

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 | 2015年12月1日から2025年10月10日までです。 |
| 運用方針 | 信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。 別に定める投資信託証券とは、以下の投資信託証券をいいます。 ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド ・エマーゼンク株式パッシブ・マザーファンド ・iシェアーズ J・P・モルガン・米ドル建てエマーゼンク・マーケット債券 ETF ・J-REITインデックスファンド・マザーファンド ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド ・コモディティインデックス・マザーファンド |
| 運用方法 | 主として、別に定める投資信託証券への投資を通じて、実質的に、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、世界リート、コモディティ（*）等の各資産へ投資を行い、世界の様々な資産に分散投資を行います。なお、上記のほか、短期金融資産等に直接投資する場合があります。 （*）コモディティ（商品）への投資に際しては、投資信託証券への投資を通じて、商品指数の動きに概ね連動する投資成果をめざす債券等に実質的に投資を行います。 各資産への投資割合は、目標リスク水準に応じて、長期的見通しに基づく基本資産配分と短・中期的見通しに基づく資産配分を組み合わせで決定します。上記投資割合は定期的に見直しを行うほか、市場環境等によっては不定期に見直しを行う場合があります。なお、市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。 コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 各資産への投資割合について、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、必要な場合は追加、除外、入替えを行う場合があります。 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。 |
| 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。 株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 |
| 分配方針 | 決算日（原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。 |

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）

第6期<決算日2021年10月12日>

グローバル8資産ラップファンド （安定型／中立型／積極型）

愛称：グロ8（安定型／中立型／積極型）

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「グローバル8資産ラップファンド」は、2021年10月12日に第6期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

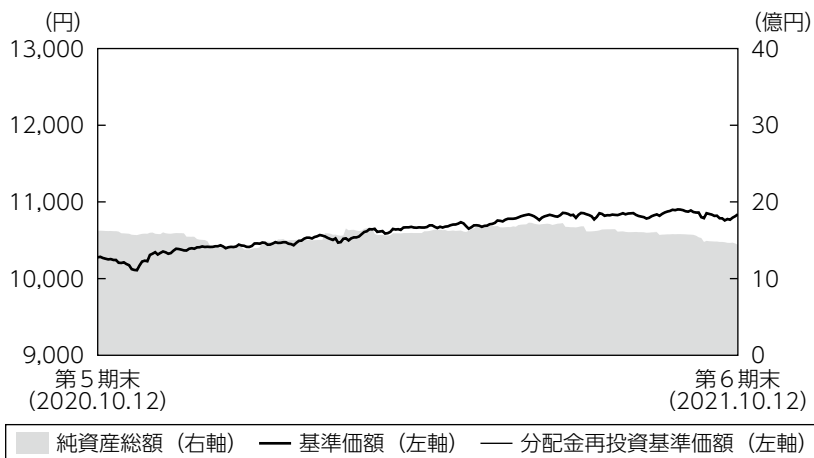
アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

■当期の運用経過（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

グローバル8資産ラップファンド（安定型） 基準価額等の推移



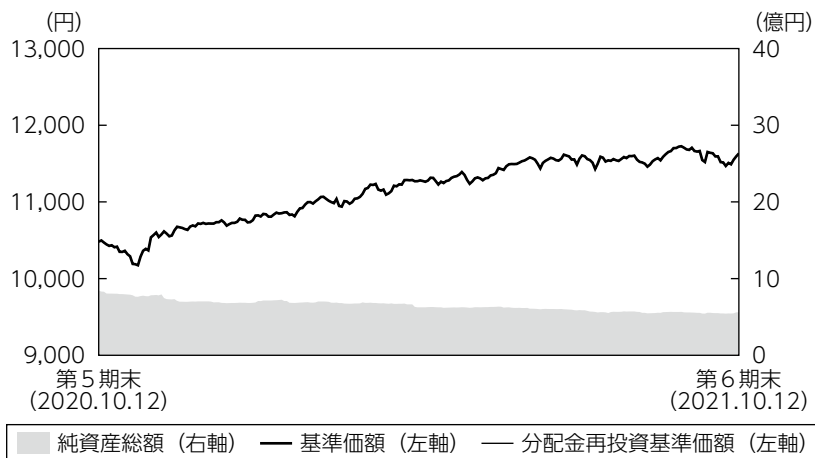
第6期首：10,277円
第6期末：10,838円
(既払分配金0円)
騰落率：5.5%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さま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、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭されたことや、新型コロナウイルスワクチンの接種拡大による経済活動正常化に対する期待の高まりを受けた内外の株式市場、内外リート市場、商品市場の上昇がプラスに寄与しました。また、為替市場が円安となったこともプラスに寄与しました。基準価額は前期末比で上昇しました。

グローバル8資産ラップファンド（中立型） 基準価額等の推移



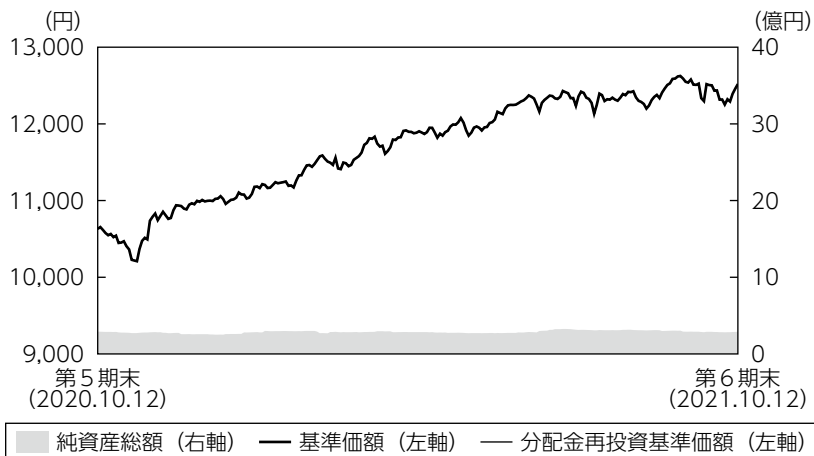
第6期首：10,482円
 第6期末：11,632円
 (既払分配金0円)
 騰落率：11.0%
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さま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、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭されたことや、新型コロナウイルスワクチンの接種拡大による経済活動正常化に対する期待の高まりを受けた内外の株式市場、内外リート市場、商品市場の上昇がプラスに寄与しました。また、為替市場が円安となったこともプラスに寄与しました。基準価額は前期末比で上昇しました。

グローバル8資産ラップファンド（積極型） 基準価額等の推移



第6期首：10,631円
 第6期末：12,519円
 (既払分配金0円)
 騰落率：17.8%
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さま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、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

米国の大統領選挙を巡る政治不透明感が払拭されたことや、新型コロナウイルスワクチンの接種拡大による経済活動正常化に対する期待の高まりを受けた内外の株式市場、内外リート市場、商品市場の上昇がプラスに寄与しました。また、為替市場が円安となったこともプラスに寄与しました。基準価額は前期末比で上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初は下落して始まりましたが、2020年11月から2021年3月半ばまでは世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待などを受けて続伸しました。その後は、新型コロナウイルスの感染状況、ワクチン接種の進展、米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月から期末にかけては、菅首相の退陣と共に上昇した後、岸田新首相の政策不安や米国の金利上昇などを要因として下落しました。

国内債券市場は利回りは上昇（価格は下落）しました。期初から2021年2月にかけては国内株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。3月から8月にかけては、新型コロナウイルスの感染収束が見通せない中、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格は上昇）しました。9月から期末にかけては、米国で年内の資産買い入れ縮小が示唆されたことや、エネルギー価格の上昇を受けインフレ懸念が高まったことなどを背景に、利回りは上昇しました。

先進国株式市場は上昇しました。期初は米国の大統領選挙を巡る不透明感などから調整しました。2020年11月以降は新型コロナウイルスのワクチン開発や接種の進展などを受け堅調に推移し、2021年に入っても変異株の感染拡大による不透明感や米国のインフレ加速への懸念などから調整する場面も見られましたが、経済活動正常化への期待感やFRB（米連邦準備理事会）議長が利上げを急がないとの姿勢を示したことを受け、堅調に推移し期末を迎えました。

先進国債券市場では、米国債、ドイツ債の利回りはともに上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米景気回復が加速するとの見方や、FOMC（米連邦公開市場委員会）で早期にテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）が開始される可能性が示されたことを受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても、ECB（欧州中央銀行）が資産買い入れペースを減速させるとの見方などを受けて利回りは上昇しました。

新興国株式市場は上昇しました。2020年11月以降、新型コロナウイルスのワクチン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感を受け堅調に推移しました。2021年2月に入ると米国長期金利の上昇などから上値の重い展開となりました。その後、インドでの新規感染者数の減少などが好感され、中国株やインド株を中心に上昇しました。7月以降は中国のインターネット企業に対する監督強化が嫌気されたことや、中国大手不動産会社の破綻懸念などから調整して期末を迎えました。

新興国債券市場の利回りは上昇しました。米国長期金利は新型コロナウイルスワクチンの普及や追加経済対策による米景気回復が加速したこと、金融緩和縮小観測の高まりなどから上昇しました。スプレッド（米国債との利回り格差）は期初はワクチン普及による経済活動の回復期待から縮小の動きとなりました。以降は新型コロナウイルスの感染拡大や米欧を中心とした金融緩和姿勢の継続と縮小の観測が交錯する展開となり上下に振れる展開となりました。スプレッドは期を通じては縮小となりました。

国内リート市場は上昇しました。期初は新型コロナウイルスのワクチン開発への期待やその後の欧米でのワクチン接種の進展が相場を支えました。中旬以降は国内におけるワクチン接種の進展、長期金利の低位安定や相対的に高い配当利回りに着目した資金流入などを背景に堅調な推移となりました。期末にかけては利益確定の売りや相次ぐ公募増資による需給悪化懸念などにより、やや軟調な推移となりました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化への期待や、大型経済対策法案の可決を受け堅調に推移した後、期末には中国大手不動産を巡る懸念から上昇幅を縮小しました。欧州リート市場はワクチン接種の進展が支援材料となり上昇しました。豪州リート市場は期半ばにロックダウンを受けて下落する局面がありましたが、その後は好調な経済指標の発表などから上昇しました。

原油価格は上昇しました。バイデン新政権による追加経済対策への期待や米欧での新型コロナウイルスワクチン接種の進展、株価上昇などによりリスク選好の動きが高まったことなどが上昇要因となりました。

為替市場では多くの先進国通貨に対して円安の動きとなりました。米ドル/円相場は、新型コロナウイルスのワクチン接種が進み、経済活動の正常化に対する期待感等から米国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大する中、円安米ドル高となりました。その他の主要通貨に対しても、経済活動の正常化に対する期待感等から主要国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大する中、円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

各ファンドとも組入れる8資産の保有比率について、長期的戦略に基づく資産配分比率をベースに、短・中期的戦略に基づく資産配分を行いました。長期的戦略、短・中期的戦略については以下の通りです。

長期的戦略

2021年4月に長期的戦略に基づく資産配分比率の変更を行いました。安定型、中立型、積極型とも、リスク対比でのリターン効率および為替リスク要因等を勘案し、国内株式と新興国株式等の組入比率を引き上げた一方、リスク対比でのリターン効率の向上が相対的に低かった世界リート、コモディティ等の組入比率を引き下げました。

短・中期的戦略

期初には、金融緩和環境の長期化等を背景にベースとなる米長期金利は低位で推移すると予想し新興国債券を長期的戦略に対して引き上げ、割高な状況にある世界リートを長期的戦略に対して引き下げたポジションとしました。2021年1月は米国の追加経済対策期待等を背景にリスクオンムードが高まりましたがバリエーション面で割高と見られた先進国株式、資金流入の過熱感からの調整を見込んだ新興国株式、新興国債券を長期的戦略に対して引き下げたポジションとしキャッシュを引き上げました。4月には新型コロナウイルスワクチンの接種拡大による景気回復期待が高まりました。各資産とも長期的戦略に対し中立のポジションを取りました。7月には景気回復期待の高まりに加え緩和的な金融環境が継続したマーケットとなり各資産とも長期的戦略に対し中立のポジションを維持しました。10月には国内の新型コロナウイルス感染の縮小傾向からなる経済再開、衆議院選挙後の新政権への期待等から国内株式を長期的戦略に対して引き上げたポジションとし、中国大手不動産の債務不履行が相場への重しになるとの懸念から新興国株式は長期的戦略に対して引き下げたポジションとしました。

○組入ファンドの当作成期間の騰落率および期末時点の組入比率

| 投資対象資産 | 組入ファンド | 騰落率 | 組入比率 | | |
|--------|---|-------|-------|-------|-------|
| | | | 安定型 | 中立型 | 積極型 |
| 国内株式 | 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 23.2% | 6.3% | 13.4% | 17.0% |
| 国内債券 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △0.1% | 60.1% | 32.9% | 9.9% |
| 先進国株式 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 35.9% | 8.4% | 13.8% | 22.5% |
| 先進国債券 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3.4% | 8.3% | 13.5% | 15.1% |
| 新興国株式 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 21.9% | 2.1% | 3.5% | 5.7% |
| 新興国債券 | iシェアーズ J. P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF | 8.9% | 6.4% | 9.3% | 10.5% |
| 世界リート | J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 23.5% | 4.2% | 6.9% | 11.2% |
| | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 38.0% | | | |
| コモディティ | コモディティインデックス・マザーファンド | 70.8% | 1.8% | 2.8% | 4.7% |
| 現金等 | - | - | 2.5% | 3.9% | 3.4% |

(注1) iシェアーズ J. P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETFの騰落率は、分配金再投資基準価額を円換算して計算したものです。

(注2) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

各組入ファンドはベンチマークのリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

○組入ファンドのベンチマーク

| 組入ファンド | ベンチマーク |
|---|--|
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 東証株価指数（TOPIX）（配当込み） |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | NOMURA-BPI総合 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし） |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし） |
| iシェアーズ J. P. モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF | J. P. モルガン EMBI グローバル・コア・インデックス |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 東証REIT指数（配当込み） |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし） |
| コモディティインデックス・マザーファンド | S&P GSCI商品指数 |

分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、各ファンドとも無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目 | 当 | | 期 |
|------------|------|--------|--------|
| | 安定型 | 中立型 | 積極型 |
| 当期分配金（税引前） | －円 | －円 | －円 |
| 対基準価額比率 | －% | －% | －% |
| 当期の収益 | －円 | －円 | －円 |
| 当期の収益以外 | －円 | －円 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 838円 | 1,631円 | 2,518円 |

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が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、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

短・中期的戦略に基づく資産配分比率に維持されるように資産配分を行います。なお、長期的戦略に基づく資産配分比率は原則として年1回見直しを行います。また、短・中期的戦略に基づく資産配分比率は原則として四半期毎に見直しを行います。

各組入ファンドは、引き続きベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■分配金のお知らせ

各ファンドの収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■各ファンドが投資対象とする「J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を2,000億円から5,000億円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年6月2日)

グローバル8資産ラップファンド（安定型）

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | | | 株式組 入率 | 株式先 物比率 | 債券組 入率 | 新株予約 権証券 比率 | 債券先 物比率 | 投資信託 受託証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|---------------|---|------|-----------|------------|-----------|-------------------|------------|----------------------|------------|
| | 円 | 円 | % | | | | | | | |
| 2期（2017年10月12日） | 10,192 | 0 | 3.5 | 10.6 | 0.3 | 73.3 | — | — | 6.7 | 百万円 728 |
| 3期（2018年10月12日） | 10,026 | 0 | △1.6 | 9.5 | 0.4 | 74.1 | — | — | 9.5 | 1,618 |
| 4期（2019年10月15日） | 10,289 | 0 | 2.6 | 11.3 | 0.5 | 69.5 | — | — | 10.1 | 1,930 |
| 5期（2020年10月12日） | 10,277 | 0 | △0.1 | 13.7 | 0.5 | 69.7 | — | — | 10.8 | 1,624 |
| 6期（2021年10月12日） | 10,838 | 0 | 5.5 | 16.0 | 0.6 | 69.8 | — | — | 10.7 | 1,440 |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基準価額 | | 株式組入率 | 株式先物比率 | 債券組入率 | 債券先物比率 | 新株予約権付社債(転換)組入率 | 債券先物比率 | 債券先物比率 | 投資信託受益証券組入率 |
|---------------------|--------|--------|-----------|----------|-----------|--------|-----------------|--------|-----------|-------------|
| | 円 | 騰落率 | | | | | | | | |
| (期首) 2020年10月12日 | 10,277 | % - | % 13.7 | % 0.5 | % 69.7 | % - | % - | % - | % 10.8 | |
| 10月 末 | 10,113 | △1.6 | 13.2 | 0.5 | 70.8 | - | - | - | 10.5 | |
| 11月 末 | 10,367 | 0.9 | 14.5 | 0.6 | 69.6 | - | - | - | 11.2 | |
| 12月 末 | 10,432 | 1.5 | 14.7 | 0.6 | 68.2 | - | - | - | 10.9 | |
| 2021年1月 末 | 10,450 | 1.7 | 12.1 | 0.4 | 69.2 | - | - | - | 9.4 | |
| 2月 末 | 10,469 | 1.9 | 12.9 | 0.4 | 70.2 | - | - | - | 9.4 | |
| 3月 末 | 10,644 | 3.6 | 13.0 | 0.6 | 68.5 | - | - | - | 9.7 | |
| 4月 末 | 10,704 | 4.2 | 15.3 | 0.6 | 68.6 | - | - | - | 9.9 | |
| 5月 末 | 10,753 | 4.6 | 15.5 | 0.6 | 69.3 | - | - | - | 10.0 | |
| 6月 末 | 10,808 | 5.2 | 15.2 | 0.8 | 67.7 | - | - | - | 9.9 | |
| 7月 末 | 10,826 | 5.3 | 15.1 | 0.7 | 69.2 | - | - | - | 10.0 | |
| 8月 末 | 10,861 | 5.7 | 15.5 | 0.6 | 68.8 | - | - | - | 10.4 | |
| 9月 末 | 10,820 | 5.3 | 15.2 | 0.5 | 72.4 | - | - | - | 10.2 | |
| (期末) 2021年10月12日 | 10,838 | 5.5 | 16.0 | 0.6 | 69.8 | - | - | - | 10.7 | |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■ 1 万口当たりの費用明細

| 項目 | 第6期 | | 項目の概要 |
|-------------|-------------------------------|---------|--|
| | (2020年10月13日 ～2021年10月12日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 144円 | 1.353% | (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10,617円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (81) | (0.759) | |
| (販売会社) | (58) | (0.550) | |
| (受託会社) | (5) | (0.044) | |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.004 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.002) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) | |
| (投資証券) | (0) | (0.001) | |
| (c) 有価証券取引税 | 1 | 0.008 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (0) | (0.005) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資証券) | (0) | (0.003) | |
| (d) その他費用 | 3 | 0.024 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (1) | (0.006) | |
| (監査費用) | (0) | (0.004) | |
| (その他) | (1) | (0.013) | |
| 合計 | 147 | 1.389 | |

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は追加・解約によ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、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

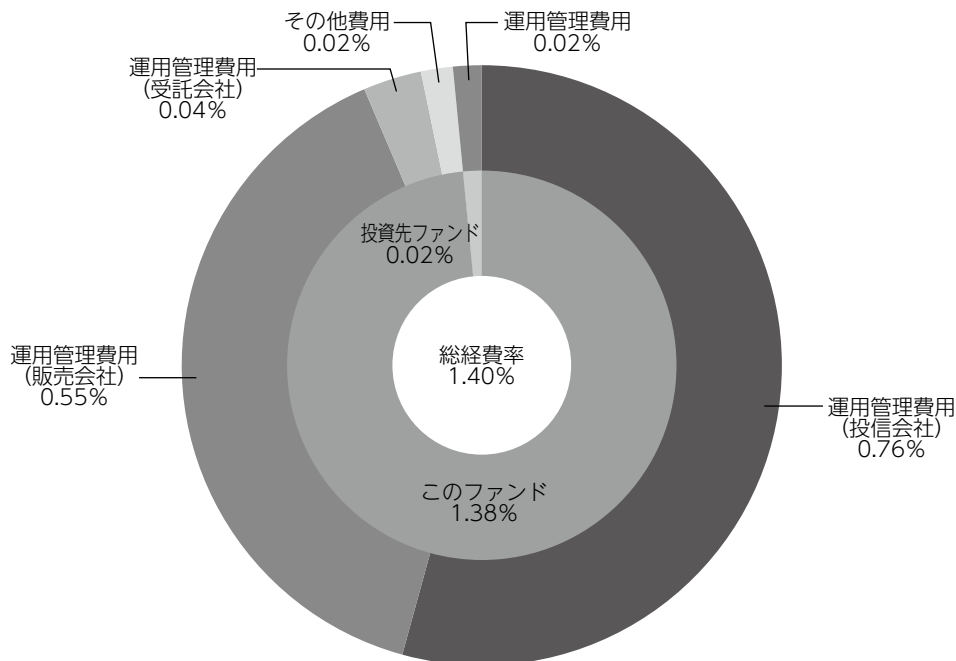
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

(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1.40%です。



| | |
|--------------------|-------|
| 総経費率 (①+②) | 1.40% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.38% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.02% |

(注1) ①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、売買委託手数料およ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、このファンドが組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) ①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) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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異なります。

■売買及び取引の状況 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

投資信託受益証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|--|------|----------|------|----------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外 国 | i シェアーズ J.P.モルガン・ 米ドル建てエマージング・ マーケット債券 E T F | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| | | 1.48 | 161 | 2.28 | 262 |

(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 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド | 千□ 13,727 | 千円 43,164 | 千□ 15,288 | 千円 46,644 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 262,806 | 342,893 | 358,473 | 468,679 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 11,460 | 56,367 | 20,349 | 96,924 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 25,681 | 51,618 | 28,638 | 57,725 |
| エマージング株式パッシブ・ マザーファンド | 13,602 | 20,127 | 18,645 | 26,014 |
| J-R E I T インデックス ファンド・マザーファンド | 997 | 2,225 | 2,504 | 5,652 |
| 外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド | 15,219 | 19,654 | 40,067 | 54,167 |
| コモディティインデックス・ マザーファンド | 3,999 | 1,679 | 60,665 | 21,930 |

■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 | | |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | 国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド | 外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド | エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 566,365,897千円 | 433,615,079千円 | 124,981,010千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 322,384,030千円 | 485,262,670千円 | 57,916,864千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 1.75 | 0.89 | 2.15 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【グローバル8資産ラップファンド（安定型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 65千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.036千円 |
| (B)／(A) | 0.1% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 株 式 | 百万円 318,180 | 百万円 50,087 | % 15.7 | 百万円 248,185 | 百万円 7,021 | % 2.8 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | 期 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 2,570 | 百万円 1,904 | 百万円 3,236 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-----|------------|
| | 買 付 額 |
| 株 式 | 百万円 523 |

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 公 社 債 | 百万円 561,417 | 百万円 60,978 | % 10.9 | 百万円 257,326 | 百万円 30,397 | % 11.8 |

平均保有割合 0.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-------|------------|
| | 買 付 額 |
| 公 社 債 | 百万円 304 |

【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【J-REITインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 投 資 証 券 | 百万円 270,034 | 百万円 720 | % 0.3 | 百万円 128,009 | 百万円 237 | % 0.2 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|---------|---------------|
| | 買 付 額 |
| 投 資 証 券 | 百万円 12,271 |

【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【コモディティインデックス・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | 比 率 |
|--|------------|------------|-----------------|--------------|----------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマーシング・マーケット債券 E T F | 千□ 8.29 | 千□ 7.49 | 千アメリカ・ドル 813 | 千円 92,279 | % 6.4 |
| 合 計 | 8.29 | 7.49 | 813 | 92,279 | 6.4 |

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(2) 親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------------|-----------|---------|---------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千□ | 千□ | 千円 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 29,269 | 27,708 | 90,808 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 758,532 | 662,864 | 865,038 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 30,549 | 21,659 | 120,855 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 60,738 | 57,781 | 118,931 |
| エマーシング株式パッシブ・マザーファンド | 25,831 | 20,789 | 30,481 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 3,651 | 2,143 | 5,216 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 59,582 | 34,734 | 54,932 |
| コモディティインデックス・マザーファンド | 110,615 | 53,949 | 25,539 |

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 92,279 | 6.2 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 90,808 | 6.1 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 865,038 | 57.8 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 120,855 | 8.1 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 118,931 | 7.9 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 30,481 | 2.0 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 5,216 | 0.3 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 54,932 | 3.7 |
| コモディティインデックス・マザーファンド | 25,539 | 1.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 92,149 | 6.2 |
| 投資信託財産総額 | 1,496,233 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8%、コモディティインデックス・マザーファンドは4,397,846千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニュージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------------|----------------|
| (A) 資 産 | 1,496,233,848円 |
| コール・ローン等 | 66,857,735 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 92,279,983 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額) | 90,808,427 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 865,038,802 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 120,855,348 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 118,931,416 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額) | 30,481,199 |
| J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額) | 5,216,116 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 54,932,945 |
| コモディティインデックス・マザーファンド(評価額) | 25,539,877 |
| 未 収 入 金 | 25,292,000 |
| (B) 負 債 | 55,712,533 |
| 未 払 解 約 金 | 44,689,048 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 10,991,757 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 31,728 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 1,440,521,315 |
| 元 本 | 1,329,096,008 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 111,425,307 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 1,329,096,008口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 10,838円 |

(注) 期首における元本額は1,580,427,441円、当期中における追加設定元本額は767,972,440円、同解約元本額は1,019,303,873円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,869,855円 |
| 受 取 配 当 金 | 2,888,644 |
| 受 取 利 息 | 187 |
| 支 払 利 息 | △18,976 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 74,824,299 |
| 売 買 益 | 104,582,294 |
| 売 買 損 | △29,757,995 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △21,459,486 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 56,234,668 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 7,976,351 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 47,214,288 |
| (配 当 等 相 当 額) | (29,935,213) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (17,279,075) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 111,425,307 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 111,425,307 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 47,214,288 |
| (配 当 等 相 当 額) | (30,235,301) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (16,978,987) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 64,211,019 |

(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4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|-------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 12,987,113円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 42,406,266 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 47,214,288 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 8,817,640 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 111,425,307 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 838.35 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

グローバル8資産ラップファンド（中立型）

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | | | 株式組 入率 | 株式 先物 比率 | 債券 組入 率 | 新株予 約権 社債 比率 | 債券 先物 比率 | 投資信 託証券 組入 比率 | 純資産 総額 |
|------------------|---------------|---|------|-----------|----------------|---------------|-----------------------|----------------|------------------------|------------|
| | 円 | 円 | % | | | | | | | |
| 2期 (2017年10月12日) | 10,229 | 0 | 8.6 | 16.5 | 0.5 | 52.5 | — | — | 19.6 | 百万円 494 |
| 3期 (2018年10月12日) | 10,022 | 0 | △2.0 | 17.3 | 0.7 | 52.3 | — | — | 20.3 | 879 |
| 4期 (2019年10月15日) | 10,329 | 0 | 3.1 | 18.9 | 0.8 | 52.5 | — | — | 19.6 | 957 |
| 5期 (2020年10月12日) | 10,482 | 0 | 1.5 | 23.4 | 0.9 | 52.7 | — | — | 21.1 | 841 |
| 6期 (2021年10月12日) | 11,632 | 0 | 11.0 | 29.3 | 1.0 | 48.9 | — | — | 16.5 | 561 |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基準価額 | | 株 組 比 | 式 入 率 | 株 先 比 | 式 物 率 | 債 組 比 | 券 入 率 | 新株予約権 付社債 (転換比 率) | 債 先 比 | 券 物 率 | 投資信託 受益証券 組入比率 |
|---------------------|--------|--------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|----------------------------|-------------|-------------|----------------------|
| | 円 | 騰落率 | | | | | | | | | | |
| (期首) 2020年10月12日 | 10,482 | % - | % 23.4 | | % 0.9 | % 52.7 | % - | % - | % - | % - | % - | % 21.1 |
| 10月 末 | 10,188 | △2.8 | 22.8 | | 0.9 | 53.4 | - | - | - | - | - | 20.1 |
| 11月 末 | 10,645 | 1.6 | 23.9 | | 1.1 | 51.0 | - | - | - | - | - | 21.1 |
| 12月 末 | 10,768 | 2.7 | 24.3 | | 1.0 | 49.5 | - | - | - | - | - | 20.5 |
| 2021年1月 末 | 10,836 | 3.4 | 20.2 | | 0.8 | 51.7 | - | - | - | - | - | 18.6 |
| 2月 末 | 10,948 | 4.4 | 20.7 | | 0.7 | 51.5 | - | - | - | - | - | 18.7 |
| 3月 末 | 11,229 | 7.1 | 21.2 | | 1.0 | 50.8 | - | - | - | - | - | 19.6 |
| 4月 末 | 11,328 | 8.1 | 28.0 | | 1.1 | 49.2 | - | - | - | - | - | 17.6 |
| 5月 末 | 11,428 | 9.0 | 27.9 | | 1.1 | 48.9 | - | - | - | - | - | 17.6 |
| 6月 末 | 11,538 | 10.1 | 28.3 | | 1.5 | 48.7 | - | - | - | - | - | 17.6 |
| 7月 末 | 11,536 | 10.1 | 27.2 | | 1.2 | 48.6 | - | - | - | - | - | 16.4 |
| 8月 末 | 11,621 | 10.9 | 28.1 | | 1.1 | 48.4 | - | - | - | - | - | 16.6 |
| 9月 末 | 11,594 | 10.6 | 27.9 | | 1.0 | 51.0 | - | - | - | - | - | 16.1 |
| (期末) 2021年10月12日 | 11,632 | 11.0 | 29.3 | | 1.0 | 48.9 | - | - | - | - | - | 16.5 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第6期 | | 項目の概要 |
|-------------|-------------------------------|---------|--|
| | (2020年10月13日 ～2021年10月12日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 151円 | 1.353% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,156円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (85) | (0.759) | |
| (販売会社) | (61) | (0.550) | |
| (受託会社) | (5) | (0.044) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.008 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.003) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.002) | |
| (投資証券) | (0) | (0.002) | |
| (c) 有価証券取引税 | 2 | 0.015 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (1) | (0.008) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) | |
| (投資証券) | (1) | (0.006) | |
| (d) その他費用 | 5 | 0.043 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (1) | (0.013) | |
| (監査費用) | (0) | (0.004) | |
| (その他) | (3) | (0.026) | |
| 合計 | 158 | 1.418 | |

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は追加・解約によ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、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

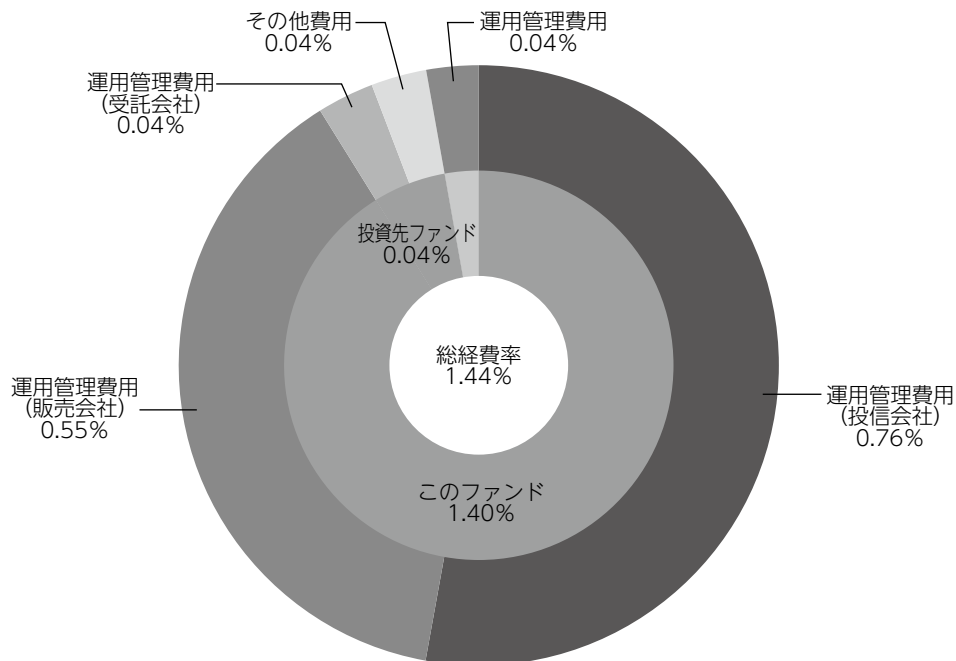
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

(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1.44%です。



| | |
|--------------------|-------|
| 総経費率 (①+②) | 1.44% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.40% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.04% |

(注1) ①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、売買委託手数料およ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、このファンドが組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) ①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) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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異なります。

■売買及び取引の状況 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

投資信託受益証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|--|-----|----------|-----|----------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外 国 | i シェアーズ J.P.モルガン・ 米ドル建てエマーシング・ マーケット債券 E T F | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| | | - | - | 4.3 | 484 |

(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 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド | 千□ 15,916 | 千円 50,682 | 千□ 12,595 | 千円 37,527 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 33,306 | 43,540 | 114,780 | 150,014 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 3,030 | 14,722 | 19,105 | 87,161 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 7,841 | 15,714 | 33,520 | 67,151 |
| エマーシング株式パッシブ・ マザーファンド | 3,884 | 5,623 | 17,282 | 23,598 |
| J-R E I T インデックス ファンド・マザーファンド | 295 | 643 | 2,501 | 5,486 |
| 外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド | 4,220 | 5,488 | 40,092 | 52,322 |
| コモディティインデックス・ マザーファンド | - | - | 81,589 | 28,691 |

■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 | | |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | 国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド | 外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド | エマーシング株式 パッシブ・ マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 566,365,897千円 | 433,615,079千円 | 124,981,010千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 322,384,030千円 | 485,262,670千円 | 57,916,864千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 1.75 | 0.89 | 2.15 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【グローバル8資産ラップファンド（中立型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 52千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.022千円 |
| (B)／(A) | 0.0% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 株 式 | 百万円 318,180 | 百万円 50,087 | % 15.7 | 百万円 248,185 | 百万円 7,021 | % 2.8 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | 期 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 2,570 | 百万円 1,904 | 百万円 3,236 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-----|------------|
| | 買 付 額 |
| 株 式 | 百万円 523 |

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 公 社 債 | 百万円 561,417 | 百万円 60,978 | % 10.9 | 百万円 257,326 | 百万円 30,397 | % 11.8 |

平均保有割合 0.1%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-------|------------|
| | 買 付 額 |
| 公 社 債 | 百万円 304 |

【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【J-REITインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 投 資 証 券 | 百万円 270,034 | 百万円 720 | % 0.3 | 百万円 128,009 | 百万円 237 | % 0.2 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|---------|---------------|
| | 買 付 額 |
| 投 資 証 券 | 百万円 12,271 |

【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【コモディティインデックス・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 期首(前期末) | 当 期 | | 末 | 比 率 |
|--|-------------|-------------|-----------------|--------------|----------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマーシング・マーケット債券 E T F | 千□ 8,555 | 千□ 4,255 | 千アメリカ・ドル 461 | 千円 52,423 | % 9.3 |
| 合 計 | 8,555 | 4,255 | 461 | 52,423 | 9.3 |

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(2) 親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 | | 末 |
|-----------------------------|-----------|---------|---------|---|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | |
| | 千□ | 千□ | 千円 | |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 19,603 | 22,925 | 75,133 | |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 223,103 | 141,629 | 184,826 | |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 29,931 | 13,856 | 77,318 | |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 62,398 | 36,718 | 75,578 | |
| エマーシング株式パッシブ・マザーファンド | 26,751 | 13,353 | 19,578 | |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 3,579 | 1,373 | 3,340 | |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 58,152 | 22,280 | 35,235 | |
| コモディティインデックス・マザーファンド | 114,907 | 33,317 | 15,772 | |

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 52,423 | 9.3 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 75,133 | 13.3 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 184,826 | 32.7 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 77,318 | 13.7 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 75,578 | 13.4 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 19,578 | 3.5 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 3,340 | 0.6 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 35,235 | 6.2 |
| コモディティインデックス・マザーファンド | 15,772 | 2.8 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 26,100 | 4.6 |
| 投資信託財産総額 | 565,309 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8％、コモディティインデックス・マザーファンドは4,397,846千円、99.2％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニュージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|---------------------|
| (A) 資 産 | 565,309,000円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 26,100,028 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評 価 額) | 52,423,408 |
| 国 内 株 式 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド(最 適 化 法)・マザーフア ン ド(評 価 額) | 75,133,069 |
| 国 内 債 券 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 184,826,889 |
| 外 国 株 式 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 77,318,864 |
| 外 国 債 券 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 75,578,485 |
| エ マ ー ジ ン グ 株 式 パ ッ シ ッ プ ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 19,578,866 |
| J - R E I T イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 3,340,952 |
| 外 国 リ ー ト ・ パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 35,235,875 |
| コ モ デ ィ テ ィ イ ン デ ッ ク ス ・ マザーフア ン ド(評 価 額) | 15,772,564 |
| (B) 負 債 | 4,001,262 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 3,989,809 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 11,453 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 561,307,738 |
| 元 本 | 482,558,733 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 78,749,005 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 482,558,733口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 11,632円 |

(注) 期首における元本額は802,373,030円、当期中における追加設定元本額は142,249,332円、同解約元本額は462,063,629円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 2,033,557円 |
| 受 取 配 当 金 | 2,040,399 |
| 受 取 利 息 | 83 |
| 支 払 利 息 | △6,925 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 54,696,692 |
| 売 買 益 | 75,972,947 |
| 売 買 損 | △21,276,255 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △8,838,720 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 47,891,529 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 12,115,780 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 18,741,696 |
| (配 当 等 相 当 額) | (18,459,792) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (281,904) |
| (G) 合 計(D + E + F) | 78,749,005 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 78,749,005 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 18,741,696 |
| (配 当 等 相 当 額) | (18,535,334) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (206,362) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 60,007,309 |

(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4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 7,820,724円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 39,853,688 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 18,741,696 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 12,332,897 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a + b + c + d) | 78,749,005 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 1,631.91 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

グローバル8資産ラップファンド (積極型)

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | | | 株式組 入率 | 株式先 物比率 | 債券組 入率 | 新株予約 権付社債 (転換社 債)比率 | 債券先 物比率 | 投資信託 受託証券 投資比率 | 純資産 総額 |
|------------------|---------------|---|------|-----------|------------|-----------|------------------------------|------------|----------------------|------------|
| | 円 | 円 | % | | | | | | | |
| 2期 (2017年10月12日) | 10,277 | 0 | 14.1 | 28.6 | 0.8 | 30.0 | — | — | 28.9 | 百万円 352 |
| 3期 (2018年10月12日) | 10,024 | 0 | △2.5 | 29.2 | 1.3 | 30.9 | — | — | 27.9 | 447 |
| 4期 (2019年10月15日) | 10,362 | 0 | 3.4 | 29.6 | 1.2 | 34.6 | — | — | 27.5 | 369 |
| 5期 (2020年10月12日) | 10,631 | 0 | 2.6 | 36.5 | 1.3 | 32.0 | — | — | 26.5 | 289 |
| 6期 (2021年10月12日) | 12,519 | 0 | 17.8 | 43.1 | 1.5 | 29.5 | — | — | 22.2 | 288 |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

■当期中の基準価額の推移

| 年 月 日 | 基準価額 | | 株式組入率 | 株式先物比率 | 債券組入率 | 債券先物比率 | 新株予約権付社債(転換社債)組入率 | 債券先物比率 | 債券先物比率 | 投資信託受益証券組入率 |
|---------------------|--------|------|-------|--------|-------|--------|-------------------|--------|--------|-------------|
| | 円 | 騰落率 | | | | | | | | |
| (期首) 2020年10月12日 | 10,631 | — | 36.5 | 1.3 | 32.0 | — | — | — | — | 26.5 |
| 10月 末 | 10,219 | △3.9 | 35.7 | 1.3 | 32.4 | — | — | — | — | 26.3 |
| 11月 末 | 10,895 | 2.5 | 37.4 | 1.7 | 32.6 | — | — | — | — | 27.6 |
| 12月 末 | 11,080 | 4.2 | 36.9 | 1.5 | 30.7 | — | — | — | — | 25.9 |
| 2021年1月 末 | 11,197 | 5.3 | 32.5 | 1.1 | 31.8 | — | — | — | — | 23.7 |
| 2月 末 | 11,418 | 7.4 | 32.8 | 1.0 | 31.8 | — | — | — | — | 24.1 |
| 3月 末 | 11,822 | 11.2 | 33.1 | 1.5 | 30.8 | — | — | — | — | 25.0 |
| 4月 末 | 11,992 | 12.8 | 41.4 | 1.6 | 29.4 | — | — | — | — | 23.0 |
| 5月 末 | 12,141 | 14.2 | 41.5 | 1.7 | 29.7 | — | — | — | — | 23.4 |
| 6月 末 | 12,325 | 15.9 | 41.0 | 2.2 | 28.6 | — | — | — | — | 21.9 |
| 7月 末 | 12,316 | 15.8 | 41.5 | 1.8 | 30.1 | — | — | — | — | 23.0 |
| 8月 末 | 12,460 | 17.2 | 41.9 | 1.6 | 29.3 | — | — | — | — | 23.4 |
| 9月 末 | 12,436 | 17.0 | 41.1 | 1.5 | 30.1 | — | — | — | — | 21.3 |
| (期末) 2021年10月12日 | 12,519 | 17.8 | 43.1 | 1.5 | 29.5 | — | — | — | — | 22.2 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第6期 | | 項目の概要 |
|-------------|-------------------------------|---------|--|
| | (2020年10月13日 ～2021年10月12日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 158円 | 1.353% | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,713円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、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等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (投信会社) | (89) | (0.759) | |
| (販売会社) | (64) | (0.550) | |
| (受託会社) | (5) | (0.044) | |
| (b) 売買委託手数料 | 1 | 0.010 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (1) | (0.005) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.002) | |
| (投資証券) | (0) | (0.003) | |
| (c) 有価証券取引税 | 2 | 0.021 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株式) | (1) | (0.012) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) | |
| (投資証券) | (1) | (0.008) | |
| (d) その他費用 | 7 | 0.061 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| (保管費用) | (2) | (0.019) | |
| (監査費用) | (0) | (0.004) | |
| (その他) | (4) | (0.038) | |
| 合計 | 169 | 1.445 | |

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は追加・解約によ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、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

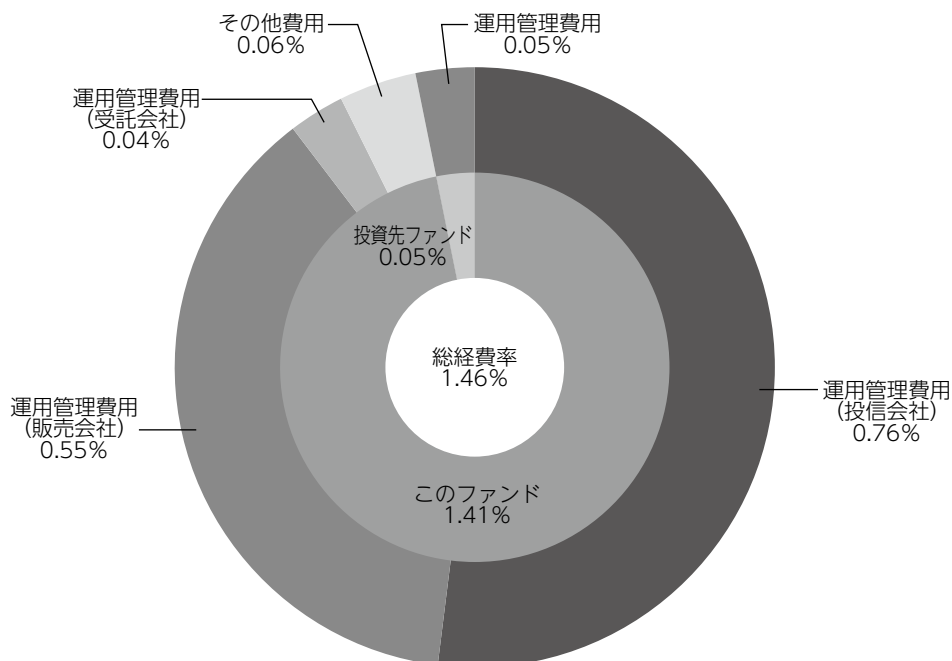
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

(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1.46%です。



| | |
|--------------------|-------|
| 総経費率 (①+②) | 1.46% |
| ①このファンドの費用の比率 | 1.41% |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.05% |

(注1) ①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、売買委託手数料およ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、このファンドが組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) ①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) ①の費用と②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 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異なります。

■売買及び取引の状況 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

投資信託受益証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|--|------|----------|------|----------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 外 国 | i シェアーズ J.P.モルガン・ 米ドル建てエマージング・ マーケット債券 E T F | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| | | 0.25 | 28 | 1.26 | 141 |

(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 (2020年10月13日から2021年10月12日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------------------|-------------|--------------|-------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド | 千□ 9,028 | 千円 28,249 | 千□ 8,491 | 千円 25,891 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 13,627 | 17,793 | 13,548 | 17,700 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 7,615 | 37,513 | 10,168 | 47,930 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド | 11,122 | 22,352 | 15,427 | 31,030 |
| エマージング株式パッシブ・ マザーファンド | 8,905 | 13,145 | 9,775 | 13,769 |
| J-R E I T インデックス ファンド・マザーファンド | 702 | 1,549 | 1,214 | 2,703 |
| 外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド | 9,467 | 12,599 | 17,961 | 24,058 |
| コモディティインデックス・ マザーファンド | 638 | 268 | 24,028 | 8,663 |

■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 | | |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | 国内株式パッシブ・ ファンド(最適化法)・ マザーファンド | 外国株式パッシブ・ ファンド・ マザーファンド | エマージング株式 パッシブ・ マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 566,365,897千円 | 433,615,079千円 | 124,981,010千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 322,384,030千円 | 485,262,670千円 | 57,916,864千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 1.75 | 0.89 | 2.15 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

【グローバル8資産ラップファンド（積極型）における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 30千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 0.016千円 |
| (B)／(A) | 0.1% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 株 式 | 百万円 318,180 | 百万円 50,087 | % 15.7 | 百万円 248,185 | 百万円 7,021 | % 2.8 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 当 期 | | 期 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
| 株 式 | 百万円 2,570 | 百万円 1,904 | 百万円 3,236 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-----|------------|
| | 買 付 額 |
| 株 式 | 百万円 523 |

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 公 社 債 | 百万円 561,417 | 百万円 60,978 | % 10.9 | 百万円 257,326 | 百万円 30,397 | % 11.8 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|-------|------------|
| | 買 付 額 |
| 公 社 債 | 百万円 304 |

【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【J-REITインデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 投 資 証 券 | 百万円 270,034 | 百万円 720 | % 0.3 | 百万円 128,009 | 百万円 237 | % 0.2 |

平均保有割合 0.0%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 期 |
|---------|---------------|
| | 買 付 額 |
| 投 資 証 券 | 百万円 12,271 |

【外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【コモディティインデックス・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| フ ァ ン ド 名 | 期首(前期末) | 当 期 | | | 末 |
|--|------------|------------|-----------------|--------------|-----------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 E T F | 千□ 3.47 | 千□ 2.46 | 千アメリカ・ドル 267 | 千円 30,308 | % 10.5 |
| 合 計 | 3.47 | 2.46 | 267 | 30,308 | 10.5 |

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(2) 親投資信託残高

| | 期 首 (前期末) | 当 期 | | 末 |
|-----------------------------|-----------|--------|-------|--------|
| | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | 評 価 額 |
| | 千□ | 千□ | | 千円 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 14,400 | 14,937 | | 48,953 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 21,860 | 21,939 | | 28,631 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14,173 | 11,620 | | 64,840 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 25,473 | 21,168 | | 43,571 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 12,011 | 11,141 | | 16,335 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 1,673 | 1,161 | | 2,824 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 27,135 | 18,640 | | 29,480 |
| コモディティインデックス・マザーファンド | 51,798 | 28,408 | | 13,448 |

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 30,308 | 10.4 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド | 48,953 | 16.9 |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 28,631 | 9.9 |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 64,840 | 22.3 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 43,571 | 15.0 |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 16,335 | 5.6 |
| J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド | 2,824 | 1.0 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 29,480 | 10.2 |
| コモディティインデックス・マザーファンド | 13,448 | 4.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 11,832 | 4.1 |
| 投資信託財産総額 | 290,227 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年10月12日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは603,957,812千円、99.8％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは148,874,094千円、97.8％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは63,210,342千円、99.2％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは64,355,846千円、99.8％、コモディティインデックス・マザーファンドは4,397,846千円、99.2％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年10月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.50円、1カナダ・ドル=90.84円、1オーストラリア・ドル=83.31円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.70円、1ニュージーランド・ドル=78.66円、1台湾・ドル=4.041円、1イギリス・ポンド=154.20円、1イスラエル・シェケル=35.165円、1スイス・フラン=122.32円、1トルコ・リラ=12.613円、1デンマーク・クローネ=17.62円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローナ=12.93円、1メキシコ・ペソ=5.436円、1フィリピン・ペソ=2.234円、100チリ・ペソ=13.755円、100コロンビア・ペソ=3.012円、1クウェート・ディナール=376.95円、1カタール・リアル=31.07円、1サウジアラビア・リアル=30.31円、1インド・ルピー=1.51円、1パキスタン・ルピー=0.67円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=30.95円、1ブラジル・レアル=20.489円、1チェコ・コルナ=5.162円、100韓国・ウォン=9.47円、1オフショア・人民元=17.572円、1マレーシア・リンギット=27.173円、1南アフリカ・ランド=7.52円、1タイ・バーツ=3.39円、1ポーランド・ズロチ=28.559円、100ハンガリー・フォリント=36.457円、1ユーロ=131.12円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年10月12日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|---------------------|
| (A) 資 産 | 290,227,292円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 11,832,893 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評 価 額) | 30,308,246 |
| 国 内 株 式 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド(最 適 化 法)・マザーフアンド(評 価 額) | 48,953,951 |
| 国 内 債 券 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフアンド(評 価 額) | 28,631,685 |
| 外 国 株 式 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフアンド(評 価 額) | 64,840,618 |
| 外 国 債 券 パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフアンド(評 価 額) | 43,571,113 |
| エ マ ー ジ ン グ 株 式 パ ッ シ ッ プ ・ マザーフアンド(評 価 額) | 16,335,051 |
| J - R E I T イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド ・ マザーフアンド(評 価 額) | 2,824,926 |
| 外 国 リ ー ト ・ パ ッ シ ッ プ ・ フ ァ ン ド ・ マザーフアンド(評 価 額) | 29,480,248 |
| コ モ デ ィ テ ィ イ ン デ ッ ク ス ・ マザーフアンド(評 価 額) | 13,448,561 |
| (B) 負 債 | 1,997,341 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 1,991,662 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 5,679 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 288,229,951 |
| 元 本 | 230,234,648 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 57,995,303 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 230,234,648口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 12,519円 |

(注) 期首における元本額は272,104,130円、当期中における追加設定元本額は117,477,278円、同解約元本額は159,346,760円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------------|-------------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 1,050,005円 |
| 受 取 配 当 金 | 1,053,222 |
| 受 取 利 息 | 30 |
| 支 払 利 息 | △3,247 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 36,408,968 |
| 売 買 益 | 47,993,929 |
| 売 買 損 | △11,584,961 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △3,916,848 |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) | 33,542,125 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 7,345,950 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 17,107,228 |
| (配 当 等 相 当 額) | (14,259,670) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,847,558) |
| (G) 合 計(D + E + F) | 57,995,303 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G) | 57,995,303 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | 17,107,228 |
| (配 当 等 相 当 額) | (14,355,906) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (2,751,322) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 40,888,075 |

(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4) 分配金の計算過程

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------------|------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 5,029,156円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 28,307,532 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 17,107,228 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 7,551,387 |
| (e) 当 期 分 配 対 象 額(a + b + c + d) | 57,995,303 |
| (f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額 | 2,518.97 |
| (g) 分 配 金 | 0 |
| (h) 1 万 口 当 た り 分 配 金 | 0 |

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第19期（決算日 2021年2月8日）

（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2002年10月30日から無期限です。 |
| 運用方針 | 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証株価指数(TOPIX) | | 株式組入率 | 株式先物率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|------------------|------|-------|-------|---------|
| | 期騰 | 期中落率 | (配当込み) ベンチマーク | 期中落率 | | | |
| 15期 (2017年2月7日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 15期 (2017年2月7日) | 22,429 | 12.3 | 2,161.36 | 12.3 | 97.6 | 2.3 | 284,249 |
| 16期 (2018年2月7日) | 26,432 | 17.8 | 2,547.46 | 17.9 | 98.1 | 0.8 | 289,238 |
| 17期 (2019年2月7日) | 24,228 | △8.3 | 2,334.81 | △8.3 | 98.5 | 1.5 | 279,184 |
| 18期 (2020年2月7日) | 27,423 | 13.2 | 2,642.55 | 13.2 | 97.6 | 2.4 | 269,760 |
| 19期 (2021年2月8日) | 31,202 | 13.8 | 3,006.47 | 13.8 | 97.7 | 2.3 | 318,586 |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）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・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

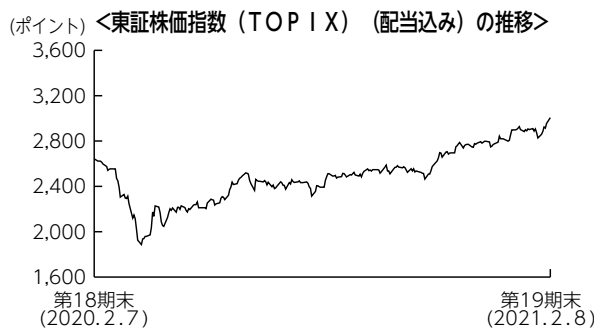
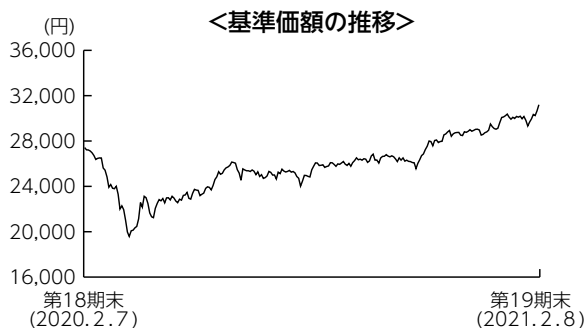
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東証株価指数(TOPIX) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 |
|---------------------|---------|--------|----------------------------|--------|-------------|-------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (配当込み) (ベンチマーク) ポイント | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2020年 2月7日 | 27,423 | % - | 2,642.55 | % - | 97.6 | 2.4 |
| 2 月 末 | 23,926 | △12.8 | 2,305.76 | △12.7 | 97.8 | 1.9 |
| 3 月 末 | 22,498 | △18.0 | 2,167.60 | △18.0 | 100.1 | 3.3 |
| 4 月 末 | 23,470 | △14.4 | 2,261.88 | △14.4 | 97.1 | 3.0 |
| 5 月 末 | 25,068 | △8.6 | 2,416.04 | △8.6 | 92.2 | 2.2 |
| 6 月 末 | 25,027 | △8.7 | 2,411.45 | △8.7 | 97.4 | 2.6 |
| 7 月 末 | 24,020 | △12.4 | 2,314.39 | △12.4 | 98.2 | 1.8 |
| 8 月 末 | 25,983 | △5.3 | 2,503.59 | △5.3 | 97.8 | 2.4 |
| 9 月 末 | 26,316 | △4.0 | 2,536.14 | △4.0 | 96.6 | 3.4 |
| 10 月 末 | 25,569 | △6.8 | 2,464.21 | △6.7 | 96.8 | 2.8 |
| 11 月 末 | 28,422 | 3.6 | 2,738.72 | 3.6 | 97.0 | 3.2 |
| 12 月 末 | 29,264 | 6.7 | 2,819.93 | 6.7 | 97.1 | 2.7 |
| 2021年 1 月 末 | 29,330 | 7.0 | 2,826.50 | 7.0 | 97.6 | 2.4 |
| (期 末) 2021年 2月8日 | 31,202 | 13.8 | 3,006.47 | 13.8 | 97.7 | 2.3 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月8日から2021年2月8日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,202円となり、前期末比で13.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】 (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。
 (注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種
 期首 (前期末)

| No. | 業種 | 比率 |
|-----|--------|-------|
| 1 | 電気機器 | 14.2% |
| 2 | 情報・通信業 | 8.7 |
| 3 | 輸送用機器 | 7.4 |
| 4 | 化学 | 6.9 |
| 5 | 医薬品 | 6.1 |
| 6 | 銀行業 | 5.5 |
| 7 | サービス業 | 5.1 |
| 8 | 機械 | 5.0 |
| 9 | 卸売業 | 4.9 |
| 10 | 小売業 | 4.4 |



期末

| No. | 業種 | 比率 |
|-----|--------|-------|
| 1 | 電気機器 | 17.6% |
| 2 | 情報・通信業 | 9.2 |
| 3 | 化学 | 7.3 |
| 4 | 輸送用機器 | 6.9 |
| 5 | 医薬品 | 5.6 |
| 6 | 機械 | 5.6 |
| 7 | サービス業 | 5.5 |
| 8 | 銀行業 | 4.6 |
| 9 | 小売業 | 4.6 |
| 10 | 卸売業 | 4.4 |

○組入上位10銘柄
 期首 (前期末)

| No. | 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------|-------------------|---------|------|
| 1 | トヨタ自動車 | 日本・円 | 3.5% |
| 2 | ソニー | 日本・円 | 2.0 |
| 3 | ソフトバンクグループ | 日本・円 | 1.6 |
| 4 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円 | 1.6 |
| 5 | 武田薬品工業 | 日本・円 | 1.5 |
| 6 | 日本電信電話 | 日本・円 | 1.5 |
| 7 | キーエンス | 日本・円 | 1.4 |
| 8 | リクルートホールディングス | 日本・円 | 1.2 |
| 9 | 三井住友フィナンシャルグループ | 日本・円 | 1.1 |
| 10 | KDDI | 日本・円 | 1.0 |
| 組入銘柄数 | | 2,151銘柄 | |



期末

| No. | 銘柄名 | 通貨 | 比率 |
|-------|-------------------|---------|------|
| 1 | トヨタ自動車 | 日本・円 | 3.0% |
| 2 | ソニー | 日本・円 | 2.8 |
| 3 | ソフトバンクグループ | 日本・円 | 2.7 |
| 4 | キーエンス | 日本・円 | 2.1 |
| 5 | 任天堂 | 日本・円 | 1.3 |
| 6 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 日本・円 | 1.3 |
| 7 | 日本電産 | 日本・円 | 1.3 |
| 8 | リクルートホールディングス | 日本・円 | 1.3 |
| 9 | 信越化学工業 | 日本・円 | 1.2 |
| 10 | 日本電信電話 | 日本・円 | 1.2 |
| 組入銘柄数 | | 2,183銘柄 | |

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|------------------------------------|------------------|------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) | 0円 (0) (0) | 0.001% (0.000) (0.001) |
| 合 計 | 0 | 0.001 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(25,909円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については10ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2020年2月8日から2021年2月8日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---------|--|---------------------------|--------------------|------------|-------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 国 内 上 場 | | 63,510.4 (△11,652.101) | 127,938,692 (-) | 55,403.199 | 112,472,446 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は、株式分割、増資割当および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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------------|---------------|---------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内 株 式 先 物 取 引 | 百万円 71,359 | 百万円 71,662 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 240,411,139千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 237,278,032千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b) | 1.01 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月8日から2021年2月8日まで）

(1) 期中の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 |
| 株 式 | 百万円 127,938 | 百万円 6,656 | % 5.2 | 百万円 112,472 | 百万円 7,504 | % 6.7 |

(2) 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 | 百万円 1,047 | 百万円 867 | 百万円 2,537 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 | 期 |
|-----|-------|------------|
| | 買 付 額 | 買 付 額 |
| 株 式 | | 百万円 250 |

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 3,691千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 207千円 |
| (B) / (A) | 5.6% |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|----------------------|---------|-------|---------|-------|-----|-------|-------------------|---------|-------|-----------|-------|-----|-------|-------------------|---------|---------|-----------|-------|-----|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 |
| 極洋 | 5.1 | 5.4 | 16,956 | | | | ビーエス三菱 | 11.1 | 12.2 | 8,405 | | | | 森永製菓 | 25.4 | 27.8 | 118,984 | | | |
| 日本水産 | 146.5 | 148.6 | 76,083 | | | | 日本ハウスホールディングス | 23.2 | 25.6 | 9,088 | | | | 中村屋 | 2.8 | 2.5 | 9,925 | | | |
| マルハニチロ | 21.2 | 25.2 | 64,688 | | | | 大東建託 | 40.5 | 40.5 | 486,000 | | | | 江崎グリコ | 32.1 | 32.7 | 156,469 | | | |
| 雪国まいたけ | — | 9.9 | 17,998 | | | | 新日本建設 | 14.4 | 15.9 | 14,182 | | | | 名糖産業 | 5.2 | 5.6 | 8,428 | | | |
| カネコ種苗 | 4.5 | 4.6 | 7,369 | | | | N I P P O | 27.9 | 30.8 | 87,348 | | | | 井村屋グループ | 4.6 | 6.8 | 17,999 | | | |
| サカタのタネ | 17.4 | 19.2 | 75,552 | | | | 東亜道路工業 | 2.1 | 2.4 | 9,372 | | | | 不二家 | 6 | 7.6 | 18,088 | | | |
| ホクト | 11.2 | 13.6 | 29,648 | | | | 前田道路 | 35.8 | 22.9 | 45,777 | | | | 山崎製パン | 81.2 | 89 | 172,126 | | | |
| ホクリヨウ | 2.3 | 2.3 | 1,628 | | | | 日本道路 | 3.3 | 3.6 | 27,108 | | | | 第一屋製パン | 1.8 | 2.9 | 2,821 | | | |
| 鉱業 (0.2%) | | | | | | | 東亜建設工業 | 10.5 | 9.9 | 20,304 | | | | モロゾフ | 1.8 | 1.7 | 9,707 | | | |
| 住石ホールディングス | 30.1 | 27.8 | 3,141 | | | | 日本国土開発 | 19.8 | 36.3 | 20,763 | | | | 亀田製菓 | 6.2 | 6.9 | 34,051 | | | |
| 日鉄鉱業 | 3.4 | 3.7 | 20,831 | | | | 若築建設 | 6.1 | 6.7 | 8,736 | | | | 寿スビリッツ | 10.4 | 11.4 | 75,924 | | | |
| 三井鉱山ホールディングス | 5.7 | 6.7 | 6,117 | | | | 東洋建設 | 37.9 | 41.6 | 22,713 | | | | カルビー | 49.4 | 54.1 | 166,898 | | | |
| 国際石油開発帝石 | 587.5 | 590.1 | 411,889 | | | | 五洋建設 | 134 | 157.5 | 140,175 | | | | 森永乳業 | 20 | 21.9 | 111,690 | | | |
| 石油資源開発 | 19.2 | 21 | 49,224 | | | | 世紀東急工業 | 16.2 | 17.9 | 15,501 | | | | 六甲バター | 7.1 | 8 | 14,848 | | | |
| K&Oエナジーグループ | 7.1 | 7.7 | 11,118 | | | | 福田組 | 3.9 | 4.3 | 22,489 | | | | ヤクルト本社 | 74.5 | 81.6 | 438,192 | | | |
| 建設業 (2.3%) | | | | | | | 住友林業 | 85.7 | 87.2 | 199,164 | | | | 明治ホールディングス | 71.6 | 78.5 | 580,115 | | | |
| ヒノキヤグループ | 3.7 | 4 | 8,560 | | | | 日本基礎技術 | 11.4 | 11.7 | 5,814 | | | | 雪印メグミルク | 26.1 | 28.6 | 68,153 | | | |
| シノボンドホールディングス | 22.7 | 22.9 | 107,859 | | | | 巴コーポレーション | 15.2 | 16.8 | 6,820 | | | | プリマハム | 16.9 | 16.8 | 55,860 | | | |
| ミライト・ホールディングス | 43.6 | 55.7 | 96,361 | | | | 大和ハウス工業 | 334.5 | 342.4 | 1,101,500 | | | | 日本ハム | 41.4 | 45.4 | 212,472 | | | |
| タマホーム | 6.9 | 9.7 | 18,100 | | | | ライト工業 | 19.4 | 21.3 | 38,254 | | | | 林業産業 | 3.7 | 3.6 | 2,199 | | | |
| サンヨーホームズ | 1.2 | 2.2 | 1,850 | | | | 積水ハウス | 369.9 | 402.2 | 850,451 | | | | 丸大食品 | 11.6 | 11.8 | 20,886 | | | |
| 日本アーク | 5.8 | 6.4 | 3,916 | | | | 日特建設 | 8.9 | 9.9 | 7,959 | | | | S Foods | 8.7 | 10.7 | 37,610 | | | |
| ファーストコーポレーション | 4.5 | 4.9 | 3,528 | | | | 北陸電気工事 | 5.8 | 6.6 | 8,144 | | | | 柿安本店 | 3.8 | 4.1 | 11,512 | | | |
| ベステラ | 2.5 | 3 | 4,932 | | | | ユアテック | 19.4 | 21.3 | 18,147 | | | | 伊藤ハム米久ホールディングス | 69.8 | 76.7 | 57,525 | | | |
| TATERU | 30.3 | 29.9 | 5,621 | | | | 日本リーテック | — | 7.7 | 18,995 | | | | サッポロホールディングス | 36.9 | 40.5 | 88,492 | | | |
| キャンディル | — | 2.8 | 1,598 | | | | 四電工 | 1.7 | 1.7 | 4,845 | | | | アサヒグループホールディングス | 226.6 | 259.3 | 1,151,032 | | | |
| スペースリョーホールディングス | 17.8 | 19.6 | 13,818 | | | | 中電工 | 13.7 | 17.1 | 38,970 | | | | キリンホールディングス | 459 | 503.3 | 1,138,716 | | | |
| ダイセキ環境ソリューション | 2.9 | 3.1 | 2,476 | | | | 関電工 | 48.1 | 60.4 | 55,749 | | | | 宝ホールディングス | 81 | 87.9 | 124,378 | | | |
| 第一カッター興業 | 1.8 | 4 | 5,532 | | | | きんでん | 80.4 | 80.2 | 146,365 | | | | オノンホールディングス | 28.7 | 34.2 | 13,885 | | | |
| 安藤・間 | 87.2 | 102.9 | 81,805 | | | | 東京エネクス | 11.2 | 12.3 | 11,771 | | | | 養命酒製造 | 3.4 | 4 | 7,812 | | | |
| 東急建設 | 42.9 | 47 | 26,696 | | | | トーエネック | 3.4 | 3.8 | 14,934 | | | | コトコト 株式会社ホールディングス | 76 | 90.8 | 159,989 | | | |
| コムスホールディングス | 51.9 | 56.9 | 194,598 | | | | 住友電設 | 9.6 | 10.5 | 27,111 | | | | サントリー食品インターナショナル | 72.4 | 79.5 | 302,497 | | | |
| ビーアールホールディングス | 16 | 19 | 13,756 | | | | 日本電設工業 | 18.6 | 20.4 | 41,616 | | | | ダイドールホールディングス | 5.6 | 6.7 | 36,180 | | | |
| 福松コンストラクショングループ | 9.1 | 10.1 | 21,573 | | | | 協和エクシオ | 51.3 | 56.2 | 163,429 | | | | 伊藤園 | 32.8 | 36.1 | 241,870 | | | |
| 東建コーポレーション | 4.5 | 4.9 | 43,414 | | | | 新日本空調 | 9 | 9.8 | 21,903 | | | | キーコーヒー | 10.7 | 11.8 | 25,735 | | | |
| ソネック | 1.5 | 1.7 | 1,390 | | | | 九電工 | 23.8 | 26.1 | 92,916 | | | | ユニカフェ | 2.9 | 3.9 | 3,966 | | | |
| ヤマウラ | 6.4 | 7.2 | 6,789 | | | | 三機工業 | 24.4 | 26.3 | 34,374 | | | | ジャパンフーズ | 1.5 | 1.5 | 1,866 | | | |
| 大成建設 | 112.8 | 115.4 | 437,366 | | | | 日揮ホールディングス | 104.1 | 123.6 | 166,365 | | | | 日清オイリオグループ | 14 | 15.3 | 48,118 | | | |
| 大林組 | 338.1 | 370.8 | 350,406 | | | | 中外炉工業 | 3.7 | 4.1 | 7,121 | | | | 不二製油グループ本社 | 26.4 | 29 | 95,410 | | | |
| 清水建設 | 343.2 | 347.3 | 277,492 | | | | ヤマト | 10.8 | 11.9 | 8,472 | | | | かどや製油 | 1.1 | 1 | 4,060 | | | |
| 飛鳥建設 | 9.7 | 10.5 | 12,316 | | | | 太平電業 | 8.2 | 8.2 | 21,287 | | | | J-オイルミルズ | 5.6 | 5.6 | 21,336 | | | |
| 長谷工コーポレーション | 130.9 | 121.3 | 163,633 | | | | 高砂熱学工業 | 29.4 | 33.5 | 55,442 | | | | キッコマン | 77.9 | 85.4 | 628,544 | | | |
| 松井建設 | 13.4 | 14.7 | 10,936 | | | | 三晃金属工業 | 1.4 | 1.6 | 4,753 | | | | 味の素 | 239 | 282.3 | 648,301 | | | |
| 銭高組 | 1.4 | 1.2 | 5,412 | | | | 朝日工業社 | 2.2 | 2.1 | 6,224 | | | | キューピー | 60.3 | 66 | 160,512 | | | |
| 鹿島建設 | 265.5 | 271.6 | 413,646 | | | | 明星工業 | 21.8 | 24.1 | 19,810 | | | | ハウス食品グループ本社 | 40.5 | 44.4 | 175,824 | | | |
| 不動テトラ | 8.9 | 9.1 | 16,489 | | | | 大気社 | 16.4 | 18 | 53,946 | | | | カゴメ | 41.1 | 48.5 | 169,507 | | | |
| 大末建設 | 4 | 4.9 | 4,356 | | | | ダイダン | 8.1 | 8.2 | 23,780 | | | | 焼津水産化学工業 | 5.3 | 4.8 | 4,939 | | | |
| 鉄建建設 | 7.3 | 7.5 | 14,970 | | | | 日比谷総合設備 | 10.9 | 12.2 | 23,131 | | | | アリアゲジャパン | 9.9 | 10.9 | 78,153 | | | |
| 西松建設 | 26 | 26.5 | 68,688 | | | | フィル・カンパニー | 1.4 | 2.1 | 4,166 | | | | ビエトロ | 1.4 | 1.2 | 2,109 | | | |
| 三井住友建設 | 81.7 | 89.4 | 42,912 | | | | OS JBホールディングス | 53.1 | 54.1 | 14,985 | | | | エバラ食品工業 | 2.5 | 2.4 | 6,684 | | | |
| 大豊建設 | 7.6 | 8.1 | 30,942 | | | | 東洋エン지니어リング | 14.2 | 15.4 | 7,499 | | | | やまみ | 0.5 | 1.1 | 2,332 | | | |
| 前田建設工業 | 84.7 | 92.9 | 89,834 | | | | レイズネクスト | 18.2 | 20 | 23,800 | | | | ニチレイ | 51.5 | 56.5 | 167,070 | | | |
| 佐田建設 | 7.4 | 6.7 | 2,974 | | | | 食料品 (3.4%) | | | | | | 東洋水産 | 55.7 | 61 | 291,580 | | | | |
| ナカノフード・建設 | 9.3 | 9.7 | 3,899 | | | | ニップ | 31.6 | 35 | 57,435 | | | | イトフードホールディングス | 3.8 | 4.2 | 7,988 | | | |
| 奥村組 | 18.4 | 20.4 | 56,630 | | | | 日清製粉グループ本社 | 122.3 | 134.1 | 246,207 | | | | 大冷 | 1.4 | 1.5 | 2,919 | | | |
| 東鉄工業 | 14.5 | 16 | 44,624 | | | | 日清製粉 | 0.7 | 0.6 | 4,032 | | | | ヨムラ・フード・ホールディングス | 5.9 | 6.7 | 6,110 | | | |
| イチケン | 2.4 | 2.7 | 5,367 | | | | 昭和产业 | 10 | 10.1 | 32,168 | | | | 日清食品ホールディングス | 46 | 46.5 | 400,830 | | | |
| 浅沼組 | 3.8 | 4.4 | 20,064 | | | | 鳥越製粉 | 9.7 | 10.8 | 9,698 | | | | 永谷園ホールディングス | 5.3 | 6 | 14,418 | | | |
| 戸田建設 | 140.3 | 154.1 | 122,201 | | | | 中部飼料 | 13.3 | 14.6 | 21,681 | | | | 一正精糖 | 4 | 4 | 4,872 | | | |
| 熊谷組 | 15.7 | 17.1 | 48,273 | | | | フィード・ワン | 72.9 | 16.2 | 14,596 | | | | フジッコ | 11.7 | 13 | 26,806 | | | |
| 北野建設 | 2 | 1.9 | 4,677 | | | | 東洋精糖 | 1.7 | 1.7 | 2,087 | | | | ロック・フィールド | 11.7 | 12.8 | 20,569 | | | |
| 植木組 | 1.5 | 1.6 | 4,606 | | | | 日本甜菜製糖 | 5.7 | 6.4 | 10,873 | | | | 日本たばこ産業 | 624.9 | 636.5 | 1,369,111 | | | |
| 矢作建設工業 | 14.9 | 16.7 | 14,545 | | | | 三井製糖 | 9.5 | 9.5 | 18,800 | | | | ケンコーマヨネーズ | 6.1 | 7.3 | 14,235 | | | |
| | | | | | | | 塩水港精糖 | 11.3 | 14.4 | 3,283 | | | | わらべや日洋ホールディングス | 7.1 | 7.8 | 13,392 | | | |
| | | | | | | | 日新製糖 | 5.1 | 4.5 | 8,536 | | | | なとり | 6.1 | 6.9 | 13,869 | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期末 | | |
|---------------------|---------|-------|---------|-----|-------|-------|-----------|------------------|-------|-------|-----------|----|-------|-------|-----------|----|-------|-------|-----------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 |
| イフジ産業 | 1.9 | 2.3 | 2,081 | | 3.8 | 3.8 | 9,146 | ハリマ化成グループ | 8.8 | 8.7 | 8,404 | | 8.8 | 8.7 | 8,404 | | 8.8 | 8.7 | 8,404 | |
| ピッルスコーポレーション | 2.3 | 2.8 | 9,996 | | 9.1 | 9.9 | 70,587 | 花王 | 258.1 | 283.1 | 2,128,062 | | 258.1 | 283.1 | 2,128,062 | | 258.1 | 283.1 | 2,128,062 | |
| 北の達人コーポレーション | 37.7 | 41.4 | 25,957 | | 3.1 | 4.5 | 27,945 | 第一工業製薬 | 4 | 3.9 | 15,015 | | 4 | 3.9 | 15,015 | | 4 | 3.9 | 15,015 | |
| ユーグレナ | 46.2 | 51.2 | 47,104 | | 7.8 | 8.4 | 12,793 | 石原ケミカル | 3 | 3 | 6,240 | | 3 | 3 | 6,240 | | 3 | 3 | 6,240 | |
| ミヨシ油脂 | 4.4 | 4.4 | 5,302 | | 19 | 20.6 | 17,036 | 日華化学 | 3.7 | 4.3 | 3,857 | | 3.7 | 4.3 | 3,857 | | 3.7 | 4.3 | 3,857 | |
| 理研ビタミン | 5.1 | 11.2 | 15,792 | | 3 | 2.4 | 3,033 | ニイタカ | 1.6 | 2.4 | 6,835 | | 1.6 | 2.4 | 6,835 | | 1.6 | 2.4 | 6,835 | |
| 繊維製品 (0.5%) | | | | | 15.6 | 16.2 | 54,270 | 三洋化成工業 | 6.3 | 6.9 | 37,191 | | 6.3 | 6.9 | 37,191 | | 6.3 | 6.9 | 37,191 | |
| 片倉工業 | 15.4 | 15.6 | 21,715 | | 163.3 | 178.9 | 334,364 | 有機合成薬品工業 | 8.5 | 9.2 | 2,815 | | 8.5 | 9.2 | 2,815 | | 8.5 | 9.2 | 2,815 | |
| グンゼ | 7.8 | 8.5 | 32,895 | | 30.5 | 34.3 | 91,615 | 日本塗料 | 12 | 13.2 | 13,002 | | 12 | 13.2 | 13,002 | | 12 | 13.2 | 13,002 | |
| 東洋紡 | 41.7 | 45.8 | 63,707 | | 21.6 | 22 | 49,038 | 大日本ペイント | 87.2 | 95.5 | 926,350 | | 87.2 | 95.5 | 926,350 | | 87.2 | 95.5 | 926,350 | |
| ユニチカ | 31.2 | 33.8 | 15,345 | | 66.4 | 70.7 | 84,274 | 関西ペイント | 118.7 | 130.1 | 404,611 | | 118.7 | 130.1 | 404,611 | | 118.7 | 130.1 | 404,611 | |
| 富士紡ホールディングス | 5.1 | 5.6 | 24,948 | | 10.8 | 11.9 | 32,713 | 神東塗料 | 8.8 | 9.3 | 1,953 | | 8.8 | 9.3 | 1,953 | | 8.8 | 9.3 | 1,953 | |
| 倉敷紡績 | 10.9 | 10.7 | 20,811 | | 25.1 | 27.3 | 23,778 | 中国塗料 | 30.1 | 27.9 | 25,891 | | 30.1 | 27.9 | 25,891 | | 30.1 | 27.9 | 25,891 | |
| シキボウ | 5.6 | 6.6 | 6,890 | | 38.6 | 42.2 | 175,763 | 日本特殊塗料 | 8 | 8.7 | 9,952 | | 8 | 8.7 | 9,952 | | 8 | 8.7 | 9,952 | |
| 日本毛織 | 34.8 | 38.1 | 38,100 | | 181.3 | 214.1 | 3,869,857 | 藤倉化成 | 14.5 | 16 | 8,256 | | 14.5 | 16 | 8,256 | | 14.5 | 16 | 8,256 | |
| ダイトウボウ | 17.8 | 19.3 | 2,161 | | 3.7 | 4.2 | 5,712 | 太陽ホールディングス | 7.8 | 8.5 | 52,105 | | 7.8 | 8.5 | 52,105 | | 7.8 | 8.5 | 52,105 | |
| トー紡コーポレーション | 4.1 | 4.1 | 1,927 | | 6.8 | 8.1 | 17,293 | D I C | 44.7 | 48.9 | 134,866 | | 44.7 | 48.9 | 134,866 | | 44.7 | 48.9 | 134,866 | |
| ダイドーリミテッド | 14.1 | 16.6 | 3,170 | | 11.5 | 11.7 | 11,594 | サカタインクス | 23.2 | 25.3 | 28,513 | | 23.2 | 25.3 | 28,513 | | 23.2 | 25.3 | 28,513 | |
| 帝国繊維 | 11.8 | 13 | 30,407 | | 90.2 | 118.1 | 208,800 | 兼キョウキス(ホールディングス) | 22.4 | 24.5 | 47,309 | | 22.4 | 24.5 | 47,309 | | 22.4 | 24.5 | 47,309 | |
| 帝人 | 86.2 | 109 | 211,351 | | 101.5 | 95.3 | 196,413 | T & K TOKA | 8.4 | 9.4 | 7,802 | | 8.4 | 9.4 | 7,802 | | 8.4 | 9.4 | 7,802 | |
| 東レ | 764.7 | 838.4 | 618,655 | | 3.3 | 3.2 | 9,712 | 富士フイルムホールディングス | 206.7 | 207.8 | 1,281,918 | | 206.7 | 207.8 | 1,281,918 | | 206.7 | 207.8 | 1,281,918 | |
| サカイオーベックス | 2.9 | 3.1 | 6,767 | | 1.5 | 1.9 | 2,758 | 資生堂 | 214.3 | 235 | 1,830,180 | | 214.3 | 235 | 1,830,180 | | 214.3 | 235 | 1,830,180 | |
| 住江織物 | 2.3 | 2.1 | 4,332 | | 53.3 | 58.4 | 64,824 | ライオン | 140.2 | 153.7 | 363,961 | | 140.2 | 153.7 | 363,961 | | 140.2 | 153.7 | 363,961 | |
| 日本フェルト | 5.7 | 5.5 | 2,480 | | 16.9 | 18.5 | 13,912 | 高砂香料工業 | 6.8 | 7.4 | 19,336 | | 6.8 | 7.4 | 19,336 | | 6.8 | 7.4 | 19,336 | |
| イチカフ | 1.5 | 1.3 | 1,683 | | 1.3 | 1.5 | 3,553 | マンダム | 24.3 | 24.7 | 43,076 | | 24.3 | 24.7 | 43,076 | | 24.3 | 24.7 | 43,076 | |
| 日東製網 | 1.2 | 1.3 | 1,970 | | 16.3 | 15.5 | 19,313 | ミルボン | 14.4 | 15.8 | 111,232 | | 14.4 | 15.8 | 111,232 | | 14.4 | 15.8 | 111,232 | |
| アヅキ | 8.8 | 9.3 | 4,770 | | 2.4 | 2.4 | 5,347 | ファンケル | 43.7 | 43 | 168,560 | | 43.7 | 43 | 168,560 | | 43.7 | 43 | 168,560 | |
| ダイニチ | 3.9 | 3.6 | 2,851 | | 5.8 | 6.3 | 22,522 | コーセー | 20.3 | 22.2 | 385,614 | | 20.3 | 22.2 | 385,614 | | 20.3 | 22.2 | 385,614 | |
| セーレン | 26 | 28.5 | 52,012 | | 4 | 3.4 | 17,238 | コタ | 5.7 | 7 | 10,703 | | 5.7 | 7 | 10,703 | | 5.7 | 7 | 10,703 | |
| ソトー | 3.8 | 4 | 3,272 | | 16.4 | 21 | 126,000 | シーボン | 1.2 | 1.3 | 2,581 | | 1.2 | 1.3 | 2,581 | | 1.2 | 1.3 | 2,581 | |
| 東海染工 | 1.4 | 1.3 | 1,458 | | 9.4 | 9.6 | 22,790 | ホーラルオビスホールディングス | 46 | 50.5 | 109,585 | | 46 | 50.5 | 109,585 | | 46 | 50.5 | 109,585 | |
| 小松マテール | 17.3 | 19.1 | 20,093 | | 27.3 | 30 | 119,850 | ノビアホールディングス | 10.3 | 10 | 50,500 | | 10.3 | 10 | 50,500 | | 10.3 | 10 | 50,500 | |
| ワコールホールディングス | 27.5 | 28.9 | 68,695 | | 99.7 | 116 | 291,972 | アジパコシステムジャパン | 2.3 | 3 | 3,267 | | 2.3 | 3 | 3,267 | | 2.3 | 3 | 3,267 | |
| ホギメディカル | 12 | 15.6 | 50,934 | | 96 | 100 | 335,500 | 新日本製薬 | — | 2.4 | 6,506 | | — | 2.4 | 6,506 | | — | 2.4 | 6,506 | |
| レナウン | 28.2 | — | — | | 98.4 | 116.2 | 362,544 | エステー | 6.9 | 7.7 | 16,016 | | 6.9 | 7.7 | 16,016 | | 6.9 | 7.7 | 16,016 | |
| クラウディアホールディングス | 2.9 | 2.4 | 691 | | 18.2 | 19.9 | 142,882 | アグロ カネシヨウ | 3.4 | 4.5 | 6,961 | | 3.4 | 4.5 | 6,961 | | 3.4 | 4.5 | 6,961 | |
| T S Iホールディングス | 35.5 | 34.7 | 10,028 | | 9.8 | 10.7 | 39,162 | コニシ | 17.7 | 19.5 | 32,311 | | 17.7 | 19.5 | 32,311 | | 17.7 | 19.5 | 32,311 | |
| マツオカコーポレーション | 3.1 | 3.7 | 7,788 | | 706.2 | 774.1 | 577,943 | 長谷川香料 | 14.4 | 20.5 | 43,009 | | 14.4 | 20.5 | 43,009 | | 14.4 | 20.5 | 43,009 | |
| ワールド | 1.5 | 15.1 | 21,789 | | 18.6 | 19.1 | 48,380 | 星光PMC | 6.3 | 6.9 | 5,361 | | 6.3 | 6.9 | 5,361 | | 6.3 | 6.9 | 5,361 | |
| 三陽商会 | 5.5 | 6 | 4,512 | | 144.5 | 155.5 | 130,309 | 小林製薬 | 30.2 | 33.1 | 364,100 | | 30.2 | 33.1 | 364,100 | | 30.2 | 33.1 | 364,100 | |
| ナイガイ | 4 | 3.8 | 1,250 | | 16.6 | 18.2 | 74,074 | 荒川化学工業 | 9.7 | 9.9 | 12,780 | | 9.7 | 9.9 | 12,780 | | 9.7 | 9.9 | 12,780 | |
| オンワードホールディングス | 63.5 | 69.3 | 20,166 | | 227.1 | 244.9 | 502,289 | メック | 7.4 | 8.1 | 17,293 | | 7.4 | 8.1 | 17,293 | | 7.4 | 8.1 | 17,293 | |
| ルックホールディングス | 3.6 | 4 | 3,752 | | 95.3 | 104.5 | 172,425 | 日本高純度化学 | 3.1 | 3.3 | 9,147 | | 3.1 | 3.3 | 9,147 | | 3.1 | 3.3 | 9,147 | |
| キムラタン | 57.9 | 68.3 | 1,707 | | 31.7 | 32.2 | 122,360 | タカラバイオ | 28.2 | 31 | 96,565 | | 28.2 | 31 | 96,565 | | 28.2 | 31 | 96,565 | |
| ゴールドウイン | 19.2 | 19.1 | 139,812 | | 53.3 | 58.4 | 123,048 | J C U | 13.1 | 13.3 | 49,010 | | 13.1 | 13.3 | 49,010 | | 13.1 | 13.3 | 49,010 | |
| デサント | 20.6 | 19.8 | 35,224 | | 19 | 19.1 | 41,408 | 新田セラチン | 6.7 | 7.7 | 5,197 | | 6.7 | 7.7 | 5,197 | | 6.7 | 7.7 | 5,197 | |
| キング | 5 | 4.6 | 2,737 | | 22.8 | 25.2 | 17,589 | O A Tアグリオ | 1.8 | 2.3 | 3,061 | | 1.8 | 2.3 | 3,061 | | 1.8 | 2.3 | 3,061 | |
| ヤマトインターナショナル | 6.3 | 10.6 | 3,710 | | 6 | 6.6 | 10,553 | デクセラリアルズ | 27.8 | 33 | 46,860 | | 27.8 | 33 | 46,860 | | 27.8 | 33 | 46,860 | |
| パルプ・紙 (0.2%) | | | | | 48.9 | — | — | アース製薬 | 8.2 | 8.9 | 55,269 | | 8.2 | 8.9 | 55,269 | | 8.2 | 8.9 | 55,269 | |
| 特種東海製紙 | 6.7 | 7.2 | 34,452 | | 5.6 | 6.2 | 11,315 | 北興化学工業 | 11.1 | 10.9 | 12,415 | | 11.1 | 10.9 | 12,415 | | 11.1 | 10.9 | 12,415 | |
| 王子ホールディングス | 441.3 | 521.3 | 347,185 | | 26.7 | 28.2 | 14,128 | 大成ラミック | 3.3 | 3.7 | 11,081 | | 3.3 | 3.7 | 11,081 | | 3.3 | 3.7 | 11,081 | |
| 日本製紙 | 46.7 | 51.1 | 75,219 | | 5 | 5.5 | 10,923 | クミアイ化学工業 | 44.7 | 48.8 | 44,359 | | 44.7 | 48.8 | 44,359 | | 44.7 | 48.8 | 44,359 | |
| 三菱製紙 | 12 | 17.1 | 5,950 | | 14.2 | 15.6 | 8,923 | 日本農業 | 19.4 | 21.2 | 10,833 | | 19.4 | 21.2 | 10,833 | | 19.4 | 21.2 | 10,833 | |
| 北越コーポレーション | 70 | 82.9 | 38,797 | | 2.4 | 2.2 | 5,526 | アキレス | 7.4 | 8.2 | 12,464 | | 7.4 | 8.2 | 12,464 | | 7.4 | 8.2 | 12,464 | |
| 中越パルプ工業 | 4.5 | 4.7 | 5,705 | | 5.6 | 6.7 | 2,914 | 有沢製作所 | 17 | 16.5 | 16,665 | | 17 | 16.5 | 16,665 | | 17 | 16.5 | 16,665 | |
| 巴川製紙所 | 3.2 | 3.7 | 3,048 | | 3.8 | 3.7 | 4,421 | 日東電工 | 74.5 | 75.7 | 734,290 | | 74.5 | 75.7 | 734,290 | | 74.5 | 75.7 | 734,290 | |
| 大王製紙 | 46.3 | 56 | 103,936 | | 3.8 | 4.3 | 4,592 | レック | 11.5 | 14 | 18,802 | | 11.5 | 14 | 18,802 | | 11.5 | 14 | 18,802 | |
| 阿波製紙 | 2.8 | 3 | 1,407 | | 22.2 | 24.5 | 22,025 | 三光合成 | 12.4 | 12.4 | 5,642 | | 12.4 | 12.4 | 5,642 | | 12.4 | 12.4 | 5,642 | |
| レンゴウ | 99.9 | 119.4 | 110,206 | | 3.8 | 4.2 | 3,691 | きもと | 18.5 | 18.9 | 3,761 | | 18.5 | 18.9 | 3,761 | | 18.5 | 18.9 | 3,761 | |
| トーモク | 6.5 | 7.2 | 13,788 | | 5.7 | 6.3 | 13,721 | 藤森工業 | 9.7 | 10.6 | 50,774 | | 9.7 | 10.6 | 50,774 | | 9.7 | 10.6 | 50,774 | |
| ザ・パックス | 8 | 8.7 | 23,307 | | — | 1.7 | 3,525 | 前澤化成工業 | 6.9 | 7.8 | 7,776 | | 6.9 | 7.8 | 7,776 | | 6.9 | 7.8 | 7,776 | |
| 化学 (7.4%) | | | | | 65.4 | 71.6 | 7 | | | | | | | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | | | |
|-----------------------|---------|---------|---------|-------|-----------|----|------------------|---------|-------|-------|---------|---|---------|--------------------|---------|-------|-------|-------|-------|----|---|---------|----|
| | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 |
| バルカー | | | 千株 | | | 千株 | 日本山村硝子 | | | 千株 | | | 千株 | 古河機械金属 | | | 千株 | | | 千株 | | | 千株 |
| ユニ・チャーム | | 8.8 | 9.7 | | 20,622 | | 日本電気硝子 | | 4.5 | 5.3 | 4,833 | | 107,397 | エス・サイエンス | | 19 | 19.3 | | 19.3 | | | 25,765 | |
| ジョーエコーポレーション | | 207.9 | 250.8 | | 1,171,236 | | オハラ | | 43.3 | 43.8 | 8,992 | | 107,397 | 大塚チタニウムテクノロジーズ | | 47.6 | 54.7 | | 54.7 | | | 2,461 | |
| 医薬品 (5.7%) | | 1.2 | 2.6 | | 2,727 | | 住友大阪セメント | | 4.3 | 4.7 | 8,992 | | 107,397 | 東邦チタニウム | | 11.1 | 12 | | 12 | | | 9,972 | |
| 協和キリン | | 108.4 | 119 | | 379,015 | | 太平洋セメント | | 20.4 | 21.3 | 71,355 | | 171,220 | UACJ | | 19.1 | 20.9 | | 20.9 | | | 19,395 | |
| 武田薬品工業 | | 897.1 | 983.7 | | 3,584,602 | | 日本ヒューム | | 68.1 | 70 | 8,690 | | 197,120 | C Kサンエツ | | 16.2 | 17.7 | | 17.7 | | | 40,656 | |
| アステラス製薬 | | 948.4 | 1,025.1 | | 1,882,083 | | 日本コクリート工業 | | 10.8 | 11 | 8,280 | | 197,120 | 古河電気工業 | | 1.9 | 2.1 | | 2.1 | | | 8,158 | |
| 大日本住友製薬 | | 79.9 | 87.6 | | 164,512 | | 三谷セキサン | | 23.4 | 25.4 | 27,775 | | 197,120 | 住友電気工業 | | 33.1 | 36.4 | | 36.4 | | | 106,142 | |
| 塩野義製薬 | | 137.9 | 148.7 | | 883,426 | | アジパイルホールディングス | | 5 | 5.5 | 9,342 | | 197,120 | フジクラ | | 398.6 | 407.9 | | 407.9 | | | 652,232 | |
| わかもと製薬 | | 13 | 14.3 | | 3,532 | | 東海カーボン | | 112.9 | 115.5 | 180,988 | | 197,120 | 昭栄ホールディングス | | 128.7 | 141.1 | | 141.1 | | | 77,605 | |
| あすか製薬 | | 12.3 | 13.4 | | 20,314 | | 日本カーボン | | 5.5 | 6.5 | 27,072 | | 197,120 | 東京特殊電線 | | 12.3 | 11.3 | | 11.3 | | | 21,470 | |
| 日本新薬 | | 28.3 | 33.5 | | 269,675 | | 東洋炭素 | | 6.3 | 7 | 14,329 | | 197,120 | タツタ電線 | | 1.6 | 1.5 | | 1.5 | | | 3,870 | |
| ピオフェルミン製薬 | | 1.7 | 2.2 | | 5,658 | | ノリタケカンパニーリミテド | | 5.9 | 6.6 | 24,156 | | 197,120 | カナレ電気 | | 21.1 | 20.6 | | 20.6 | | | 14,440 | |
| 中外製薬 | | 112.4 | 369.8 | | 1,982,497 | | TOTO | | 77 | 84.5 | 612,625 | | 197,120 | 平河ヒューテック | | 1.7 | 2.2 | | 2.2 | | | 3,916 | |
| 科研製薬 | | 18.5 | 20.2 | | 83,426 | | 日本硝子 | | 131.6 | 130 | 248,430 | | 197,120 | リョービ | | 4 | 6.5 | | 6.5 | | | 7,956 | |
| エーザイ | | 129 | 130.6 | | 1,020,377 | | 日本特殊陶業 | | 83.9 | 90 | 179,910 | | 197,120 | アーレスティ | | 13.2 | 14.2 | | 14.2 | | | 18,616 | |
| ロート製薬 | | 55.3 | 56.3 | | 181,849 | | ダントーホールディングス | | 8 | 8.6 | 3,706 | | 197,120 | アサヒホールディングス | | 14 | 14.6 | | 14.6 | | | 5,956 | |
| 小野薬品工業 | | 247.6 | 271.5 | | 856,854 | | MARUWA | | 4.2 | 4.1 | 44,936 | | 197,120 | アサヒホールディングス | | 18.7 | 21.9 | | 21.9 | | | 93,294 | |
| 久光製薬 | | 28.5 | 34.4 | | 226,008 | | 品川リフラクトリーズ | | 2.9 | 2.8 | 8,066 | | 197,120 | 金属製品 (0.6%) | | | | | | | | | |
| 持田製薬 | | 15 | 16.4 | | 69,946 | | 黒崎播磨 | | 2.1 | 2 | 9,830 | | 197,120 | 稲葉製作所 | | 6 | 6.7 | | 6.7 | | | 9,601 | |
| 参天製薬 | | 200.8 | 205.7 | | 353,392 | | ユータイ | | 8.6 | 8.6 | 8,101 | | 197,120 | 豊地エンジニアリンググループ | | 3.3 | 3.8 | | 3.8 | | | 8,759 | |
| 扶桑薬品工業 | | 3.8 | 3.8 | | 10,598 | | インソライト工業 | | 5.5 | 5.3 | 3,121 | | 197,120 | トーカロ | | 29.6 | 30.2 | | 30.2 | | | 43,004 | |
| 日本ケミファ | | 1.4 | 1.2 | | 2,703 | | 東京窯業 | | 13.8 | 15.7 | 5,243 | | 197,120 | アルファ | | 3.8 | 4.5 | | 4.5 | | | 4,761 | |
| ソムラ | | 33.5 | 39.5 | | 138,842 | | ニッカトー | | 4.9 | 5.4 | 4,152 | | 197,120 | SUMCO | | 127.7 | 149.6 | | 149.6 | | | 338,694 | |
| 日医工 | | 30.6 | 33.4 | | 35,971 | | フジミンコ・ポレテッド | | 9.6 | 9.5 | 38,475 | | 197,120 | 川田テクノロジー | | 2.1 | 2.4 | | 2.4 | | | 10,896 | |
| キッセイ薬品工業 | | 19.1 | 20.9 | | 49,135 | | クニミネ工業 | | 4.4 | 3.8 | 4,993 | | 197,120 | RS Technologies | | 3.1 | 3.8 | | 3.8 | | | 24,472 | |
| 生化学工業 | | 20.8 | 20.9 | | 23,345 | | エーアンドエマテリアル | | 1.8 | 2.4 | 2,625 | | 197,120 | ジェイテックホールディングス | | - | 1 | | 1 | | | 3,855 | |
| 栄研化学 | | 19 | 20.8 | | 48,672 | | ニチアス | | 29.5 | 29.9 | 76,514 | | 197,120 | 信和 | | 67.9 | 74.5 | | 74.5 | | | 100,426 | |
| 日本製薬 | | 4.6 | 4.6 | | 4,696 | | ニチハ | | 15 | 16.5 | 55,687 | | 197,120 | 野馳グループホールディングス | | 4.6 | 6.4 | | 6.4 | | | 4,588 | |
| 鳥居薬品 | | 6.7 | 7.4 | | 23,495 | | 鉄鋼 (0.7%) | | | | | | 197,120 | ホッカンホールディングス | | 5.9 | 6 | | 6 | | | 8,946 | |
| JCRファーマ | | 7.6 | 33.3 | | 105,727 | | 日本製鉄 | | 477.3 | 558.1 | 819,848 | | 197,120 | コロナ | | 5.9 | 6.8 | | 6.8 | | | 6,473 | |
| 東和薬品 | | 13.8 | 17.1 | | 36,337 | | 神戸製鋼所 | | 195.1 | 213.7 | 135,508 | | 197,120 | 横河アリジックホールディングス | | 19.9 | 20.1 | | 20.1 | | | 40,099 | |
| 富士製薬工業 | | 7.3 | 8.1 | | 11,064 | | 中山製鋼所 | | 14.9 | 17.1 | 6,788 | | 197,120 | 駒井ハルテック | | 0.9 | 2.4 | | 2.4 | | | 5,296 | |
| 沢井製薬 | | 22.1 | 25.9 | | 127,557 | | 合同製鐵 | | 5.7 | 6.3 | 13,097 | | 197,120 | 高田機工 | | 1.9 | 0.8 | | 0.8 | | | 2,056 | |
| ゼリア新薬工業 | | 19.6 | 21.5 | | 46,547 | | ジェイエフイーホールディングス | | 287.9 | 338.2 | 364,579 | | 197,120 | 三和ホールディングス | | 102.3 | 110.2 | | 110.2 | | | 146,566 | |
| 第一三共 | | 308.5 | 1,015 | | 3,273,375 | | 東京製鐵 | | 52 | 45.6 | 34,792 | | 197,120 | 文化シャッター | | 31.5 | 34.6 | | 34.6 | | | 33,873 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | | 23.8 | 26.1 | | 51,025 | | 共英製鋼 | | 12 | 13.1 | 18,929 | | 197,120 | 三協立山 | | 14.8 | 15 | | 15 | | | 13,065 | |
| 大幸薬品 | | 4.4 | 14.5 | | 23,229 | | 大和工業 | | 22.6 | 24.9 | 68,574 | | 197,120 | アルインコ | | 7.8 | 7.8 | | 7.8 | | | 7,612 | |
| ダイト | | 6.3 | 7.5 | | 28,537 | | 東京製鋼 | | 4.4 | 4.5 | 8,824 | | 197,120 | 東洋シャッター | | 2.5 | 2.4 | | 2.4 | | | 1,682 | |
| 大塚ホールディングス | | 205.4 | 245.8 | | 1,165,829 | | 大阪製鐵 | | 5.7 | 6.3 | 8,057 | | 197,120 | LIXIL | | 157.4 | 161 | | 161 | | | 464,485 | |
| 大正製薬ホールディングス | | 22.7 | 28.1 | | 200,634 | | 淀川製鋼所 | | 14.4 | 15.9 | 36,395 | | 197,120 | 日本フイルコン | | 8.3 | 8.5 | | 8.5 | | | 4,309 | |
| ペプチドリーム | | 54.6 | 60.1 | | 391,251 | | 丸一鋼管 | | 34.6 | 37.9 | 92,097 | | 197,120 | ノーリツ | | 22.1 | 24.3 | | 24.3 | | | 39,438 | |
| 石油・石化製品 (0.4%) | | | | | | | モリ工業 | | 3.2 | 3.5 | 8,193 | | 197,120 | 長府製作所 | | 10.8 | 12 | | 12 | | | 25,860 | |
| 日本コークス工業 | | 92.1 | 100.5 | | 10,050 | | 大同特殊鋼 | | 17.4 | 19.1 | 92,730 | | 197,120 | リンナイ | | 20.7 | 22.7 | | 22.7 | | | 252,197 | |
| ニチレキ | | 12.7 | 14 | | 21,910 | | 日本高周波鋼業 | | 4.2 | 4 | 1,528 | | 197,120 | ダイニチ工業 | | 5.7 | 5.7 | | 5.7 | | | 5,033 | |
| ユシロ化学工業 | | 6 | 6.8 | | 7,922 | | 山陽特殊製鋼 | | 7.6 | 14 | 23,282 | | 197,120 | 日東精工 | | 14.7 | 15.1 | | 15.1 | | | 7,368 | |
| ピーピー・カストロール | | 3.9 | 4.3 | | 5,400 | | 愛知製鋼 | | 6 | 6.6 | 21,813 | | 197,120 | 三洋工業 | | 1.4 | 1.3 | | 1.3 | | | 2,455 | |
| 富士石油 | | 29 | 28.8 | | 6,681 | | 日立金属 | | 114.8 | 110.3 | 191,922 | | 197,120 | 岡部 | | 21.6 | 24.1 | | 24.1 | | | 19,207 | |
| MORESCO | | 4 | 4.5 | | 5,301 | | 日本金属 | | 2.4 | 2.9 | 3,503 | | 197,120 | ジーテクト | | 13.3 | 14.6 | | 14.6 | | | 23,038 | |
| 出光興産 | | 121.3 | 131.2 | | 339,414 | | 大太平洋金属 | | 7.2 | 7.8 | 17,643 | | 197,120 | 高周波熱錬 | | 19.9 | 21.9 | | 21.9 | | | 35,565 | |
| ENEOSホールディングス | | 1,621.8 | 1,778.3 | | 788,498 | | 新日本電工 | | 69.2 | 75.3 | 21,234 | | 197,120 | 東京製鋼 | | 20.5 | 22.3 | | 22.3 | | | 12,532 | |
| コスモエネルギーホールディングス | | 31.2 | 37.3 | | 88,550 | | 栗本鐵工所 | | 5.3 | 5.4 | 9,579 | | 197,120 | サンコール | | 7.6 | 8.2 | | 8.2 | | | 11,873 | |
| ゴム製品 (0.6%) | | | | | | | 缸 技 | | 1.6 | 1.3 | 1,492 | | 197,120 | モリテックスチール | | 6.1 | 10.3 | | 10.3 | | | 4,923 | |
| 横浜ゴム | | 62.4 | 68.4 | | 124,556 | | 日本精練 | | 1.7 | 1.7 | 6,613 | | 197,120 | パイオラックス | | 8.4 | 9 | | 9 | | | 3,807 | |
| TOYO TIRE | | 61.9 | 62.4 | | 113,452 | | 日本鋳鉄管 | | 1.1 | 1.4 | 1,828 | | 197,120 | エイチワン | | 15.7 | 17.3 | | 17.3 | | | 28,493 | |
| ブリヂストン | | 331.4 | 314.4 | | 1,301,930 | | 三菱製鋼 | | 8 | 8.8 | 6,151 | | 197,120 | エイチワン | | 10.5 | 11.6 | | 11.6 | | | 9,767 | |
| 住友ゴム工業 | | 96.9 | 106 | | 110,770 | | 日亜鋼業 | | 15.7 | 17.8 | 5,340 | | 197,120 | 日本発条 | | 114.3 | 116.4 | | 116.4 | | | 99,522 | |
| 藤倉コンポジット | | 9.5 | 10.8 | | 4,762 | | 日本精練 | | 1.7 | 1.7 | 6,613 | | 197,120 | 中央発条 | | 1.2 | 1 | | 1 | | | 2,803 | |
| オカモト | | 6.5 | 7.3 | | 29,382 | | エビプロ・ホールディングス | | 4.1 | 5.1 | 3,529 | | 197,120 | アドパネクス | | 1.3 | 1.6 | | 1.6 | | | 2,606 | |
| フコク | | 4.7 | 4.4 | | 3,132 | | シン・ツタン | | 16.6 | 14.5 | 3,146 | | 197,120 | 立川プラインド工業 | | 4.7 | 5.3 | | 5.3 | | | 7,080 | |
| ニッタ | | 12.1 | 12.2 | | 30,841 | | 新家工業 | | 2.4 | 3.1 | 4,417 | | 197,120 | 三益半導体工業 | | 8.4 | 9.1 | | 9.1 | | | 24,151 | |
| 住友理工 | | 20.9 | 22.8 | | 15,572 | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|---|-------|-----------|---------------------|---------|---|-------|-----------|------------------------|---------|---|---------|-----------|
| | 株 | 数 | 株 | 数 評 価 額 | | 株 | 数 | 株 | 数 評 価 額 | | 株 | 数 | 株 | 数 評 価 額 |
| | 千株 | | 千株 | 千円 | | 千株 | | 千株 | 千円 | | 千株 | | 千株 | 千円 |
| アイデンジニアリング | 27.9 | | 30.7 | 31,774 | 鶴見製作所 | 8.4 | | 9.2 | 16,928 | ブラザー工業 | 131.6 | | 144.3 | 346,175 |
| 滝澤鉄工所 | 3.3 | | 3.9 | 4,102 | 住友精密工業 | 1.6 | | 1.9 | 3,957 | ミネベアミツミ | 200.1 | | 203.7 | 522,286 |
| F U J I | 45.8 | | 46.6 | 129,268 | 日本ギア工業 | 3.5 | | 6 | 1,842 | 日立製作所 | 518.1 | | 568.4 | 2,840,294 |
| 牧野フライス製作所 | 12.4 | | 13.7 | 57,677 | 酒井重工業 | 2 | | 1.9 | 4,166 | 三菱電機 | 1,078.2 | | 1,182.4 | 2,039,048 |
| オーエスジー | 49.3 | | 57.6 | 111,628 | 荏原製作所 | 44.6 | | 49 | 185,465 | 富士電機 | 65 | | 71.2 | 310,432 |
| ダイジェット工業 | 1.2 | | 1 | 1,416 | 石井鐵工所 | 1.4 | | 1.2 | 3,501 | 東洋電機製造 | 4.3 | | 4.7 | 5,893 |
| 旭ダイヤモド工業 | 27.9 | | 31 | 15,562 | 西島製作所 | 10.9 | | 12.2 | 10,748 | 安川電機 | 116.1 | | 127.3 | 731,975 |
| DMG森精機 | 67.4 | | 73.9 | 126,960 | 北越工業 | 11.1 | | 12.4 | 13,652 | シノフィニア テクノロジー | 14 | | 15.4 | 21,560 |
| ソディック | 25.1 | | 25.6 | 25,216 | ダイキン工業 | 137.4 | | 150.6 | 3,519,522 | 明電舎 | 19.8 | | 20 | 48,920 |
| デスコ | 14.5 | | 15.9 | 539,805 | オルガノ | 3.9 | | 3.8 | 24,662 | オリジン | 3 | | 2.6 | 3,536 |
| 日東工器 | 5.8 | | 5.7 | 10,584 | トーヨーカネツ | 4.7 | | 4.4 | 11,272 | 山洋電気 | 5.2 | | 5.7 | 36,651 |
| 日進工具 | 3.2 | | 4.6 | 12,999 | 栗田工業 | 58.3 | | 64 | 267,840 | デンヨー | 9.2 | | 10.1 | 21,290 |
| パンチ工業 | 9.8 | | 9.9 | 4,623 | 椿本チエイン | 15.4 | | 16.9 | 48,705 | 東芝テック | 13.5 | | 12.7 | 54,229 |
| 富士ダイス | 4.6 | | 6.4 | 4,256 | 大同工業 | 5.2 | | 4.6 | 3,666 | 芝浦メカトロニクス | 1.9 | | 2.1 | 10,122 |
| 豊和工業 | 5.9 | | 6.5 | 5,772 | 木村化工機 | 9 | | 9.8 | 6,076 | マブチモーター | 29.9 | | 32.7 | 156,142 |
| OK K | 4.4 | | 4.8 | 2,256 | アネスト岩田 | 16.7 | | 20 | 22,360 | 日本電産 | 129.7 | | 284.6 | 4,044,166 |
| 石川製作所 | 2.5 | | 3 | 5,295 | ダイフク | 55.1 | | 65.1 | 725,865 | ユ・ユ・ユ・エレクトロニクス | 6.5 | | 7 | 4,137 |
| 東洋機械金属 | 7.5 | | 8.4 | 3,981 | サムコ | 3 | | 2.9 | 10,643 | トレスラ・セミコンダクター | 6.2 | | 6.4 | 9,401 |
| 津田駒工業 | 2 | | 2.4 | 2,229 | 加藤製作所 | 5.9 | | 6.4 | 6,412 | 東光高岳 | 6 | | 6 | 9,564 |
| エンシュウ | 2.5 | | 2.4 | 2,174 | 油研工業 | 1.7 | | 1.7 | 2,808 | ダブル・スコープ | 16.7 | | 23.2 | 23,014 |
| 島精機製作所 | 17.1 | | 17.1 | 39,398 | タダノ | 52 | | 57 | 57,342 | 宮越ホールディングス | 4 | | 4.4 | 3,445 |
| オプトラン | 11.9 | | 14.6 | 38,441 | フジテック | 39.2 | | 40.8 | 103,224 | ダイヘン | 11.8 | | 12.9 | 64,113 |
| NCホールディングス | 3.3 | | 3.1 | 2,011 | C K D | 30 | | 27.4 | 65,677 | ヤーマン | 15.6 | | 19.3 | 36,477 |
| イワキ | 5.1 | | 7.6 | 6,429 | キトー | 8.2 | | 10 | 15,000 | J V C ケンウッド | 88 | | 101.9 | 20,991 |
| フリュー | 10.4 | | 11.5 | 13,259 | 平和 | 30.1 | | 32.9 | 52,113 | ミキエンジニアリング | 9.6 | | 11 | 5,995 |
| ヤマシンフィルタ | 23.2 | | 23.5 | 19,928 | 理想科学工業 | 9.5 | | 9.2 | 13,606 | イー P E X | 4 | | 5.5 | 12,325 |
| 日阪製作所 | 13.2 | | 14.8 | 12,742 | S A N K Y O | 24 | | 28 | 85,120 | 日新電機 | 25.3 | | 27.7 | 36,010 |
| やまびこ | 20.7 | | 22.6 | 30,668 | 日本金銭機械 | 11.9 | | 13.2 | 7,260 | 大崎電気工業 | 21.4 | | 23.4 | 14,578 |
| 平田機工 | 5 | | 5.5 | 45,650 | マースグループホールディングス | 6.8 | | 7.6 | 12,046 | オムロン | 96.7 | | 98.4 | 954,480 |
| ベガサスミシン製造 | 10.7 | | 12.2 | 5,014 | フクシマガリレイ | 6.6 | | 8.1 | 36,652 | 日東工業 | 15.8 | | 17.3 | 37,108 |
| マルエ | 4.4 | | 4.3 | 5,594 | オーイズミ | 4.6 | | 5.1 | 2,136 | I D E C | 15.6 | | 15.9 | 29,605 |
| タツモ | 5 | | 4.9 | 7,609 | ダイコク電機 | 5 | | 5.6 | 5,230 | 正興電機製作所 | 2.5 | | 2.7 | 6,280 |
| ナプテスコ | 62.8 | | 68.9 | 337,265 | 竹内製作所 | 18.1 | | 19.7 | 50,766 | 不二電機工業 | 1.2 | | 2.3 | 2,983 |
| 三井海洋開発 | 11.3 | | 12.4 | 25,940 | アmano | 28.3 | | 31 | 79,236 | ジエス・ユア コーポレーション | 36 | | 42.4 | 146,068 |
| レオン自動車 | 10.5 | | 11.4 | 14,113 | J U K I | 15 | | 16.5 | 11,187 | サクサホールディングス | 2.5 | | 2.8 | 3,984 |
| S M C | 33.9 | | 34.6 | 2,244,156 | 蛇谷ホールディングス | 14.2 | | 16.5 | 7,326 | メルコホールディングス | 3.8 | | 4.1 | 15,785 |
| マイエターロフイグスターリングス | 9.3 | | - | - | 乾の目ミシン工業 | 10.1 | | 10.6 | 9,423 | テクノメディア | 2.4 | | 2.8 | 4,536 |
| ホソカワミクロン | 3.8 | | 4.1 | 25,625 | マックス | 16.4 | | 16.3 | 26,748 | ダイモトドレックリソグラフィホールディングス | 1.7 | | 3.4 | 6,344 |
| ユニオンツール | 4 | | 4.4 | 15,180 | グロリー | 27.6 | | 30.4 | 70,041 | 日本電気 | 130.9 | | 150.2 | 949,264 |
| オイレ工業 | 13.8 | | 16.5 | 28,726 | 新晃工業 | 10 | | 11 | 21,417 | 富士通 | 103.9 | | 106.4 | 1,710,380 |
| 日精工・エス・ピー機械 | 3.6 | | 3.4 | 20,604 | 大和冷機工業 | 15.6 | | 19 | 21,584 | 沖電気工業 | 43.9 | | 47.9 | 53,456 |
| サトールディングス | 15.2 | | 15.4 | 36,867 | セガサミーホールディングス | 107 | | 107.5 | 184,470 | 若崎通信機 | 4.8 | | 4.4 | 3,872 |
| 技研製作所 | 9.4 | | 10.3 | 52,530 | 日本ピストンリング | 4 | | 4.5 | 4,603 | 電気興業 | 5.2 | | 5.7 | 16,569 |
| 日本エアテック | 3.4 | | 3.8 | 5,688 | リケン | 5 | | 5.5 | 12,375 | サンケン電気 | 11.7 | | 13.8 | 61,341 |
| カワタ | 3.2 | | 3.2 | 3,088 | T P R | 14.5 | | 16 | 25,248 | ナカヨ | 1.9 | | 1.9 | 2,850 |
| 日精樹脂工業 | 9 | | 9.2 | 8,675 | ツバキ・ナカシマ | 22 | | 22.5 | 29,970 | アイホン | 6.1 | | 6.8 | 12,124 |
| オカダアイオン | 3.4 | | 3.8 | 4,468 | ホシザキ | 31.5 | | 37.2 | 398,040 | ルネサスエレクトロニクス | 514.9 | | 508.7 | 611,966 |
| ワイエイシホールディングス | 4.6 | | 4.6 | 4,779 | 大豊工業 | 8.9 | | 9.8 | 7,712 | セイコーエプソン | 133.8 | | 146.6 | 273,115 |
| 小松製作所 | 488.3 | | 535.7 | 1,654,241 | 日本精工 | 203 | | 242.6 | 254,972 | ワコム | 72.4 | | 85.5 | 76,180 |
| 住友重機械工業 | 61.7 | | 67.6 | 213,278 | NTN | 249.6 | | 272.6 | 84,506 | アルバック | 19.8 | | 21.8 | 107,365 |
| 日立建機 | 43.1 | | 55.3 | 166,453 | ジェイテクト | 103.4 | | 113.3 | 128,029 | アクセル | 4.5 | | 4.9 | 3,748 |
| 日工 | 14.8 | | 17.6 | 13,217 | 不二越 | 10 | | 11 | 48,235 | E I Z O | 8.4 | | 10 | 38,250 |
| 巴工業 | 4.6 | | 4.8 | 9,936 | 日本トムソン | 31.9 | | 32.2 | 16,357 | ジャパンディスプレイ | 31.2 | | 40.4 | 20,604 |
| 井関農機 | 10.8 | | 11.8 | 17,405 | T H K | 62.7 | | 73.7 | 261,266 | 日本信号 | 27.4 | | 27.6 | 27,048 |
| T O W A | 10.9 | | 11 | 22,066 | ユーション精機 | 8.4 | | 7.9 | 7,884 | 京三製作所 | 25.2 | | 25.4 | 11,125 |
| 丸山製作所 | 2.2 | | 2.4 | 3,955 | 前澤給装工業 | 3.9 | | 4.2 | 9,256 | 能美防災 | 14.3 | | 15.7 | 36,816 |
| 北川鉄工所 | 4.8 | | 5.5 | 7,936 | イーグル工業 | 13.3 | | 14.7 | 17,772 | ホーチキ | 7.9 | | 8.6 | 11,266 |
| ローツェ | 4.7 | | 5.2 | 40,352 | 前澤工業 | 7.1 | | 7.3 | 4,358 | 星和電機 | 5.4 | | 5.9 | 4,271 |
| タカキタ | 3.7 | | 4.3 | 3,074 | 日本ビラー工業 | 10.9 | | 12.1 | 22,155 | エレコム | 11.7 | | 13.5 | 68,445 |
| クボタ | 572.1 | | 621.2 | 1,568,530 | キッツ | 43.8 | | 36.6 | 22,582 | パナソニック | 1,231.9 | | 1,260.9 | 1,827,044 |
| 荏原実業 | 2.7 | | 2.9 | 11,861 | マキタ | 140.6 | | 154.2 | 766,374 | シャープ | 124.7 | | 136.8 | 306,568 |
| 三菱化工機 | 3.8 | | 3.7 | 11,340 | 日立造船 | 85.6 | | 93.7 | 61,092 | アンリツ | 69.5 | | 71 | 178,636 |
| 月島機械 | 19.9 | | 21.8 | 30,498 | 三菱重工業 | 180.7 | | 185.7 | 590,154 | 富士通ゼネラル | 29.3 | | 36.2 | 115,840 |
| 帝国電機製作所 | 8.9 | | 8.3 | 10,557 | I H I | 77.6 | | 79.5 | 166,791 | ソニー | 681.6 | | 740.6 | 8,955,557 |
| 東京機械製作所 | 4.7 | | 4.3 | 1,345 | スター精密 | 16.6 | | 18.2 | 30,266 | T D K | 52 | | 57.1 | 903,893 |
| 新東工業 | 25.5 | | 28.2 | 22,334 | 電気機器 (18.0%) | | | | | 帝国通信工業 | 4.7 | | 5.6 | 6,294 |
| 瀬谷工業 | 9.4 | | 10.4 | 37,024 | 日清紡ホールディングス | 71.8 | | 72 | 62,712 | タムラ製作所 | 3.6 | | 4.3 | 23,688 |
| アイチコーポレーション | 18.7 | | 20.5 | 19,249 | イビデン | 66 | | 56.8 | 276,900 | アルプスアルパイン | 95.5 | | 96.5 | 143,688 |
| 小森コーポレーション | 27.3 | | 30.1 | 21,792 | コニカミノルタ | 235.6 | | 239.4 | 131,430 | 池上通信機 | 3.5 | | 4 | 3,468 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期 末 | | | |
|-----------------|---------|-------|-----------|------|---------|---------|---------------------|---------|---------|-----------|------|-----------|---------------------|-------|---------|-----------|-----|-------|-------|-----------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | |
| 日本電波工業 | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | 太陽誘電 | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | T B K | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | |
| 鈴木 | 9.8 | 11.5 | 8,372 | | 47.9 | 52.5 | 村田製作所 | 316.7 | 347.3 | 3,288,236 | | 3,288,236 | エフセディ | 12.9 | 11.8 | 5,298 | | 14.7 | 16 | 26,592 | |
| 日本トリム | 1.4 | 2.5 | 11,500 | | 17 | 20.3 | 双葉電子工業 | 17 | 20.3 | 20,320 | | 20,320 | 豊田合成 | 34.8 | 38.2 | 114,600 | | 16.9 | 18.5 | 11,322 | |
| ローランド ディー・ジー | 5.9 | 7 | 12,838 | | 4.3 | 4.6 | 北陸電気工業 | 4.3 | 4.6 | 4,443 | | 4,443 | 愛三工業 | 16.9 | 18.5 | 11,322 | | 1.6 | 1.6 | 1,465 | |
| フォスター電機 | 11.3 | 12.4 | 18,910 | | 36.6 | 37.1 | ニチコン | 36.6 | 37.1 | 52,756 | | 52,756 | 盟和産業 | 1.6 | 1.6 | 1,465 | | 8.4 | 10.3 | 5,963 | |
| S M K | 2.8 | 3.1 | 9,501 | | 8.2 | 11.9 | 日本ケミコン | 8.2 | 11.9 | 20,658 | | 20,658 | 日本プラス | 8.4 | 10.3 | 5,963 | | 10.1 | 10.2 | 14,280 | |
| ヨコオ | 6.9 | 8.7 | 28,710 | | 16.2 | 16.3 | K O A | 16.2 | 16.3 | 27,106 | | 27,106 | ヨロズ | 10.1 | 10.2 | 14,280 | | 17.6 | 19.3 | 32,539 | |
| ティアック | 8 | 7.3 | 985 | | 16.1 | 17.6 | 市光工業 | 16.1 | 17.6 | 13,710 | | 13,710 | エフ・シー・シー | 17.6 | 19.3 | 32,539 | | 40.4 | 44.3 | 1,087,786 | |
| ホンデン | 29.5 | 32.2 | 36,225 | | 64.6 | 70.8 | 小糸製作所 | 64.6 | 70.8 | 544,452 | | 544,452 | シマノ | 40.4 | 44.3 | 1,087,786 | | 25 | 27.4 | 86,858 | |
| ヒロセ電機 | 16.7 | 18.2 | 297,024 | | 19.9 | 21.7 | ミツバ | 19.9 | 21.7 | 11,001 | | 11,001 | ティ・エス テック | 25 | 27.4 | 86,858 | | 5.4 | 7 | 5,306 | |
| 日本航空電子工業 | 24.7 | 27 | 45,873 | | 18.7 | 20.5 | SCREENホールディングス | 18.7 | 20.5 | 171,995 | | 171,995 | ジャムコ | 5.4 | 7 | 5,306 | | | | | |
| T O A | 11.5 | 14 | 12,670 | | 11.3 | 10.9 | キャノン電子 | 11.3 | 10.9 | 19,227 | | 19,227 | 精密機器 (2.6%) | | | | | | | | |
| マクセルホールディングス | 23.3 | 23.4 | 34,351 | | 580.4 | 587.5 | キャノン | 580.4 | 587.5 | 1,395,312 | | 1,395,312 | テルモ | 305.1 | 362.5 | 1,653,000 | | 3.6 | 4.2 | 4,124 | |
| 古野電気 | 13.9 | 15.1 | 17,938 | | 274.3 | 300.7 | リコー | 274.3 | 300.7 | 282,658 | | 282,658 | クリエートメディック | 3.6 | 4.2 | 4,124 | | 32.3 | 38.2 | 42,058 | |
| ユニデンホールディングス | 3 | 3 | 7,113 | | 31.6 | 31.9 | 象印マホービン | 31.6 | 31.9 | 59,621 | | 59,621 | 日機装 | 32.3 | 38.2 | 42,058 | | 6.2 | 6.8 | 14,708 | |
| ユニデンホールディングス | 3 | 3 | 7,113 | | 1.4 | 1.2 | MUTOHホールディングス | 1.4 | 1.2 | 1,868 | | 1,868 | 日本エム・ディ・エム | 6.2 | 6.8 | 14,708 | | 128.8 | 152.2 | 637,718 | |
| スマグコーポレーション | 8.3 | 10 | 10,410 | | 71.9 | 69.3 | 東京エレクトロン | 71.9 | 69.3 | 2,851,695 | | 2,851,695 | 島津製作所 | 128.8 | 152.2 | 637,718 | | 9.2 | 10 | 11,540 | |
| アイコム | 6 | 4.9 | 13,940 | | | | 輸送用機器 (7.0%) | | | | | | J M S | 9.2 | 10 | 11,540 | | 2.8 | 3.1 | 1,159 | |
| リオン | 4.5 | 5 | 15,975 | | 31.4 | 34.5 | トヨタ紡織 | 31.4 | 34.5 | 64,618 | | 64,618 | クボテック | 2.8 | 3.1 | 1,159 | | 7.8 | 8.5 | 8,185 | |
| 本多通信工業 | 9.4 | 9.4 | 4,690 | | 2.2 | 2.4 | 芦森工業 | 2.2 | 2.4 | 2,460 | | 2,460 | 長野計器 | 7.8 | 8.5 | 8,185 | | 5 | 5.5 | 35,200 | |
| 船井電機 | 10.9 | 13.4 | 6,324 | | 20.9 | 19.3 | ユニプレス | 20.9 | 19.3 | 21,654 | | 21,654 | ブイ・テクノロジ | 5 | 5.5 | 35,200 | | 6.9 | 7.5 | 7,177 | |
| 横河電機 | 98.9 | 118.3 | 282,855 | | 87.3 | 95.7 | 豊田自動織機 | 87.3 | 95.7 | 912,021 | | 912,021 | 東京計器 | 6.9 | 7.5 | 7,177 | | 1.3 | 1.2 | 5,334 | |
| 新電元工業 | 3.8 | 4.5 | 13,360 | | 18.9 | 19 | 豊田自動織機 | 18.9 | 19 | 34,827 | | 34,827 | 愛知時計電機 | 1.3 | 1.2 | 5,334 | | 5.8 | 5.9 | 15,045 | |
| アズビル | 68 | 80 | 404,800 | | 13.7 | 16.3 | 三機工業 | 13.7 | 16.3 | 15,273 | | 15,273 | インターアクション | 5.8 | 5.9 | 15,045 | | 9.8 | 10.7 | 3,520 | |
| 東亜ディーケーケー | 5.3 | 6.1 | 5,264 | | 237.4 | 260.4 | デンソー | 237.4 | 260.4 | 1,749,627 | | 1,749,627 | オーバル | 9.8 | 10.7 | 3,520 | | 19.5 | 19.9 | 90,744 | |
| 日本光電工業 | 44.6 | 48.9 | 154,035 | | 28.4 | 31.2 | 東海理化電機製作所 | 28.4 | 31.2 | 60,091 | | 60,091 | 東京精密 | 19.5 | 19.9 | 90,744 | | 42.9 | 47 | 134,843 | |
| チノ | 3.7 | 3.8 | 5,506 | | 39 | 45.7 | 三井E&Sホールディングス | 39 | 45.7 | 20,245 | | 20,245 | マニ | 42.9 | 47 | 134,843 | | 174.4 | 180.4 | 162,179 | |
| 共和電業 | 11.3 | 13 | 5,187 | | 83.9 | 91.9 | 川崎重工 | 83.9 | 91.9 | 221,019 | | 221,019 | ニコン | 174.4 | 180.4 | 162,179 | | 54.3 | 59.5 | 81,158 | |
| 日本電子材料 | 4.3 | 4.3 | 8,376 | | 34.7 | 35.7 | 川崎重工 | 34.7 | 35.7 | 6,961 | | 6,961 | トプコン | 54.3 | 59.5 | 81,158 | | 596.7 | 654.2 | 1,336,857 | |
| 堀場製作所 | 21.3 | 23.4 | 165,438 | | 13.2 | 15.5 | 名村造船所 | 13.2 | 15.5 | 2,464 | | 2,464 | オリンパス | 596.7 | 654.2 | 1,336,857 | | 9.5 | 10.5 | 32,182 | |
| アドバンテスト | 80.2 | 87.9 | 777,036 | | 14.3 | 15.7 | サナハスホールディングス | 14.3 | 15.7 | 18,698 | | 18,698 | 理研計器 | 9.5 | 10.5 | 32,182 | | 8.7 | 9.5 | 20,510 | |
| 小野測器 | 4.2 | 4.3 | 2,390 | | 1.6 | 1.6 | 日本車輛製造 | 1.6 | 1.6 | 2,035 | | 2,035 | タムロン | 8.7 | 9.5 | 20,510 | | 4.6 | 5.2 | 3,354 | |
| エスベック | 9.5 | 10.5 | 21,231 | | 1,271.6 | 1,394.4 | 三菱ロジスネクスト | 14.3 | 15.7 | 18,698 | | 18,698 | HOYA | 215.3 | 234.6 | 3,065,049 | | 7.2 | 10.6 | 23,415 | |
| キーエンス | 97.7 | 116 | 6,583,000 | | 1,271.6 | 1,394.4 | 近畿車輛 | 1.6 | 1.6 | 2,035 | | 2,035 | シード | 4.6 | 5.2 | 3,354 | | 7.2 | 10.6 | 23,415 | |
| 日置電機 | 5.6 | 5.7 | 23,740 | | 312.4 | 342.6 | 日産自動車 | 1,271.6 | 1,394.4 | 877,914 | | 877,914 | ノーリツ鋼機 | 7.2 | 10.6 | 23,415 | | 9.8 | 9.9 | 13,087 | |
| シスメックス | 77 | 92.2 | 1,095,797 | | 1,203.1 | 1,197.8 | いすゞ自動車 | 312.4 | 342.6 | 393,304 | | 393,304 | イー・アンド・ディ | 9.8 | 9.9 | 13,087 | | 91.6 | 124.4 | 414,252 | |
| 日本マイクロニクス | 18.8 | 20.6 | 32,774 | | 1,346 | 147.7 | トヨタ自動車 | 1,203.1 | 1,197.8 | 9,626,718 | | 9,626,718 | 朝日インテック | 91.6 | 124.4 | 414,252 | | 126.3 | 149.2 | 54,010 | |
| メガチップス | 10 | 11.9 | 35,200 | | 399 | 437.1 | 日野自動車 | 134.6 | 147.7 | 146,518 | | 146,518 | シチズン時計 | 126.3 | 149.2 | 54,010 | | 3.4 | 3.1 | 2,263 | |
| OBARA GROUP | 5.6 | 7 | 29,050 | | 7.5 | 8.4 | 三菱自動車工業 | 399 | 437.1 | 135,938 | | 135,938 | リズム | 3.4 | 3.1 | 2,263 | | 7.5 | 9.5 | 5,443 | |
| 薄藤電機 | 1.3 | 1.3 | 2,701 | | 4.4 | 4.6 | エフテック | 7.5 | 8.4 | 5,955 | | 5,955 | 大研医器 | 7.5 | 9.5 | 5,443 | | 14.8 | 18.1 | 120,908 | |
| 原田工業 | 5.1 | 5 | 4,550 | | 2 | 2.2 | レシップホールディングス | 4.4 | 4.6 | 2,829 | | 2,829 | メニコン | 14.8 | 18.1 | 120,908 | | 1.1 | 1.2 | 824 | |
| コーセル | 13.2 | 14.4 | 17,121 | | 1.9 | 2.3 | G M B | 2 | 2.2 | 2,305 | | 2,305 | シンシア | 1.1 | 1.2 | 824 | | 4.9 | 5.5 | 10,274 | |
| イリソ電子工業 | 9.1 | 9.9 | 50,985 | | 21.1 | 17.3 | ファルテック | 1.9 | 2.3 | 1,731 | | 1,731 | 松風 | 4.9 | 5.5 | 10,274 | | 15.2 | 16.6 | 26,609 | |
| オプテックグループ | 17.6 | 19.4 | 37,830 | | 29.1 | 33.3 | 武蔵精密工業 | 24 | 26.4 | 43,612 | | 43,612 | セイコーホールディングス | 15.2 | 16.6 | 26,609 | | 74.7 | 88.1 | 117,525 | |
| 千代田インテグレイ | 5 | 5.1 | 9,327 | | 20 | 20.4 | 日産車体 | 21.1 | 17.3 | 15,760 | | 15,760 | ニプロ | 74.7 | 88.1 | 117,525 | | | | | |
| アイ・オー・データ機器 | 4 | 4.4 | 4,549 | | 21.9 | — | 新明和工業 | 29.1 | 33.3 | 32,267 | | 32,267 | その他製品 (2.5%) | | | | | | | | |
| レーザーテック | 47.3 | 51.9 | 703,764 | | 8.9 | 9.8 | 極東開発工業 | 20 | 20.4 | 32,762 | | 32,762 | 中本パックス | 2.8 | 3.1 | 5,418 | | 5.1 | 7 | 14,378 | |
| スタンレー電気 | 75.8 | 82.9 | 291,808 | | 8.9 | 9.8 | 日信工業 | 21.9 | — | — | | — | スノーピーク | 5.1 | 7 | 14,378 | | 11.4 | 11.4 | 54,663 | |
| 岩崎電気 | 4.2 | 4.3 | 6,811 | | 3.9 | 3.7 | トビー工業 | 8.9 | 9.8 | 14,131 | | 14,131 | パダマウントパッドホールディングス | 11.4 | 11.4 | 54,663 | | 6.9 | 6.4 | 7,180 | |
| ウシオ電機 | 62.6 | 60.6 | 84,840 | | 59.3 | 64.1 | ティラド | 3.9 | 3.7 | 5,901 | | 5,901 | トランザクション | 6.9 | 6.4 | 7,180 | | 3.2 | 3 | 1,218 | |
| 岡谷電機産業 | 8.5 | 8.9 | 3,408 | | 17.6 | 18.1 | 曙ブレーキ工業 | 59.3 | 64.1 | 10,961 | | 10,961 | 糖美堂 | 3.2 | 3 | 1,218 | | 5 | 10.1 | 12,796 | |
| ハリス テクノ ホールディング | 9.9 | 11.2 | 3,998 | | 57.9 | 57.2 | タチエス | 17.6 | 18.1 | 21,683 | | 21,683 | ニホンフラッシュ | 3.2 | 3 | 1,218 | | 11.8 | 13 | 37,388 | |
| エノモト | 3.3 | 3.3 | 5,824 | | 30.1 | 29.6 | N O K | 57.9 | 57.2 | 81,224 | | 81,224 | 前田工業 | 5 | 10.1 | 12,796 | | 14.3 | 16.8 | 5,292 | |
| 日本セラミック | 10.9 | 12 | 36,360 | | 12 | 13.2 | フタバ産業 | 30.1 | 29.6 | 16,605 | | 16,605 | 永大産業 | 11.8 | 13 | 37,388 | | 11.5 | 11.6 | 7,992 | |
| 遠藤照明 | 5.4 | 6.7 | 3,912 | | 20.7 | 24.6 | K Y B | 12 | 13.2 | 34,848 | | 34,848 | アートネイチャー | 11.5 | 11.6 | 7,992 | | 111.5 | 97.8 | 903,574 | |
| 古河電池 | 7.6 | 8.4 | 14,086 | | 53.5 | 58.5 | 大同メタル工業 | 20.7 | 24.6 | 13,677 | | 13,677 | パダイナムホールディングス | 111.5 | 97.8 | 903,574 | | 2.8 | 3.2 | 2,307 | |
| 双信電機 | 5.4 | 5.8 | 2,615 | | 22.5 | 24.8 | プレス工業 | 53.5 | 58.5 | 20,884 | | 20,884 | アイフィスジャパン | 2.8 | 3.2 | 2,307 | | 18.4 | 21.9 | 2,825 | |
| 山一電機 | 7.9 | 7.6 | 11,947 | | — | — | ミクニ | 13.7 | 16.1 | 4,620 | | 4,620 | 共立印刷 | 18.4 | 21.9 | 2,825 | | 5.2 | 10.4 | 44,200 | |
| 図研 | 7 | 7.7 | 23,600 | | 14.5 | 16.2 | 太平洋工業 | 22.5 | 24.8 | 30,975 | | 30,975 | S H O E I | 5.2 | 10.4 | 44,200 | | 15.3 | 15.3 | 15,138 | |
| 日本電子 | 21.2 | 21.6 | 90, | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | |
|------------------|---------|---------|-----------|-------|-----------------|-------|---------|---------|------|--------|---------|-----------|-------|---------|---------|-----------|-------|-------|---------|-----------|-------|
| | 株 | 数 | 価 値 | 株 | 数 | 評 価 額 | | 株 | 数 | 株 | 数 | 評 価 額 | 株 | | 数 | 株 | 数 | 評 価 額 | 株 | 数 | 評 価 額 |
| プロネクス | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | 鴻池運輸 | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | クロスキャット | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | |
| ホクシン | 9.3 | 10.3 | 12,030 | | 17.1 | 19 | 20,805 | | 2.8 | 3 | 3,690 | | 2.8 | 3 | 3,690 | | 2.8 | 3 | 3,690 | | |
| ウッドワン | 7.2 | 8.5 | 994 | | 29.9 | 32.8 | 97,088 | | 37.7 | 41.4 | 83,172 | | 37.7 | 41.4 | 83,172 | | 37.7 | 41.4 | 83,172 | | |
| 大建工業 | 3.5 | 3.4 | 3,733 | | 8.3 | 9.1 | 30,667 | | 5.2 | 6.8 | 70,400 | | 5.2 | 6.8 | 70,400 | | 5.2 | 6.8 | 70,400 | | |
| 凸版印刷 | 7.2 | 8 | 14,808 | | 5.7 | 5.5 | 29,095 | | 15.9 | 17.3 | 60,896 | | 15.9 | 17.3 | 60,896 | | 15.9 | 17.3 | 60,896 | | |
| 大日本印刷 | 152.2 | 179.6 | 290,952 | | 102.1 | 111.9 | 536,001 | | 5.6 | 6.2 | 7,303 | | 5.6 | 6.2 | 7,303 | | 5.6 | 6.2 | 7,303 | | |
| 共同印刷 | 141.1 | 142.8 | 286,456 | | 136.2 | 149.3 | 555,396 | | 1.9 | 1.8 | 3,319 | | 1.9 | 1.8 | 3,319 | | 1.9 | 1.8 | 3,319 | | |
| N I S S H A | 3.4 | 3.7 | 13,597 | | 48.4 | 53.1 | 144,697 | | 4.5 | 4.9 | 7,599 | | 4.5 | 4.9 | 7,599 | | 4.5 | 4.9 | 7,599 | | |
| 光村印刷 | 22.1 | 24.3 | 35,235 | | 45.5 | 49.9 | 257,983 | | 5.1 | 8.2 | 16,334 | | 5.1 | 8.2 | 16,334 | | 5.1 | 8.2 | 16,334 | | |
| TAKARA & COMPANY | 0.9 | 0.8 | 1,436 | | 2.4 | 2.8 | 10,500 | | 4.6 | 5.8 | 10,242 | | 4.6 | 5.8 | 10,242 | | 4.6 | 5.8 | 10,242 | | |
| アシックス | 5.2 | 5.8 | 10,440 | | 83.9 | 92.1 | 261,379 | | 4.6 | 4.5 | 12,123 | | 4.6 | 4.5 | 12,123 | | 4.6 | 4.5 | 12,123 | | |
| ツツミ | 89 | 104.6 | 204,702 | | 7.3 | 8.1 | 17,074 | | 35.3 | 116 | 283,272 | | 35.3 | 116 | 283,272 | | 35.3 | 116 | 283,272 | | |
| ローランド | 3.4 | 3 | 5,739 | | 36.1 | 38.8 | 299,536 | | 4.3 | 5.5 | 3,151 | | 4.3 | 5.5 | 3,151 | | 4.3 | 5.5 | 3,151 | | |
| 小松ウオール工業 | - | 6.9 | 27,117 | | 179 | 157 | 449,962 | | 4.1 | 4.3 | 13,029 | | 4.1 | 4.3 | 13,029 | | 4.1 | 4.3 | 13,029 | | |
| ヤマハ | 3.4 | 3.7 | 6,645 | | 28.4 | 28.7 | 128,289 | | 64.9 | 71.1 | 43,726 | | 64.9 | 71.1 | 43,726 | | 64.9 | 71.1 | 43,726 | | |
| 河合楽器製作所 | 64.2 | 70.3 | 447,108 | | 丸連 | 5.9 | 7.6 | 1,968 | | - | 0.8 | 4,624 | | - | 0.8 | 4,624 | | - | 0.8 | 4,624 | |
| クリナップ | 3.4 | 3.3 | 10,065 | | 丸全昭和運輸 | 8.3 | 9.1 | 32,396 | | 21.6 | 23.7 | 149,073 | | 21.6 | 23.7 | 149,073 | | 21.6 | 23.7 | 149,073 | |
| ビジョン | 10.1 | 11.4 | 5,814 | | セコウグループホールディングス | 56.3 | 61.9 | 62,828 | | 4.6 | 5 | 20,975 | | 4.6 | 5 | 20,975 | | 4.6 | 5 | 20,975 | |
| オリバー | 65.2 | 75.9 | 340,411 | | トナミホールディングス | 2.4 | 2.3 | 13,501 | | 1.9 | 2.8 | 1,512 | | 1.9 | 2.8 | 1,512 | | 1.9 | 2.8 | 1,512 | |
| 兼松サステック | 2.2 | 2.4 | 6,345 | | ニッコンホールディングス | 36.5 | 37.6 | 85,540 | | 1.2 | 1 | 2,539 | | 1.2 | 1 | 2,539 | | 1.2 | 1 | 2,539 | |
| キングジム | 0.7 | 0.6 | 1,057 | | 日本石油輸送 | 1.1 | 0.9 | 2,394 | | 5.9 | 6.1 | 5,105 | | 5.9 | 6.1 | 5,105 | | 5.9 | 6.1 | 5,105 | |
| リンテック | 9 | 10.2 | 9,169 | | 福山通運 | 13.1 | 14.4 | 65,232 | | 9 | 9.7 | 10,864 | | 9 | 9.7 | 10,864 | | 9 | 9.7 | 10,864 | |
| イトーキ | 25.6 | 25.4 | 61,366 | | セイノールホールディングス | 76.5 | 83.9 | 128,702 | | 2.1 | 2.9 | 12,397 | | 2.1 | 2.9 | 12,397 | | 2.1 | 2.9 | 12,397 | |
| 任天堂 | 22.9 | 23.3 | 8,108 | | エスライン | 3.1 | 3 | 2,709 | | 20.4 | 21.2 | 20,966 | | 20.4 | 21.2 | 20,966 | | 20.4 | 21.2 | 20,966 | |
| 三菱鉛筆 | 66.1 | 67.7 | 4,295,565 | | 神奈川中央交通 | 2.5 | 2.5 | 9,825 | | 12.7 | 15.4 | 18,587 | | 12.7 | 15.4 | 18,587 | | 12.7 | 15.4 | 18,587 | |
| タカラスタンダード | 17.7 | 19.5 | 27,865 | | 日立物流 | 18.8 | 24.7 | 84,721 | | 1.5 | 1.9 | 4,727 | | 1.5 | 1.9 | 4,727 | | 1.5 | 1.9 | 4,727 | |
| ココヨ | 22.2 | 24.5 | 40,400 | | 丸和運輸機関 | 10.8 | 23.6 | 50,409 | | 301.2 | 293.1 | 1,017,057 | | 301.2 | 293.1 | 1,017,057 | | 301.2 | 293.1 | 1,017,057 | |
| ナカバヤシ | 51.7 | 56.6 | 82,239 | | C&Fホールディングス | 10.3 | 11.4 | 23,210 | | 27.3 | 35.3 | 16,696 | | 27.3 | 35.3 | 16,696 | | 27.3 | 35.3 | 16,696 | |
| グローブライド | 10.7 | 12.1 | 7,562 | | 九州旅客鉄道 | 91.1 | 86.4 | 220,665 | | 3.1 | 3 | 7,266 | | 3.1 | 3 | 7,266 | | 3.1 | 3 | 7,266 | |
| オカムラ | 4.8 | 5.7 | 24,367 | | S Gホールディングス | 107.2 | 211.7 | 544,492 | | 7.2 | 8 | 9,792 | | 7.2 | 8 | 9,792 | | 7.2 | 8 | 9,792 | |
| 美津濃 | 37.6 | 45.4 | 49,440 | | 海運業 (0.2%) | | | | | 7.5 | 10.9 | 14,137 | | 7.5 | 10.9 | 14,137 | | 7.5 | 10.9 | 14,137 | |
| 電気・ガス業 (1.3%) | 9.8 | 11.7 | 27,144 | | 日本郵船 | 85.4 | 93.6 | 276,120 | | 8.3 | 8.9 | 6,363 | | 8.3 | 8.9 | 6,363 | | 8.3 | 8.9 | 6,363 | |
| 東京電力ホールディングス | 860.8 | 1,002.3 | 407,936 | | 商船三井 | 64.6 | 66.4 | 204,844 | | en ish | 4.7 | 5.9 | 2,979 | | 4.7 | 5.9 | 2,979 | | 4.7 | 5.9 | 2,979 |
| 中部電力 | 330 | 361.8 | 488,249 | | 川崎汽船 | 31.4 | 34.5 | 67,930 | | 34.7 | 38 | 35,986 | | 34.7 | 38 | 35,986 | | 34.7 | 38 | 35,986 | |
| 関西電力 | 408.6 | 448 | 479,360 | | NSユニテッド海運 | 5.6 | 5.4 | 8,456 | | 7.9 | 6.8 | 2,944 | | 7.9 | 6.8 | 2,944 | | 7.9 | 6.8 | 2,944 | |
| 中国電力 | 149.1 | 170.7 | 223,787 | | 明治海運 | 10.2 | 12.3 | 5,043 | | 52.5 | 57.4 | 37,424 | | 52.5 | 57.4 | 37,424 | | 52.5 | 57.4 | 37,424 | |
| 北陸電力 | 98.6 | 108.1 | 75,886 | | 飯野海運 | 48.1 | 52.4 | 22,741 | | 4.9 | 5.4 | 2,143 | | 4.9 | 5.4 | 2,143 | | 4.9 | 5.4 | 2,143 | |
| 東北電力 | 269.6 | 276.8 | 259,361 | | 共栄タンカー | 1.8 | 2.2 | 2,085 | | 5.6 | 5.3 | 6,990 | | 5.6 | 5.3 | 6,990 | | 5.6 | 5.3 | 6,990 | |
| 四国電力 | 97.2 | 98.2 | 74,533 | | 乾汽船 | 5.9 | 5.9 | 5,846 | | 5.4 | 8.5 | 10,081 | | 5.4 | 8.5 | 10,081 | | 5.4 | 8.5 | 10,081 | |
| 九州電力 | 222.3 | 261 | 246,123 | | 空運業 (0.4%) | | | | | 3.4 | 4.4 | 27,236 | | 3.4 | 4.4 | 27,236 | | 3.4 | 4.4 | 27,236 | |
| 北海道電力 | 101 | 110.3 | 51,841 | | 日本航空 | 183.8 | 272.7 | 606,212 | | 26.2 | 28.2 | 11,928 | | 26.2 | 28.2 | 11,928 | | 26.2 | 28.2 | 11,928 | |
| 沖縄電力 | 20 | 23 | 33,281 | | ANAホールディングス | 186.6 | 302.1 | 721,565 | | 6.5 | 6.3 | 19,246 | | 6.5 | 6.3 | 19,246 | | 6.5 | 6.3 | 19,246 | |
| 電源開発 | 85.9 | 94 | 164,970 | | パスコ | 1.9 | 2.2 | 3,416 | | 1.7 | 2.2 | 1,471 | | 1.7 | 2.2 | 1,471 | | 1.7 | 2.2 | 1,471 | |
| エフオン | 5.1 | 7.2 | 8,071 | | 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | | | 1.6 | 3.8 | 8,208 | | 1.6 | 3.8 | 8,208 | | 1.6 | 3.8 | 8,208 | |
| イーレックス | 15.3 | 17.3 | 30,396 | | トランコム | 2.9 | 3.4 | 29,648 | | 7.9 | 9.2 | 2,999 | | 7.9 | 9.2 | 2,999 | | 7.9 | 9.2 | 2,999 | |
| レノバ | 17.8 | 19.9 | 74,426 | | 日新 | 8.8 | 9 | 12,591 | | 11.2 | 12.2 | 12,322 | | 11.2 | 12.2 | 12,322 | | 11.2 | 12.2 | 12,322 | |
| 東京瓦斯 | 207.5 | 227.3 | 527,676 | | 三菱倉庫 | 32.4 | 38.7 | 125,001 | | 5.1 | 4.7 | 6,283 | | 5.1 | 4.7 | 6,283 | | 5.1 | 4.7 | 6,283 | |
| 大阪瓦斯 | 209.3 | 214.1 | 432,053 | | 三井倉庫ホールディングス | 11.6 | 11.9 | 27,036 | | 2.8 | 8.1 | 26,365 | | 2.8 | 8.1 | 26,365 | | 2.8 | 8.1 | 26,365 | |
| 東邦瓦斯 | 53 | 58.1 | 381,136 | | 住友倉庫 | 37.5 | 40.3 | 56,460 | | 3.5 | 3.8 | 10,260 | | 3.5 | 3.8 | 10,260 | | 3.5 | 3.8 | 10,260 | |
| 北海道瓦斯 | 5.8 | 6.6 | 10,791 | | 滋澤倉庫 | 5.6 | 6.3 | 14,565 | | 2.8 | 5.2 | 67,288 | | 2.8 | 5.2 | 67,288 | | 2.8 | 5.2 | 67,288 | |
| 広島ガス | 22.4 | 25.4 | 9,804 | | 東陽倉庫 | 18.5 | 16.8 | 5,796 | | 9.4 | 12.3 | 23,628 | | 9.4 | 12.3 | 23,628 | | 9.4 | 12.3 | 23,628 | |
| 西部瓦斯 | 12.1 | 13.3 | 39,806 | | 日本トランスシティ | 25.5 | 25.1 | 14,809 | | 1.5 | 1.7 | 4,836 | | 1.5 | 1.7 | 4,836 | | 1.5 | 1.7 | 4,836 | |
| 静岡ガス | 30.6 | 33.5 | 33,165 | | ケイヒン | 1.8 | 1.7 | 2,327 | | 11.1 | 11.2 | 14,425 | | 11.1 | 11.2 | 14,425 | | 11.1 | 11.2 | 14,425 | |
| メタウォーター | 5.2 | 13.4 | 30,860 | | 中央倉庫 | 6.2 | 6.4 | 7,628 | | 7.2 | - | - | | 7.2 | - | - | | 7.2 | - | - | |
| SBSホールディングス | 9.3 | 8.7 | 22,011 | | 川西倉庫 | 1.8 | 2.1 | 2,480 | | 7.4 | 17.9 | 34,708 | | 7.4 | 17.9 | 34,708 | | 7.4 | 17.9 | 34,708 | |
| 東武鉄道 | 113.7 | 123.2 | 394,240 | | 安田倉庫 | 8.4 | 9.6 | 9,177 | | 3.1 | 3.4 | 4,848 | | 3.1 | 3.4 | 4,848 | | 3.1 | 3.4 | 4,848 | |
| 相鉄ホールディングス | 34.5 | 40.5 | 106,393 | | ファイブホールディングス | 2.2 | 2 | 2,296 | | 25.5 | 27.9 | 73,181 | | 25.5 | 27.9 | 73,181 | | 25.5 | 27.9 | 73,181 | |
| 東急 | 271.9 | 298.1 | 432,245 | | 東洋埠頭 | 3.1 | 3 | 4,266 | | 17.4 | 24.6 | 378,594 | | 17.4 | 24.6 | 378,594 | | 17.4 | 24.6 | 378,594 | |
| 京浜急行電鉄 | 138.5 | 151.8 | 268,230 | | 宇徳 | 8.7 | 8.5 | 3,995 | | 5.6 | 4.6 | 2,093 | | 5.6 | 4.6 | 2,093 | | 5.6 | 4.6 | 2,093 | |
| 小田急電鉄 | 160.3 | 189.4 | 623,126 | | 上組 | 58.5 | 62.4 | 123,614 | | 2.9 | 3.4 | 6,245 | | 2.9 | 3.4 | 6,245 | | 2.9 | 3.4 | 6,245 | |
| 京王電鉄 | 56 | 66 | 564,960 | | サンリツ | 2.3 | 2.3 | 1,649 | | 15.6 | 30.9 | 70,050 | | 15.6 | 30.9 | 70,050 | | 15.6 | 30.9 | 70,050 | |
| 京成電鉄 | 75.1 | 88.6 | 352,628 | | キムラユニティ | 2.8 | 3.5 | 3,976 | | 11.3 | 12.2 | 8,491 | | 11.3 | 12.2 | 8,491 | </ | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | | | | | |
|----------------------|---------|------|--------|-------|------|--------|------------------|---------|---------|-----------|---------|---------|-----------|-------|---------|-----------|-------|-------|-----------|-------|-------|-----------|-------|-------|-----------|
| | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | 株 | 数 | 千株 | | |
| ODKソリューションズ | — | — | — | — | — | — | ベース | — | — | — | — | — | ゼンリン | — | — | — | — | — | — | — | — | — | | | |
| フリービット | 6.3 | 6.9 | 1,550 | 6.3 | 6.9 | 1,550 | フォーカスシステムズ | 6.5 | 7.7 | 5,420 | 6.5 | 7.7 | 5,420 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | 21.1 | | |
| コムチュア | 11.8 | 10.7 | 33,116 | 11.8 | 10.7 | 33,116 | フレスコ | 6.5 | 7.9 | 11,194 | 6.5 | 7.9 | 11,194 | 5 | 4.4 | 2,050 | 5 | 4.4 | 2,050 | 5 | 4.4 | 2,050 | 5 | 4.4 | 2,050 |
| サイバーコム | 1.8 | 2.1 | 3,654 | 1.8 | 2.1 | 3,654 | フジ・メディア・ホールディングス | 101.9 | 120.1 | 159,372 | 101.9 | 120.1 | 159,372 | 8.8 | 10 | 1,950 | 8.8 | 10 | 1,950 | 8.8 | 10 | 1,950 | 8.8 | 10 | 1,950 |
| アステリア | 6.4 | 8.3 | 8,715 | 6.4 | 8.3 | 8,715 | オービック | 36.7 | 36.6 | 718,824 | 36.7 | 36.6 | 718,824 | 5.4 | 6 | 9,168 | 5.4 | 6 | 9,168 | 5.4 | 6 | 9,168 | 5.4 | 6 | 9,168 |
| アール | 3.8 | 6.5 | 10,276 | 3.8 | 6.5 | 10,276 | ジャストシステム | 17.2 | 16.5 | 129,300 | 17.2 | 16.5 | 129,300 | 7 | 7.6 | 116,888 | 7 | 7.6 | 116,888 | 7 | 7.6 | 116,888 | 7 | 7.6 | 116,888 |
| マクラインズ | 5.3 | 4.8 | 12,086 | 5.3 | 4.8 | 12,086 | TDCソフト | 9.3 | 10.2 | 9,904 | 9.3 | 10.2 | 9,904 | 63.2 | 68.5 | 289,412 | 63.2 | 68.5 | 289,412 | 63.2 | 68.5 | 289,412 | 63.2 | 68.5 | 289,412 |
| メディカル・データ・ビジョン | 8.1 | 13.2 | 33,950 | 8.1 | 13.2 | 33,950 | Zホールディングス | 1,452.9 | 1,593.8 | 1,063,064 | 1,452.9 | 1,593.8 | 1,063,064 | 9 | 3.8 | 76,646 | 9 | 3.8 | 76,646 | 9 | 3.8 | 76,646 | 9 | 3.8 | 76,646 |
| gumi | 13.6 | 16 | 14,672 | 13.6 | 16 | 14,672 | トレンドマイクロ | 47 | 61.9 | 372,019 | 47 | 61.9 | 372,019 | 281.7 | 309 | 518,193 | 281.7 | 309 | 518,193 | 281.7 | 309 | 518,193 | 281.7 | 309 | 518,193 |
| ショーケース | 2.4 | 2.4 | 2,409 | 2.4 | 2.4 | 2,409 | IDホールディングス | 4.1 | 4.5 | 5,728 | 4.1 | 4.5 | 5,728 | 1.3 | 1.7 | 7,633 | 1.3 | 1.7 | 7,633 | 1.3 | 1.7 | 7,633 | 1.3 | 1.7 | 7,633 |
| モバイルファクトリー | 2.3 | 2.4 | 2,680 | 2.3 | 2.4 | 2,680 | 日本オラクル | 21.4 | 23.5 | 301,035 | 21.4 | 23.5 | 301,035 | 1.8 | 4 | 7,236 | 1.8 | 4 | 7,236 | 1.8 | 4 | 7,236 | 1.8 | 4 | 7,236 |
| テラスカイ | 3.8 | 3.7 | 14,152 | 3.8 | 3.7 | 14,152 | アルファシステムズ | 3.3 | 3.1 | 11,966 | 3.3 | 3.1 | 11,966 | 23.7 | 24 | 58,080 | 23.7 | 24 | 58,080 | 23.7 | 24 | 58,080 | 23.7 | 24 | 58,080 |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジ | 4.7 | 5.1 | 8,221 | 4.7 | 5.1 | 8,221 | フューチャー | 12.7 | 14 | 27,356 | 12.7 | 14 | 27,356 | 45.1 | 49.5 | 346,995 | 45.1 | 49.5 | 346,995 | 45.1 | 49.5 | 346,995 | 45.1 | 49.5 | 346,995 |
| PCIホールディングス | 2.1 | 4.4 | 6,116 | 2.1 | 4.4 | 6,116 | CAC Holdings | 6.8 | 7.5 | 10,725 | 6.8 | 7.5 | 10,725 | 11.3 | 12.2 | 17,677 | 11.3 | 12.2 | 17,677 | 11.3 | 12.2 | 17,677 | 11.3 | 12.2 | 17,677 |
| パイプHD | 1.3 | 2.4 | 3,796 | 1.3 | 2.4 | 3,796 | S Bテクノロジ | 3.8 | 4.2 | 12,999 | 3.8 | 4.2 | 12,999 | 49.9 | 49.7 | 339,948 | 49.9 | 49.7 | 339,948 | 49.9 | 49.7 | 339,948 | 49.9 | 49.7 | 339,948 |
| アイビジー | 1.9 | 1.9 | 2,101 | 1.9 | 1.9 | 2,101 | トーセ | 2.9 | 3.3 | 2,653 | 2.9 | 3.3 | 2,653 | 2 | 5.3 | 7,234 | 2 | 5.3 | 7,234 | 2 | 5.3 | 7,234 | 2 | 5.3 | 7,234 |
| ネオジャパン | 1.9 | 2.2 | 4,052 | 1.9 | 2.2 | 4,052 | オービックビジネスコンサルタント | 10.8 | 11.9 | 80,920 | 10.8 | 11.9 | 80,920 | 6.7 | 7.3 | 9,117 | 6.7 | 7.3 | 9,117 | 6.7 | 7.3 | 9,117 | 6.7 | 7.3 | 9,117 |
| P R T I M E S | 0.9 | 2.4 | 8,964 | 0.9 | 2.4 | 8,964 | 伊藤忠テクノソリューションズ | 48.2 | 52.9 | 195,730 | 48.2 | 52.9 | 195,730 | 24.4 | 26.8 | 179,024 | 24.4 | 26.8 | 179,024 | 24.4 | 26.8 | 179,024 | 24.4 | 26.8 | 179,024 |
| ランドコンピュータ | 1.6 | 1.5 | 1,707 | 1.6 | 1.5 | 1,707 | アイティフォー | 12.9 | 15.1 | 13,741 | 12.9 | 15.1 | 13,741 | 3.5 | 3.8 | 7,923 | 3.5 | 3.8 | 7,923 | 3.5 | 3.8 | 7,923 | 3.5 | 3.8 | 7,923 |
| ダブルスタンダード | 1.3 | 1.5 | 6,615 | 1.3 | 1.5 | 6,615 | 東計電算 | 1.5 | 1.8 | 7,542 | 1.5 | 1.8 | 7,542 | 10.4 | 11.3 | 15,740 | 10.4 | 11.3 | 15,740 | 10.4 | 11.3 | 15,740 | 10.4 | 11.3 | 15,740 |
| オープンドア | 5.2 | 6.9 | 14,276 | 5.2 | 6.9 | 14,276 | エックスネット | 1.6 | 2.2 | 2,206 | 1.6 | 2.2 | 2,206 | 9 | 9.8 | 71,050 | 9 | 9.8 | 71,050 | 9 | 9.8 | 71,050 | 9 | 9.8 | 71,050 |
| マイネット | 3.5 | 3.8 | 3,587 | 3.5 | 3.8 | 3,587 | 大塚商会 | 57.2 | 62.8 | 331,584 | 57.2 | 62.8 | 331,584 | 13.6 | 12.3 | 70,479 | 13.6 | 12.3 | 70,479 | 13.6 | 12.3 | 70,479 | 13.6 | 12.3 | 70,479 |
| アカツキ | 3.8 | 4.6 | 19,964 | 3.8 | 4.6 | 19,964 | サイボウズ | 12.3 | 13.5 | 37,732 | 12.3 | 13.5 | 37,732 | 34.8 | 37.3 | 75,980 | 34.8 | 37.3 | 75,980 | 34.8 | 37.3 | 75,980 | 34.8 | 37.3 | 75,980 |
| ベネフィットジャパン | 0.8 | 0.9 | 1,746 | 0.8 | 0.9 | 1,746 | ソフトブレーン | 6.2 | — | — | 6.2 | — | — | 38.5 | 42.1 | 309,435 | 38.5 | 42.1 | 309,435 | 38.5 | 42.1 | 309,435 | 38.5 | 42.1 | 309,435 |
| Ubicomホールディングス | 2.3 | 3 | 9,720 | 2.3 | 3 | 9,720 | 電通国際情報サービス | 6.5 | 14.4 | 58,032 | 6.5 | 14.4 | 58,032 | 4.2 | 5.3 | 20,908 | 4.2 | 5.3 | 20,908 | 4.2 | 5.3 | 20,908 | 4.2 | 5.3 | 20,908 |
| LINE | 24.2 | — | — | 24.2 | — | — | ACCES | — | 10.8 | 8,424 | — | 10.8 | 8,424 | 7.1 | 7.8 | 11,832 | 7.1 | 7.8 | 11,832 | 7.1 | 7.8 | 11,832 | 7.1 | 7.8 | 11,832 |
| カナミックネットワーク | 6.4 | 10.6 | 7,706 | 6.4 | 10.6 | 7,706 | デジタルガレージ | 19.1 | 19.1 | 77,164 | 19.1 | 19.1 | 77,164 | 9.3 | 11.5 | 25,656 | 9.3 | 11.5 | 25,656 | 9.3 | 11.5 | 25,656 | 9.3 | 11.5 | 25,656 |
| ノムラシステムコーポレーション | 2.3 | 5.1 | 1,907 | 2.3 | 5.1 | 1,907 | イーエムシステムズ | 14.9 | 19.2 | 18,316 | 14.9 | 19.2 | 18,316 | 839.5 | 920.5 | 8,730,942 | 839.5 | 920.5 | 8,730,942 | 839.5 | 920.5 | 8,730,942 | 839.5 | 920.5 | 8,730,942 |
| チェンジ | 2.1 | 16.2 | 58,887 | 2.1 | 16.2 | 58,887 | ウェザーニューズ | 3.6 | 3.4 | 17,612 | 3.6 | 3.4 | 17,612 | — | 0.6 | 604 | — | 0.6 | 604 | — | 0.6 | 604 | — | 0.6 | 604 |
| シンクロ・フード | 4.6 | 6.9 | 2,566 | 4.6 | 6.9 | 2,566 | C I J | 7.9 | 7.9 | 7,149 | 7.9 | 7.9 | 7,149 | 4.1 | 4.7 | 5,729 | 4.1 | 4.7 | 5,729 | 4.1 | 4.7 | 5,729 | 4.1 | 4.7 | 5,729 |
| オークネット | 6.5 | 6.1 | 8,021 | 6.5 | 6.1 | 8,021 | ビジネスエンジニアリング | 1.2 | 1.2 | 4,080 | 1.2 | 1.2 | 4,080 | — | 1.6 | 2,544 | — | 1.6 | 2,544 | — | 1.6 | 2,544 | — | 1.6 | 2,544 |
| キャピタル・アセット・プランニング | — | — | — | — | — | — | 日本エンタープライズ | 10.8 | 11.6 | 2,865 | 10.8 | 11.6 | 2,865 | 2.4 | 2.4 | 12,768 | 2.4 | 2.4 | 12,768 | 2.4 | 2.4 | 12,768 | 2.4 | 2.4 | 12,768 |
| セググループ | 1.7 | 2.9 | 3,775 | 1.7 | 2.9 | 3,775 | WOWOW | 5.1 | 5.7 | 16,404 | 5.1 | 5.7 | 16,404 | 9.9 | 9.4 | 10,020 | 9.9 | 9.4 | 10,020 | 9.9 | 9.4 | 10,020 | 9.9 | 9.4 | 10,020 |
| エイトレッド | 1.3 | 2.2 | 5,717 | 1.3 | 2.2 | 5,717 | スカラ | 7.5 | 10.3 | 8,549 | 7.5 | 10.3 | 8,549 | 3.1 | 3.3 | 5,240 | 3.1 | 3.3 | 5,240 | 3.1 | 3.3 | 5,240 | 3.1 | 3.3 | 5,240 |
| AOI TYO HOLDINGS | 10.7 | 12 | 5,580 | 10.7 | 12 | 5,580 | インテリジェント ウェブ | 4 | 6.9 | 4,974 | 4 | 6.9 | 4,974 | 8.5 | 9.3 | 45,570 | 8.5 | 9.3 | 45,570 | 8.5 | 9.3 | 45,570 | 8.5 | 9.3 | 45,570 |
| マクромリ | 18.9 | 23.6 | 20,437 | 18.9 | 23.6 | 20,437 | IMAGICA GROUP | 9 | 10 | 4,030 | 9 | 10 | 4,030 | 1.6 | 1.6 | 6,400 | 1.6 | 1.6 | 6,400 | 1.6 | 1.6 | 6,400 | 1.6 | 1.6 | 6,400 |
| ビョーグリー | 2 | 2.3 | 4,054 | 2 | 2.3 | 4,054 | ネットワンシステムズ | 40.3 | 47.3 | 172,172 | 40.3 | 47.3 | 172,172 | 3.9 | 3.8 | 13,813 | 3.9 | 3.8 | 13,813 | 3.9 | 3.8 | 13,813 | 3.9 | 3.8 | 13,813 |
| オロ | 2.8 | 3.6 | 13,860 | 2.8 | 3.6 | 13,860 | システムソフト | 26.3 | 25.5 | 3,162 | 26.3 | 25.5 | 3,162 | 8.2 | 10.2 | 5,783 | 8.2 | 10.2 | 5,783 | 8.2 | 10.2 | 5,783 | 8.2 | 10.2 | 5,783 |
| ユーザローカル | — | 1.8 | 7,560 | — | 1.8 | 7,560 | アルゴグラフィックス | 9 | 9 | 28,305 | 9 | 9 | 28,305 | 586.6 | 641.6 | 168,740 | 586.6 | 641.6 | 168,740 | 586.6 | 641.6 | 168,740 | 586.6 | 641.6 | 168,740 |
| テモナ | 1.3 | 2.5 | 2,527 | 1.3 | 2.5 | 2,527 | メーベラス | 16.1 | 18.2 | 16,398 | 16.1 | 18.2 | 16,398 | 118 | 120.7 | 267,471 | 118 | 120.7 | 267,471 | 118 | 120.7 | 267,471 | 118 | 120.7 | 267,471 |
| ニーズウェル | 1.2 | 2.2 | 1,515 | 1.2 | 2.2 | 1,515 | エイベックス | 18.2 | 19.9 | 28,536 | 18.2 | 19.9 | 28,536 | 29.9 | 30.8 | 27,812 | 29.9 | 30.8 | 27,812 | 29.9 | 30.8 | 27,812 | 29.9 | 30.8 | 27,812 |
| サンポスト | 1.6 | 2.6 | 2,631 | 1.6 | 2.6 | 2,631 | 日本ユニシス | 33 | 40.3 | 143,266 | 33 | 40.3 | 143,266 | 1.5 | 1.6 | 2,657 | 1.5 | 1.6 | 2,657 | 1.5 | 1.6 | 2,657 | 1.5 | 1.6 | 2,657 |
| ソルクシーズ | 4.5 | 4.4 | 4,386 | 4.5 | 4.4 | 4,386 | 兼松エレクトロニクス | 5.7 | 6.4 | 24,576 | 5.7 | 6.4 | 24,576 | 5.6 | 6.5 | 6,051 | 5.6 | 6.5 | 6,051 | 5.6 | 6.5 | 6,051 | 5.6 | 6.5 | 6,051 |
| フェイス | 3.8 | 3.6 | 3,002 | 3.8 | 3.6 | 3,002 | 都築電気 | — | 4.3 | 6,712 | — | 4.3 | 6,712 | 11.2 | 12.3 | 20,750 | 11.2 | 12.3 | 20,750 | 11.2 | 12.3 | 20,750 | 11.2 | 12.3 | 20,750 |
| プロトコーポレーション | 9.5 | 10.4 | 12,823 | 9.5 | 10.4 | 12,823 | TBSホールディングス | 64.4 | 76.9 | 170,641 | 64.4 | 76.9 | 170,641 | 36.6 | 80.4 | 244,014 | 36.6 | 80.4 | 244,014 | 36.6 | 80.4 | 244,014 | 36.6 | 80.4 | 244,014 |
| ハイマックス | 1.2 | 2.9 | 4,355 | 1.2 | 2.9 | 4,355 | 日本テレビホールディングス | 88.3 | 96.6 | 137,751 | 88.3 | 96.6 | 137,751 | — | 2 | 1 | | | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|-------|-------------------|---------|------|---------|-------|--------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| スターティアホールディングス | | 千株 | 千株 | 千円 | 佐藤商事 | | 千株 | 千株 | 千円 | スズケン | | 千株 | 千株 | 千円 |
| コマダホールディングス | 2.4 | 2.3 | 2,454 | | 菱洋エレクトロ | 8.8 | 10 | 9,850 | | ジェコス | 45 | 49.3 | 212,236 | |
| ピーバンドットコム | 23.2 | 25.4 | 50,342 | | 東京産業 | 10.8 | 8.8 | 25,678 | | グローセル | 7.3 | 8.2 | 7,986 | |
| アセンテック | — | 1.5 | 1,426 | | ユアサ商事 | 9.6 | 11 | 7,370 | | 小売業 (4.7%) | 9.4 | 12.9 | 6,566 | |
| 富士興産 | 0.8 | 2.9 | 5,417 | | 神鋼商事 | 10.1 | 12 | 39,480 | | ローン | 26.8 | 29.5 | 158,710 | |
| 協栄産業 | 3.3 | 3.5 | 4,665 | | トルク | 2.7 | 2.7 | 5,402 | | サンエー | 8.9 | 8.8 | 37,708 | |
| 小野建 | 1.2 | 1.5 | 2,095 | | 阪和興業 | 6.3 | 5.8 | 1,548 | | カワチ薬品 | 8.3 | 8.1 | 24,624 | |
| 南陽 | 9.6 | 10.7 | 13,407 | | 正栄食品工業 | 19.9 | 23.2 | 68,092 | | エービーシー・マート | 16.6 | 18.1 | 117,107 | |
| 佐島電機 | 2.1 | 2.1 | 3,540 | | カナデン | 6.8 | 7.5 | 29,437 | | ハードオフコーポレーション | 4.2 | 5.4 | 4,266 | |
| エコトレーディング | 7.9 | 7.4 | 5,638 | | 菱電商事 | 8.6 | 9.6 | 12,220 | | アスフル | 11.1 | 10.1 | 39,137 | |
| 伯東 | 2.3 | 2.6 | 1,799 | | フルサト工業 | 7.6 | 8.4 | 13,784 | | ゲオホールディングス | 19.1 | 15.6 | 19,874 | |
| コンドーテック | 6.5 | 7.1 | 9,201 | | 岩谷産業 | 5.9 | 6.3 | 8,366 | | アダグストリア | 14.7 | 16.1 | 34,212 | |
| 中山福 | 8.3 | 9.2 | 9,926 | | ナイス | 23.6 | 27.9 | 180,234 | | ジープット | 14.7 | 16.1 | 34,212 | |
| ナガイレーベン | 6.2 | 7.1 | 3,819 | | 昭光通商 | 4.6 | 4.7 | 7,764 | | シー・グレイ・エス・バイエリア | 6.4 | 7.6 | 3,268 | |
| 三菱食品 | 15.4 | 15.5 | 48,205 | | ニチモウ | 3.5 | 3.4 | 2,291 | | くら寿司 | 1.5 | 2 | 840 | |
| 松田産業 | 11.6 | 12.9 | 37,474 | | 極東貿易 | 1.7 | 1.6 | 3,086 | | キャンドウ | 5.5 | 6.9 | 46,713 | |
| 第一興商 | 7.8 | 8.5 | 16,192 | | イワキ | 3.1 | 3 | 4,215 | | アイケイ | 5.1 | 5.6 | 10,651 | |
| メビアルホールディングス | 15.8 | 17.3 | 69,373 | | 三菱石油 | 14 | 15.2 | 9,910 | | アイケイ | — | 2.5 | 2,247 | |
| S P K | 114.6 | 116.7 | 261,174 | | 稲畑産業 | 26.1 | 28.7 | 32,344 | | バルブルーホールディングス | 5.4 | 10.2 | 16,932 | |
| 萩原電気ホールディングス | 2.2 | 5.2 | 6,812 | | G S I クレオス | 23.4 | 27.9 | 45,393 | | エディオン | 48.8 | 49.3 | 53,441 | |
| アズワン | 4 | 4.4 | 12,315 | | 明和産業 | 2.5 | 2.8 | 6,104 | | ワッツ | 21.6 | 23.9 | 14,005 | |
| スズデン | 6.9 | 8.3 | 127,820 | | クワザホールディングス | 9.8 | 10.8 | 5,076 | | ハローズ | 4.8 | 4.4 | 13,860 | |
| 尾家産業 | 3.7 | 3.5 | 4,389 | | ヤマエク野 | 3.8 | 4.4 | 2,961 | | フジフードグループ本社 | 9 | 9.8 | 12,828 | |
| シモンヤ | 3.1 | 3 | 3,978 | | ワキタ | — | 8.5 | 9,613 | | あみやき亭 | 2.2 | 2.5 | 7,377 | |
| ドウシヤ | 6.5 | 6.5 | 9,145 | | 東邦ホールディングス | 22.6 | 22.9 | 23,541 | | ひらまつ | 19.6 | 21.9 | 3,810 | |
| 小津産業 | 10.1 | 11 | 20,680 | | サンゲツ | 34.1 | 37.3 | 77,994 | | 大黒天物産 | 2.5 | 2.7 | 16,200 | |
| 高速 | 2.3 | 2.3 | 4,397 | | ミツロコグループホールディングス | 29.2 | 31.5 | 52,542 | | ハニースホールディングス | 9.4 | 9.1 | 9,236 | |
| たけびし | 6.3 | 6.3 | 10,111 | | シナネンホールディングス | 15.7 | 17.1 | 21,665 | | ファーマライズホールディングス | 2.5 | 3.3 | 2,577 | |
| リックス | 3.5 | 3.5 | 5,565 | | 伊藤忠エネクス | 4.4 | 4.3 | 14,061 | | アルペン | 8.2 | 8.9 | 20,108 | |
| 丸文 | 2.3 | 2.2 | 3,773 | | サンリョ | 23.5 | 26 | 26,910 | | ハブ | 3.1 | 3.6 | 2,535 | |
| ハピネット | 9.4 | 10.6 | 5,989 | | サンワ テクノス | 29.8 | 32.6 | 55,452 | | クオールホールディングス | 15.6 | 15.7 | 22,011 | |
| 橋本総業ホールディングス | 8.9 | 9.7 | 16,266 | | リョーサン | 7.5 | 7.6 | 8,436 | | ジンスホールディングス | 5.6 | 6.2 | 45,198 | |
| 日本ライフライン | 2.1 | 2 | 5,008 | | 新光商事 | 11.7 | 12.8 | 30,438 | | ビックカメラ | 62.9 | 69 | 84,594 | |
| タカショー | 31.4 | 37.6 | 55,384 | | トーホー | 16.7 | 15.9 | 12,497 | | DCMホールディングス | 57.3 | 71.9 | 78,083 | |
| エクセル | 5.4 | 7.4 | 5,653 | | 三信電気 | 4.8 | 5.4 | 10,303 | | ペッパーフードサービス | 8.5 | 13.2 | 3,722 | |
| マルカ | 3.1 | — | — | | 東陽テクニカ | 5.7 | 6.4 | 13,344 | | MonotaRO | 75.5 | 82.8 | 475,272 | |
| l DOM | 3.8 | 3.8 | 7,527 | | モスフードサービス | 12.2 | 12.2 | 14,554 | | DDホールディングス | 2.7 | 2.6 | 1,534 | |
| 進和 | 28.7 | 39.3 | 26,095 | | 加賀電子 | 14 | 16.5 | 51,315 | | きちりホールディングス | 4.2 | 5.2 | 3,556 | |
| エスケイジャパン | 6.3 | 7 | 15,638 | | ソーダニッカ | 10.6 | 10.5 | 26,901 | | アークランドサービスホールディングス | 2.9 | 3.4 | 2,080 | |
| ダイトロン | 2.2 | 2.7 | 1,236 | | 立花エレテック | 10.8 | 11.3 | 6,102 | | J. フロント リテイリング | 7.8 | 9.7 | 21,262 | |
| シークス | 4.5 | 5 | 8,300 | | フォーバル | 7.9 | 8.7 | 14,215 | | トール・ドレスホールディングス | 126.8 | 139 | 139,139 | |
| 田中商事 | 13.5 | 14.8 | 24,375 | | P A L T A C | 4.7 | 4.3 | 3,650 | | マツモトキヨシホールディングス | 16.9 | 18.4 | 30,875 | |
| オーハシテクニカ | 3.4 | 3.1 | 2,176 | | 三谷産業 | 17 | 18.7 | 108,273 | | ブロンコビリー | 43.9 | 48.1 | 222,222 | |
| 白銅 | 5.9 | 6.2 | 8,500 | | 太平洋興発 | 14.2 | 15.6 | 7,098 | | ZOZO | 5.5 | 6.1 | 14,139 | |
| ダイコー通産 | 3.9 | 3.6 | 5,320 | | smallsatcホールディングス | 4.1 | 5.1 | 3,274 | | トレジャー・ファクトリー | 73 | 68.7 | 246,976 | |
| 伊藤忠商事 | — | 1.1 | 1,741 | | ヤマシタヘルスケアホールディングス | 1.9 | 2.6 | 7,254 | | 物語コーポレーション | 3.2 | 3.4 | 2,760 | |
| 丸紅 | 742.8 | 814.6 | 2,526,074 | | コア商事ホールディングス | 0.8 | 1.1 | 1,706 | | ココカラファイン | 2.7 | 3.1 | 37,541 | |
| 高島 | 1.6 | 1.6 | 2,710 | | 国際紙パルプ商事 | — | 3.3 | 4,524 | | 三協伊勢丹ホールディングス | 11.1 | 10.4 | 79,560 | |
| 長瀬産業 | 59.8 | 65.5 | 114,297 | | ヤマタネ | 25.2 | 25.5 | 6,273 | | Hamee | 185.6 | 203.4 | 150,516 | |
| 蝶理 | 6.8 | 7.5 | 12,412 | | 丸紅建材リース | 5.3 | 5.3 | 7,568 | | ウエルシアホールディングス | 3.3 | 2.9 | 5,121 | |
| 豊田通商 | 118.5 | 116.9 | 550,599 | | 日鉄物産 | 1 | 0.9 | 1,655 | | クワイエSTDホールディングス | 31.6 | 61.5 | 222,630 | |
| 三共生興 | 16 | 18 | 9,396 | | 泉州電業 | 7.5 | 8.3 | 32,079 | | 丸善CH1ホールディングス | 17.8 | 17.1 | 60,277 | |
| 兼松 | 39.6 | 46.5 | 67,378 | | オートバックセブン | 3.3 | 3.3 | 11,022 | | ミザウ | 12.4 | 15.4 | 5,790 | |
| ツカモトコーポレーション | 1.8 | 1.7 | 2,585 | | モリト | 22.1 | 26.7 | 76,655 | | ディーライフ | 2.1 | 2.4 | 1,608 | |
| 三井物産 | 933.4 | 945.5 | 1,900,455 | | 加藤産業 | 39.4 | 43.2 | 61,646 | | イー・ピーホールディングス | 1.4 | 1.7 | 2,055 | |
| 日本紙パルプ商事 | 6 | 6.1 | 22,539 | | 北恵 | 7.8 | 9 | 5,562 | | チュムニー | 2 | 1.9 | 805 | |
| 日立ハイテック | 36.9 | — | — | | イノテック | 16.6 | 16.9 | 60,671 | | シュッピン | 3.3 | 3.5 | 4,938 | |
| カメイ | 13.9 | 15.2 | 18,939 | | イエローハット | 2 | 3.2 | 3,004 | | オインクス・ラ・大地 | 7.2 | 7.9 | 7,497 | |
| 東都水産 | 1.3 | 1.4 | 4,963 | | J Kホールディングス | 6.3 | 6.6 | 8,058 | | ネクステージ | — | 11.5 | 35,707 | |
| OUGホールディングス | 1.6 | 1.8 | 5,122 | | 日伝 | 20.1 | 21.9 | 39,288 | | ジョイフル本田 | 15.2 | 19.9 | 33,969 | |
| スターゼン | 3.9 | 4.3 | 19,371 | | 北沢産業 | 9.6 | 10.7 | 9,137 | | 鳥貴族ホールディングス | 31.1 | 34.2 | 49,384 | |
| 山善 | 41.4 | 45.5 | 47,502 | | 杉本商事 | 9.6 | 9.7 | 21,786 | | キリン堂ホールディングス | 3.5 | 3.3 | 3,569 | |
| 橋本興業 | 1.9 | 1.7 | 6,230 | | 東テック | 7.8 | 7.3 | 1,934 | | ホットランド | 4.2 | — | — | |
| 住友商事 | 670 | 734.9 | 1,094,633 | | ミスミグループ本社 | 5.7 | 5.9 | 14,059 | | すかいらくホールディングス | 7.1 | 8.6 | 10,732 | |
| 内田洋行 | 4.5 | 4.6 | 20,447 | | アルテック | 30.2 | 31.1 | 78,745 | | SFPホールディングス | 119 | 130.4 | 223,896 | |
| 三菱商事 | 745.2 | 709 | 2,012,142 | | タキヒヨー | 3.5 | 3.9 | 11,111 | | 綿半ホールディングス | 4.5 | 5.7 | 8,567 | |
| 第一実業 | 5.2 | 5.3 | 22,472 | | 蔵王産業 | 8.6 | 8.8 | 2,525 | | ヨシックス | 4 | 8.8 | 11,897 | |
| キャノンマーケティングジャパン | 30.4 | 28.9 | 71,469 | | | 3.1 | 4 | 8,056 | | | 1.7 | 2.3 | 5,048 | |
| 西華産業 | 6 | 6.2 | 8,872 | | | 2.1 | 1.9 | 2,650 | | | 30.9 | 33.9 | 39,188 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当期末 | | |
|----------------------|---------|-------|-----------|-----|-------|-----------|--------------------|---------|-------|-----------|-----|-------|-----------|--------------------|---------|---------|-----------|-----|---------|-----------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 | | 株数 | 株数 | 評価額 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 | | | 千株 | 千円 | | 千株 | 千円 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 4.9 | 6 | 5,916 | | 6 | 5,916 | SRSホールディングス | 12.5 | 14.6 | 12,585 | | 14.6 | 12,585 | ヤマザワ | 2 | 2.6 | 4,555 | | 2.6 | 4,555 |
| B E E N O S | 4 | 5.4 | 12,792 | | 5.4 | 12,792 | 千趣会 | 19.2 | 20.9 | 7,064 | | 20.9 | 7,064 | やまや | 2.1 | 2.5 | 5,577 | | 2.5 | 5,577 |
| あさひ | 8 | 8.6 | 13,975 | | 8.6 | 13,975 | タカキュー | 8.6 | 9.9 | 1,485 | | 9.9 | 1,485 | ベルーナ | 22.7 | 25 | 26,350 | | 25 | 26,350 |
| 日本調剤 | 3.3 | 7.1 | 11,786 | | 7.1 | 11,786 | リテールパートナーズ | - | 14.1 | 19,711 | | 14.1 | 19,711 | 銀行業 (4.7%) | | | | | | |
| コスモス薬品 | 4.7 | 11.8 | 197,296 | | 11.8 | 197,296 | ケーヨー | 21.8 | 21.6 | 16,372 | | 21.6 | 16,372 | 島根銀行 | 2.1 | 4.3 | 2,906 | | 4.3 | 2,906 |
| トーエル | 5.2 | 5.7 | 4,776 | | 5.7 | 4,776 | 上新電機 | 12.5 | 13.7 | 42,744 | | 13.7 | 42,744 | じもとホールディングス | 72.2 | 8 | 6,648 | | 8 | 6,648 |
| オンリー | 1.8 | 2.6 | 1,209 | | 2.6 | 1,209 | 日本瓦斯 | 16.8 | 19.2 | 100,800 | | 19.2 | 100,800 | めがきフィナンシャルグループ | 552.6 | 604.6 | 130,593 | | 604.6 | 130,593 |
| セブ&アイ・ホールディングス | 415.4 | 455.6 | 1,935,388 | | 455.6 | 1,935,388 | ロイヤルホールディングス | 18.6 | 20.3 | 38,955 | | 20.3 | 38,955 | 東京さほしフィナンシャルグループ | 14.4 | 14.6 | 17,052 | | 14.6 | 17,052 |
| クワイート・レストラン・ホールディングス | 28.6 | 62.5 | 55,437 | | 62.5 | 55,437 | 東天紅 | 0.8 | 0.6 | 554 | | 0.6 | 554 | 九州フィナンシャルグループ | 174.5 | 238 | 105,196 | | 238 | 105,196 |
| ツルハホールディングス | 23.1 | 25.4 | 372,110 | | 25.4 | 372,110 | いなげや | 13.2 | 13 | 22,750 | | 13 | 22,750 | ゆうちょ銀行 | 301.3 | 330.8 | 318,560 | | 330.8 | 318,560 |
| サンマルクホールディングス | 8.4 | 9.1 | 14,696 | | 9.1 | 14,696 | 島忠 | 20 | - | - | | - | - | 富士第一銀行 | 25.4 | 28.6 | 8,608 | | 28.6 | 8,608 |
| フェリシモ | 2.3 | 2.6 | 3,458 | | 2.6 | 3,458 | チヨダ | 11.1 | 12.2 | 12,285 | | 12.2 | 12,285 | コンコディア・フィナンシャルグループ | 625.3 | 709.7 | 291,686 | | 709.7 | 291,686 |
| トリドールホールディングス | 13.2 | 28.8 | 47,001 | | 28.8 | 47,001 | ライフコーポレーション | 8.1 | 8.8 | 29,656 | | 8.8 | 29,656 | 西日本フィナンシャルホールディングス | 72.5 | 77.6 | 53,388 | | 77.6 | 53,388 |
| TOKYO BASE | 9.6 | 10.4 | 6,905 | | 10.4 | 6,905 | リンガーハット | 13.1 | 14.4 | 35,913 | | 14.4 | 35,913 | 関西みらいフィナンシャルグループ | 62.4 | 54.8 | 31,181 | | 54.8 | 31,181 |
| ウィルバスホールディングス | 1.6 | 1.9 | 1,575 | | 1.9 | 1,575 | M r M a x H D | 14.6 | 15.9 | 12,465 | | 15.9 | 12,465 | 三十三フィナンシャルグループ | 9.9 | 10.2 | 13,637 | | 10.2 | 13,637 |
| JMホールディングス | 5.4 | 8.8 | 18,647 | | 8.8 | 18,647 | テンアライド | 9.8 | 11.7 | 4,223 | | 11.7 | 4,223 | 新設越フィナンシャルグループ | 18.5 | 19 | 44,270 | | 19 | 44,270 |
| サツドラホールディングス | 1.5 | 1.5 | 3,097 | | 1.5 | 3,097 | AOKIホールディングス | 21.2 | 23.1 | 14,691 | | 23.1 | 14,691 | ひろさんホールディングス | - | 172.2 | 110,380 | | 172.2 | 110,380 |
| アレナホールディングス | 5.3 | 6.7 | 9,339 | | 6.7 | 9,339 | オークワ | 16.6 | 18.2 | 23,314 | | 18.2 | 23,314 | 新生銀行 | 78 | 95.1 | 131,428 | | 95.1 | 131,428 |
| 軌道トヨホホールディングス | 1.6 | 3 | 5,172 | | 3 | 5,172 | コメリ | 16.4 | 18 | 51,948 | | 18 | 51,948 | あおぞら銀行 | 63.3 | 69.4 | 148,169 | | 69.4 | 148,169 |
| パロックスジャパンリミテッド | 7.3 | 8.1 | 6,625 | | 8.1 | 6,625 | 青山商事 | 21.9 | 25.7 | 18,735 | | 25.7 | 18,735 | 三井住友フィナンシャルグループ | 7,320.8 | 7,977.2 | 4,144,953 | | 7,977.2 | 4,144,953 |
| グスノアホールディングス | 9.5 | 11.6 | 102,544 | | 11.6 | 102,544 | しまむら | 12.3 | 13.5 | 157,545 | | 13.5 | 157,545 | りそなホールディングス | 1,167 | 1,267.6 | 513,758 | | 1,267.6 | 513,758 |
| かの源ホールディングス | 4.8 | 5.4 | 3,520 | | 5.4 | 3,520 | はせがわ | 5.3 | 5.2 | 1,549 | | 5.2 | 1,549 | 三井住友トラスト・ホールディングス | 201 | 220.5 | 771,529 | | 220.5 | 771,529 |
| スシローホールディングス | 11.6 | 63.9 | 269,658 | | 63.9 | 269,658 | 高島屋 | 77.4 | 84.7 | 93,000 | | 84.7 | 93,000 | 三井住友フィナンシャルグループ | 735.5 | 807.1 | 2,881,347 | | 807.1 | 2,881,347 |
| L I X I L ビバ | 10.5 | - | - | | - | - | 松屋 | 21.4 | 25.4 | 24,384 | | 25.4 | 24,384 | 千葉銀行 | 365.7 | 388.8 | 250,776 | | 388.8 | 250,776 |
| メディカルシステムネットワーク | 10.3 | 10.2 | 7,701 | | 10.2 | 7,701 | エチ・ツー・オー リテイリング | 50.3 | 55 | 45,815 | | 55 | 45,815 | 群馬銀行 | 209 | 239.8 | 81,532 | | 239.8 | 81,532 |
| はるやまホールディングス | 4.5 | 6.1 | 4,385 | | 6.1 | 4,385 | 近鉄百貨店 | 4 | 4.5 | 15,277 | | 4.5 | 15,277 | 武蔵野銀行 | 15.8 | 17.3 | 28,233 | | 17.3 | 28,233 |
| ノジマ | 18.9 | 20.7 | 57,525 | | 20.7 | 57,525 | 丸コ | 10.2 | - | - | | - | - | 千葉興業銀行 | 29.2 | 29.8 | 7,688 | | 29.8 | 7,688 |
| カッパ・クリエイト | 14.9 | 16.4 | 25,420 | | 16.4 | 25,420 | 丸井グループ | 97.3 | 98.5 | 207,539 | | 98.5 | 207,539 | 筑波銀行 | 44.4 | 48.4 | 9,002 | | 48.4 | 9,002 |
| ライトオン | 8 | 8.8 | 5,737 | | 8.8 | 5,737 | アグシアル リテイリング | 8.8 | 9.7 | 48,694 | | 9.7 | 48,694 | 七十七銀行 | 35.9 | 36.6 | 51,715 | | 36.6 | 51,715 |
| ジーンズメイト | 3.4 | 3.6 | 1,130 | | 3.6 | 1,130 | 井筒屋 | 5.8 | 6.3 | 1,417 | | 6.3 | 1,417 | 青森銀行 | 8.3 | 9 | 22,077 | | 9 | 22,077 |
| 良品計画 | 141 | 154.5 | 391,348 | | 154.5 | 391,348 | イオン | 408.7 | 448.1 | 1,543,704 | | 448.1 | 1,543,704 | 秋田銀行 | 6.8 | 7.1 | 10,089 | | 7.1 | 10,089 |
| 三城ホールディングス | 11.5 | 14.9 | 4,410 | | 14.9 | 4,410 | イズミ | 21.6 | 23.6 | 95,580 | | 23.6 | 95,580 | 山形銀行 | 11.9 | 13 | 13,884 | | 13 | 13,884 |
| アドヴァン | 16.2 | 12 | 13,560 | | 12 | 13,560 | 平和堂 | 21.5 | 21.5 | 47,558 | | 21.5 | 47,558 | 岩手銀行 | 6.9 | 7.6 | 15,481 | | 7.6 | 15,481 |
| アルビス | 4 | 3.7 | 9,375 | | 3.7 | 9,375 | フジ | 12.9 | 14.1 | 28,482 | | 14.1 | 28,482 | 東邦銀行 | 95.1 | 104.1 | 22,069 | | 104.1 | 22,069 |
| コナカ | 12.5 | 14.1 | 4,808 | | 14.1 | 4,808 | ヤオコー | 12 | 13.2 | 92,004 | | 13.2 | 92,004 | 東北銀行 | 5.1 | 5.9 | 6,578 | | 5.9 | 6,578 |
| ハウス オブ ローゼ | 1.3 | 1.2 | 2,034 | | 1.2 | 2,034 | ゼビオホールディングス | 12.9 | 14 | 13,440 | | 14 | 13,440 | みちのく銀行 | 6.8 | 7.5 | 7,792 | | 7.5 | 7,792 |
| G-7ホールディングス | 6.2 | 6.9 | 16,870 | | 6.9 | 16,870 | ケーズホールディングス | 102.5 | 103.7 | 153,683 | | 103.7 | 153,683 | みくおフィナンシャルグループ | 89.5 | 105.1 | 216,716 | | 105.1 | 216,716 |
| イオン北海道 | 10.7 | 15.6 | 16,426 | | 15.6 | 16,426 | O l y m p i c グループ | 5.5 | 6 | 5,526 | | 6 | 5,526 | 静岡銀行 | 263.3 | 283.9 | 230,526 | | 283.9 | 230,526 |
| ゴジマ | 18.3 | 19.9 | 13,273 | | 19.9 | 13,273 | 日産東京販売ホールディングス | 15.9 | 14.3 | 3,875 | | 14.3 | 3,875 | 十六銀行 | 13.4 | 14.6 | 29,127 | | 14.6 | 29,127 |
| ヒマラヤ | 3.5 | 4.3 | 4,067 | | 4.3 | 4,067 | シルバライフ | - | 1.6 | 3,393 | | 1.6 | 3,393 | スルガ銀行 | 108.8 | 101.6 | 34,645 | | 101.6 | 34,645 |
| コーナン商事 | 15.1 | 16.6 | 49,401 | | 16.6 | 49,401 | 一家ダニングプロジェクト | - | 1.1 | 687 | | 1.1 | 687 | 八十二銀行 | 256.7 | 262.3 | 97,051 | | 262.3 | 97,051 |
| エコス | 3.9 | 4.3 | 8,380 | | 4.3 | 8,380 | Genky DrugStores | 5.2 | 5.1 | 20,145 | | 5.1 | 20,145 | 山梨中央銀行 | 12.3 | 13.6 | 11,655 | | 13.6 | 11,655 |
| ワタミ | 12.5 | 15.3 | 15,682 | | 15.3 | 15,682 | ナルミヤ・インターナショナル | 1.8 | 2.3 | 2,263 | | 2.3 | 2,263 | 大垣共立銀行 | 21 | 23 | 47,817 | | 23 | 47,817 |
| マルシェ | 2.9 | 3 | 1,524 | | 3 | 1,524 | 聯合メディアカルホールディングス | 9.3 | - | - | | - | - | 福井銀行 | 9.1 | 10 | 19,210 | | 10 | 19,210 |
| パルティフィカ・インターナショナル | 233.4 | 232.8 | 572,688 | | 232.8 | 572,688 | フクオクスグループホールディングス | 6.2 | 6.8 | 5,997 | | 6.8 | 5,997 | 北國銀行 | 10.9 | 10.9 | 28,797 | | 10.9 | 28,797 |
| 西松屋チェーン | 23.3 | 25.5 | 38,683 | | 25.5 | 38,683 | ギフト | - | 1.1 | 2,302 | | 1.1 | 2,302 | 清水銀行 | 4.4 | 4.9 | 8,374 | | 4.9 | 8,374 |
| ゼンショーホールディングス | 50.9 | 62.5 | 181,312 | | 62.5 | 181,312 | アインホールディングス | 13.1 | 16.9 | 122,525 | | 16.9 | 122,525 | 富士銀行 | 2 | 1.9 | 5,449 | | 1.9 | 5,449 |
| 幸楽苑ホールディングス | 6.7 | 7.3 | 12,942 | | 7.3 | 12,942 | 元気寿司 | 2.7 | 3.2 | 8,102 | | 3.2 | 8,102 | 滋賀銀行 | 21.3 | 23.3 | 46,157 | | 23.3 | 46,157 |
| ハウスレイ | 2 | 2 | 1,852 | | 2 | 1,852 | ヤマダホールディングス | 323.6 | 390.2 | 214,610 | | 390.2 | 214,610 | 南都銀行 | 17.6 | 17 | 30,685 | | 17 | 30,685 |
| サイゼリヤ | 17.5 | 17.2 | 37,083 | | 17.2 | 37,083 | アークランドサカモト | 16.6 | 18.2 | 28,301 | | 18.2 | 28,301 | 百五銀行 | 95.7 | 105.2 | 32,401 | | 105.2 | 32,401 |
| V Tホールディングス | 44.1 | 43.9 | 19,140 | | 43.9 | 19,140 | ニトリホールディングス | 46 | 46.3 | 954,011 | | 46.3 | 954,011 | 京都銀行 | 38 | 41.7 | 254,787 | | 41.7 | 254,787 |
| 魚力 | 3 | 3.5 | 6,443 | | 3.5 | 6,443 | グルメ軒屋 | 7.5 | 8.4 | 8,509 | | 8.4 | 8,509 | 紀陽銀行 | 37.6 | 41.3 | 58,728 | | 41.3 | 58,728 |
| ポプラ | 2.8 | 3.3 | 1,135 | | 3.3 | 1,135 | 愛眼 | 8.3 | 7.6 | 1,770 | | 7.6 | 1,770 | ほくほくフィナンシャルグループ | 70.7 | 77.5 | 75,950 | | 77.5 | 75,950 |
| フジ・コーポレーション | 2.9 | 3.1 | 6,993 | | 3.1 | 6,993 | ケーユーホールディングス | 5.5 | 6 | 5,088 | | 6 | 5,088 | 広島銀行 | 157.1 | - | - | | - | - |
| ユナイテッドアローズ | 11.1 | 13.2 | 26,637 | | 13.2 | 26,637 | 吉野家ホールディングス | 34.9 | 38.2 | 84,956 | | 38.2 | 84,956 | 山陰合同銀行 | 63 | 73.6 | 36,652 | | 73.6 | 36,652 |
| ハイデイ日高 | 15.3 | 16.8 | 31,197 | | 16.8 | 31,197 | 松屋フーズホールディングス | 5.1 | 5.6 | 20,524 | | 5.6 | 20,524 | 中国銀行 | 91.5 | 100.4 | 86,344 | | 100.4 | 86,344 |
| 京都さきもの友禅 | 7 | 6.4 | 1,561 | | 6.4 | 1,561 | サガミホールディングス | 14.2 | 15.7 | 19,106 | | 15.7 | 19,106 | 鳥取銀行 | 3.7 | 4 | 4,480 | | 4 | 4,480 |
| コウイド | 35.3 | 38.6 | 76,775 | | 38.6 | 76,775 | 関西スパーマーケット | 8.9 | 8 | | | | | | | | | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | | 銘柄 | 期首(前期末) | | | 当 期 末 | | |
|--------------------|---------|-------|-----------|-------|-------|-----------|-------------------------|---------|-------|-----------|------------------|---------|-----------|-----------|-------------|--------|----|-------|----|----|
| | 株 | 数 | 価 値 額 | 株 | 数 | 評 価 額 | | 株 | 数 | 株 | 数 | 評 価 額 | 株 | | 数 | 株 | 数 | 評 価 額 | 株 | 数 |
| 博報堂DYホールディングス | 143.3 | 157.2 | 266,454 | 18 | 19.6 | 11,936 | デザインワン・ジャパン | 2 | 3.5 | 752 | ダイクマーケティングミックス | — | 4.4 | — | 4.4 | 14,190 | 株 | 株 | 千円 | 千円 |
| ぐるなび | 11 | 14.1 | 7,755 | 11 | 14.6 | 11,936 | イー・ガーディアン | 5.2 | 4.9 | 15,312 | ポリズホールディングス | — | 2.3 | 6,354 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| タカミヤ | 18 | 19.6 | 7,755 | 18 | 19.6 | 11,936 | リブセンス | 6.7 | 6.2 | 1,475 | アドバテッジシステムマネジメント | 5.2 | 5.7 | 4,218 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ジャパンパレスキョウシズテム | 6.9 | 8.9 | 8,971 | 6.9 | 8.9 | 8,971 | ジャパネットホリデイ | 31.7 | 34.8 | 53,278 | リログループ | 56.3 | 61.7 | 158,939 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ファンコミュニケーションズ | 28.4 | 31.3 | 13,146 | 28.4 | 31.3 | 13,146 | ベクトル | 12.9 | 14 | 18,018 | 東祥 | 6.4 | 7.1 | 12,900 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ライク | 4.1 | 3 | 6,102 | 4.1 | 3 | 6,102 | ウチヤマホールディングス | 5.2 | 5.8 | 2,088 | エイチ・アイ・エス | 16 | 16.4 | 33,767 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ビジネス・ブレイクスルー | 4.4 | 5.1 | 2,233 | 4.4 | 5.1 | 2,233 | フォーラム・ケア・コーポレーション | 7.5 | 8.4 | 11,440 | ラクランド | 2.1 | 3.2 | 7,657 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| エスプール | 19.9 | 28.9 | 28,813 | 19.9 | 28.9 | 28,813 | ライクキッズ | 2.4 | — | — | 共立メンテナンス | 17 | 18.7 | 73,210 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| WDBホールディングス | 4.7 | 5.2 | 14,346 | 4.7 | 5.2 | 14,346 | キャリアリンク | 3.4 | 3.6 | 11,340 | イネンホールディングス | 11.5 | 11.8 | 16,000 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 手間いらず | — | 1.1 | 5,852 | — | 1.1 | 5,852 | IBJ | 7 | 9.1 | 8,881 | 建設技術研究所 | 7.1 | 7.3 | 18,374 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ティア | 6.1 | 7.2 | 3,204 | 6.1 | 7.2 | 3,204 | アサンテ | 4.2 | 4.1 | 6,994 | スペース | 6.7 | 7.7 | 6,337 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| CDG | 1.1 | 1.3 | 1,999 | 1.1 | 1.3 | 1,999 | N・フィールド | 7.1 | 7.6 | 7,554 | 長 大 | 3.8 | 4.5 | 7,191 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| アドウェイズ | — | 13.7 | 9,809 | — | 13.7 | 9,809 | パリュウHR | 2 | 4.5 | 7,717 | 燦ホールディングス | 4.5 | 4.7 | 5,687 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| パリュウコマース | 5.8 | 7.5 | 23,175 | 5.8 | 7.5 | 23,175 | M&Aキャピタルパートナーズ | 7.3 | 9.3 | 46,267 | スバル興業 | 0.6 | 0.7 | 5,705 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| インフォマート | 112.9 | 114.3 | 109,842 | 112.9 | 114.3 | 109,842 | ライオンガスアパレルホールディングス | 3.9 | 4.3 | 9,146 | 東京デアトル | 4.1 | 4.6 | 6,016 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| J Pホールディングス | 32.4 | 32.6 | 9,682 | 32.4 | 32.6 | 9,682 | ER1ホールディングス | 3 | 2.8 | 1,789 | ダナベ経営 | 1.9 | 2.2 | 3,102 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| エコナックホールディングス | 18.8 | 20.7 | 1,966 | 18.8 | 20.7 | 1,966 | アビスト | 1.6 | 1.8 | 5,351 | ナガワ | 3.3 | 3.6 | 41,364 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| E P Sホールディングス | 15.5 | 15.3 | 19,966 | 15.5 | 15.3 | 19,966 | シグマクシス | 7 | 6.2 | 11,749 | よみうりランド | 2.2 | 0.6 | 3,618 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| レックス | 2.5 | 2.7 | 4,887 | 2.5 | 2.7 | 4,887 | ウィルグループ | 6.7 | 8.2 | 8,552 | 東京都競馬 | 6.7 | 7.3 | 33,507 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| プラステック・インターナショナル | 38.6 | 42.2 | 35,490 | 38.6 | 42.2 | 35,490 | エスグロー・エージェンツ・ジャパン | 14.5 | 16.6 | 5,063 | 常盤興産 | 4.2 | 4.7 | 6,396 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| アミューズ | 5.6 | 6.2 | 17,043 | 5.6 | 6.2 | 17,043 | メドピア | — | 5.3 | 38,213 | カナモト | 16.8 | 19.9 | 47,978 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ドリームインキュベータ | 3.2 | 3.5 | 4,291 | 3.2 | 3.5 | 4,291 | レアジョブ | — | 1.6 | 3,825 | 東京ドーム | 41.8 | 44.5 | 57,716 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| クイック | 6.4 | 7 | 8,638 | 6.4 | 7 | 8,638 | リクルートホールディングス | 738 | 809.3 | 4,030,314 | 西尾レントオール | 10.5 | 10.4 | 27,071 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| T A C | 6.7 | 6.3 | 1,701 | 6.7 | 6.3 | 1,701 | エラン | 6.1 | 15.6 | 23,478 | アソナ・ホスピタリティ・グループ | 69 | 71.2 | 1,922 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ケネディクス | 98 | 32.3 | 24,128 | 98 | 32.3 | 24,128 | 土木管理総合試験所 | 4.5 | 5.7 | 2,023 | トランス・コスモス | 9.8 | 10.8 | 30,974 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 電通グループ | 106.2 | 127 | 473,075 | 106.2 | 127 | 473,075 | ネットマーケティング | 3.8 | 5.4 | 3,699 | 乃村工藝社 | 44.2 | 48.3 | 39,992 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| テイクアンドグ・ニーズ | 4 | 5.2 | 3,468 | 4 | 5.2 | 3,468 | 日本郵政 | 844.5 | 855.3 | 754,716 | 藤田観光 | 4.5 | 4.4 | 7,290 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ぴあ | 2.9 | 3.2 | 10,048 | 2.9 | 3.2 | 10,048 | ベルシテム24ホールディングス | 17.2 | 18.9 | 36,174 | KNT-CTホールディングス | 6.4 | 6 | 6,114 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| イオンファンタジー | 4 | 4.3 | 10,582 | 4 | 4.3 | 10,582 | 鎌倉新書 | 7.6 | 11.4 | 10,488 | 日本管財 | 11 | 12.2 | 25,607 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| シーティーエス | 11.6 | 12.6 | 12,020 | 11.6 | 12.6 | 12,020 | SMN | 1.6 | 2.4 | 1,855 | トーカイ | 10 | 11 | 24,684 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ネクシィーズグループ | 3.6 | 3.5 | 3,367 | 3.6 | 3.5 | 3,367 | 一蔵 | 1.1 | 1.7 | 649 | 白洋舎 | 1.1 | 1 | 2,427 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| H. U. グループホールディングス | 28.9 | 31.7 | 98,587 | 28.9 | 31.7 | 98,587 | L I T A L I C O | 3.6 | 4.6 | 16,560 | セコム | 109.3 | 111.3 | 1,140,268 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| アルプス技研 | 9.1 | 10 | 21,600 | 9.1 | 10 | 21,600 | グローバルキッズCOMPANY | 1.5 | 2.1 | 1,881 | セントラル警備保障 | 5 | 5.4 | 19,008 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| サンックス | 18.1 | 17.7 | 6,000 | 18.1 | 17.7 | 6,000 | エアトリ | 4.6 | 6.1 | 10,107 | 丹青社 | 19.5 | 21.1 | 17,048 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ダイオーズ | 2 | 2.2 | 2,145 | 2 | 2.2 | 2,145 | アトラエ | 2.7 | 3.4 | 10,472 | メイテック | 12.7 | 13.8 | 77,142 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 日本空調サービス | 10.8 | 12.2 | 8,930 | 10.8 | 12.2 | 8,930 | ストライク | 3.9 | 4.2 | 20,223 | 応用地質 | 11.1 | 13.2 | 17,410 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| オリエンタルランド | 109.5 | 120.1 | 2,141,383 | 109.5 | 120.1 | 2,141,383 | ソラスト | 28.4 | 27.7 | 41,439 | 船井総研ホールディングス | 21.3 | 23.1 | 59,736 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ダスキン | 26.4 | 26.2 | 75,482 | 26.4 | 26.2 | 75,482 | セラク | 3.3 | 3.5 | 6,191 | 進学会ホールディングス | 4.1 | 4.9 | 2,401 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 朝光ネットワークジャパン | 12.1 | 14.2 | 8,548 | 12.1 | 14.2 | 8,548 | インソース | 5 | 9.4 | 20,670 | オオバ | 8.1 | 7.9 | 5,925 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ファコホールディングス | 5.7 | 5.4 | 9,763 | 5.7 | 5.4 | 9,763 | ベイカレント・コンサルティング | 6.2 | 7.4 | 130,684 | いであ | 1.9 | 2.7 | 4,884 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 秀英予備校 | 2.3 | 2.8 | 1,226 | 2.3 | 2.8 | 1,226 | Orchestra Holdings | 2 | 2.5 | 5,897 | 学究社 | 3.1 | 3.4 | 4,831 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 田谷 | 2 | 1.7 | 974 | 2 | 1.7 | 974 | アイモバイル | 3.3 | 4 | 4,900 | ベネッセホールディングス | 34.3 | 41.4 | 92,818 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ラウンドワン | 28.8 | 38.5 | 38,808 | 28.8 | 38.5 | 38,808 | キャリアインテックス | 4.2 | 4.6 | 2,783 | イオンディライト | 12.7 | 13.9 | 40,991 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| リゾートトラスト | 47.2 | 51.7 | 88,045 | 47.2 | 51.7 | 88,045 | MS-Japan | 3.4 | 4.5 | 5,413 | ナック | 5.7 | 5.6 | 5,510 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ビー・エム・エル | 13.3 | 14.6 | 51,465 | 13.3 | 14.6 | 51,465 | 船場 | 1.7 | 1.6 | 1,403 | ニチイ学館 | 14.7 | — | — | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ワタベウエディング | 1.6 | 1.7 | 562 | 1.6 | 1.7 | 562 | グレイステクノロジー | 4.7 | 5.7 | 35,454 | ダイセキ | 17.2 | 18.9 | 64,638 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| りららコミュニケーションズ | 18.7 | 17.1 | 24,504 | 18.7 | 17.1 | 24,504 | チャイルドエンターテインメントホールディングス | 10.8 | 32.5 | 77,187 | ステップ | 3.8 | 4.3 | 6,712 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| リソー教育 | 47.1 | 57.3 | 20,169 | 47.1 | 57.3 | 20,169 | フルテック | 1.2 | 1.8 | 2,534 | 合計 | 株数・金額 | 127,662.7 | 124,117.8 | 311,274.068 | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 |
| 早稲田アカデミー | 3.4 | 4.4 | 4,307 | 3.4 | 4.4 | 4,307 | グリーンズ | 3.9 | 4.2 | 2,205 | 銘柄数<比率> | 2,151銘柄 | 2,183銘柄 | <97.7%> | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| ユー・エス・エス | 115.4 | 126.4 | 274,920 | 115.4 | 126.4 | 274,920 | ソナグループ・ホールディングス | 1.2 | 1.7 | 603 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 東京個別指導学院 | 3.7 | 9.9 | 6,672 | 3.7 | 9.9 | 6,672 | G A M E W I T H | 2.2 | 3.5 | 2,075 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| サイバーエージェント | 59.3 | 69.6 | 467,016 | 59.3 | 69.6 | 467,016 | ソウルダウト | 1.6 | 2.7 | 4,665 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 楽天 | 480.2 | 526.6 | 583,999 | 480.2 | 526.6 | 583,999 | MS&Consulting | 1.4 | 1.9 | 1,181 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| グリーク・アンド・リパ社 | 5.3 | 5.8 | 7,105 | 5.3 | 5.8 | 7,105 | エル・ティー・エス | — | 0.8 | 3,336 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| モーニングスター | — | 12.4 | 6,001 | — | 12.4 | 6,001 | ミダック | — | 2.4 | 7,716 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| デー・オー・ダブリュー | 9 | 19.8 | 5,841 | 9 | 19.8 | 5,841 | 日総工業 | — | 8.7 | 7,786 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| 山田コンサルテインググループ | 5 | 6.6 | 6,943 | 5 | 6.6 | 6,943 | キュービネットホールディングス | 4.3 | 5.2 | 8,824 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| セントラルスポーツ | 3.9 | 4.2 | 10,243 | 3.9 | 4.2 | 10,243 | R P Aホールディングス | 5.8 | 12.8 | 8,652 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| フルキャストホールディングス | 10.3 | 9.8 | 18,247 | 10.3 | 9.8 | 18,247 | スプリックス | 3.5 | 3.2 | 2,646 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| エン・ジャパン | 18.4 | 20.1 | 68,239 | 18.4 | 20.1 | 68,239 | マゼンメントソリューションズ | 1.1 | 5.5 | 9,916 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| リソールホールディングス | 1 | 0.9 | 3,555 | 1 | 0.9 | 3,555 | プロレド・パートナーズ | — | 1.6 | 5,624 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 20.7 | 22.5 | 180,000 | 20.7 | 22.5 | 180,000 | and factory | — | 1 | 770 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| アトラ | 2.3 | 2.5 | 890 | 2.3 | 2.5 | 890 | テノ・ホールディングス | — | 0.9 | 1,140 | | | | | 株 | 株 | 千円 | 千円 | 千円 | |
| インターワークス | 1.9 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当 期 | | 末 |
|-----|-----------|--------------|-------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 国内 | T O P I X | 百万円 7,442 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2021年2月8日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|-------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 株 式 | 千円 311,274,068 | | % 97.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 7,511,950 | | 2.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 318,786,019 | | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月8日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 318,786,019,057円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 6,651,925,208 |
| 株 式(評価額) | 311,274,068,500 |
| 未 収 入 金 | 391,827,620 |
| 未 収 配 当 金 | 389,312,729 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 78,885,000 |
| (B) 負 債 | 199,379,000 |
| 未 払 解 約 金 | 199,379,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 318,586,640,057 |
| 元 次 期 繰 越 損 益 金 | 102,105,610,506 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 216,481,029,551 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 102,105,610,506円 |
| | 31,202円 |

(注1) 期首元本額 98,370,254,055円
 追加設定元本額 67,069,989,134円
 一部解約元本額 63,334,632,683円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|-------------------------------|-----------------|
| One DC 国内株式インデックスファンド | 15,975,939,497円 |
| DIAM国内株式バッシブ・ファンド | 3,179,107,702円 |
| MITO ラップ型ファンド(安定型) | 2,626,890円 |
| MITO ラップ型ファンド(中立型) | 5,088,758円 |
| MITO ラップ型ファンド(積極型) | 8,151,762円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 24,072,359円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 14,018,113円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 12,980,814円 |
| たわらノーロード TOPIX | 784,765,731円 |
| たわらノーロード バランス(8資産均等型) | 612,281,321円 |
| たわらノーロード バランス(堅実型) | 23,454,696円 |
| たわらノーロード バランス(標準型) | 140,720,417円 |
| たわらノーロード バランス(積極型) | 207,209,167円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型) | 1,707,448円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型) | 108,252,549円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) | 248,952,107円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型) | 166,536,220円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型) | 228,275,842円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(保守型) | 431,973円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型) | 1,205,302円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) | 4,833,419円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型) | 2,885,817円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型) | 6,004,044円 |
| DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金> | 34,764,926,964円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 1,023,160,847円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 3,393,344,349円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 3,451,908,533円 |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド | 332,009,300円 |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド | 1,152,607,788円 |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド | 1,085,041,257円 |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) | 35,744,954円 |
| マネックス資産設計ファンド(育成型) | 1,112,139,190円 |
| マネックス資産設計ファンド エゴリレーション | 21,186,872円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 313,080,893円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 264,026,418円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 439,000,020円 |
| 投資のソムリエ | 15,620,354,669円 |
| クルーズコントロール | 637,176,611円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 960,546,202円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 294,854,779円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 367,544,221円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(堅実型) | 6,918,316円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(積極型) | 16,838,854円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 264,587,992円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 2,928,248,506円 |

| | |
|--|------------------|
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045) | 19,134,149円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055) | 9,070,573円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC) | 2,599,277円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035) | 42,338,447円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 98,734,309円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 1,803,475,886円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 265,437,692円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040) | 9,278,066円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050) | 5,239,774円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060) | 5,173,103円 |
| 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 3,626,870円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定) | 52,904,100円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定) | 64,217,224円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定) | 71,448,850円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定) | 32,545,912円 |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 41,658,362円 |
| 日米資産分散戦略ファンド(インカム重視)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定) | 562,668,029円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド | 85,977,917円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 72,359,909円 |
| DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 128,443,286円 |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 7,951,637円 |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 35,906,053円 |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 8,484,030円 |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 3,658,825円 |
| DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 21,889,554円 |
| DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 46,792,943円 |
| DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 689,878,804円 |
| DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定) | 729,307,036円 |
| DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 2,064,787,625円 |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定) | 150,408,971円 |
| DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定) | 37,142,128円 |
| DIAM アスク グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 373,020,041円 |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定) | 102,439,732円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド55VA(適格機関投資家限定) | 1,576,268円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定) | 468,054,341円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 24,008,365円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 99,685,187円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定) | 238,004,405円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定) | 323,286,503円 |
| DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定) | 45,168,755円 |
| DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定) | 20,550,710円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド7VA(121)(適格機関投資家限定) | 362,800,005円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定) | 1,106,076,367円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定) | 1,467,666,407円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定) | 58,984,178円 |
| 期末元本合計 | 102,105,610,506円 |

(注3) 担保資産
 代用として担保を提供している資産はありません。

■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 5,192,079,491円 | |
| | 受取配当金 | 5,191,315,557 | |
| | 受取利息 | 7,434 | |
| | その他の収益 | 3,319,941 | |
| | 支払利息 | △2,563,441 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | 32,654,345,029 | |
| | 売却益 | 50,944,545,133 | |
| | 売却損 | △18,290,200,104 | |
| (C) | 先物取引等取引損益 | 1,230,944,200 | |
| | 取引益 | 2,753,684,220 | |
| | 取引損 | △1,522,740,020 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 39,077,368,720 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 171,390,003,476 | |
| (F) | 解約差損益金 | △99,083,661,761 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 105,097,319,116 | |
| (H) | 合計(D+E+F+G) | 216,481,029,551 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 216,481,029,551 | |

(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)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3) (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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期 (決算日 2021年2月15日)

(計算期間 2020年2月15日～2021年2月15日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2002年12月3日から無期限です。 |
| 運用方針 | NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要投資対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク) | | 債券組入 比率 | 新株予約 権付社債 (転換社債) 比率 | 債券先物 比率 | 純資産 総額 |
|------------------|--------|-----------|--------------------------|-----------|------------|------------------------------|------------|----------------|
| | 円 | 期中 騰落率 | ポイント | 期中 騰落率 | | | | |
| 14期 (2017年2月14日) | 12,730 | 0.9 | 376.81 | 0.9 | 98.6 | — | — | 百万円 379,734 |
| 15期 (2018年2月14日) | 12,855 | 1.0 | 380.56 | 1.0 | 99.5 | — | — | 355,598 |
| 16期 (2019年2月14日) | 13,042 | 1.5 | 386.15 | 1.5 | 99.3 | — | — | 292,112 |
| 17期 (2020年2月14日) | 13,197 | 1.2 | 390.72 | 1.2 | 99.4 | — | — | 222,859 |
| 18期 (2021年2月15日) | 13,022 | △1.3 | 385.59 | △1.3 | 99.2 | — | — | 273,346 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

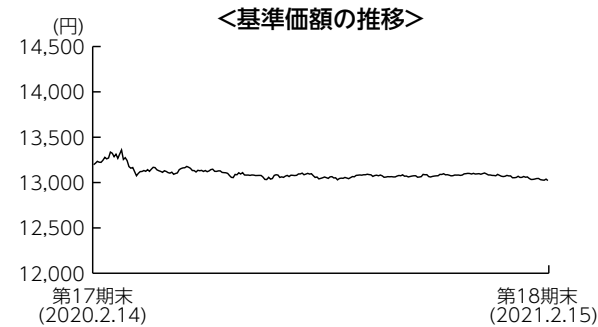
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | NOMURA-BPI総合 | | 債券組入 率 | 新株予約 権付社債 (転換社債) 率 | 債券先物 率 |
|----------------------|-------------|----------|----------------|--------|-----------|-----------------------------|-----------|
| | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | | | |
| (期 首) 2020年 2月14日 | 円 13,197 | % - | ポイント 390.72 | % - | % 99.4 | % - | % - |
| 2 月 末 | 13,336 | 1.1 | 394.74 | 1.0 | 101.0 | - | - |
| 3 月 末 | 13,124 | △0.6 | 388.45 | △0.6 | 101.4 | - | - |
| 4 月 末 | 13,169 | △0.2 | 389.79 | △0.2 | 99.4 | - | - |
| 5 月 末 | 13,112 | △0.6 | 388.13 | △0.7 | 99.4 | - | - |
| 6 月 末 | 13,060 | △1.0 | 386.56 | △1.1 | 99.7 | - | - |
| 7 月 末 | 13,104 | △0.7 | 387.91 | △0.7 | 99.5 | - | - |
| 8 月 末 | 13,044 | △1.2 | 386.09 | △1.2 | 100.0 | - | - |
| 9 月 末 | 13,081 | △0.9 | 387.22 | △0.9 | 99.7 | - | - |
| 10 月 末 | 13,059 | △1.0 | 386.63 | △1.0 | 99.5 | - | - |
| 11 月 末 | 13,076 | △0.9 | 387.12 | △0.9 | 99.9 | - | - |
| 12 月 末 | 13,078 | △0.9 | 387.20 | △0.9 | 99.3 | - | - |
| 2021年 1 月 末 | 13,045 | △1.2 | 386.25 | △1.1 | 99.2 | - | - |
| (期 末) 2021年 2月15日 | 13,022 | △1.3 | 385.59 | △1.3 | 99.2 | - | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月15日から2021年2月15日まで）

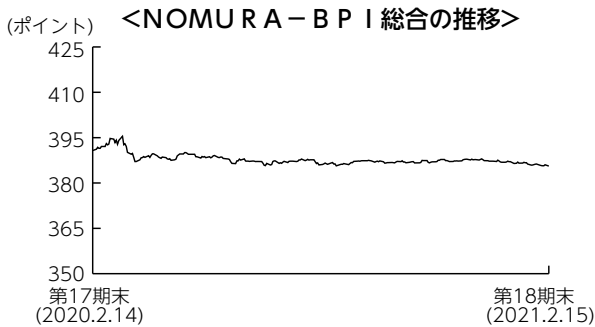


基準価額の推移

当期末の基準価額は13,022円となり、前期末比で1.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり基準価額は上昇して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和政策などを受けて基準価額は下落に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり利回りは低下（価格は上昇）して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和

政策などを受けて利回りは上昇に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。

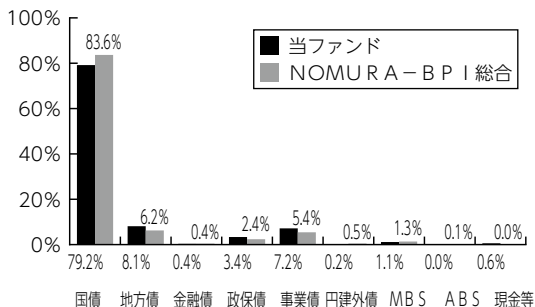
ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

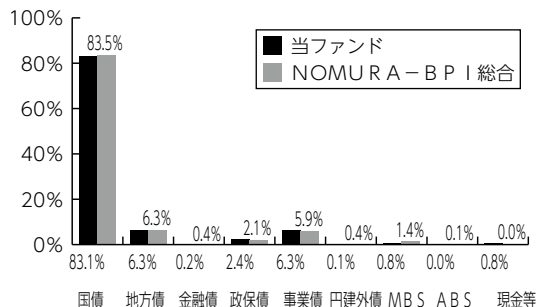
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

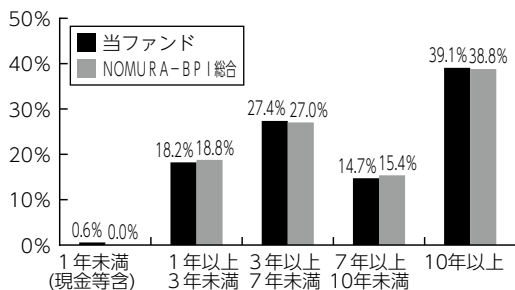


期末

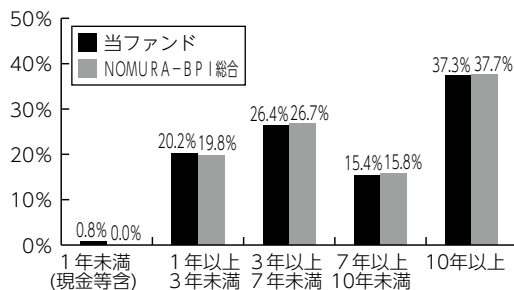


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|-------|-------------|------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 内 | | |
| | 国債証券 | 191,780,597 | 136,499,291 (-) |
| | 地方債証券 | 2,830,950 | 3,489,753 (-) |
| | 特殊債証券 | 2,021,381 | 1,817,635 (203,888) |
| | 社債証券 | 1,451,683 | 1,318,867 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 | 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 |
| 公 社 債 | 百万円 198,084 | 百万円 4,470 | % 2.3 | 百万円 143,125 | 百万円 11,792 | % 8.2 |

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区 分 | 当 期 | | | | 末 | | |
|-----------|-------------|-------------|---------|--------------------|-------------------|---------|---------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うち B B 格 以下組入比率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 | | |
| | | | | | 5 年 以 上 | 2 年 以 上 | 2 年 未 満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国 債 証 券 | 212,920,000 | 227,135,859 | 83.1 | — | 55.9 | 18.5 | 8.7 |
| 地 方 債 証 券 | 16,600,000 | 17,224,060 | 6.3 | 5.1 | 2.3 | 2.8 | 1.1 |
| 特 殊 債 券 | 14,894,979 | 15,838,836 | 5.8 | — | 3.8 | 1.5 | 0.5 |
| 金 融 債 券 | 500,000 | 500,321 | 0.2 | — | — | 0.2 | — |
| 普 通 社 債 券 | 10,281,000 | 10,583,824 | 3.9 | 0.1 | 1.2 | 2.0 | 0.7 |
| 合 計 | 255,195,979 | 271,282,901 | 99.2 | 5.2 | 63.1 | 25.1 | 11.0 |

(注1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 無格付銘柄については、B B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 1.0000 | 1,300,000 | 1,315,925 | 2022/03/20 |
| 4 1 1 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 900,000 | 902,367 | 2022/04/01 |
| 4 1 2 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 1,500,000 | 1,504,245 | 2022/05/01 |
| 4 1 3 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 400,000 | 401,184 | 2022/06/01 |
| 4 1 2 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 2,500,000 | 2,507,700 | 2022/06/20 |
| 3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.9000 | 3,200,000 | 3,244,000 | 2022/06/20 |
| 3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,050,000 | 1,063,030 | 2022/06/20 |
| 4 1 4 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 1,000,000 | 1,003,220 | 2022/07/01 |
| 4 1 5 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 200,000 | 200,684 | 2022/08/01 |
| 4 1 6 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 1,270,000 | 1,274,597 | 2022/09/01 |
| 1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,980,000 | 1,987,246 | 2022/09/20 |
| 3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,400,000 | 1,420,650 | 2022/09/20 |
| 4 1 8 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 1,300,000 | 1,305,330 | 2022/11/01 |
| 4 1 9 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 600,000 | 602,526 | 2022/12/01 |
| 1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,690,000 | 1,697,165 | 2022/12/20 |
| 3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.7000 | 500,000 | 507,610 | 2022/12/20 |
| 3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,200,000 | 1,220,472 | 2022/12/20 |
| 4 2 0 回 利付国庫債券 (2 年) | 0.1000 | 1,600,000 | 1,607,056 | 2023/01/01 |
| 1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,840,000 | 1,848,648 | 2023/03/20 |
| 3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 1,790,000 | 1,817,154 | 2023/03/20 |
| 1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,250,000 | 1,256,587 | 2023/06/20 |
| 3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,770,000 | 1,808,196 | 2023/06/20 |
| 1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,400,000 | 1,408,190 | 2023/09/20 |
| 3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.8000 | 1,250,000 | 1,279,887 | 2023/09/20 |
| 3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 650,000 | 662,161 | 2023/09/20 |

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 2,550,000 | 2,567,085 | 2023/12/20 |
| 3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,360,000 | 2,408,781 | 2023/12/20 |
| 1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,720,000 | 1,732,263 | 2024/03/20 |
| 3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,250,000 | 2,300,557 | 2024/03/20 |
| 1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,690,000 | 1,702,742 | 2024/06/20 |
| 3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.6000 | 2,380,000 | 2,437,453 | 2024/06/20 |
| 1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,660,000 | 1,673,163 | 2024/09/20 |
| 3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.5000 | 2,940,000 | 3,005,209 | 2024/09/20 |
| 7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 350,000 | 377,958 | 2024/09/20 |
| 1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,920,000 | 1,935,916 | 2024/12/20 |
| 3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.5000 | 760,000 | 777,882 | 2024/12/20 |
| 3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.3000 | 1,340,000 | 1,361,185 | 2024/12/20 |
| 7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 340,000 | 367,672 | 2024/12/20 |
| 1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,500,000 | 1,513,245 | 2025/03/20 |
| 3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 2,030,000 | 2,072,508 | 2025/03/20 |
| 7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.1000 | 140,000 | 152,703 | 2025/03/20 |
| 1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 2,750,000 | 2,775,162 | 2025/06/20 |
| 3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 3,040,000 | 3,107,579 | 2025/06/20 |
| 7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 1.9000 | 190,000 | 206,606 | 2025/06/20 |
| 1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 2,000,000 | 2,019,380 | 2025/09/20 |
| 3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.4000 | 2,350,000 | 2,405,295 | 2025/09/20 |
| 8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年) | 2.0000 | 240,000 | 263,308 | 2025/09/20 |
| 1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年) | 0.1000 | 1,100,000 | 1,110,967 | 2025/12/20 |
| 3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.3000 | 2,210,000 | 2,253,537 | 2025/12/20 |
| 3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年) | 0.1000 | 2,580,000 | 2,605,696 | 2026/03/20 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 85回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 440,000 | 489,249 | 2026/03/20 |
| 343回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,280,000 | 2,303,233 | 2026/06/20 |
| 88回 利付国庫債券(20年) | 2.3000 | 350,000 | 394,775 | 2026/06/20 |
| 344回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,280,000 | 2,303,689 | 2026/09/20 |
| 90回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 300,000 | 338,418 | 2026/09/20 |
| 345回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 3,010,000 | 3,041,785 | 2026/12/20 |
| 92回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 870,000 | 981,012 | 2026/12/20 |
| 346回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,470,000 | 2,496,429 | 2027/03/20 |
| 93回 利付国庫債券(20年) | 2.0000 | 250,000 | 281,637 | 2027/03/20 |
| 94回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 450,000 | 509,697 | 2027/03/20 |
| 347回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,010,000 | 2,031,748 | 2027/06/20 |
| 95回 利付国庫債券(20年) | 2.3000 | 350,000 | 402,692 | 2027/06/20 |
| 348回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 1,980,000 | 2,001,621 | 2027/09/20 |
| 97回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 500,000 | 574,780 | 2027/09/20 |
| 349回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,060,000 | 2,082,639 | 2027/12/20 |
| 99回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 450,000 | 516,591 | 2027/12/20 |
| 350回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,700,000 | 2,727,837 | 2028/03/20 |
| 100回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 600,000 | 695,772 | 2028/03/20 |
| 351回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 1,960,000 | 1,979,462 | 2028/06/20 |
| 102回 利付国庫債券(20年) | 2.4000 | 360,000 | 424,504 | 2028/06/20 |
| 352回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,220,000 | 2,241,090 | 2028/09/20 |
| 105回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 400,000 | 464,652 | 2028/09/20 |
| 106回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 350,000 | 409,230 | 2028/09/20 |
| 353回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 1,840,000 | 1,856,596 | 2028/12/20 |
| 107回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 400,000 | 466,412 | 2028/12/20 |
| 108回 利付国庫債券(20年) | 1.9000 | 400,000 | 460,132 | 2028/12/20 |
| 354回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 1,870,000 | 1,885,876 | 2029/03/20 |
| 109回 利付国庫債券(20年) | 1.9000 | 220,000 | 253,908 | 2029/03/20 |
| 110回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 330,000 | 386,202 | 2029/03/20 |
| 355回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 1,920,000 | 1,935,187 | 2029/06/20 |
| 111回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 290,000 | 343,064 | 2029/06/20 |
| 112回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 550,000 | 646,052 | 2029/06/20 |
| 356回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,180,000 | 2,195,892 | 2029/09/20 |
| 1回 利付国庫債券(30年) | 2.8000 | 100,000 | 123,791 | 2029/09/20 |
| 113回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 770,000 | 907,753 | 2029/09/20 |
| 357回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,160,000 | 2,173,327 | 2029/12/20 |
| 114回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 550,000 | 650,386 | 2029/12/20 |
| 115回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 200,000 | 238,268 | 2029/12/20 |
| 2回 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 100,000 | 121,243 | 2030/02/20 |
| 358回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,100,000 | 2,111,403 | 2030/03/20 |
| 116回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 320,000 | 382,585 | 2030/03/20 |
| 117回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 650,000 | 771,238 | 2030/03/20 |
| 359回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,160,000 | 2,169,028 | 2030/06/20 |
| 118回 利付国庫債券(20年) | 2.0000 | 310,000 | 366,193 | 2030/06/20 |
| 119回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 300,000 | 348,804 | 2030/06/20 |
| 120回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 400,000 | 457,636 | 2030/06/20 |
| 360回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 2,090,000 | 2,096,959 | 2030/09/20 |
| 121回 利付国庫債券(20年) | 1.9000 | 540,000 | 634,451 | 2030/09/20 |
| 122回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 350,000 | 407,883 | 2030/09/20 |
| 4回 利付国庫債券(30年) | 2.9000 | 200,000 | 254,984 | 2030/11/20 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 361回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 800,000 | 801,952 | 2030/12/20 |
| 123回 利付国庫債券(20年) | 2.1000 | 750,000 | 898,800 | 2030/12/20 |
| 124回 利付国庫債券(20年) | 2.0000 | 390,000 | 463,565 | 2030/12/20 |
| 125回 利付国庫債券(20年) | 2.2000 | 660,000 | 800,012 | 2031/03/20 |
| 126回 利付国庫債券(20年) | 2.0000 | 340,000 | 405,324 | 2031/03/20 |
| 127回 利付国庫債券(20年) | 1.9000 | 420,000 | 496,490 | 2031/03/20 |
| 128回 利付国庫債券(20年) | 1.9000 | 620,000 | 734,582 | 2031/06/20 |
| 129回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 590,000 | 692,996 | 2031/06/20 |
| 130回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 680,000 | 800,734 | 2031/09/20 |
| 131回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 300,000 | 350,124 | 2031/09/20 |
| 6回 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 200,000 | 248,698 | 2031/11/20 |
| 132回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 420,000 | 491,278 | 2031/12/20 |
| 133回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 570,000 | 672,839 | 2031/12/20 |
| 134回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 630,000 | 745,397 | 2032/03/20 |
| 135回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 350,000 | 410,284 | 2032/03/20 |
| 136回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 440,000 | 510,972 | 2032/03/20 |
| 137回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 350,000 | 411,176 | 2032/06/20 |
| 138回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 380,000 | 437,931 | 2032/06/20 |
| 139回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 450,000 | 523,629 | 2032/06/20 |
| 140回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,090,000 | 1,283,224 | 2032/09/20 |
| 8回 利付国庫債券(30年) | 1.8000 | 200,000 | 238,010 | 2032/11/22 |
| 141回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 750,000 | 884,730 | 2032/12/20 |
| 142回 利付国庫債券(20年) | 1.8000 | 400,000 | 476,508 | 2032/12/20 |
| 143回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 700,000 | 889,245 | 2033/03/20 |
| 144回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 430,000 | 498,030 | 2033/03/20 |
| 11回 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 200,000 | 236,840 | 2033/06/20 |
| 145回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,410,000 | 1,669,722 | 2033/06/20 |
| 12回 利付国庫債券(30年) | 2.1000 | 200,000 | 247,280 | 2033/09/20 |
| 146回 利付国庫債券(20年) | 1.7000 | 1,050,000 | 1,245,741 | 2033/09/20 |
| 13回 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 100,000 | 122,688 | 2033/12/20 |
| 147回 利付国庫債券(20年) | 1.6000 | 1,180,000 | 1,387,691 | 2033/12/20 |
| 148回 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 290,000 | 371,606 | 2034/03/20 |
| 149回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,090,000 | 1,269,904 | 2034/03/20 |
| 15回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 200,000 | 259,598 | 2034/06/20 |
| 149回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,130,000 | 1,318,291 | 2034/06/20 |
| 16回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 150,000 | 195,262 | 2034/09/20 |
| 150回 利付国庫債券(20年) | 1.4000 | 1,230,000 | 1,420,600 | 2034/09/20 |
| 17回 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 200,000 | 258,562 | 2034/12/20 |
| 151回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,410,000 | 1,592,383 | 2034/12/20 |
| 18回 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 320,000 | 410,387 | 2035/03/20 |
| 152回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,270,000 | 1,435,150 | 2035/03/20 |
| 19回 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 200,000 | 257,114 | 2035/06/20 |
| 153回 利付国庫債券(20年) | 1.3000 | 1,170,000 | 1,339,135 | 2035/06/20 |
| 20回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 200,000 | 263,350 | 2035/09/20 |
| 154回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 1,030,000 | 1,165,290 | 2035/09/20 |
| 21回 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 200,000 | 258,300 | 2035/12/20 |
| 155回 利付国庫債券(20年) | 1.0000 | 1,230,000 | 1,356,185 | 2035/12/20 |
| 22回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 220,000 | 291,332 | 2036/03/20 |
| 156回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 940,000 | 953,564 | 2036/03/20 |
| 23回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 200,000 | 265,498 | 2036/06/20 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 157回 利付国庫債券(20年) | 0.2000 | 1,150,000 | 1,130,645 | 2036/06/20 |
| 24回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 190,000 | 252,825 | 2036/09/20 |
| 158回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 980,000 | 1,006,195 | 2036/09/20 |
| 25回 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 200,000 | 260,686 | 2036/12/20 |
| 159回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,050,000 | 1,093,501 | 2036/12/20 |
| 26回 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 400,000 | 528,508 | 2037/03/20 |
| 160回 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 1,080,000 | 1,140,166 | 2037/03/20 |
| 161回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,150,000 | 1,194,424 | 2037/06/20 |
| 27回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 420,000 | 564,253 | 2037/09/20 |
| 162回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 920,000 | 954,564 | 2037/09/20 |
| 163回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,070,000 | 1,109,012 | 2037/12/20 |
| 28回 利付国庫債券(30年) | 2.5000 | 480,000 | 647,956 | 2038/03/20 |
| 164回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 1,160,000 | 1,182,330 | 2038/03/20 |
| 165回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 890,000 | 905,895 | 2038/06/20 |
| 29回 利付国庫債券(30年) | 2.4000 | 560,000 | 749,616 | 2038/09/20 |
| 166回 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 1,150,000 | 1,207,684 | 2038/09/20 |
| 167回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 950,000 | 963,404 | 2038/12/20 |
| 30回 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 570,000 | 755,215 | 2039/03/20 |
| 168回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 850,000 | 845,716 | 2039/03/20 |
| 169回 利付国庫債券(20年) | 0.3000 | 850,000 | 829,098 | 2039/06/20 |
| 31回 利付国庫債券(30年) | 2.2000 | 460,000 | 603,280 | 2039/09/20 |
| 170回 利付国庫債券(20年) | 0.3000 | 820,000 | 798,212 | 2039/09/20 |
| 171回 利付国庫債券(20年) | 0.3000 | 1,060,000 | 1,029,694 | 2039/12/20 |
| 32回 利付国庫債券(30年) | 2.3000 | 610,000 | 814,807 | 2040/03/20 |
| 172回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 760,000 | 751,336 | 2040/03/20 |
| 173回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 1,020,000 | 1,006,444 | 2040/06/20 |
| 33回 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 930,000 | 1,194,910 | 2040/09/20 |
| 174回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 1,100,000 | 1,084,237 | 2040/09/20 |
| 175回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 400,000 | 401,812 | 2040/12/20 |
| 34回 利付国庫債券(30年) | 2.2000 | 920,000 | 1,221,097 | 2041/03/20 |
| 35回 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 1,100,000 | 1,422,652 | 2041/09/20 |
| 36回 利付国庫債券(30年) | 2.0000 | 950,000 | 1,232,416 | 2042/03/20 |
| 37回 利付国庫債券(30年) | 1.9000 | 990,000 | 1,267,506 | 2042/09/20 |
| 38回 利付国庫債券(30年) | 1.8000 | 690,000 | 871,884 | 2043/03/20 |
| 39回 利付国庫債券(30年) | 1.9000 | 610,000 | 783,972 | 2043/06/20 |
| 40回 利付国庫債券(30年) | 1.8000 | 500,000 | 633,225 | 2043/09/20 |
| 41回 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 500,000 | 623,635 | 2043/12/20 |
| 42回 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 810,000 | 1,011,179 | 2044/03/20 |
| 43回 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 520,000 | 649,740 | 2044/06/20 |
| 44回 利付国庫債券(30年) | 1.7000 | 590,000 | 737,848 | 2044/09/20 |
| 45回 利付国庫債券(30年) | 1.5000 | 580,000 | 700,564 | 2044/12/20 |
| 46回 利付国庫債券(30年) | 1.5000 | 750,000 | 906,360 | 2045/03/20 |
| 47回 利付国庫債券(30年) | 1.6000 | 710,000 | 874,720 | 2045/06/20 |
| 48回 利付国庫債券(30年) | 1.4000 | 710,000 | 842,549 | 2045/09/20 |
| 49回 利付国庫債券(30年) | 1.4000 | 800,000 | 949,648 | 2045/12/20 |
| 50回 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 610,000 | 639,389 | 2046/03/20 |
| 51回 利付国庫債券(30年) | 0.3000 | 620,000 | 576,550 | 2046/06/20 |
| 52回 利付国庫債券(30年) | 0.5000 | 680,000 | 663,442 | 2046/09/20 |
| 53回 利付国庫債券(30年) | 0.6000 | 750,000 | 748,320 | 2046/12/20 |
| 54回 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 700,000 | 731,577 | 2047/03/20 |

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | |
|------------------|--------|-------------|-------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| (国債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 55回 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 700,000 | 731,010 | 2047/06/20 |
| 56回 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 620,000 | 646,951 | 2047/09/20 |
| 57回 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 690,000 | 719,407 | 2047/12/20 |
| 58回 利付国庫債券(30年) | 0.8000 | 870,000 | 906,313 | 2048/03/20 |
| 59回 利付国庫債券(30年) | 0.7000 | 680,000 | 691,097 | 2048/06/20 |
| 60回 利付国庫債券(30年) | 0.9000 | 760,000 | 809,179 | 2048/09/20 |
| 61回 利付国庫債券(30年) | 0.7000 | 660,000 | 668,566 | 2048/12/20 |
| 2回 利付国庫債券(40年) | 2.2000 | 280,000 | 390,972 | 2049/03/20 |
| 62回 利付国庫債券(30年) | 0.5000 | 500,000 | 480,470 | 2049/03/20 |
| 63回 利付国庫債券(30年) | 0.4000 | 570,000 | 532,072 | 2049/06/20 |
| 64回 利付国庫債券(30年) | 0.4000 | 640,000 | 596,384 | 2049/09/20 |
| 65回 利付国庫債券(30年) | 0.4000 | 610,000 | 567,446 | 2049/12/20 |
| 3回 利付国庫債券(40年) | 2.2000 | 290,000 | 406,925 | 2050/03/20 |
| 66回 利付国庫債券(30年) | 0.4000 | 520,000 | 483,464 | 2050/03/20 |
| 67回 利付国庫債券(30年) | 0.6000 | 690,000 | 676,496 | 2050/06/20 |
| 68回 利付国庫債券(30年) | 0.6000 | 710,000 | 696,005 | 2050/09/20 |
| 69回 利付国庫債券(30年) | 0.7000 | 400,000 | 402,480 | 2050/12/20 |
| 4回 利付国庫債券(40年) | 2.2000 | 550,000 | 776,259 | 2051/03/20 |
| 5回 利付国庫債券(40年) | 2.0000 | 500,000 | 683,400 | 2052/03/20 |
| 6回 利付国庫債券(40年) | 1.9000 | 570,000 | 768,348 | 2053/03/20 |
| 7回 利付国庫債券(40年) | 1.7000 | 530,000 | 688,099 | 2054/03/20 |
| 8回 利付国庫債券(40年) | 1.4000 | 620,000 | 753,963 | 2055/03/20 |
| 9回 利付国庫債券(40年) | 0.4000 | 1,020,000 | 928,567 | 2056/03/20 |
| 10回 利付国庫債券(40年) | 0.9000 | 900,000 | 960,156 | 2057/03/20 |
| 11回 利付国庫債券(40年) | 0.8000 | 750,000 | 776,655 | 2058/03/20 |
| 12回 利付国庫債券(40年) | 0.5000 | 750,000 | 701,722 | 2059/03/20 |
| 13回 利付国庫債券(40年) | 0.5000 | 560,000 | 523,213 | 2060/03/20 |
| 小 計 | - | 212,920,000 | 227,135,859 | - |
| (地方債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 23年度20回 愛知県公募公債 | 1.0820 | 500,000 | 505,950 | 2022/03/29 |
| 109回 共同発行市場公募地方債 | 1.0500 | 500,000 | 506,155 | 2022/04/25 |
| 708回 東京都公募公債 | 0.8900 | 500,000 | 505,870 | 2022/06/20 |
| 111回 共同発行市場公募地方債 | 0.8900 | 700,000 | 708,288 | 2022/06/24 |
| 364回 大阪府公募公債 | 0.7900 | 300,000 | 303,675 | 2022/09/27 |
| 194回 神奈川県公募公債 | 0.7910 | 300,000 | 304,290 | 2022/12/20 |
| 24年度7回 千葉県公募公債 | 0.7400 | 300,000 | 304,020 | 2022/12/22 |
| 119回 共同発行市場公募地方債 | 0.8000 | 500,000 | 507,945 | 2023/02/24 |
| 121回 共同発行市場公募地方債 | 0.5700 | 500,000 | 506,070 | 2023/04/25 |
| 25年度4回 愛知県公募公債 | 0.8560 | 300,000 | 305,760 | 2023/05/30 |
| 720回 東京都公募公債 | 0.8700 | 300,000 | 306,006 | 2023/06/20 |
| 25年度4回 札幌市公募公債 | 0.8000 | 200,000 | 203,676 | 2023/06/20 |
| 25年度2回 横浜市公募公債 | 0.8880 | 400,000 | 408,404 | 2023/07/14 |
| 374回 大阪府公募公債 | 0.9380 | 300,000 | 306,657 | 2023/07/28 |
| 25年度5回 千葉県公募公債 | 0.8400 | 200,000 | 204,162 | 2023/08/25 |
| 128回 共同発行市場公募地方債 | 0.6600 | 300,000 | 305,367 | 2023/11/24 |
| 726回 東京都公募公債 | 0.7300 | 400,000 | 408,140 | 2023/12/20 |
| 25年度11回 福岡県公募公債 | 0.6940 | 200,000 | 204,114 | 2024/02/26 |
| 208回 神奈川県公募公債 | 0.5510 | 300,000 | 305,370 | 2024/06/20 |
| 1回 兵庫県公募公債(12年) | 1.1000 | 300,000 | 310,767 | 2024/06/26 |
| 26年度5回 埼玉県公募公債 | 0.6110 | 400,000 | 408,188 | 2024/07/29 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|-----------------------|--------|------------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (地方債証券) | % | 千円 | 千円 | |
| 488回 名古屋市公債券 10年 | 0.5980 | 450,000 | 459,342 | 2024/09/20 |
| 26年度11回 京都府公債券 | 0.4760 | 350,000 | 356,125 | 2024/12/19 |
| 142回 共同発行市場公募地方債 | 0.3450 | 500,000 | 506,395 | 2025/01/24 |
| 26年度17回 兵庫県公債券 | 0.4600 | 200,000 | 203,420 | 2025/02/26 |
| 5回 東京都公債券 20年 | 2.1100 | 100,000 | 108,538 | 2025/03/19 |
| 144回 共同発行市場公募地方債 | 0.4700 | 400,000 | 407,380 | 2025/03/25 |
| 146回 共同発行市場公募地方債 | 0.5530 | 400,000 | 409,088 | 2025/05/23 |
| 148回 共同発行市場公募地方債 | 0.5530 | 500,000 | 511,810 | 2025/07/25 |
| 1回 静岡県公債券 20年 | 2.1800 | 100,000 | 109,907 | 2025/09/19 |
| 9回 東京都公債券 20年 | 2.4400 | 200,000 | 225,162 | 2026/06/19 |
| 10回 東京都公債券 20年 | 2.3300 | 300,000 | 337,659 | 2026/09/18 |
| 4回 京都府公債券 20年 | 2.5100 | 100,000 | 113,555 | 2026/09/18 |
| 166回 共同発行市場公募地方債 | 0.1800 | 500,000 | 503,105 | 2027/01/25 |
| 29年度4回 大阪市公債券 | 0.1500 | 200,000 | 200,720 | 2027/09/21 |
| 29年度6回 広島市公債券 | 0.2300 | 300,000 | 302,616 | 2028/02/25 |
| 5回 兵庫県公債券 15年 | 1.3100 | 300,000 | 325,755 | 2028/05/26 |
| 30年度7回 神戸市公債券 30年 | 0.2540 | 300,000 | 302,910 | 2028/09/20 |
| 第91回 川崎市公債券 | 0.1850 | 200,000 | 200,902 | 2028/09/20 |
| 7回 静岡県公債券 20年 | 2.3200 | 300,000 | 349,713 | 2028/09/21 |
| 30年度14回 北海道公債券 | 0.1950 | 300,000 | 301,023 | 2028/12/28 |
| 30年度19回 愛知県公債券 | 0.1150 | 200,000 | 199,584 | 2029/03/28 |
| 802回 東京都公債券 | 0.1300 | 400,000 | 398,920 | 2030/03/19 |
| 8回 静岡県公債券 15年 | 0.8280 | 200,000 | 212,062 | 2030/06/07 |
| 36回2号 宮城県公債券 10年 | 0.1350 | 250,000 | 249,280 | 2030/10/28 |
| 19回 神奈川県公債券 20年 | 1.8180 | 100,000 | 117,027 | 2032/01/30 |
| 24年度2回 福岡県公債券(20年) | 1.6350 | 300,000 | 346,629 | 2032/08/16 |
| 10回 大阪府公債券 20年 | 1.7200 | 200,000 | 233,022 | 2032/09/24 |
| 14回 千葉県公債券 20年 | 1.1370 | 100,000 | 110,202 | 2033/04/15 |
| 14回 埼玉県公債券 20年 | 1.5460 | 300,000 | 347,556 | 2034/05/08 |
| 17回 北九州市公債券 20年 | 1.5290 | 100,000 | 115,540 | 2034/06/20 |
| 2回 横浜市公債券 30年 | 2.4900 | 100,000 | 129,352 | 2035/03/20 |
| 18回 千葉県公債券 20年 | 1.1380 | 100,000 | 110,769 | 2035/04/13 |
| 14回 大阪府公債券 20年 | 0.5400 | 100,000 | 101,754 | 2036/09/29 |
| 30年度7回 福岡市公債券 | 0.7010 | 200,000 | 207,200 | 2038/10/19 |
| 27年度8回 愛知県公債券 30年 | 1.5790 | 150,000 | 180,630 | 2045/06/20 |
| 27年度2回 広島県公債券 30年 | 0.7110 | 100,000 | 100,534 | 2046/03/22 |
| 小計 | - | 16,600,000 | 17,224,060 | - |
| (特殊債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 36回 政地方公共団体金融機構債券 | 0.9010 | 300,000 | 303,435 | 2022/05/20 |
| 96回 高速道路機構債 | 0.7960 | 700,000 | 708,715 | 2022/09/20 |
| 44回 政地方公共団体金融機構債券 | 0.8340 | 400,000 | 406,508 | 2023/01/20 |
| 5回 鉄道建設運輸施設債 | 0.8420 | 500,000 | 508,535 | 2023/03/20 |
| 189回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.5410 | 500,000 | 505,830 | 2023/04/28 |
| 193回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.8820 | 500,000 | 510,330 | 2023/06/30 |
| 50回 政地方公共団体金融機構債券 | 0.9110 | 500,000 | 510,845 | 2023/07/14 |
| 195回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.9110 | 330,000 | 337,296 | 2023/07/31 |
| 116回 高速道路機構債 | 0.7220 | 100,000 | 101,807 | 2023/09/20 |
| 56回 政地方公共団体金融機構債券 | 0.7470 | 542,000 | 553,696 | 2024/01/19 |
| 64回 政地方公共団体金融機構債券 | 0.5440 | 300,000 | 305,619 | 2024/09/13 |
| 241回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.4500 | 500,000 | 508,850 | 2025/03/31 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|------------------------|--------|------------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (特殊債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 85回 中日本高速道路債券 | 0.0700 | 300,000 | 299,988 | 2025/10/21 |
| 83回 地方公共団体金融機構債券 | 0.0900 | 400,000 | 400,100 | 2026/04/28 |
| 78回 日本政策投資銀行債券 | 0.2250 | 200,000 | 201,450 | 2027/04/13 |
| 309回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.1400 | 800,000 | 804,584 | 2027/04/30 |
| 72回 東日本高速道路社債 | 0.1200 | 200,000 | 199,936 | 2027/06/18 |
| 222回 住宅金融支援機構債券 | 0.2100 | 300,000 | 301,809 | 2027/11/19 |
| 230回 住宅金融支援機構債券 | 0.2600 | 300,000 | 302,601 | 2028/02/18 |
| 9回 新関西国際空港社債 | 1.2310 | 200,000 | 216,500 | 2028/12/20 |
| 1回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.0700 | 200,000 | 229,678 | 2028/12/20 |
| 1回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.2660 | 200,000 | 234,800 | 2029/06/28 |
| 2回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 2.2660 | 300,000 | 353,061 | 2029/08/28 |
| 39回 住宅金融支援機構債券 | 2.1500 | 200,000 | 233,760 | 2029/09/20 |
| 109回 都市再生機構債券 | 0.9180 | 200,000 | 213,174 | 2030/06/20 |
| 15回 日本政策金融公庫債券 | 1.9110 | 200,000 | 232,584 | 2030/10/29 |
| 121回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8000 | 500,000 | 580,090 | 2030/10/31 |
| 75回 住宅金融支援機構債券 | 2.0660 | 350,000 | 415,009 | 2031/06/13 |
| 9回 地方公共団体金融機構債券 | 1.8400 | 200,000 | 233,608 | 2031/12/26 |
| 13回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 1.9600 | 9,602 | 9,625 | 2032/05/10 |
| 14回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 1.7000 | 48,380 | 48,479 | 2032/05/10 |
| 15回 国際協力機構債 | 1.7240 | 100,000 | 116,203 | 2032/09/17 |
| 24回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 1.7020 | 200,000 | 231,992 | 2032/09/28 |
| 28回 日本道路・機構承継債 | 2.8300 | 400,000 | 524,544 | 2033/12/20 |
| 239回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.1600 | 300,000 | 334,509 | 2035/02/28 |
| 44回 地方公共団体金融機構債券 20年 | 1.2980 | 200,000 | 224,840 | 2035/06/28 |
| 172回 高速道路機構債 | 0.2880 | 200,000 | 195,472 | 2036/06/20 |
| 6回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券 | 2.2600 | 33,729 | 34,375 | 2037/05/10 |
| 8回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券 | 2.1500 | 23,700 | 24,300 | 2037/05/10 |
| 9回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券 | 2.1900 | 35,535 | 36,439 | 2037/05/10 |
| 319回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.6300 | 200,000 | 206,776 | 2037/07/31 |
| 26回 高速道路機構債 | 2.6700 | 200,000 | 269,850 | 2037/09/18 |
| 2回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券 | 2.2700 | 37,851 | 39,092 | 2037/11/10 |
| 43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.2800 | 12,520 | 12,966 | 2041/06/10 |
| 44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.3000 | 48,532 | 49,903 | 2041/07/10 |
| 51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 2.2100 | 36,441 | 37,518 | 2042/02/10 |
| 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 2.1300 | 59,815 | 61,473 | 2042/05/10 |
| 29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.9500 | 126,650 | 135,786 | 2044/10/10 |
| 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.8100 | 201,216 | 212,960 | 2045/05/10 |
| 260回 政日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.3900 | 200,000 | 232,750 | 2045/10/31 |
| 169回 高速道路機構債 | 1.2000 | 100,000 | 109,874 | 2045/12/20 |
| 19回 高速道路機構債 | 2.7500 | 150,000 | 219,892 | 2047/03/20 |
| 131回 日本政策投資銀行債券 | 0.7000 | 100,000 | 97,973 | 2050/06/20 |
| 165回 都市再生機構債券 | 0.7090 | 100,000 | 98,305 | 2050/06/20 |
| 114回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3400 | 243,543 | 244,073 | 2051/11/10 |
| 126回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4300 | 256,239 | 258,150 | 2052/11/10 |
| 128回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4200 | 256,635 | 258,377 | 2053/01/10 |
| 131回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4000 | 261,603 | 262,976 | 2053/04/10 |
| 132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4000 | 261,339 | 262,708 | 2053/05/10 |
| 137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4700 | 269,649 | 272,447 | 2053/10/10 |
| 小計 | - | 14,894,979 | 15,838,836 | - |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|--------------------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (金融債券) | % | 千円 | 千円 | |
| い第828号 利付商工債 | 0.1400 | 100,000 | 100,245 | 2024/05/27 |
| 369回 利附信金中金債(5年) | 0.0600 | 400,000 | 400,076 | 2025/08/27 |
| 小計 | - | 500,000 | 500,321 | - |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 13回 パナソニック社債 | 0.5680 | 100,000 | 100,504 | 2022/03/18 |
| 9回 西日本旅客鉄道社債 | 2.2800 | 200,000 | 204,970 | 2022/03/25 |
| 45回 住友商事社債 | 1.1170 | 100,000 | 101,167 | 2022/04/20 |
| 23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債 | 0.0900 | 100,000 | 99,933 | 2022/05/23 |
| 1回 BPCE SA円債社債(ノンチャルボンド) | 0.2140 | 200,000 | 200,026 | 2022/06/30 |
| 21回 東日本旅客鉄道社債 | 2.0200 | 100,000 | 103,163 | 2022/09/20 |
| 94回 丸紅社債 | 1.1700 | 100,000 | 101,679 | 2022/10/12 |
| 57回 東京三菱銀行社債 | 2.2200 | 200,000 | 207,266 | 2022/10/27 |
| 19回 三菱ケミカルホールディングス社債 | 0.4760 | 100,000 | 100,632 | 2022/12/02 |
| 11回 東海旅客鉄道社債 | 1.1500 | 300,000 | 306,135 | 2022/12/20 |
| 18回 大阪ガス社債 | 1.4700 | 100,000 | 102,634 | 2022/12/20 |
| 518回 中部電力社債 | 0.1900 | 200,000 | 200,522 | 2023/01/25 |
| 14回 トヨタ自動車社債 | 0.9630 | 200,000 | 203,664 | 2023/03/20 |
| 10回 セブン銀行社債 | 0.8030 | 100,000 | 101,449 | 2023/03/20 |
| 47回 日立キャピタル社債 | 0.8740 | 200,000 | 203,150 | 2023/03/20 |
| 301回 北陸電力社債 | 1.1580 | 100,000 | 102,272 | 2023/03/24 |
| 23回 東京瓦斯社債 | 1.0100 | 300,000 | 306,687 | 2023/06/09 |
| 27回 NTTデータ社債 | 0.9000 | 100,000 | 101,833 | 2023/06/20 |
| 253回 四国電力社債 | 1.0000 | 200,000 | 204,340 | 2023/06/23 |
| 6回 JXホールディングス社債 | 1.1190 | 100,000 | 102,389 | 2023/07/19 |
| 377回 中国電力社債 | 1.1210 | 400,000 | 410,484 | 2023/08/25 |
| 10回 西日本旅客鉄道社債 | 2.0400 | 300,000 | 315,429 | 2023/09/20 |
| 48回 クレディセゾン社債 | 1.0380 | 100,000 | 102,394 | 2023/10/20 |
| 47回 住友商事社債 | 0.8580 | 100,000 | 101,811 | 2023/10/23 |
| 424回 九州電力社債 | 1.2330 | 200,000 | 206,326 | 2023/11/24 |
| 13回 東海旅客鉄道社債 | 2.0150 | 200,000 | 211,196 | 2023/12/20 |
| 38回 電源開発社債 | 0.9780 | 300,000 | 307,551 | 2023/12/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|--------------------------|--------|-------------|-------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| (普通社債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 471回 東北電力社債 | 1.1680 | 400,000 | 412,360 | 2023/12/25 |
| 426回 九州電力社債 | 1.0640 | 400,000 | 411,680 | 2024/02/23 |
| 16回 トヨタ自動車社債 | 0.6450 | 200,000 | 203,324 | 2024/03/19 |
| 14回 東海旅客鉄道社債 | 2.2000 | 100,000 | 106,595 | 2024/03/19 |
| 72回 三菱地所社債 | 2.2800 | 100,000 | 107,569 | 2024/09/20 |
| 10回 三井住友信託銀行社債 | 0.5850 | 200,000 | 203,108 | 2024/10/28 |
| 6回 クレディ・アグリコル・エス・エー・円債社債 | 0.8650 | 200,000 | 204,512 | 2024/11/28 |
| 321回 北海道電力社債 | 0.8860 | 161,000 | 165,607 | 2024/12/25 |
| 39回 東日本旅客鉄道社債 | 2.0500 | 300,000 | 325,155 | 2025/06/20 |
| 13回 電源開発社債 | 2.0400 | 200,000 | 216,228 | 2025/06/20 |
| 42回 東日本旅客鉄道社債 | 2.1100 | 200,000 | 218,268 | 2025/09/19 |
| 4回 東京地下鉄社債 | 2.3800 | 120,000 | 134,320 | 2026/06/19 |
| 307回 北陸電力社債 | 1.0550 | 100,000 | 104,642 | 2026/06/25 |
| 33回 西日本高速道路債 | 0.2700 | 300,000 | 302,778 | 2026/12/14 |
| 34回 西日本高速道路債 | 0.3350 | 200,000 | 202,562 | 2027/02/16 |
| 508回 関西電力社債 | 0.4550 | 300,000 | 303,708 | 2027/04/23 |
| 340回 北海道電力社債 | 0.4800 | 300,000 | 304,260 | 2027/04/23 |
| 108回 住友不動産社債 | 0.4000 | 200,000 | 200,200 | 2027/05/07 |
| 56回 三菱UFJリース社債 | 0.4550 | 200,000 | 202,036 | 2028/01/18 |
| 7回 ファーストリテイリング社債 | 0.4050 | 200,000 | 202,072 | 2028/06/06 |
| 14回 プリズトン社債 | 0.3750 | 200,000 | 200,284 | 2029/04/19 |
| 80回 東京急行電鉄社債 | 1.2110 | 100,000 | 107,232 | 2029/04/27 |
| 18回 NTTファイナンス社債 | 0.3800 | 200,000 | 201,788 | 2030/09/20 |
| 73回 東日本旅客鉄道普通社債 | 2.0980 | 200,000 | 235,190 | 2030/12/20 |
| 350回 北海道電力社債 | 0.7540 | 200,000 | 202,868 | 2038/03/25 |
| 43回 京浜急行電鉄社債 | 0.6760 | 100,000 | 99,910 | 2038/07/12 |
| 71回 西日本旅客鉄道社債 | 0.9560 | 100,000 | 98,726 | 2059/12/24 |
| 47回 東京地下鉄社債 | 0.9090 | 100,000 | 97,235 | 2060/09/17 |
| 小計 | - | 10,281,000 | 10,583,824 | - |
| 合計 | - | 255,195,979 | 271,282,901 | - |

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 271,282,901 | % 99.2 |
| コール・ローン等、その他 | 2,188,062 | 0.8 |
| 投資信託財産総額 | 273,470,964 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|---|
| (A) 資 産 | 273,470,964,587円 |
| コ ー ル ・ 公 社 未 前 負 未 払 純 資 産 元 次 受 取 払 解 約 総 額 (A - B) 期 繰 越 損 益 総 口 数 | 1,577,987,460 271,282,901,629 528,367,341 81,708,157 124,841,000 124,841,000 273,346,123,587 209,919,027,595 63,427,095,992 209,919,027,595円 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D) | 13,022円 |

| | | | |
|--------------------------------|------------------|--|------------------|
| (注1) 期首元本額 | 168,870,516,479円 | リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C) | 25,891,763円 |
| 追加設定元本額 | 167,666,444,476円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 37,090,342円 |
| 一部解約元本額 | 126,617,933,360円 | 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 588,184,487円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | | リスクコントロール世界資産分散ファンド | 1,654,944,013円 |
| D I A M国内債券パッシブ・ファンド | 20,138,397,472円 | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 4,553,714,682円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 75,739,659円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 8,354,710円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 64,284,684円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 4,154,214円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 13,922,204円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 4,151,302円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 698,579,753円 | 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 10,186,401円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 175,024,830円 | D I A Mエマージング債券ファンド | 9,450,010円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 22,170,668円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 1,324,203円 |
| たわらノーロード 国内債券 | 13,371,410,550円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 18,427,003円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 1,375,425,101円 | マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 1,519,942,923円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 479,364,723円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 9,097,902円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 771,140,997円 | D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) | 7,795,147,063円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 94,268,225円 | Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 1,101,630,563円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 35,956,909円 | D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 308,141,870円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 841,677,984円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定) | 5,804,574,674円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 857,299,721円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定) | 5,780,092,239円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 267,544,001円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定) | 5,759,938,173円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 94,593,242円 | One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV (適格機関投資家限定) | 5,767,537,679円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 11,595,925円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 2,207,986円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 7,216,822円 | D I A Mグローバル・バランスファンド25VA | 194,833,349円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 15,550,209円 | D I A Mグローバル・バランスファンド50VA | 115,400,455円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 3,935,187円 | D I A M国際分散バランスファンド30VA | 41,774,211円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 2,527,471円 | D I A M国際分散バランスファンド50VA | 118,714,473円 |
| D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金> | 14,617,188,939円 | D I A M国内重視バランスファンド30VA | 47,275,935円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 7,945,845,516円 | D I A M国内重視バランスファンド50VA | 10,741,315円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 10,564,168,081円 | D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 63,831,542円 |
| D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 4,214,698,647円 | D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 147,396,923円 |
| D I A M DCバランス30インデックスファンド | 1,934,636,468円 | D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 4,113,378,518円 |
| D I A M DCバランス50インデックスファンド | 2,100,996,248円 | D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 2,455,390,819円 |
| D I A M DCバランス70インデックスファンド | 317,515,894円 | D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 4,620,892,716円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 69,643,768円 | D I A Mグローバル・アセット・バランスVA | 512,197,093円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 2,183,121,770円 | D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 209,605,289円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション | 9,343,546円 | D I A M アグサ グローバル バランスファンド30VA | 2,518,908,521円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 3,834,269,246円 | D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) | 229,606,580円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 1,215,297,756円 | D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 10,843,033円 |
| D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 244,940,249円 | D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 2,800,949,726円 |
| 投資のソムリエ | 19,968,780,596円 | D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 54,001,054円 |
| クルーズコントロール | 1,710,359,908円 | D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 448,922,701円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 1,200,230,759円 | D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 713,955,739円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 3,601,786,821円 | D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) | 1,210,800,648円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 458,001,465円 | D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定) | 338,532,229円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 6,432,489円 | D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定) | 106,770,675円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 14,490,817円 | Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定) | 928,960,030円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 2,572,825,479円 | コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 382,409,178円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 28,534,806,570円 | 期末元本合計 | 209,919,027,595円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 15,124,286円 | | |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 7,164,986円 | | |

■損益の状況

当期 自2020年2月15日 至2021年2月15日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-------|----------------|---|------------------------|
| (A) 配 | 当 等 収 益 | | 1,854,548,870円 |
| 受 | 取 利 息 | | 1,855,446,015 |
| 支 | 払 利 息 | | △897,145 |
| (B) 有 | 価 証 券 売 買 損 益 | | △5,046,081,656 |
| 売 | 買 益 | | 53,162,300 |
| 売 | 買 損 | | △5,099,243,956 |
| (C) 当 | 期 損 益 金(A+B) | | △3,191,532,786 |
| (D) 前 | 期 繰 越 損 益 金 | | 53,988,844,136 |
| (E) 解 | 約 差 損 益 金 | | △39,191,042,382 |
| (F) 追 | 加 信 託 差 損 益 金 | | 51,820,827,024 |
| (G) 合 | 計(C+D+E+F) | | 63,427,095,992 |
| 次 | 期 繰 越 損 益 金(G) | | 63,427,095,992 |

(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)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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月18日～2021年2月15日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2002年9月2日から無期限です。 |
| 運用方針 | 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 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には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | MSCIコクサイ・インデックス | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|------|---------------------------------------|-----------|------------|------------|----------------|
| | 円 | 騰落率 | （円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | 騰落率 | | | |
| 15期(2017年2月15日) | 30,270 | 26.6 | ポイント 971,437.64 | % 27.0 | % 95.6 | % 1.7 | 百万円 278,963 |
| 16期(2018年2月15日) | 33,302 | 10.0 | 1,070,930.74 | 10.2 | 95.7 | 2.2 | 284,448 |
| 17期(2019年2月15日) | 34,418 | 3.4 | 1,111,144.35 | 3.8 | 95.3 | 2.0 | 349,689 |
| 18期(2020年2月17日) | 41,812 | 21.5 | 1,354,548.25 | 21.9 | 94.7 | 2.7 | 370,420 |
| 19期(2021年2月15日) | 47,083 | 12.6 | 1,529,401.79 | 12.9 | 95.5 | 2.5 | 477,565 |

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

(注4) MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

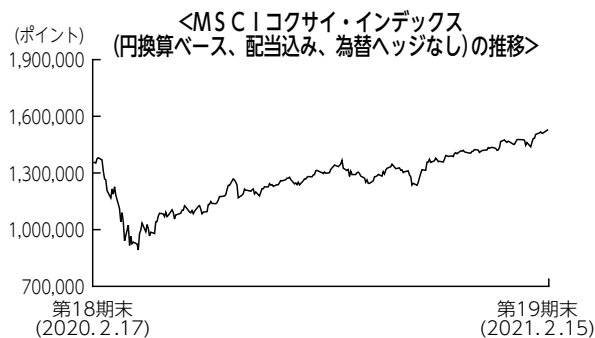
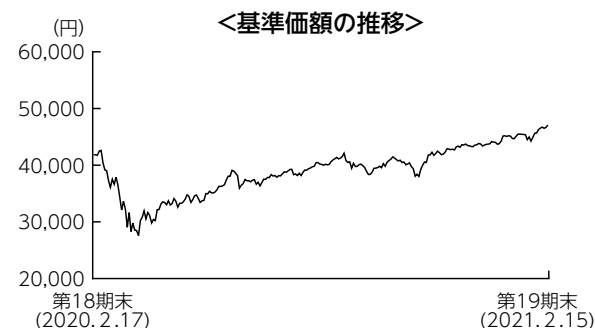
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 |
|-----------------------|---------|--------|--|--------|-------------|-------------|
| | 円 | 騰 落 率 | ポ イ ン ト | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2020年 2月 17日 | 41,812 | % - | 1,354,548.25 | % - | % 94.7 | % 2.7 |
| 2 月 末 | 37,252 | △10.9 | 1,206,797.36 | △10.9 | 95.7 | 1.4 |
| 3 月 末 | 31,648 | △24.3 | 1,027,164.79 | △24.2 | 96.5 | 2.6 |
| 4 月 末 | 34,754 | △16.9 | 1,126,486.20 | △16.8 | 94.3 | 3.0 |
| 5 月 末 | 36,243 | △13.3 | 1,175,146.51 | △13.2 | 94.1 | 3.4 |
| 6 月 末 | 36,940 | △11.7 | 1,198,230.56 | △11.5 | 96.0 | 1.5 |
| 7 月 末 | 38,177 | △8.7 | 1,236,614.10 | △8.7 | 95.4 | 2.2 |
| 8 月 末 | 41,110 | △1.7 | 1,333,631.14 | △1.5 | 90.7 | 7.9 |
| 9 月 末 | 39,487 | △5.6 | 1,281,404.41 | △5.4 | 95.4 | 2.1 |
| 10 月 末 | 38,389 | △8.2 | 1,245,785.85 | △8.0 | 95.9 | 1.6 |
| 11 月 末 | 42,818 | 2.4 | 1,390,283.49 | 2.6 | 95.9 | 2.9 |
| 12 月 末 | 44,055 | 5.4 | 1,430,471.52 | 5.6 | 96.0 | 2.3 |
| 2021年 1 月 末 | 44,967 | 7.5 | 1,461,431.17 | 7.9 | 96.1 | 1.7 |
| (期 末) 2021年 2月 15日 | 47,083 | 12.6 | 1,529,401.79 | 12.9 | 95.5 | 2.5 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月18日から2021年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は47,083円となり、前期末比で12.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

株式市場では米国市場が新型コロナウイルスの感染拡大への懸念による急落から反発し、前期末の水準を大きく上回る上昇となり、基準価額を押し上げました。為替市場では米ドルなど一部の通貨が円高となりマイナスに寄与したものの、ユーロなどの欧州通貨が円安となりプラスの寄与となりました。こうした要因から当期の基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は2020年2月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から急落しましたが、3月下旬以降は米景気対策法案への期待などから反発しました。その後も欧米における新型コロナウイルスの感染拡大から調整する場面もありましたが、ワク

チン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感などを受けて堅調に推移しました。欧州市場は急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

為替市場はまちまちの値動きとなりました。新型コロナウイルスの感染拡大から大きく変動した2020年2月、3月を除いて、米ドルに対してはほぼ一貫して円高となりました。これは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因です。一方でユーロなど他の多くの通貨に対しては円安となりました。経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退したことから、安全資産と見られた円が売られ、その他の通貨が買われたためです。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

| No. | 業種 | 比率 |
|-----|------------------------|-------|
| 1 | ソフトウェア・サービス | 10.3% |
| 2 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.9 |
| 3 | 銀行 | 7.3 |
| 4 | 資本財 | 6.7 |
| 5 | メディア・娯楽 | 6.1 |
| 6 | ヘルスケア機器・サービス | 4.9 |
| 7 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.9 |
| 8 | 小売 | 4.8 |
| 9 | 食品・飲料・タバコ | 4.6 |
| 10 | エネルギー | 4.5 |

期末

| No. | 業種 | 比率 |
|-----|------------------------|-------|
| 1 | ソフトウェア・サービス | 12.1% |
| 2 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.6 |
| 3 | メディア・娯楽 | 7.1 |
| 4 | 資本財 | 6.2 |
| 5 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.1 |
| 6 | 小売 | 5.8 |
| 7 | 銀行 | 5.6 |
| 8 | ヘルスケア機器・サービス | 5.1 |
| 9 | 半導体・半導体製造装置 | 4.6 |
| 10 | 各種金融 | 4.4 |



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で12.9%上昇しました。

当ファンドはベンチマーク比で△0.3%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-------------|------|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) 売買委託手数料 | 1円 | 0.004% |
| (株 式) | (1) | (0.002) |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) |
| (先物・オプション) | (1) | (0.002) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (b) 有価証券取引税 | 5 | 0.013 |
| (株 式) | (5) | (0.012) |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.000) |
| (投 資 証 券) | (0) | (0.000) |
| (c) その他費用 | 9 | 0.024 |
| (保 管 費 用) | (0) | (0.000) |
| (そ の 他) | (9) | (0.024) |
| 合 計 | 16 | 0.040 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(39,034円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については10ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | | |
|---|----------|--------------------------------|---------------------------------|--------------------------|------------------------|----------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| 外 | ア メ リ カ | 百株 76,463.16 (14,562.26) | 千アメリカ・ドル 701,987 (△3,608) | 百株 45,411.7 | 千アメリカ・ドル 353,039 | |
| | カ ナ ダ | 百株 12,093.39 (△21.96) | 千カナダ・ドル 51,424 (△0.21676) | 百株 7,238.68 | 千カナダ・ドル 24,349 | |
| | オーストラリア | 百株 21,852.12 (453.07) | 千オーストラリア・ドル 36,147 (-) | 百株 14,694.93 | 千オーストラリア・ドル 16,462 | |
| | 香 港 | 百株 19,390 (△2,849.15) | 千香港・ドル 83,001 (-) | 百株 12,540.48 | 千香港・ドル 48,260 | |
| | シンガポール | 百株 8,246.5 (2,113.75) | 千シンガポール・ドル 3,326 (-) | 百株 12,498.19 | 千シンガポール・ドル 2,401 | |
| | ニュージーランド | 百株 872.37 (-) | 千ニュージーランド・ドル 822 (-) | 百株 719.94 | 千ニュージーランド・ドル 502 | |
| | イ ギ リ ス | 百株 78,899.1 (5,792.39) | 千イギリス・ポンド 42,047 (△8) | 百株 50,946.95 | 千イギリス・ポンド 18,921 | |
| | イスラエル | 百株 496.65 (39.42) | 千イスラエル・シケル 1,841 (-) | 百株 39.42 | 千イスラエル・シケル 32 | |
| | ス イ ス | 百株 4,418.96 (0.31) | 千スイス・フラン 31,583 (△340) | 百株 2,215.29 | 千スイス・フラン 15,848 | |
| | デンマーク | 百株 1,158.98 (-) | 千デンマーク・クローネ 58,612 (-) | 百株 555.11 | 千デンマーク・クローネ 28,435 | |
| | ノルウェー | 百株 1,469.2 (-) | 千ノルウェー・クローネ 19,876 (-) | 百株 582.96 | 千ノルウェー・クローネ 8,645 | |
| | スウェーデン | 百株 6,788.69 (375.01) | 千スウェーデン・クローナ 111,556 (-) | 百株 3,516.25 | 千スウェーデン・クローナ 42,207 | |
| 国 | イ | イ ギ リ ス | 百株 269.98 (-) | 千ユーロ 1,265 (-) | 百株 1,401.32 | 千ユーロ 6,758 |
| | | アイルランド | 百株 458.5 (1.04) | 千ユーロ 2,589 (-) | 百株 1,443.88 | 千ユーロ 982 |
| | | オランダ | 百株 4,881.21 (839.88) | 千ユーロ 15,275 (△4) | 百株 3,280.09 | 千ユーロ 7,736 |
| | | ベルギー | 百株 432.31 (-) | 千ユーロ 2,499 (-) | 百株 232.58 | 千ユーロ 900 |
| | | ルクセンブルグ | 百株 569.96 (101.97) | 千ユーロ 530 (-) | 百株 306.11 | 千ユーロ 153 |
| | | フランス | 百株 6,144.78 (△285.63) | 千ユーロ 29,258 (△125) | 百株 3,419.66 | 千ユーロ 14,451 |
| | | ドイツ | 百株 6,260.14 (378.62) | 千ユーロ 29,572 (△322) | 百株 3,026.64 | 千ユーロ 12,394 |

| | | 買 付 | | 売 付 | | |
|-----|---------|-------------|--------------------------|-----------------------|-----------|---------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| 外 国 | ユ ー ロ ム | ポ ル ト ガ ル | 370.56 (2,016.06) | 千ユーロ 154 (-) | 2,016.06 | 百株 千ユーロ 18 |
| | | ス ペ イ ン | 11,323.51 (36,219.26) | 千ユーロ 6,785 (△1) | 47,689.27 | 百株 千ユーロ 4,268 |
| | | イ タ リ ア | 8,841.37 (-) | 千ユーロ 6,080 (-) | 3,017.58 | 百株 千ユーロ 2,303 |
| | | フ ィ ン ラ ン ド | 2,365.02 (-) | 千ユーロ 3,003 (-) | 1,056.68 | 百株 千ユーロ 1,660 |
| | | オ ー ス ト リ ア | 213.07 (-) | 千ユーロ 503 (-) | 140.25 | 百株 千ユーロ 378 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および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。

(2) 新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|---------|--------|-----------------|--------------|-----------------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外 国 | ア メ リ カ | 9,583 | 千アメリカ・ドル 153 | 9,583 (-) | 千アメリカ・ドル 29 (-) |
| | ス イ ス | 87,844 | 千スイス・フラン 17 | 証券 (-) | 千スイス・フラン (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------|--|---------------|--------------|---------------|------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | | | 千アメリカ・ドル | | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 4.85 (-) | 777 (-) | 1.49 (-) | 258 (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 4.047 (-) | 379 (-) | 3.127 (-) | 267 (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | 4.922 (-) | 183 (-) | - (-) | - (-) |
| SL GREEN | | 2.636 (-) | 121 (-) | 9.733 (-) | 487 (-) |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | | 42.275 (-) | 276 (-) | 22.963 (-) | 139 (-) |
| PROLOGIS INC | | 18.354 (-) | 1,753 (-) | 8.083 (-) | 798 (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 2.743 (-) | 435 (-) | 0.905 (-) | 145 (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 6.861 (-) | 594 (-) | 5.28 (-) | 501 (-) |
| EQUINIX INC | | 2.314 (-) | 1,707 (-) | 0.844 (-) | 633 (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | | - (-) | - (-) | 13.649 (-) | 514 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------|-----------|----------|-------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| DUKE REALTY TRUST | 9.24 | 334 | 4.589 | 173 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 11.24 | 1,808 | 3.992 | 639 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1.316 | 285 | 0.887 | 186 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 14.226 | 867 | 6.987 | 404 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | - | - | 6 | 523 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 11.492 | 269 | 6.111 | 200 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 1.835 | 527 | 0.775 | 231 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 15.617 | 849 | 9.305 | 519 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | - | - | 32.98 | 366 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 5.143 | 127 | 4.529 | 143 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 2.461 | 151 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 8.836 | 125 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 4.745 | 576 | 2.725 | 311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 9.434 | 560 | 3.459 | 207 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 3.096 | 123 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 10.298 | 374 | 5.586 | 190 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 7.149 | 492 | 2.372 | 151 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PUBLIC STORAGE | 3.283 | 697 | 1.637 | 311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 2.252 | 330 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VENTAS INC | 8.055 | 304 | 2.539 | 132 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 3.954 | 132 | 3.712 | 139 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WEYERHAEUSER CO | 15.289 | 354 | 8.814 | 254 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 3.124 | 339 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 9.706 | 1,350 | 1.819 | 276 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 21.376 | 429 | 7.418 | 132 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AGNC INVESTMENT CORP | 9.532 | 111 | 8.245 | 149 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 20.066 | 138 | - | - |
| | (△82.136) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN TOWER CORP | 10.881 | 2,582 | 5.358 | 1,305 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 7.024 | 454 | 4.534 | 323 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|-----------|-------------|--------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| INVITATION HOMES INC | 8.091 | 231 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| VICI PROPERTIES INC | 30.263 | 635 | 17.38 | 344 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | — | — | 3.067 | 73 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 3.947 | 157 | 3.812 | 220 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | — | — | 10.748 | 104 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 12.935 | 174 | 30.611 | 555 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| DEXUS | 24.397 | 218 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| GOODMAN GROUP | 30.602 | 436 | 14.296 | 213 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| VICINITY CENTRES | 101.268 | 160 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 66.3 | 4,266 | 24 | 1,464 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 136.1 | 294 | — | — |
| | (148.536) | (375) | (—) | (—) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 161.8 | 490 | 70 | 236 |
| | (—) | (△7) | (—) | (—) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | — | — | — | — |
| | (△206.3) | (△429) | (—) | (—) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 563.1 | 1,151 | 293 | 609 |
| | (—) | (△2) | (—) | (—) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | — | — | — | — |
| | (—) | (△1) | (—) | (—) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| SEGRO PLC | 13.709 | 129 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| ICADE | — | — | 2.234 | 138 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| KLEPIERRE | 4.769 | 104 | 4.712 | 125 |
| | (—) | (△14) | (—) | (—) |
| COVIVIO | 1.942 | 112 | 1.544 | 148 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 2.022 | 119 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|-----------|----------------|----------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 株式先物取引 | 百万円 147,648 | 百万円 147,076 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 160,063,426千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 346,644,284千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 0.46 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------------|----------|-----------|----------|------------|-------|--------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 千円 | 千円 | | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | | |
| AMAZON.COM INC | 325.49 | 380.64 | 124,762 | 13,115,060 | | | インターネット販売・通信販売 |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,365.53 | 1,585.92 | 20,336 | 2,137,746 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| AES CORP | 475.98 | 567.35 | 1,618 | 170,152 | | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ABIOMED INC | 35.74 | 39.87 | 1,309 | 137,620 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 684.81 | 798.02 | 9,640 | 1,013,365 | | | 情報技術サービス |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 790.23 | 1,053.11 | 9,875 | 1,038,061 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| ADOBE INC | 375.4 | 429.77 | 21,438 | 2,253,630 | | | ソフトウェア |
| CHUBB LTD | 352.14 | 406.4 | 6,671 | 701,304 | | | 保険 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 173.59 | 198.54 | 5,172 | 543,781 | | | 化学 |
| ALLEGHANY CORP | 10.94 | 12.63 | 769 | 80,865 | | | 保険 |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC | 60.52 | 60.52 | 551 | 57,937 | | | バイオテクノロジー |
| RALPH LAUREN CORP | 34.22 | - | - | - | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ALLSTATE CORP | 258.32 | 283.81 | 2,963 | 311,557 | | | 保険 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 556.87 | 627.86 | 12,781 | 1,343,575 | | | コングロマリット |
| AMGEN INC | 464.84 | 524.53 | 12,442 | 1,307,942 | | | バイオテクノロジー |
| HESS CORP | 213.67 | 247.76 | 1,486 | 156,267 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 544.74 | 616.15 | 7,986 | 839,544 | | | 消費者金融 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 392.77 | 450.17 | 3,538 | 371,997 | | | 電力 |
| AFLAC INC | 570.28 | 582.83 | 2,734 | 287,465 | | | 保険 |
| AMERICAN INTL GROUP | 680.37 | 754.5 | 3,123 | 328,355 | | | 保険 |
| AMERCO | 5.85 | 9.29 | 464 | 48,851 | | | 陸運・鉄道 |
| ANALOG DEVICES | 291.05 | 335.79 | 5,398 | 567,525 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 181.92 | 192.19 | 3,044 | 319,995 | | | バイオテクノロジー |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 604.52 | 653.14 | 3,499 | 367,869 | | | 建設関連製品 |
| JONES LANG LASALLE INC | 40.87 | - | - | - | | | 不動産管理・開発 |
| VALERO ENERGY CORP | 314.33 | 374 | 2,421 | 254,524 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| APACHE CORP | 314.7 | - | - | - | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ANSYS INC | 67.7 | 79.7 | 3,216 | 338,138 | | | ソフトウェア |
| APPLE INC | 3,499.77 | 15,286.24 | 206,929 | 21,752,463 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| APPLIED MATERIALS INC | 711.21 | 818.51 | 9,552 | 1,004,107 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| ALBEMARLE CORP | 76.34 | 95.36 | 1,570 | 165,039 | | | 化学 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 421.46 | 517.45 | 2,883 | 303,085 | | | 食品 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 78.13 | 92.78 | 706 | 74,308 | | | 電力 |
| AMEREN CORP | 194.87 | 222.73 | 1,632 | 171,573 | | | 総合公益事業 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 57.95 | 66.51 | 698 | 73,467 | | | 電子装置・機器・部品 |
| AUTOLIV INC | 59.13 | 75.7 | 713 | 75,016 | | | 自動車部品 |
| AUTODESK INC | 172.35 | 198.42 | 6,054 | 636,458 | | | ソフトウェア |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 334.93 | 386.31 | 6,452 | 678,290 | | | 情報技術サービス |
| AUTOZONE INC | 19.17 | 21.6 | 2,476 | 260,357 | | | 専門小売り |
| AVERY DENNISON CORP | 65.49 | 76.27 | 1,351 | 142,094 | | | 容器・包装 |
| BALL CORP | 252.62 | 288.47 | 2,586 | 271,945 | | | 容器・包装 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 1,020.32 | 1,250.78 | 30,326 | 3,187,912 | | | 各種金融サービス |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 666.37 | 702.98 | 2,947 | 309,851 | | | 資本市場 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 370.97 | 443.26 | 3,489 | 366,846 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| BECTON DICKINSON & CO | 207.72 | 260.87 | 6,686 | 702,897 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| AMETEK INC | 178.21 | 200.08 | 2,435 | 256,069 | | | 電気設備 |
| VERIZON COMM INC | 3,203.11 | 3,685.67 | 19,976 | 2,099,911 | | | 各種電気通信サービス |
| WR BERKLEY CORP | 122.01 | 125.11 | 849 | 89,272 | | | 保険 |
| BEST BUY CO INC | 187.2 | 215.6 | 2,598 | 273,122 | | | 専門小売り |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A | 15.24 | 18.59 | 1,231 | 129,435 | | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| YUM! BRANDS INC | 231.1 | 273.93 | 2,889 | 303,706 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| FIRSTENERGY CORP | 435.84 | 478 | 1,493 | 156,972 | | | 電力 |
| BOEING CO | 413.69 | 481.42 | 10,156 | 1,067,703 | | | 航空宇宙・防衛 |
| ROBERT HALF INTL INC | 83.24 | 111.11 | 819 | 86,174 | | | 専門サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| BORGLWARNER INC | 172.1 | 219.38 | 921 | 96,834 | 自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,066.58 | 1,290.98 | 4,956 | 520,982 | ヘルスケア機器・用品 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 99.88 | 117.19 | 1,069 | 112,472 | 航空貨物・物流サービス |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 87.66 | 106.87 | 2,135 | 224,526 | 娯楽 |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC | 19.29 | 22.08 | 2,695 | 283,321 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,814.88 | 2,018.55 | 12,109 | 1,272,927 | 医薬品 |
| INGREDION INC | 53.05 | - | - | - | 食品 |
| ONEOK INC | 324.27 | 392.84 | 1,772 | 186,283 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 59 | 80.93 | 874 | 91,913 | 保険 |
| UNITED RENTALS INC | 61.81 | 61.81 | 1,769 | 185,970 | 商社・流通業 |
| SEMPRA ENERGY | 215.99 | 261.13 | 3,251 | 341,752 | 総合公益事業 |
| FEDEX CORP | 193.68 | 224.18 | 5,895 | 619,780 | 航空貨物・物流サービス |
| VERISIGN INC | 80.48 | 87.62 | 1,773 | 186,413 | 情報技術サービス |
| AMPHENOL CORP | 227.63 | 262.07 | 3,561 | 374,388 | 電子装置・機器・部品 |
| BROWN-FORMAN CORP | 243.81 | 260.85 | 2,004 | 210,726 | 飲料 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 1,252.54 | 971.36 | 591 | 62,184 | メディア |
| CSX CORP | 595.4 | 686.59 | 6,188 | 650,579 | 陸運・鉄道 |
| CABOT OIL & GAS CORP | 314.16 | 314.16 | 572 | 60,203 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAMPBELL SOUP CO | 140.5 | 166.23 | 777 | 81,691 | 食品 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 200.52 | 196.41 | 1,418 | 149,089 | コンピュータ・周辺機器 |
| CONSTELLATION BRANDS INC | 128.2 | 146.75 | 3,540 | 372,191 | 飲料 |
| CARDINAL HEALTH INC | 229.5 | 247.18 | 1,281 | 134,750 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED | 319.62 | 471.45 | 971 | 102,091 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CATERPILLAR INC | 432.58 | 486.12 | 9,624 | 1,011,747 | 機械 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 98.65 | 98.65 | 1,190 | 125,187 | ソフトウェア |
| CITRIX SYSTEMS INC | 94.64 | 99.33 | 1,367 | 143,759 | ソフトウェア |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC | 804.24 | 804.24 | 947 | 99,590 | 各種電気通信サービス |
| CERNER CORP | 251.43 | 272.58 | 2,042 | 214,758 | ヘルスケア・テクノロジー |
| JPMORGAN CHASE & CO | 2,476.52 | 2,725.45 | 38,496 | 4,046,802 | 銀行 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 198.96 | 212.87 | 1,765 | 185,593 | 家庭用品 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 112.22 | 128.72 | 1,189 | 125,053 | 保険 |
| CINTAS CORP | 66.04 | 80.99 | 2,773 | 291,542 | 商業サービス・用品 |
| CISCO SYSTEMS INC | 3,309.4 | 3,769.58 | 17,826 | 1,873,905 | 通信機器 |
| CLOROX COMPANY | 98.76 | 117.85 | 2,191 | 230,386 | 家庭用品 |
| COCA-COLA CO/THE | 3,147.58 | 3,644.71 | 18,475 | 1,942,095 | 飲料 |
| COPART INC | 167.49 | 186.28 | 2,224 | 233,855 | 商業サービス・用品 |
| COGNEX CORP | 122.84 | 146.77 | 1,379 | 145,012 | 電子装置・機器・部品 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 627.79 | 712.97 | 5,591 | 587,812 | 家庭用品 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 221.45 | 256.86 | 3,325 | 349,610 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MOLINA HEALTHCARE INC | - | 52.03 | 1,125 | 118,292 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| COMERICA INC | 119.85 | - | - | - | 銀行 |
| NRG ENERGY, INC. | 210.39 | 210.39 | 905 | 95,188 | 電力 |
| COMCAST CORP-CL A | 3,511.08 | 4,081.73 | 21,727 | 2,283,947 | メディア |
| CONAGRA BRANDS INC | 358.02 | 461.45 | 1,594 | 167,593 | 食品 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 252.2 | 298.44 | 2,120 | 222,929 | 総合公益事業 |
| CMS ENERGY CORP | 229.37 | 259.36 | 1,462 | 153,713 | 総合公益事業 |
| COOPER COS INC | 39.36 | 50.31 | 1,938 | 203,822 | ヘルスケア機器・用品 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 132.2 | 165.13 | 726 | 76,394 | 飲料 |
| CORNING INC | 583.76 | 710.11 | 2,618 | 275,297 | 電子装置・機器・部品 |
| SEALED AIR CORP | 138.7 | 138.7 | 611 | 64,283 | 容器・包装 |
| HEICO CORP-CL A | 52.92 | 62.36 | 724 | 76,126 | 航空宇宙・防衛 |
| CUMMINS INC | 119.63 | 137.18 | 3,346 | 351,813 | 機械 |
| DR HORTON INC | 283.55 | 322.07 | 2,646 | 278,228 | 家庭用耐久財 |
| DANAHER CORP | 482.99 | 572.81 | 14,085 | 1,480,657 | ヘルスケア機器・用品 |
| MOODY'S CORP | 129.22 | 151.99 | 4,235 | 445,236 | 資本市場 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 423.7 | 470.43 | 3,620 | 380,579 | 情報技術サービス |
| TARGET CORP | 394.21 | 449.86 | 8,611 | 905,258 | 複合小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| DEERE & CO | 238.24 | 267.97 | 8,387 | 881,689 | 機械 |
| MORGAN STANLEY | 951.98 | 1,216.65 | 9,077 | 954,218 | 資本市場 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 180.81 | 191.36 | 1,746 | 183,576 | 商業サービス・用品 |
| COSTAR GROUP INC | 27.85 | 34.38 | 3,230 | 339,631 | 専門サービス |
| THE WALT DISNEY CO | 1,394.4 | 1,619.66 | 30,396 | 3,195,244 | 娯楽 |
| DOLLAR TREE INC | 186.97 | 219.16 | 2,375 | 249,675 | 複合小売り |
| DOVER CORP | 111.13 | 126.52 | 1,552 | 163,228 | 機械 |
| OMNICOM GROUP | 173.65 | 196.63 | 1,302 | 136,937 | メディア |
| DTE ENERGY CO | 148.17 | 177.93 | 2,151 | 226,206 | 総合公益事業 |
| DUKE ENERGY CORP | 568.01 | 642.05 | 5,766 | 606,215 | 電力 |
| FLOWERVE CORP | 98.82 | - | - | - | 機械 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 97 | 109.02 | 1,400 | 147,206 | ホテル・レストラン・レジャー |
| EBAY INC | 637.71 | 614.91 | 3,874 | 407,292 | インターネット販売・通信販売 |
| BANK OF AMERICA CORP | 6,844.79 | 6,976.37 | 23,280 | 2,447,209 | 銀行 |
| CITIGROUP INC | 1,746.72 | 1,867.17 | 11,880 | 1,248,909 | 銀行 |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 94.23 | 122.29 | 1,335 | 140,416 | 化学 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 171.04 | - | - | - | 資本市場 |
| EATON CORP PLC | 318.18 | 364.97 | 4,524 | 475,657 | 電気設備 |
| EATON VANCE CORP | 91.84 | - | - | - | 資本市場 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 226.28 | 246.39 | 3,589 | 377,318 | ソフトウェア |
| DISH NETWORK CORP | 177.49 | 214.2 | 671 | 70,612 | メディア |
| ECOLAB INC | 204.79 | 230.5 | 5,068 | 532,772 | 化学 |
| PERKINELMER INC | 83.38 | 97.55 | 1,468 | 154,401 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| ELECTRONIC ARTS INC | 224.91 | 251.42 | 3,714 | 390,466 | 娯楽 |
| SALESFORCE.COM INC | 644.04 | 815.12 | 19,593 | 2,059,620 | ソフトウェア |
| ERIE INDEMNITY CO | 22.43 | 22.43 | 583 | 61,367 | 保険 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 467.05 | 522.99 | 4,462 | 469,116 | 電気設備 |
| ATMOS ENERGY CORP | 86.5 | 115.03 | 1,047 | 110,097 | ガス |
| ENERGY CORP | 150.31 | 171.95 | 1,631 | 171,517 | 電力 |
| EOG RESOURCES INC | 446.03 | 540.41 | 3,297 | 346,641 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EQUIFAX INC | 91.61 | 103.22 | 1,828 | 192,259 | 専門サービス |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE | 173.46 | 202.15 | 5,867 | 616,781 | パーソナル用品 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL | 125.15 | 139.42 | 1,346 | 141,546 | 航空貨物・物流サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 3,276.09 | 3,789.44 | 19,144 | 2,012,443 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FMC CORP | 102.09 | 114.16 | 1,229 | 129,221 | 化学 |
| NEXTERA ENERGY INC | 374.04 | 1,752.42 | 14,567 | 1,531,374 | 電力 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 28.75 | 32.46 | 1,025 | 107,825 | 資本市場 |
| FAIR ISAAC CORP | - | 24.82 | 1,175 | 123,612 | ソフトウェア |
| ASSURANT INC | 45.94 | 55.23 | 707 | 74,389 | 保険 |
| FASTENAL CO | 458.91 | 504.82 | 2,392 | 251,482 | 商社・流通業 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 581.44 | 636.46 | 2,069 | 217,507 | 銀行 |
| M&T BANK CORP | 99.99 | 114.32 | 1,625 | 170,922 | 銀行 |
| FISERV INC | 443.49 | 514.04 | 5,653 | 594,340 | 情報技術サービス |
| FLIR SYSTEMS INC | 116.23 | - | - | - | 電子装置・機器・部品 |
| FORD MOTOR CO | 3,108.36 | 3,423.19 | 3,919 | 412,023 | 自動車 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 237.13 | 237.13 | 654 | 68,848 | 資本市場 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 1,149.93 | 1,269.73 | 3,965 | 416,839 | 金属・鉱業 |
| FLEX LTD | 351.27 | - | - | - | 電子装置・機器・部品 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 142.7 | 179.22 | 2,091 | 219,820 | 保険 |
| GAP INC/THE | 182.95 | - | - | - | 専門小売り |
| DENTSPLY SIRONA INC | 183.86 | 183.86 | 1,017 | 106,976 | ヘルスケア機器・用品 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 188.21 | 215.99 | 3,560 | 374,244 | 航空宇宙・防衛 |
| GENERAL MILLS INC | 461.41 | 538.66 | 3,076 | 323,435 | 食品 |
| GENUINE PARTS CO | 116.05 | 133.93 | 1,330 | 139,829 | 販売 |
| GILEAD SCIENCES INC | 978.31 | 1,130.1 | 7,559 | 794,627 | バイオテクノロジー |
| GARTNER INC | 73.84 | 75.22 | 1,375 | 144,645 | 情報技術サービス |
| MCKESSON CORP | 145.58 | 142.89 | 2,604 | 273,735 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | 評価額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | 千円 | |
| NVIDIA CORP | 447.12 | 552.38 | 33,057 | 3,474,970 | 3,474,970 | 半導体・半導体製造装置 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 6,747.57 | 7,857.77 | 9,217 | 968,908 | 968,908 | コングロマリット |
| WW GRAINGER INC | 37.62 | 42.34 | 1,575 | 165,604 | 165,604 | 商社・流通業 |
| HALLIBURTON CO | 668.43 | 774.83 | 1,562 | 164,284 | 164,284 | エネルギー設備・サービス |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 327.28 | 345.68 | 3,170 | 333,327 | 333,327 | 飲料 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 249 | 293.78 | 8,999 | 945,982 | 945,982 | 資本市場 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 129.01 | - | - | - | - | 自動車 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 175.86 | 189.69 | 3,526 | 370,728 | 370,728 | 航空宇宙・防衛 |
| HASBRO INC | 94.73 | 113.83 | 1,041 | 109,463 | 109,463 | レジャー用品 |
| HENRY SCHEIN INC | 115.16 | 115.16 | 799 | 84,085 | 84,085 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HEICO CORP | 22.78 | 36.23 | 465 | 48,954 | 48,954 | 航空宇宙・防衛 |
| HERSHEY FOODS CORP | 112.92 | 136.22 | 2,062 | 216,767 | 216,767 | 食品 |
| HP INC | 1,174.82 | 1,251.84 | 3,441 | 361,750 | 361,750 | コンピュータ・周辺機器 |
| F5 NETWORKS INC | 48.74 | 55.29 | 1,164 | 122,414 | 122,414 | 通信機器 |
| CROWN HOLDINGS INC NPR | 104.72 | 120.24 | 1,189 | 125,081 | 125,081 | 容器・包装 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 279.39 | 279.39 | 705 | 74,157 | 74,157 | 通信機器 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 118.55 | - | - | - | - | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOLOGIC INC | 196.88 | 240.09 | 1,992 | 209,427 | 209,427 | ヘルスケア機器・用品 |
| UNUM GROUP | 151.85 | - | - | - | - | 保険 |
| HOME DEPOT INC | 846.67 | 963.81 | 26,746 | 2,811,612 | 2,811,612 | 専門小売り |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 131.85 | 162.88 | 1,417 | 149,029 | 149,029 | バイオテクノロジー |
| HORMEL FOODS CORP | 241.61 | 262.54 | 1,266 | 133,133 | 133,133 | 食品 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 376.78 | 490.65 | 1,049 | 110,271 | 110,271 | 総合公益事業 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 29.13 | 29.13 | 853 | 89,677 | 89,677 | 建設関連製品 |
| HUMANA INC | 103.84 | 119.37 | 4,543 | 477,633 | 477,633 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 60 | 75.44 | 1,118 | 117,621 | 117,621 | 陸運・鉄道 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 795.17 | 938.57 | 1,356 | 142,567 | 142,567 | 銀行 |
| BIOGEN INC | 141.19 | 144.18 | 4,008 | 421,387 | 421,387 | バイオテクノロジー |
| IDEX CORP | 61.54 | 72.94 | 1,457 | 153,249 | 153,249 | 機械 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 247.55 | 275.8 | 5,543 | 582,683 | 582,683 | 機械 |
| INTUIT INC | 200.54 | 233.97 | 9,686 | 1,018,205 | 1,018,205 | ソフトウェア |
| IDEXX LABORATORIES INC | 67.91 | 77.82 | 4,234 | 445,081 | 445,081 | ヘルスケア機器・用品 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | 109.6 | 109.6 | 625 | 65,739 | 65,739 | バイオテクノロジー |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 182.44 | 218.91 | 3,304 | 347,317 | 347,317 | 建設関連製品 |
| INTEL CORP | 3,428.07 | 3,802.57 | 23,503 | 2,470,707 | 2,470,707 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 79.65 | 199.06 | 2,668 | 280,523 | 280,523 | 化学 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 294.11 | 319.83 | 1,572 | 165,345 | 165,345 | 容器・包装 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 288.62 | 353.17 | 869 | 91,439 | 91,439 | メディア |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 101.08 | 110.33 | 1,267 | 133,259 | 133,259 | 建設・土木 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 60.19 | 68.74 | 1,001 | 105,238 | 105,238 | 情報技術サービス |
| INCYTE CORP | 137.98 | 159.42 | 1,344 | 141,313 | 141,313 | バイオテクノロジー |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,043.38 | 2,351.55 | 39,172 | 4,117,773 | 4,117,773 | 医薬品 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 287.53 | 334.76 | 1,660 | 174,577 | 174,577 | 保険 |
| KLA CORPORATION | 127.24 | 141.3 | 4,688 | 492,852 | 492,852 | 半導体・半導体製造装置 |
| DEVON ENERGY CORP | 333.12 | 560.14 | 1,119 | 117,646 | 117,646 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KELLOGG CO | 191.81 | 219.54 | 1,259 | 132,421 | 132,421 | 食品 |
| EAST WEST BANCORP INC | 115.6 | - | - | - | - | 銀行 |
| KEYCORP | 794.97 | 875.97 | 1,670 | 175,600 | 175,600 | 銀行 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 261.25 | 308.61 | 4,077 | 428,644 | 428,644 | 家庭用品 |
| BLACKROCK INC./NEW YORK | 89.29 | 136.68 | 9,881 | 1,038,763 | 1,038,763 | 資本市場 |
| KOHL'S CORP | 119.1 | - | - | - | - | 複合小売り |
| KROGER CO | 639.44 | 712.62 | 2,419 | 254,321 | 254,321 | 食品・生活必需品小売り |
| LAM RESEARCH CORP | 111.39 | 130.86 | 7,670 | 806,321 | 806,321 | 半導体・半導体製造装置 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 27.16 | 33.02 | 1,280 | 134,645 | 134,645 | 航空宇宙・防衛 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 71.43 | 84.38 | 1,123 | 118,131 | 118,131 | 容器・包装 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 132.54 | 141.53 | 1,437 | 151,141 | 151,141 | 情報技術サービス |
| LEGGETT & PLATT INC | 109.28 | - | - | - | - | 家庭用耐久財 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|----------|----------|----------|------------|---------|----|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | 千円 | 千円 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | | | | |
| LENINAR CORP | 227.53 | 258.81 | 2,396 | | 251,874 | | 家庭用耐久財 |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC | 207.95 | - | - | | - | | 各種金融サービス |
| ELI LILLY & CO | 672.42 | 771.11 | 15,984 | 1,680,273 | | | 医薬品 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 153.44 | 180.9 | 947 | 99,549 | | | 保険 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 539.13 | 633.18 | 10,345 | 1,087,521 | | | 航空貨物・物流サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 236.62 | 284.52 | 3,641 | 382,772 | | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 196.76 | 225.05 | 7,600 | 798,976 | | | 航空宇宙・防衛 |
| LOEWS CORP | 217.59 | 217.59 | 1,057 | 111,208 | | | 保険 |
| LOWE'S COS INC | 599.41 | 679.92 | 12,045 | 1,266,219 | | | 専門小売り |
| DOMINION ENERGY INC | 637.96 | 733.73 | 5,273 | 554,331 | | | 総合公益事業 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 385.73 | 458.5 | 1,647 | 173,173 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| MCCORMICK & CO INC | 99.35 | 215.14 | 1,928 | 202,748 | | | 食品 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 587.12 | 664.19 | 14,207 | 1,493,442 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| S&P GLOBAL INC | 190.18 | 215.72 | 7,322 | 769,753 | | | 資本市場 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 31.14 | 34.16 | 831 | 87,452 | | | 保険 |
| MANPOWERGROUP INC | 45.55 | - | - | - | | | 専門サービス |
| MARKET CORPORATION | 10.65 | 12.01 | 1,329 | 139,752 | | | 保険 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR | 165.61 | 561.91 | 4,925 | 517,730 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 388.72 | 442.08 | 4,986 | 524,197 | | | 保険 |
| MASCO CORP | 212.16 | 231.51 | 1,272 | 133,728 | | | 建設関連製品 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | 47.86 | 52.58 | 1,739 | 182,856 | | | 建設資材 |
| METLIFE INC | 612.6 | 679.99 | 3,785 | 397,932 | | | 保険 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 213.86 | 235.91 | 2,269 | 238,614 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 1,037.71 | 1,200.14 | 14,370 | 1,510,624 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 602.43 | 696.43 | 7,229 | 759,979 | | | 娯楽 |
| CVS HEALTH CORP | 1,004.51 | 1,175.45 | 8,723 | 916,963 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MERCK & CO.INC. | 1,983.19 | 2,257.06 | 16,927 | 1,779,466 | | | 医薬品 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 326.86 | 366.51 | 1,512 | 159,003 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 80.49 | 85.88 | 2,046 | 215,094 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MICROSOFT CORP | 5,617.88 | 6,425.29 | 157,413 | 16,547,273 | | | ソフトウェア |
| MICRON TECH INC | 847.94 | 999.6 | 8,797 | 924,791 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| MIDDLEBY CORP | 41.88 | - | - | - | | | 機械 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 184.73 | 218.94 | 3,493 | 367,203 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 487.15 | 612.87 | 3,298 | 346,734 | | | 半導体・半導体製造装置 |
| 3M CO | 442.96 | 515.39 | 9,210 | 968,157 | | | コングロマリット |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 49.76 | 49.76 | 842 | 88,546 | | | 家庭用耐久財 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 125.93 | 150.06 | 2,717 | 285,625 | | | 通信機器 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 76.14 | 83.46 | 1,746 | 183,634 | | | 陸運・鉄道 |
| MYLAN NV | 435.74 | - | - | - | | | 医薬品 |
| ILLUMINA INC | 116.19 | 131.34 | 6,629 | 696,894 | | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| XCEL ENERGY INC | 389.63 | 465.91 | 2,867 | 301,401 | | | 電力 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 65.45 | 80.58 | 919 | 96,649 | | | バイオテクノロジー |
| NOV INC | 271.94 | - | - | - | | | エネルギー設備・サービス |
| NETAPP INC | 179.63 | 198.04 | 1,383 | 145,434 | | | コンピュータ・周辺機器 |
| NEWELL BRANDS INC | 333.17 | 333.17 | 805 | 84,720 | | | 家庭用耐久財 |
| NEWMONT CORP | 638.69 | 726.65 | 4,282 | 450,215 | | | 金属・鉱業 |
| NVR INC | 2.63 | 3.05 | 1,433 | 150,690 | | | 家庭用耐久財 |
| NIKE INC-CL B | 967 | 1,116.09 | 15,861 | 1,667,399 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOBLE ENERGY INC | 394.36 | - | - | - | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NORDSTROM INC | 94.87 | - | - | - | | | 複合小売り |
| NORDSON CORP | - | 46.44 | 874 | 91,909 | | | 機械 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 202.6 | 229.57 | 5,850 | 614,990 | | | 陸運・鉄道 |
| EVERSOURCE ENERGY | 247.68 | 305.69 | 2,603 | 273,686 | | | 電力 |
| NISOURCE INC | 315.48 | 314.27 | 708 | 74,430 | | | 総合公益事業 |
| TAPESTRY INC | 217.9 | - | - | - | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NORTHERN TRUST CORP | 159.59 | 173.65 | 1,704 | 179,145 | | | 資本市場 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 121.94 | 136.98 | 4,073 | 428,178 | | | 航空宇宙・防衛 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|----------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| WELLS FARGO & CO | 3,239.87 | 3,503.46 | 11,747 | 1,234,855 | 銀行 |
| NUCOR CORP | 240.42 | 288.6 | 1,625 | 170,922 | 金属・鉱業 |
| CHENIERE ENERGY INC | 191.75 | 191.9 | 1,297 | 136,406 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 359.69 | 417.51 | 4,916 | 516,788 | 消費者金融 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 695.5 | 852.06 | 2,163 | 227,414 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 52.09 | 87.12 | 1,848 | 194,343 | 陸運・鉄道 |
| OGE ENERGY CORP | 160.28 | 160.28 | 505 | 53,140 | 電力 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 58.22 | 65.76 | 2,847 | 299,354 | 専門小売り |
| ORACLE CORP | 1,806.97 | 1,782.61 | 11,244 | 1,182,043 | ソフトウェア |
| PACCAR INC | 273.94 | 304.46 | 2,983 | 313,647 | 機械 |
| PTC INC | 77.66 | 94.33 | 1,346 | 141,520 | ソフトウェア |
| EXELON CORP | 737.21 | 853.23 | 3,601 | 378,587 | 電力 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 100.92 | 119 | 3,287 | 345,556 | 機械 |
| PAYCHEX INC | 253.29 | 298.42 | 2,667 | 280,446 | 情報技術サービス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 61.63 | 65.29 | 3,979 | 418,372 | ヘルスケア機器・用品 |
| PPL CORPORATION | 537.24 | 713.2 | 1,997 | 209,995 | 電力 |
| PEPSICO INC | 1,082.92 | 1,235.16 | 16,535 | 1,738,168 | 飲料 |
| PENTAIR PLC | 125.11 | 155.64 | 834 | 87,743 | 機械 |
| PFIZER INC | 4,280.75 | 4,971.81 | 17,262 | 1,814,594 | 医薬品 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 155.16 | 229.37 | 1,070 | 112,503 | 水道 |
| CONOCOPHILLIPS | 858.96 | 1,233.91 | 5,819 | 611,705 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PVH CORP | 52.05 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| PG&E CORP | - | 1,239.99 | 1,463 | 153,810 | 電力 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 129.08 | 181.44 | 2,400 | 252,316 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,442.97 | 1,673.74 | 7,264 | 763,595 | タバコ |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 344.94 | 382.89 | 6,213 | 653,126 | 銀行 |
| BROWN & BROWN INC | 172.94 | 203.08 | 909 | 95,638 | 保険 |
| POLARIS INC | 40.95 | - | - | - | レジャー用品 |
| GARMIN LTD | 107.74 | 123.65 | 1,616 | 169,885 | 家庭用耐久財 |
| PPG INDUSTRIES INC | 190.31 | 206.85 | 2,865 | 301,264 | 化学 |
| IPG PHOTONICS CORP | 26.08 | 33.53 | 847 | 89,135 | 電子装置・機器・部品 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 339.84 | 394.44 | 13,913 | 1,462,626 | 食品・生活必需品小売り |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 184.83 | 200.07 | 3,264 | 343,210 | 資本市場 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 108.83 | 119.26 | 1,502 | 157,986 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO | 1,939.08 | 2,223.79 | 28,380 | 2,983,306 | 家庭用品 |
| PROGRESSIVE CORP | 461.27 | 528.87 | 4,562 | 479,616 | 保険 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 390.39 | 445.03 | 2,593 | 272,596 | 総合公益事業 |
| PULTE GROUP INC | 212.09 | 243.05 | 1,178 | 123,863 | 家庭用耐久財 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 236.92 | 271.25 | 5,348 | 562,235 | 情報技術サービス |
| QUALCOMM INC | 939.82 | 1,010 | 14,945 | 1,571,121 | 半導体・半導体製造装置 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 103.88 | 107.44 | 1,226 | 128,899 | 資本市場 |
| EXACT SCIENCES CORP | 113.06 | 139.11 | 2,156 | 226,674 | バイオテクノロジー |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD | 31.61 | 40.52 | 645 | 67,819 | 保険 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 61.16 | 95.04 | 4,615 | 485,163 | バイオテクノロジー |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC | 50.42 | 60.97 | 688 | 72,423 | 保険 |
| RESMED INC | 111.16 | 132.86 | 2,664 | 280,093 | ヘルスケア機器・用品 |
| US BANCORP | 1,156.14 | 1,226.62 | 5,843 | 614,281 | 銀行 |
| SEAGEN INC | 91.5 | 102.96 | 1,707 | 179,491 | バイオテクノロジー |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 315 | 343.83 | 1,208 | 127,044 | 保険 |
| ROSS STORES INC | 288.14 | 311.97 | 3,715 | 390,547 | 専門小売り |
| ROLLINS INC | 123.78 | 185.67 | 697 | 73,366 | 商業サービス・用品 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 79.49 | 91.27 | 3,614 | 379,953 | コングロマリット |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 92.51 | 107.18 | 2,670 | 280,745 | 電気設備 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 140.75 | 158.79 | 1,073 | 112,888 | ホテル・レストラン・レジャー |
| RPM INTERNATIONAL INC | 111.41 | 110.04 | 955 | 100,405 | 化学 |
| RAYTHEON COMPANY | 219.72 | - | - | - | 航空宇宙・防衛 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 38.48 | - | - | - | 情報技術サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 業種等 |
|--|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| ACCENTURE PLC-CL A | 493.57 | 568.7 | 14,642 | 1,539,200 | 情報技術サービス | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,113.85 | 1,278.63 | 7,056 | 741,806 | 食品 | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 101.9 | 117.94 | 2,682 | 281,951 | 保険 | |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC | 195.63 | 221.48 | 3,232 | 339,823 | 保険 | |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 474.12 | 557.29 | 7,556 | 794,376 | 情報技術サービス | |
| BOOKING HOLDINGS INC | 32.83 | 36.87 | 7,929 | 833,516 | インターネット販売・通信販売 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,065.93 | 1,309.4 | 3,505 | 368,473 | エネルギー設備・サービス | |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 898.67 | 1,376.29 | 8,008 | 841,867 | 資本市場 | |
| POOL CORP | — | 35.32 | 1,193 | 125,434 | 販売 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 155.9 | 181.87 | 2,935 | 308,529 | ヘルスケア機器・用品 | |
| BUNGE LTD | 106.22 | 133.04 | 1,037 | 109,084 | 食品 | |
| SEI INVESTMENTS CO | 106.53 | 106.53 | 611 | 64,323 | 資本市場 | |
| ANTHEM INC | 197.28 | 226.07 | 6,571 | 690,785 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 127.49 | 138.36 | 1,455 | 152,978 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 221.75 | 250.38 | 1,355 | 142,469 | 保険 | |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 63.67 | 73.88 | 5,327 | 559,986 | 化学 | |
| CENTENE CORP | 461.24 | 509.9 | 3,018 | 317,316 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| SVB FINANCIAL GROUP | 40.44 | 45.32 | 2,295 | 241,298 | 銀行 | |
| IAC INTERACTIVE CORP | 62.52 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| SMITH (A.O.) CORP | 113.51 | 113.51 | 685 | 72,034 | 建設関連製品 | |
| ACUIITY BRANDS INC | 30.87 | — | — | — | 電気設備 | |
| SNAP-ON INC | 39.81 | 48.25 | 916 | 96,343 | 機械 | |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 313.88 | 372.26 | 3,010 | 316,421 | 保険 | |
| ADVANCE AUTO PARTS | 52.97 | 62.26 | 951 | 100,010 | 専門小売り | |
| EDISON INTERNATIONAL | 266.52 | 350.41 | 2,029 | 213,312 | 電力 | |
| SOUTHERN CO | 800.67 | 923.98 | 5,553 | 583,743 | 電力 | |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 1,036.81 | 1,215.55 | 6,565 | 690,132 | 銀行 | |
| SOUTHWEST AIRLINES | 113.52 | 117.91 | 605 | 63,634 | 旅客航空輸送業 | |
| AT&T INC | 5,656.86 | 6,363.97 | 18,328 | 1,926,663 | 各種電気通信サービス | |
| CHEVRON CORP | 1,471.08 | 1,721.63 | 15,933 | 1,674,949 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 117.76 | 140.26 | 2,462 | 258,862 | 機械 | |
| STATE STREET CORP | 295.9 | 324.04 | 2,381 | 250,363 | 資本市場 | |
| STARBUCKS CORP | 923.12 | 1,049.03 | 11,046 | 1,161,185 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| STEEL DYNAMICS INC | 175.47 | 175.47 | 690 | 72,545 | 金属・鉱業 | |
| STRYKER CORP | 258.5 | 304.36 | 7,552 | 793,939 | ヘルスケア機器・用品 | |
| NETFLIX INC | 338.6 | 394.98 | 21,981 | 2,310,687 | 娯楽 | |
| NORTONLIFELOCK INC | 489.55 | 489.55 | 1,051 | 110,487 | ソフトウェア | |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 97.93 | 97.93 | 424 | 44,615 | 陸運・鉄道 | |
| SYNOPSIS INC | 118.55 | 133.81 | 3,908 | 410,856 | ソフトウェア | |
| SYSCO CORP | 382.29 | 421.71 | 3,215 | 337,973 | 食品・生活必需品小売り | |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 88.5 | 105.44 | 8,517 | 895,364 | ヘルスケア機器・用品 | |
| TELEFLEX INC | 34.55 | 40.02 | 1,625 | 170,880 | ヘルスケア機器・用品 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | 883.22 | 883.22 | 982 | 103,242 | 医薬品 | |
| TERADYNE INC | 121.62 | 142.84 | 2,034 | 213,833 | 半導体・半導体製造装置 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 720.56 | 818.5 | 14,703 | 1,545,635 | 半導体・半導体製造装置 | |
| TEXTRON INC | 163.04 | 194.86 | 991 | 104,241 | 航空宇宙・防衛 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 309.95 | 354.62 | 18,008 | 1,893,071 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| TIFFANY & CO | 87.33 | — | — | — | 専門小売り | |
| GLOBE LIFE INC | 72.82 | 105.78 | 994 | 104,546 | 保険 | |
| DAVITA INC | 81.59 | 64.97 | 682 | 71,704 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| TRACTOR SUPPLY CO | 95.73 | 104.62 | 1,673 | 175,885 | 専門小売り | |
| TRIMBLE INC | 200.73 | 224.42 | 1,660 | 174,502 | 電子装置・機器・部品 | |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 28.51 | 34.73 | 1,648 | 173,337 | ソフトウェア | |
| TYSON FOODS INC | 227.36 | 249.8 | 1,637 | 172,153 | 食品 | |
| UGI CORP | 147.97 | 200.72 | 780 | 82,035 | ガス | |
| MARATHON OIL CORP | 584.18 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| UNION PACIFIC CORP | 544.82 | 605.64 | 12,909 | 1,357,080 | 陸運・鉄道 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 634.51 | 1,372.1 | 9,962 | 1,047,291 | 航空宇宙・防衛 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 733.07 | 849.87 | 27,896 | 2,932,441 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 61.53 | 61.53 | 795 | 83,618 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 72.26 | 81.39 | 1,433 | 150,683 | ヘルスケア機器・用品 |
| VF CORP | 267.5 | 287.12 | 2,282 | 239,977 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VIACOMCBS INC | 453.61 | 493.63 | 2,878 | 302,572 | メディア |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 198.29 | 239.38 | 5,122 | 538,451 | バイオテクノロジー |
| VULCAN MATERIALS CO | 97.94 | 121.7 | 2,001 | 210,446 | 建設資材 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 602.5 | 668.71 | 3,368 | 354,145 | 食品・生活必需品小売り |
| WALMART INC | 1,104.64 | 1,264.14 | 18,263 | 1,919,809 | 食品・生活必需品小売り |
| WASTE MANAGEMENT INC | 323 | 383.57 | 4,343 | 456,633 | 商業サービス・用品 |
| WATERS CORP | 54.68 | 52.11 | 1,479 | 155,542 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| ALLERGAN PLC | 252.62 | — | — | — | 医薬品 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 52.4 | 70.09 | 2,060 | 216,622 | ヘルスケア機器・用品 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 91.76 | 103.06 | 1,186 | 124,695 | 食品 |
| VAIL RESORTS INC | 31.09 | 35.9 | 1,031 | 108,447 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESTERN DIGITAL CORP | 225.67 | 258.67 | 1,696 | 178,293 | コンピュータ・周辺機器 |
| WABTEC CORP | 149.64 | 162.57 | 1,309 | 137,620 | 機械 |
| WHIRLPOOL CORP | 46.14 | 56.56 | 1,130 | 118,870 | 家庭用耐久財 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 139.02 | 153.31 | 2,905 | 305,397 | 半導体・半導体製造装置 |
| WYNN RESORTS LTD | 79.7 | 86.39 | 1,018 | 107,023 | ホテル・レストラン・レジャー |
| NASDAQ INC | 90.2 | 100.97 | 1,433 | 150,707 | 資本市場 |
| CME GROUP INC | 276.73 | 321.8 | 5,933 | 623,679 | 資本市場 |
| WILLIAMS COS INC | 907.18 | 1,125.35 | 2,570 | 270,189 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LKQ CORP | 221.96 | 236.91 | 874 | 91,945 | 販売 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 172.21 | 228.29 | 1,102 | 115,885 | 電力 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 238.39 | 290.02 | 2,408 | 253,193 | 総合公益事業 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 218.2 | — | — | — | 資本市場 |
| CARMAX INC | 120.81 | 142.09 | 1,777 | 186,855 | 専門小売り |
| XILINX INC | 189.97 | 214 | 3,119 | 327,874 | 半導体・半導体製造装置 |
| TJX COMPANIES INC | 930.1 | 1,081.5 | 7,354 | 773,073 | 専門小売り |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP | 41.28 | 45.61 | 2,178 | 229,053 | 電子装置・機器・部品 |
| ZIONS BANCORP NA | 131.42 | — | — | — | 銀行 |
| DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS | 274 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 764 | 1,087 | 498 | 52,447 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 157 | 206 | 1,116 | 117,368 | コンゴロマリット |
| JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD | 171 | 171 | 432 | 45,460 | コンゴロマリット |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 81.78 | 102.39 | 1,616 | 169,973 | バイオテクノロジー |
| SIGNATURE BANK | 41.71 | — | — | — | 銀行 |
| CBRE GROUP INC | 236.13 | 296.17 | 2,112 | 222,074 | 不動産管理・開発 |
| LIBERTY GLOBAL PLC | 127.32 | 127.32 | 319 | 33,566 | 各種電気通信サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 764.8 | 855.82 | 1,673 | 175,969 | 銀行 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 32.56 | 36.41 | 1,402 | 147,420 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | — | 37.37 | 1,442 | 151,602 | 半導体・半導体製造装置 |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 30 | — | — | — | 化学 |
| T-MOBILE US INC | 256.75 | 499.8 | 6,181 | 649,802 | 無線通信サービス |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 277.59 | 302.77 | 1,696 | 178,295 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MOSAIC CO/THE | 282.49 | 325.92 | 953 | 100,281 | 化学 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 28.92 | 32.09 | 1,773 | 186,391 | 資本市場 |
| CELANESE CORP | 103.26 | 115.88 | 1,538 | 161,682 | 化学 |
| DEXCOM INC | 72.16 | 87.06 | 3,591 | 377,564 | ヘルスケア機器・用品 |
| DISCOVERY INC-A | 104.23 | 153.62 | 734 | 77,189 | メディア |
| EXPEDIA GROUP INC | 115.27 | 115.08 | 1,686 | 177,236 | インターネット販売・通信販売 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 184.75 | 184.75 | 819 | 86,151 | 化学 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 103.12 | 106.14 | 2,314 | 243,321 | 資本市場 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C | 340.23 | 340.23 | 843 | 88,625 | 各種電気通信サービス |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 442.48 | 487.85 | 5,418 | 569,597 | 資本市場 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-----|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 | 評価額 | |
| | | | 千アメリカ・ドル | 千円 | 千円 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | 千円 | |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 146.96 | — | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LIVE NATION | 113.39 | 138.04 | 1,161 | 122,137 | — | 娯楽 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 20.4 | 23.26 | 3,553 | 373,536 | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 45.08 | — | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 36.81 | 47.45 | 2,735 | 287,549 | — | 航空宇宙・防衛 |
| MASTERCARD INC | 699.14 | 798.24 | 27,219 | 2,861,364 | — | 情報技術サービス |
| HANESBRANDS INC | 276.19 | — | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| WESTERN UNION CO | 352.22 | 353.67 | 848 | 89,189 | — | 情報技術サービス |
| OWENS CORNING | 77.56 | 99.65 | 854 | 89,824 | — | 建設関連製品 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 111.13 | 128.66 | 1,386 | 145,796 | — | 情報技術サービス |
| AERCAP HOLDINGS NV | 88.07 | — | — | — | — | 商社・流通業 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC | 70.67 | — | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR | 173.5 | 173.5 | 308 | 32,464 | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 91.76 | 99.59 | 1,474 | 155,013 | — | 情報技術サービス |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 295.45 | — | — | — | — | 銀行 |
| DELTA AIR LINES INC | 111.58 | 147.23 | 637 | 66,999 | — | 旅客航空輸送業 |
| INSULET CORP | 47.81 | 55.66 | 1,612 | 169,543 | — | ヘルスケア機器・用品 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 60.38 | — | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DISCOVER FINANCIAL | 239.78 | 269.75 | 2,528 | 265,753 | — | 消費者金融 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 256.41 | 289.3 | 3,754 | 394,646 | — | 電子装置・機器・部品 |
| MASIMO CORP | — | 45.05 | 1,242 | 130,571 | — | ヘルスケア機器・用品 |
| CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX | 159.7 | — | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WABCO HOLDING INC | 40.76 | — | — | — | — | 機械 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 82.55 | 108.17 | 3,708 | 389,860 | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VMWARE INC | 65.32 | 74.64 | 1,083 | 113,871 | — | ソフトウェア |
| MERCADOLIBRE INC | 35 | 40.41 | 7,851 | 825,366 | — | インターネット販売・通信販売 |
| ULTA BEAUTY INC | 45.77 | 45.38 | 1,451 | 152,593 | — | 専門小売り |
| INVESCO LTD | 334.43 | 334.43 | 758 | 79,697 | — | 資本市場 |
| MSCI INC | 67.14 | 76.17 | 3,311 | 348,119 | — | 資本市場 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,203.48 | 1,392.7 | 11,993 | 1,260,802 | — | タバコ |
| VISA INC | 1,337.71 | 1,505.8 | 31,615 | 3,323,450 | — | 情報技術サービス |
| KEURIG DR PEPPER INC | — | 484.8 | 1,540 | 161,906 | — | 飲料 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 145.36 | 169.15 | 2,734 | 287,501 | — | 水道 |
| DISCOVERY INC-C | 304.21 | 304.21 | 1,239 | 130,312 | — | メディア |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 514.74 | 595.87 | 3,006 | 316,070 | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 116.24 | 117.44 | 1,055 | 110,910 | — | 建設関連製品 |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE | 1,600.64 | 1,859.92 | 2,760 | 290,143 | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| XYLEM INC | 132.37 | 172.22 | 1,707 | 179,444 | — | 機械 |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV | 208.76 | 246.36 | 2,368 | 248,977 | — | 化学 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 34.79 | 34.84 | 613 | 64,505 | — | 航空宇宙・防衛 |
| SPLUNK INC | 111.94 | 146.41 | 2,537 | 266,765 | — | ソフトウェア |
| EPAM SYSTEMS INC | 40.23 | 53.33 | 2,134 | 224,393 | — | 情報技術サービス |
| ZILLOW GROUP INC | — | 53.66 | 1,088 | 114,473 | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | — | 148.14 | 762 | 80,135 | — | 資本市場 |
| HCA HEALTHCARE INC | 206.49 | 236.31 | 4,100 | 431,014 | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 123.2 | 136.44 | 2,585 | 271,791 | — | 専門サービス |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 42.73 | 52.57 | 880 | 92,574 | — | 医薬品 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 68.85 | 78.06 | 2,063 | 216,875 | — | 情報技術サービス |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 124.53 | 149.86 | 2,328 | 244,790 | — | 銀行 |
| NXP SEMICONDUCTOR NV | 213.18 | 243.75 | 4,738 | 498,085 | — | 半導体・半導体製造装置 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | 98.33 | 116.67 | 963 | 101,291 | — | 情報技術サービス |
| TARGA RESOURCES CORP | 190.38 | — | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LEAR CORP | 46.81 | 46.81 | 747 | 78,568 | — | 自動車部品 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 86.22 | 104.72 | 936 | 98,401 | — | 資本市場 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 172.68 | 202.43 | 1,336 | 140,486 | — | ソフトウェア |
| DOLLAR GENERAL CORP | 202.52 | 218.25 | 4,334 | 455,636 | — | 複合小売り |
| FORTINET INC | 111.5 | 121.46 | 2,000 | 210,325 | — | ソフトウェア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------------|----------|----------|----------|-----------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| AON PLC | 181.89 | — | — | — | 保険 |
| HORIZON PHARMA PLC | — | 189.86 | 1,718 | 180,680 | 医薬品 |
| TESLA INC | 105.48 | 667.04 | 54,438 | 5,722,571 | 自動車 |
| GENERAC HOLDINGS INC | — | 54.02 | 1,765 | 185,598 | 電気設備 |
| ENPHASE ENERGY INC | — | 101.63 | 2,098 | 220,621 | 半導体・半導体製造装置 |
| GENERAL MOTORS CO | 1,006.95 | 1,164.31 | 6,240 | 656,022 | 自動車 |
| XPO LOGISTICS INC | 76.14 | 76.14 | 923 | 97,094 | 航空貨物・物流サービス |
| TRIPADVISOR INC | 92.63 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ALLY FINANCIAL INC | 318.71 | 338.57 | 1,422 | 149,515 | 消費者金融 |
| CAPRI HOLDINGS LTD | 121.38 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VOYA FINANCIAL INC | 102.73 | 135.03 | 742 | 78,040 | 各種金融サービス |
| APTIV PLC | 189.2 | 326.97 | 3,703 | 389,322 | 自動車部品 |
| PHILLIPS 66 | 342.35 | 399.51 | 3,085 | 324,338 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC | 58.85 | 71.72 | 922 | 97,022 | ソフトウェア |
| FACEBOOK INC | 1,861.56 | 2,150.14 | 58,161 | 6,113,914 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| IQVIA HOLDINGS INC | 134.53 | 168.96 | 3,255 | 342,184 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 114.24 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SERVENOW INC | 144.06 | 172.89 | 10,222 | 1,074,622 | ソフトウェア |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 72.72 | 84.6 | 3,342 | 351,386 | ソフトウェア |
| WORKDAY INC | 122.24 | 155.26 | 4,368 | 459,205 | ソフトウェア |
| ABBVIE INC | 1,144.34 | 1,581.52 | 16,517 | 1,736,308 | バイオテクノロジー |
| ZOETIS INC | 368.25 | 426.6 | 7,111 | 747,597 | 医薬品 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD | 168.99 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| COTY INC | 238.13 | — | — | — | パーソナル用品 |
| NEWS CORP/NEW-CL A | 302.63 | 302.63 | 717 | 75,459 | メディア |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC | 140.75 | — | — | — | 商社・流通業 |
| CDW CORP | 114.06 | 127.68 | 1,984 | 208,573 | 電子装置・機器・部品 |
| SPRINT CORP | 638.82 | — | — | — | 無線通信サービス |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 101.99 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 307.49 | 381.27 | 1,078 | 113,343 | 航空宇宙・防衛 |
| TWILIO INC | 91.9 | 119 | 5,179 | 544,516 | 情報技術サービス |
| COUPA SOFTWARE INC | — | 62.46 | 2,289 | 240,642 | ソフトウェア |
| SNAP INC | 571.3 | 822.23 | 5,095 | 535,624 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| TRADE DESK INC A | — | 36.48 | 3,151 | 331,324 | ソフトウェア |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 143.04 | 195.46 | 888 | 93,426 | 娯楽 |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A | 50.06 | 83.24 | 362 | 38,124 | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C | 142.05 | 142.05 | 610 | 64,149 | メディア |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | 154.1 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OKTA INC | 88.16 | 106.51 | 3,107 | 326,686 | 情報技術サービス |
| BLACK KNIGHT INC | 127 | 130.42 | 1,139 | 119,823 | 情報技術サービス |
| BAKER HUGHES CO | 510.05 | 572.74 | 1,300 | 136,668 | エネルギー設備・サービス |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 106.69 | 131.81 | 1,017 | 106,911 | 食品 |
| ALTICE USA INC-A | 138.87 | 215.06 | 744 | 78,220 | メディア |
| TECHNIPFMC LTD | 312.57 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| BROADCOM INC | 307.62 | 360.27 | 17,520 | 1,841,770 | 半導体・半導体製造装置 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 57.25 | 67.99 | 3,013 | 316,824 | ソフトウェア |
| MONGODB INC | 34.23 | 41.88 | 1,770 | 186,156 | 情報技術サービス |
| BURLINGTON STORES INC | 50.95 | 56.02 | 1,471 | 154,675 | 専門小売り |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 295.78 | 358.24 | 1,065 | 112,033 | 医薬品 |
| VEEVA SYSTEMS INC | 97.33 | 118.32 | 3,762 | 395,559 | ヘルスケア・テクノロジー |
| TWITTER INC | 575.62 | 690.05 | 4,961 | 521,548 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | 132.14 | 132.14 | 771 | 81,120 | 電気設備 |
| EVERGY INC | 183.88 | 210.39 | 1,145 | 120,378 | 電力 |
| ALLEGION PLC | 74.69 | 90.22 | 1,066 | 112,156 | 建設関連製品 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | — | 114.54 | 1,119 | 117,647 | ソフトウェア |
| STERIS PLC | 66.58 | 73.9 | 1,352 | 142,161 | ヘルスケア機器・用品 |
| DOCUSIGN INC | 72.2 | 152.47 | 4,014 | 422,007 | ソフトウェア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|---------|----------|----------|---------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| WIX.COM LTD | 40 | 49.18 | 1,440 | 151,376 | 情報技術サービス |
| DROPBOX INC | 175.73 | 281.7 | 690 | 72,579 | ソフトウェア |
| KKR & CO INC | 373.07 | 472.67 | 2,278 | 239,541 | 資本市場 |
| PERRIGO CO PLC | 105.53 | 105.53 | 474 | 49,897 | 医薬品 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC | - | 155.78 | 6,746 | 709,243 | ソフトウェア |
| MODERNA INC | - | 240.31 | 4,415 | 464,152 | バイオテクノロジー |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 206.55 | 258.78 | 2,901 | 305,053 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ARAMARK | 181.44 | 186.32 | 670 | 70,509 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CIGNA CORP | 290.83 | 331.16 | 6,852 | 720,355 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DELL TECHNOLOGIES INC | 129.6 | 205.86 | 1,647 | 173,228 | コンピュータ・周辺機器 |
| DOW INC | 564.34 | 647.07 | 3,762 | 395,536 | 化学 |
| AMCOR PLC | 1,300 | 1,461.49 | 1,680 | 176,676 | 容器・包装 |
| PINTEREST INC | 131.83 | 420.97 | 3,537 | 371,896 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PELOTON INTERACTIVE INC | - | 178.7 | 2,763 | 290,546 | レジャー用品 |
| XEROX HOLDINGS CORP | 174.55 | - | - | - | コンピュータ・周辺機器 |
| FOX CORP-A | 262.57 | 317.51 | 1,034 | 108,774 | メディア |
| FOX CORP-B | 130.09 | 130.09 | 409 | 43,008 | メディア |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC | - | 130.78 | 3,166 | 332,829 | ソフトウェア |
| CHEVY INC | - | 65.86 | 781 | 82,171 | インターネット販売・通信販売 |
| AVANTOR INC | - | 445.09 | 1,365 | 143,498 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| DYNATRACE INC | - | 159.49 | 853 | 89,746 | ソフトウェア |
| CLOUDFLARE INC | - | 132.18 | 1,136 | 119,425 | ソフトウェア |
| TRADEWEB MARKETS INC | - | 70.65 | 482 | 50,717 | 資本市場 |
| CARRIER GLOBAL CORP | - | 750.77 | 2,798 | 294,217 | 建設関連製品 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | - | 375.35 | 2,399 | 252,247 | 機械 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 133.12 | 838.27 | 5,082 | 534,265 | 陸運・鉄道 |
| CORTEVA INC | 593.22 | 686.39 | 3,045 | 320,144 | 化学 |
| MATCH GROUP INC | - | 215.66 | 3,656 | 384,327 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SLACK TECHNOLOGIES INC | - | 325.12 | 1,420 | 149,317 | ソフトウェア |
| BLACKSTONE GROUP INC | 508.89 | 585.87 | 4,113 | 432,399 | 資本市場 |
| CARLYLE GROUP INC | - | 125.09 | 464 | 48,863 | 資本市場 |
| 10X GENOMICS INC | - | 53.12 | 1,045 | 109,926 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| DATADOG INC | - | 130.21 | 1,469 | 154,479 | ソフトウェア |
| GRUBHUB INC | 81.58 | - | - | - | インターネット販売・通信販売 |
| INGERSOLL RAND INC | - | 312.82 | 1,373 | 144,424 | 機械 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 39.23 | 43.3 | 1,788 | 187,975 | ソフトウェア |
| PPD INC | - | 108.28 | 411 | 43,253 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SABRE CORP | 198.09 | - | - | - | 情報技術サービス |
| AON PLC | - | 208.07 | 4,744 | 498,776 | 保険 |
| IAC/INTERACTIVECORP | - | 70.64 | 1,853 | 194,812 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| ZENDESK INC | - | 100.21 | 1,575 | 165,595 | ソフトウェア |
| ROYALTY PHARMA PLC | - | 103.61 | 497 | 52,257 | 医薬品 |
| VIATRIS INC | - | 1,128.66 | 2,058 | 216,408 | 医薬品 |
| DRAFTKINGS INC | - | 146.71 | 895 | 94,183 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SNOWFLAKE INC | - | 28.05 | 840 | 88,302 | 情報技術サービス |
| ARISTA NETWORKS INC | 44.41 | 50.42 | 1,630 | 171,359 | 通信機器 |
| IHS MARKIT LTD | 297.96 | 344.11 | 3,220 | 338,541 | 専門サービス |
| FNF GROUP | 213.72 | 245.67 | 973 | 102,343 | 保険 |
| CATALENT INC | - | 146.73 | 1,838 | 193,219 | 医薬品 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 439.86 | 454.91 | 1,689 | 177,651 | 消費者金融 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | 358.2 | 415.03 | 1,681 | 176,780 | 銀行 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD | 34.57 | 34.57 | 562 | 59,154 | ソフトウェア |
| CDK GLOBAL INC | 99.69 | - | - | - | ソフトウェア |
| WAYFAIR INC | 50.91 | 55.43 | 1,623 | 170,707 | インターネット販売・通信販売 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 139.54 | 174.07 | 2,671 | 280,841 | 電子装置・機器・部品 |
| HUBSPOT INC | - | 37.41 | 1,879 | 197,570 | ソフトウェア |
| QORVO INC | 88.71 | 101.68 | 1,789 | 188,119 | 半導体・半導体製造装置 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 | |
|---------------------------------|------------------|---------------------|---------------------|----------------|------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| ZAYO GROUP HOLDINGS INC | 168.88 | — | — | — | 各種電気通信サービス | |
| LIBERTY BROADBAND CORP W/I | — | 29.47 | 432 | 45,436 | メディア | |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I | 83.07 | 131.89 | 1,973 | 207,423 | メディア | |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 170.18 | 170.18 | 463 | 48,730 | 化学 | |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | — | 42.57 | 1,408 | 148,071 | 半導体・半導体製造装置 | |
| GODADDY INC | 123.28 | 145.4 | 1,246 | 131,064 | 情報技術サービス | |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 262.04 | — | — | — | 専門サービス | |
| ETSY INC | — | 102.37 | 2,394 | 251,659 | インターネット販売・通信販売 | |
| TRANSUNION | 150 | 167.6 | 1,593 | 167,477 | 専門サービス | |
| SQUARE INC | 264.87 | 335.06 | 9,138 | 960,666 | 情報技術サービス | |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 587.57 | 477.57 | 3,413 | 358,794 | 化学 | |
| CARVANA CO | — | 53.47 | 1,582 | 166,402 | 専門小売り | |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | 193.21 | 182.96 | 940 | 98,894 | 飲料 | |
| TELADOC HEALTH INC | — | 104.54 | 3,069 | 322,710 | ヘルスケア・テクノロジー | |
| WESTROCK CO | 182.84 | 227.78 | 1,007 | 105,929 | 容器・包装 | |
| KRAFT HEINZ CO | 511.63 | 568.79 | 2,012 | 211,601 | 食品 | |
| NOVOCURE LTD | — | 74.08 | 1,404 | 147,685 | ヘルスケア機器・用品 | |
| FORTIVE CORP | 225 | 259.81 | 1,858 | 195,329 | 機械 | |
| MATCH GROUP INC | 45.99 | — | — | — | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| WASTE CONNECTIONS INC | 204.17 | 247.78 | 2,461 | 258,799 | 商業サービス・用品 | |
| ALPHABET INC-CL A | 231.32 | 269 | 56,356 | 5,924,174 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | 1,040.4 | 1,162.57 | 1,671 | 175,737 | コンピュータ・周辺機器 | |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 864.04 | 1,000.53 | 29,852 | 3,138,127 | 情報技術サービス | |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 354.71 | 352.77 | 964 | 101,422 | 各種金融サービス | |
| SUNRUN INC | — | 100 | 836 | 87,964 | 電気設備 | |
| DXC TECHNOLOGY CO | 208.48 | — | — | — | 情報技術サービス | |
| ZILLOW GROUP INC-C | 81.66 | 133.76 | 2,645 | 278,137 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| ALPHABET INC-CL C | 242.52 | 267.96 | 56,381 | 5,926,847 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| BEIGENE LTD ADR | 31.59 | — | — | — | バイオテクノロジー | |
| ZSCALER INC | — | 61.93 | 1,402 | 147,440 | ソフトウェア | |
| CABLE ONE INC | — | 3.92 | 806 | 84,754 | メディア | |
| LINDE PLC | 417.98 | 470.49 | 11,888 | 1,249,702 | 化学 | |
| ATHENE HOLDING LTD | 118.47 | 118.47 | 535 | 56,252 | 保険 | |
| ROKU INC | 66.74 | 95.87 | 4,493 | 472,318 | 娯楽 | |
| AVALARA INC | — | 71.02 | 1,234 | 129,737 | ソフトウェア | |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC | 119.86 | 129.32 | 7,933 | 833,931 | メディア | |
| VISTRA CORP | 300 | 380.32 | 811 | 85,275 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 232,877.56 608銘柄 | 278,491.28 592銘柄 | 3,119,137 — | 327,883,766 <68.7%> | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 163.02 | 205.78 | 1,742 | 144,386 | 金属・鉱業 | |
| ALIMENTATION COUCHE TARD INC | 684.96 | 784.79 | 3,125 | 258,877 | 食品・生活必需品小売り | |
| BARRICK GOLD CORP | 1,409.53 | 1,559.61 | 4,385 | 363,305 | 金属・鉱業 | |
| ATCO LTD | 71.93 | 71.93 | 277 | 22,988 | 総合公益事業 | |
| BANK OF MONTREAL | 502.86 | 584.93 | 5,708 | 472,926 | 銀行 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 945.61 | 1,094.36 | 7,771 | 643,753 | 銀行 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 255.48 | 291.32 | 2,117 | 175,374 | 銀行 | |
| BCE INC | 116.73 | 149.59 | 830 | 68,763 | 各種電気通信サービス | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT | 687.51 | 1,159.24 | 6,316 | 523,275 | 資本市場 | |
| BAUSCH HEALTH COS INC | 204.15 | 281.92 | 1,118 | 92,669 | 医薬品 | |
| BOMBARDIER INC 'B' | 1,516.15 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | |
| SAPUTO INC | 186.01 | 253.95 | 958 | 79,415 | 食品 | |
| BLACKBERRY LTD | 396.52 | 466.71 | 768 | 63,638 | ソフトウェア | |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO | 363.21 | 561.93 | 1,263 | 104,645 | 総合公益事業 | |
| CGI INC | 186.86 | 198.59 | 1,997 | 165,449 | 情報技術サービス | |
| CCL INDUSTRIES INC | 113.4 | 153.58 | 1,017 | 84,248 | 容器・包装 | |
| CAE INC | 230 | 250.06 | 802 | 66,495 | 航空宇宙・防衛 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---------------------------------|----------|----------|---------|-----------|-------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CAMECO CORP | 326.27 | 326.27 | 653 | 54,110 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROGERS COMM-CL B | 276.96 | 315.43 | 1,813 | 150,248 | 無線通信サービス |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 341.11 | 409.56 | 4,645 | 384,844 | 銀行 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 914.93 | 1,007.58 | 3,440 | 285,042 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN TIRE CORP-CL A | 48.62 | 48.62 | 846 | 70,138 | 複合小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD | 91.19 | 91.19 | 294 | 24,415 | 総合公益事業 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 554.93 | 634.82 | 8,918 | 738,815 | 陸運・鉄道 |
| YAMANA GOLD INC | - | 843.17 | 513 | 42,537 | 金属・鉱業 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 159.11 | 159.11 | 568 | 47,081 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OPEN TEXT CORP | 217.95 | 252.61 | 1,539 | 127,503 | ソフトウェア |
| EMPIRE CO LTD | 150.93 | 150.93 | 573 | 47,486 | 食品・生活必需品小売り |
| KINROSS GOLD CORP | 997.41 | 1,278.09 | 1,195 | 98,994 | 金属・鉱業 |
| RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC | - | 99.63 | 734 | 60,851 | 商業サービス・用品 |
| FORTIS INC | 323.12 | 452.28 | 2,329 | 192,954 | 電力 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 552.96 | 496.94 | 1,252 | 103,739 | 金属・鉱業 |
| TELUS CORP | 159.45 | 318.9 | 850 | 70,482 | 各種電気通信サービス |
| GREAT WEST LIFECO INC | 207.22 | 252.5 | 785 | 65,052 | 保険 |
| IMPERIAL OIL LTD | 215.42 | 215.42 | 554 | 45,934 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENBRIDGE INC | 1,565.99 | 1,830.5 | 8,056 | 667,361 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| IGM FINANCIAL INC | 29.53 | 60.69 | 211 | 17,521 | 資本市場 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,470.54 | 1,716.81 | 4,271 | 353,844 | 保険 |
| LOBLAW CO LTD | 153.54 | 151.36 | 947 | 78,466 | 食品・生活必需品小売り |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 239.09 | 270.24 | 2,672 | 221,359 | 自動車部品 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 442.41 | 518.08 | 3,212 | 266,090 | 保険 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 20.72 | 23.98 | 1,229 | 101,883 | 保険 |
| METRO INC | 199.49 | 207.6 | 1,136 | 94,173 | 食品・生活必需品小売り |
| HUSKY ENERGY INC | 287.49 | - | - | - | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EMERA INC | 191.38 | 224.33 | 1,166 | 96,634 | 電力 |
| METHANEX CORP | 52.81 | - | - | - | 化学 |
| ONEX CORP | 66.46 | 66.46 | 481 | 39,898 | 各種金融サービス |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | - | 187.66 | 794 | 65,851 | 金属・鉱業 |
| POWER CORP OF CANADA | 237.92 | 465.51 | 1,431 | 118,580 | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 216.76 | - | - | - | 保険 |
| QUEBECOR INC-B | 113.31 | 160.42 | 521 | 43,203 | メディア |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,113.11 | 1,270.82 | 13,496 | 1,118,017 | 銀行 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 107.47 | 122.36 | 5,673 | 470,010 | 陸運・鉄道 |
| SHAW COMM INC-B | 354.31 | 434.84 | 982 | 81,410 | メディア |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,191.41 | 1,308.06 | 2,994 | 248,035 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUNDIN MINING CORP | 434.8 | 643.1 | 855 | 70,854 | 金属・鉱業 |
| TECK RESOURCES LTD-CL B | 410.16 | 410.16 | 1,026 | 85,046 | 金属・鉱業 |
| THOMSON REUTERS CORP | 163.94 | 150.49 | 1,582 | 131,111 | 専門サービス |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD | - | 74.17 | 689 | 57,110 | 商社・流通業 |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$ | 1,409.24 | 1,612.38 | 12,160 | 1,007,381 | 銀行 |
| TC ENERGY CORP | 717.04 | 824.24 | 4,664 | 386,396 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD | 56.96 | 72 | 678 | 56,209 | 紙製品・林産品 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 61.84 | 61.84 | 599 | 49,640 | 食品・生活必需品小売り |
| INTACT FINANCIAL CORP | 109.89 | 125.15 | 1,867 | 154,723 | 保険 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 349.63 | 409.93 | 2,091 | 173,290 | 金属・鉱業 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 15.65 | 18.64 | 3,008 | 249,222 | ソフトウェア |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR | 149.22 | 176.52 | 2,714 | 224,856 | 金属・鉱業 |
| B2GOLD CORP | - | 1,016.75 | 649 | 53,821 | 金属・鉱業 |
| CI FINANCIAL CORP | 206.95 | 202.85 | 388 | 32,196 | 資本市場 |
| KEYERA CORP | 166.68 | 166.68 | 434 | 35,983 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PARKLAND CORP | 105.83 | 144.97 | 545 | 45,227 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ALTAGAS LTD | 239.44 | 239.44 | 476 | 39,432 | ガス |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 426.84 | 504.1 | 1,775 | 147,077 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DOLLARAMA INC | 235.36 | 269.06 | 1,311 | 108,636 | 複合小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------|-------------------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| STARS GROUP INC | 185.29 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| CENOVUS ENERGY INC W/I | 807.21 | 1,197.09 | 1,025 | 84,986 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| NORTHLAND POWER INC | — | 175.68 | 864 | 71,631 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| TMX GROUP LTD | — | 50.58 | 650 | 53,917 | 資本市場 | |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 152.5 | 218.4 | 1,061 | 87,910 | 金属・鉱業 | |
| INTER PIPELINE LTD | 279.46 | 418.63 | 729 | 60,446 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| NUTRIEN LTD | 444.53 | 506.3 | 3,599 | 298,206 | 化学 | |
| CRONOS GROUP INC | 160 | — | — | — | 医薬品 | |
| SSR MINING INC | — | 180 | 378 | 31,313 | 金属・鉱業 | |
| WSP GLOBAL INC | 84 | 101.94 | 1,176 | 97,451 | 建設・土木 | |
| IA FINANCIAL CORP INC | 81.04 | 122.78 | 794 | 65,786 | 保険 | |
| GFL ENVIRONMENTAL INC | — | 164.85 | 604 | 50,063 | 商業サービス・用品 | |
| OVINTIV INC | 192.78 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BROOKFIELD RENEWABLE CORP | — | 108.45 | 695 | 57,632 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 149.61 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| AIR CANADA | 107.22 | 107.22 | 239 | 19,833 | 旅客航空輸送業 | |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 196.85 | 251.76 | 1,888 | 156,481 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| AURORA CANNABIS INC | 665.62 | — | — | — | 医薬品 | |
| SHOPIFY INC | 76.05 | 97.39 | 17,989 | 1,490,281 | 情報技術サービス | |
| FIRSTSERVICE CORP | — | 35.03 | 664 | 55,008 | 不動産管理・開発 | |
| CANOPIY GROWTH CORP | 186.34 | 186.34 | 952 | 78,941 | 医薬品 | |
| HYDRO ONE LTD | 273.4 | 273.4 | 787 | 65,272 | 電力 | |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 30,926.62 85銘柄 | 35,759.37 87銘柄 | 192,614 — | 15,956,174 <3.3%> | |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 124.32 | 168.54 | 1,087 | 88,733 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 2,181.8 | 2,577.13 | 6,396 | 521,949 | 銀行 | |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 2,654.07 | 3,180.22 | 7,041 | 574,546 | 銀行 | |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,156.62 | 1,535.17 | 3,658 | 298,518 | 金属・鉱業 | |
| TELSTRA CORP LTD | 2,969.65 | 3,644.09 | 1,184 | 96,641 | 各種電気通信サービス | |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 390.14 | — | — | — | 銀行 | |
| AMP LTD | 3,024.14 | 3,024.14 | 399 | 32,573 | 各種金融サービス | |
| ASX LTD | 155.73 | 191.62 | 1,349 | 110,110 | 資本市場 | |
| BHP GROUP LTD | 2,281.36 | 2,637.49 | 11,794 | 962,460 | 金属・鉱業 | |
| AMPOL LTD | 209.46 | 209.46 | 560 | 45,720 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 148.67 | — | — | — | 複合小売り | |
| COMPUTERSHARE LT | 380.4 | 380.4 | 539 | 44,046 | 情報技術サービス | |
| CSL LIMITED | 351.66 | 407.66 | 11,282 | 920,643 | バイオテクノロジー | |
| REA GROUP LTD | 41.19 | 57.45 | 902 | 73,675 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | |
| TRANSURBAN GROUP | 2,064.75 | 2,508.16 | 3,273 | 267,088 | 運送インフラ | |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 486.01 | 526.93 | 691 | 56,455 | 飲料 | |
| COCHLEAR LTD | 43.81 | 55.33 | 1,142 | 93,192 | ヘルスケア機器・用品 | |
| ORIGIN ENERGY LTD | 1,328.6 | 1,328.6 | 579 | 47,268 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,370.26 | 1,589.4 | 13,807 | 1,126,660 | 銀行 | |
| BORAL LIMITED | 861.01 | — | — | — | 建設資材 | |
| RIO TINTO LIMITED | 280.81 | 338.59 | 3,973 | 324,225 | 金属・鉱業 | |
| APA GROUP | 941.06 | 1,182.05 | 1,120 | 91,439 | ガス | |
| ARISTOCRAT LEISU | 453.23 | 517.17 | 1,710 | 139,558 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 1,805.73 | 2,251.8 | 1,202 | 98,120 | 保険 | |
| TPG TELECOM LTD | 287.19 | 287.19 | 212 | 17,365 | 各種電気通信サービス | |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 32.75 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 339.26 | 398.39 | 1,621 | 132,310 | 建設資材 | |
| ORICA LTD | 278.65 | 413.11 | 632 | 51,575 | 化学 | |
| CIMIC GROUP LTD | 87.09 | 87.09 | 178 | 14,603 | 建設・土木 | |
| LEND LEASE CORP LTD | 429.74 | 621.16 | 741 | 60,519 | 不動産管理・開発 | |
| BLUESCOPE STEEL LTD | 369.41 | 496.93 | 844 | 68,934 | 金属・鉱業 | |
| SYDNEY AIRPORT | 851.3 | 1,160.56 | 648 | 52,938 | 運送インフラ | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 期末 | |
| | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 247.65 | 298.21 | 4,302 | 351,090 | 資本市場 |
| WORLEY LTD | 277.72 | - | - | - | エネルギー設備・サービス |
| SUNCORP GROUP LTD | 1,047.83 | 1,174.54 | 1,235 | 100,826 | 保険 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 2,264.21 | 2,998.19 | 7,474 | 609,918 | 銀行 |
| NEWCREST MINING LTD | 620.8 | 732.02 | 1,900 | 155,066 | 金属・鉱業 |
| OIL SEARCH LTD | 1,054.7 | 1,978.95 | 801 | 65,400 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INCITEC PIVOT LTD | 1,364.26 | - | - | - | 化学 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 622.82 | 622.82 | 283 | 23,124 | 旅客航空輸送業 |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 1,078.2 | 1,448.68 | 1,254 | 102,371 | 保険 |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | - | 934.04 | 1,126 | 91,918 | 金属・鉱業 |
| CHALLENGER FINANCIAL SERVICES | 457.07 | - | - | - | 各種金融サービス |
| SANTOS LTD | 1,328.62 | 1,596.18 | 1,086 | 88,699 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SONIC HEALTHCARE | 346.84 | 401.48 | 1,376 | 112,336 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD | 44.66 | 84.06 | 243 | 19,830 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TABCORP HOLDINGS LTD | 1,485.35 | 2,056.49 | 913 | 74,507 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESFARMERS LTD | 860.51 | 1,015.75 | 5,586 | 455,868 | 複合小売り |
| ALUMINA LIMITED | 1,846.13 | - | - | - | 金属・鉱業 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 759.44 | 861.96 | 2,153 | 175,699 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 956.47 | 1,117.03 | 4,590 | 374,625 | 食品・生活必需品小売り |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | 99.95 | 99.95 | 484 | 39,515 | 資本市場 |
| SEEK LTD | 258.99 | 358.36 | 1,119 | 91,381 | インターネット・メディアおよびサービス |
| AUSNET SERVICES | 1,650.66 | 1,650.66 | 282 | 23,032 | 電力 |
| AGL ENERGY LTD | 496.44 | 490.76 | 542 | 44,250 | 総合公益事業 |
| BRAMBLES LTD | 1,266.93 | 1,271.66 | 1,323 | 108,021 | 商業サービス・用品 |
| CROWN RESORTS LTD | 328.61 | 328.61 | 324 | 26,519 | ホテル・レストラン・レジャー |
| EVOLUTION MINING LTD | - | 1,409.64 | 651 | 53,142 | 金属・鉱業 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 1,501.5 | 1,501.5 | 578 | 47,171 | 陸連・鉄道 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 576.67 | 576.67 | 585 | 47,762 | 飲料 |
| XERO LTD | - | 104.98 | 1,367 | 111,585 | ソフトウェア |
| AFTERPAY LTD | - | 183.22 | 2,780 | 226,862 | 情報技術サービス |
| MEDIBANK PVT LTD | 2,069.1 | 2,831.54 | 812 | 66,312 | 保険 |
| SOUTH32 LTD(AUD) | 3,575.25 | 4,123.45 | 1,067 | 87,146 | 金属・鉱業 |
| COLES GROUP LTD | 816.08 | 1,210.32 | 2,196 | 179,253 | 食品・生活必需品小売り |
| WISETECH GLOBAL LTD | 80 | 136.04 | 446 | 36,466 | ソフトウェア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 57,763.33 62銘柄 | 65,373.59 58銘柄 | 127,470 - | 10,401,584 <2.2%> |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| ASM PACIFIC TECH | 191 | 329 | 3,964 | 53,757 | 半導体・半導体製造装置 |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 1,640 | 1,640 | 3,476 | 47,145 | 不動産管理・開発 |
| BANK OF EAST ASIA | 1,038.6 | 1,038.6 | 1,842 | 24,983 | 銀行 |
| CLP HOLDINGS LTD | 1,210 | 1,345 | 9,710 | 131,679 | 電力 |
| PCCW LTD | 3,310 | 3,310 | 1,515 | 20,556 | 各種電気通信サービス |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 495 | 495 | 2,096 | 28,426 | 電力 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 944.4 | 1,090.4 | 58,336 | 791,041 | 資本市場 |
| MTR CORP | 1,260 | 1,260 | 5,657 | 76,714 | 陸連・鉄道 |
| HANG SENG BANK LTD | 577 | 657 | 9,605 | 130,248 | 銀行 |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 1,154.5 | 1,154.5 | 3,607 | 48,921 | 不動産管理・開発 |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 1,015 | 1,345 | 5,561 | 75,414 | 電力 |
| HONG KONG & CHINA GAS | 7,767.55 | 9,132.92 | 10,027 | 135,978 | ガス |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 1,570 | 1,970 | 13,583 | 184,187 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES LTD | 735 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 2,750 | 3,175 | 7,508 | 101,820 | 銀行 |
| NWS HOLDINGS LTD | 1,350 | - | - | - | コンプロマリット |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS | 505 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 4,842.66 | 1,630.66 | 5,788 | 78,496 | 不動産管理・開発 |
| SINO LAND CO | 2,554 | 2,554 | 2,911 | 39,480 | 不動産管理・開発 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,250 | 1,085 | 11,804 | 160,073 | 不動産管理・開発 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|-------------------|-------------------|--------------|-----------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| SWIRE PACIFIC LTD A | 305 | 495 | 2,440 | 33,091 | 不動産管理・開発 |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 1,135 | 1,285 | 15,921 | 215,890 | 機械 |
| VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 700 | — | — | — | 食品 |
| WHEELLOCK & CO LTD | 640 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| XINYI GLASS HOLDING CO LTD | — | 1,660 | 3,701 | 50,196 | 建設関連製品 |
| SJM HOLDINGS LTD | 1,560 | 1,560 | 1,539 | 20,878 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD | 1,244 | 1,244 | 1,749 | 23,717 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIA GROUP LTD | 9,356.27 | 10,872.27 | 112,527 | 1,525,879 | 保険 |
| HKT TRUST / HKT LTD | 2,890 | 2,890 | 3,040 | 41,226 | 各種電気通信サービス |
| SANDS CHINA LTD | 1,992 | 1,988 | 6,739 | 91,385 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 1,042 | 1,042 | 2,349 | 31,862 | 不動産管理・開発 |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD | 957.5 | 1,497.5 | 6,581 | 89,245 | 不動産管理・開発 |
| ESR CAYMAN LTD | — | 1,474 | 4,171 | 56,564 | 不動産管理・開発 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD | 2,300 | 2,300 | 1,745 | 23,671 | 電力 |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LTD | 1,019 | 1,506 | 3,945 | 53,503 | 飲料 |
| WH GROUP LTD | 7,425 | 8,970 | 5,767 | 78,210 | 食品 |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 2,088.32 | 2,553.32 | 13,660 | 185,233 | コングロマリット |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 1,983.32 | 2,248.32 | 8,982 | 121,796 | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 351,864 | 4,771,281 | |
| | 72,797.12 36銘柄 | 76,797.49 33銘柄 | — | <1.0%> | |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポール・ドル | 千円 | |
| SINGAPORE TECH ENG | 1,250 | 1,250 | 465 | 36,902 | 航空宇宙・防衛 |
| SEMBCORP INDUSTRIES | 814 | — | — | — | 総合公益事業 |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 1,237 | — | — | — | メディア |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 1,419 | 1,557 | 4,059 | 322,130 | 銀行 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 364 | 364 | 261 | 20,740 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 59.44 | — | — | — | 販売 |
| SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD | 478 | — | — | — | 運送インフラ |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 689 | 689 | 685 | 54,405 | 資本市場 |
| CAPITALAND LTD | 2,045.15 | 3,088.15 | 960 | 76,218 | 不動産管理・開発 |
| GENTING SINGAPORE LTD | 4,164 | 4,268 | 367 | 29,128 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KEPPEL CORP LTD | 1,011 | 1,349 | 690 | 54,812 | コングロマリット |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 1,779 | — | — | — | 陸運・鉄道 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 2,515.53 | 2,716.53 | 2,865 | 227,440 | 銀行 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 6,071.22 | 6,768.22 | 1,610 | 127,835 | 各種電気通信サービス |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 475 | 1,608.5 | 702 | 55,783 | 旅客航空輸送業 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 952 | 1,024 | 2,451 | 194,547 | 銀行 |
| UOL GROUP LIMITED | 405 | 405 | 301 | 23,944 | 不動産管理・開発 |
| VENTURE CORP LTD | 210 | 210 | 418 | 33,214 | 電子装置・機器・部品 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,423 | 1,814 | 972 | 77,162 | 食品 |
| YANGZHIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 1,888 | — | — | — | 機械 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 16,812 | 1,334,268 | |
| | 29,249.34 20銘柄 | 27,111.4 14銘柄 | — | <0.3%> | |
| (ニュージーランド) | 百株 | 百株 | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 852.45 | 1,102.26 | 760 | 57,726 | 運送インフラ |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 298.94 | 298.94 | 437 | 33,240 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| A2 MILK CO LTD | 550.91 | 550.91 | 587 | 44,573 | 食品 |
| FISHER & PAYKEL | 431.84 | 490.44 | 1,581 | 120,048 | ヘルスケア機器・用品 |
| FLETCHER BUILDING LTD | 641.04 | — | — | — | 建設資材 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 1,596.23 | 1,596.23 | 749 | 56,881 | 各種電気通信サービス |
| MIGHTY RIVER POWER LTD | 617.34 | 617.34 | 419 | 31,862 | 電力 |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 756.56 | 1,241.62 | 721 | 54,752 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,258 | 399,085 | |
| | 5,745.31 8銘柄 | 5,897.74 7銘柄 | — | <0.1%> | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| ANTOFAGASTA PLC | 317.98 | 317.98 | 487 | 71,096 | 金属・鉱業 |
| ASHTREAD GROUP | 366.89 | 389.16 | 1,524 | 222,381 | 商社・流通業 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| SEVERN TRENT PLC | 182.17 | 219.33 | 514 | 75,110 | 水道 |
| BHP GROUP PLC | 1,612.84 | 1,844.54 | 3,905 | 569,662 | 金属・鉱業 |
| BARCLAYS PLC | 13,428.31 | 16,088.89 | 2,347 | 342,363 | 銀行 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 822.83 | 822.83 | 559 | 81,606 | 家庭用耐久財 |
| BT GROUP PLC | 6,307.77 | 7,955.07 | 986 | 143,870 | 各種電気通信サービス |
| BUNZL PLC | 278.38 | 288.34 | 675 | 98,533 | 商社・流通業 |
| EASYJET PLC | 136.28 | - | - | - | 旅客航空輸送業 |
| AVIVA PLC | 3,146.91 | 3,634.64 | 1,267 | 184,797 | 保険 |
| CRODA INTERNATIONAL | 103.91 | 125.68 | 829 | 120,980 | 化学 |
| DIAGEO PLC | 1,828.12 | 2,096.47 | 6,308 | 920,062 | 飲料 |
| SCHRODERS PLC | 109.32 | 113.54 | 400 | 58,439 | 資本市場 |
| DCC PLC | 78.98 | 78.98 | 464 | 67,756 | コンゴロマリット |
| NATIONAL GRID PLC | 2,646.42 | 3,068.81 | 2,628 | 383,312 | 総合公益事業 |
| KINGFISHER PLC | 1,656.8 | 1,971.59 | 534 | 77,899 | 専門小売り |
| BAE SYSTEMS PLC | 2,486.72 | 2,737.49 | 1,313 | 191,646 | 航空宇宙・防衛 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,772.72 | 2,065.85 | 5,607 | 817,890 | タバコ |
| HALMA PLC | 279.01 | 319.01 | 816 | 119,064 | 電子装置・機器・部品 |
| NEXT PLC | 100.18 | 114.67 | 880 | 128,411 | 複合小売り |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 716.56 | 877.08 | 1,309 | 191,051 | タバコ |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 150.17 | 191.07 | 573 | 83,686 | 化学 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 789.81 | 1,075.54 | 2,864 | 417,738 | 金属・鉱業 |
| COMPASS GROUP PLC | 1,195.6 | 1,564.43 | 2,205 | 321,608 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HSBC HOLDINGS PLC | 15,612.12 | 18,255.85 | 7,335 | 1,069,838 | 銀行 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 4,527.58 | 5,146.92 | 1,337 | 195,101 | 保険 |
| CENTRICA PLC | 4,713.4 | - | - | - | 総合公益事業 |
| UNILEVER PLC | 855.86 | 2,351.36 | 9,313 | 1,358,408 | パーソナル用品 |
| MEGGITT PLC | 621.81 | - | - | - | 航空宇宙・防衛 |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS | 1,686.76 | 2,302.12 | 393 | 57,415 | 食品・生活必需品小売り |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 544.87 | 677.14 | 639 | 93,230 | 水道 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC GRP | 808.64 | 954.87 | 646 | 94,284 | 保険 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 255.47 | 311.66 | 694 | 101,229 | 食品 |
| PEARSON PLC | 650.09 | 650.09 | 496 | 72,382 | メディア |
| PERSIMMON PLC | 260.85 | 281.26 | 765 | 111,661 | 家庭用耐久財 |
| PRUDENTIAL PLC | 2,049.4 | 2,268.96 | 3,013 | 439,472 | 保険 |
| RIO TINTO PLC | 874.36 | 1,010.08 | 5,993 | 874,197 | 金属・鉱業 |
| VODAFONE GROUP PLC | 20,437.18 | 24,232.37 | 3,244 | 473,241 | 無線通信サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 544.64 | 645.58 | 4,071 | 593,759 | 家庭用品 |
| RELX PLC | 1,475.23 | 1,741.63 | 3,250 | 474,122 | 専門サービス |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 1,406.17 | 1,697.66 | 891 | 130,041 | 商業サービス・用品 |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC | 1,392.68 | 6,709.69 | 622 | 90,814 | 航空宇宙・防衛 |
| NATWEST GROUP PLC | 3,974.34 | 4,230.54 | 724 | 105,696 | 銀行 |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 376.85 | 497.89 | 609 | 88,956 | 資本市場 |
| SSE PLC | 746.84 | 886.46 | 1,260 | 183,850 | 電力 |
| BP PLC | 15,740.09 | 18,382.94 | 4,812 | 701,925 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SAGE GROUP PLC(THE) | 871.11 | 1,084.48 | 640 | 93,352 | ソフトウェア |
| SMITHS GROUP PLC | 317.2 | 403.17 | 603 | 88,027 | コンゴロマリット |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 55.18 | 65.74 | 773 | 112,804 | 機械 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 2,183.29 | 2,400.93 | 1,111 | 162,096 | 銀行 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 53,939.91 | 64,953.56 | 2,409 | 351,465 | 銀行 |
| TAYLOR WIMPLEY PLC | 2,522.87 | 3,467.94 | 558 | 81,484 | 家庭用耐久財 |
| TESCO PLC | 7,573.16 | 8,605.34 | 2,070 | 301,974 | 食品・生活必需品小売り |
| 3I GROUP PLC | 766.43 | 886.51 | 1,016 | 148,304 | 資本市場 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 680.27 | 769.28 | 1,209 | 176,433 | ヘルスケア機器・用品 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 3,862.19 | 4,499.85 | 5,750 | 838,755 | 医薬品 |
| WEIR GROUP | 191.61 | - | - | - | 機械 |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC | 246.6 | 275.89 | 2,703 | 394,337 | 資本市場 |
| WPP PLC | 951.48 | 1,115.98 | 920 | 134,314 | メディア |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 |
|---------------------------------|------------------|------------------|---------|------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| ASTRAZENECA PLC | 1,015.56 | 1,175.51 | 8,782 | 1,280,889 | 医薬品 |
| WHITBREAD PLC | 98.14 | 185.94 | 596 | 86,971 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CARNIVAL PLC | 133.5 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 1,767.3 | — | — | — | 複合小売り |
| INTERTEK GROUP PLC | 120.83 | 138.42 | 808 | 117,860 | 専門サービス |
| BURBERRY GROUP PLC | 316.86 | 389.5 | 696 | 101,573 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS | 124.6 | 166.52 | 815 | 118,884 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ITV PLC | 2,543.08 | — | — | — | メディア |
| SAINSBURY (J) PLC | 1,372.15 | 1,902.05 | 435 | 63,555 | 食品・生活必需品小売り |
| G4S PLC | 1,222.5 | — | — | — | 商業サービス・用品 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 158.93 | 158.93 | 476 | 69,470 | 保険 |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS | 82.33 | 115.81 | 498 | 72,681 | 家庭用耐久財 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 3,336.87 | 3,777.76 | 5,130 | 748,349 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 2,863.67 | 3,238.58 | 4,212 | 614,334 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | — | 182 | 429 | 62,645 | 医薬品 |
| TUI AG-DI | 298.24 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| AVEVA GROUP PLC | 57.04 | 104.08 | 397 | 57,911 | ソフトウェア |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 2,011.44 | 2,063.13 | 659 | 96,230 | 資本市場 |
| EXPERIAN PLC | 698.42 | 803.76 | 2,120 | 309,248 | 専門サービス |
| MONDI PLC | 397.67 | 471.7 | 867 | 126,587 | 紙製品・林産品 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 209.27 | 280.11 | 461 | 67,245 | 資本市場 |
| FRESNILLO PLC NPR | — | 173.85 | 177 | 25,875 | 金属・鉱業 |
| OCADO GROUP PLC | 310.11 | 427.89 | 1,121 | 163,508 | インターネット販売・通信販売 |
| INFORMA PLC | 1,024.75 | 1,493.58 | 758 | 110,662 | メディア |
| GLENCORE PLC | 8,664.21 | 8,804.08 | 2,366 | 345,159 | 金属・鉱業 |
| ENTAIN PLC | 496.18 | 496.18 | 671 | 97,913 | ホテル・レストラン・レジャー |
| EVRAZ PLC | 487.65 | 487.65 | 250 | 36,500 | 金属・鉱業 |
| NMC HEALTH PLC | 81.49 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | 1,126.94 | 1,126.94 | 345 | 50,344 | 保険 |
| COCA-COLA HBC AG | 152.08 | 152.08 | 361 | 52,679 | 飲料 |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | — | 517.21 | 366 | 53,483 | 保険 |
| FERGUSON PLC | 171.28 | 205.31 | 1,831 | 267,104 | 商社・流通業 |
| M&G PLC | 2,049.4 | 2,049.4 | 384 | 56,104 | 各種金融サービス |
| JD SPORTS FASHION PLC | 320.86 | 320.86 | 258 | 37,634 | 専門小売り |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | 261 | — | — | — | ソフトウェア |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 763.48 | 980.62 | 580 | 84,727 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 3,647.35 | 4,246.75 | 725 | 105,791 | コンピュータソフト |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 146,478 | 21,363,882 | |
| (イスラエル) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| BANK HAPOALIM BM | 797.54 | 1,023.59 | 2,359 | 76,231 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL BM | 1,063.99 | 1,307.03 | 2,594 | 83,826 | 銀行 |
| ELBIT SYSTEMS LTD | 17.6 | 17.6 | 820 | 26,499 | 航空宇宙・防衛 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK LTD | 1,021.34 | 1,021.34 | 1,278 | 41,315 | 銀行 |
| ICL GROUP LTD | 494.11 | 494.11 | 944 | 30,508 | 化学 |
| NICE LTD | 49.02 | 55.35 | 4,964 | 160,415 | ソフトウェア |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 104.44 | 104.44 | 803 | 25,946 | 銀行 |
| AZRIELI GROUP | 22.91 | 44.14 | 898 | 29,022 | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 14,663 | 473,765 | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG | 1,914.83 | 2,257.7 | 2,782 | 327,931 | 資本市場 |
| LOGITECH INTL-REG | — | 144.29 | 1,512 | 178,207 | コンピュータ・周辺機器 |
| NESTLE SA-REGISTERED | 2,303.64 | 2,570.32 | 25,888 | 3,050,931 | 食品 |
| CIE FINANCIER RICHEMONT | 409.15 | 474.14 | 4,162 | 490,491 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 544.32 | 628.85 | 19,695 | 2,321,124 | 医薬品 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 28.96 | 34.67 | 870 | 102,555 | 機械 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|------------------|------------------|-------------|------------|-------|--------|-------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | | 株数 | 株数 | | | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイス・フラン | 千円 | | | |
| SIKA INHABER | 102.09 | 123.63 | 3,147 | 370,946 | | | 化学 |
| SGS SA-REG | 4.24 | 5.4 | 1,473 | 173,670 | | | 専門サービス |
| NOVARTIS AG-REG SHS | 1,662.22 | 1,981.27 | 16,246 | 1,914,639 | | | 医薬品 |
| BALOISE HOLDING AG -R | 32.52 | 42.59 | 660 | 77,798 | | | 保険 |
| BARRY CALLEBAUT AG | 2.65 | 2.65 | 535 | 63,147 | | | 食品 |
| CLARIANT AG-REG | 122.82 | 199.79 | 371 | 43,794 | | | 化学 |
| SWISSCOM AG-REG | 19.6 | 24.89 | 1,156 | 136,339 | | | 各種電気通信サービス |
| ABB LTD | 1,408.52 | 1,657.76 | 4,343 | 511,861 | | | 電気設備 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 129.44 | 129.44 | 738 | 87,011 | | | 専門サービス |
| GEBERIT AG | 29.01 | 31.81 | 1,773 | 208,958 | | | 建設関連製品 |
| LONZA GROUP AG-REG | 57.93 | 68.69 | 4,190 | 493,802 | | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LINDT & SPRUENGLI PART | 0.79 | 0.95 | 779 | 91,861 | | | 食品 |
| LINDT & SPRUENGLI NAMEN | 0.09 | 0.09 | 774 | 91,215 | | | 食品 |
| GIVAUDAN-REG | 7.42 | 8.12 | 2,967 | 349,762 | | | 化学 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 115.58 | 135.85 | 5,063 | 596,689 | | | 保険 |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 379.97 | 478.95 | 2,392 | 281,939 | | | 建設資材 |
| TEMENOS GROUP | 47.3 | 57.23 | 600 | 70,784 | | | ソフトウェア |
| SONOVA HOLDING AG | 45.84 | 46.98 | 1,122 | 132,269 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG | 40.18 | 45.18 | 942 | 111,015 | | | 海運業 |
| STRAUMANN HOLDING AG | 7.94 | 9.19 | 1,015 | 119,730 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 21.34 | 24.41 | 646 | 76,233 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 45.92 | 45.92 | 235 | 27,734 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SCHINDLER NAMEN | 16.63 | 16.63 | 416 | 49,035 | | | 機械 |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 24.58 | 27.61 | 1,204 | 141,964 | | | 保険 |
| BANQUE CANTONALE VAUD | - | 25 | 248 | 29,285 | | | 銀行 |
| VIFOR PHARMA AG | 34.65 | 46.45 | 548 | 64,594 | | | 医薬品 |
| EMS-CHEMIE HOLDING | 6.33 | 8.27 | 740 | 87,228 | | | 化学 |
| SWISS PRIME SITE AG | 59.9 | 83.37 | 731 | 86,166 | | | 不動産管理・開発 |
| PARGESA HOLDING PORTEUR | 30 | - | - | - | | | 各種金融サービス |
| DUFREY GROUP | 31.38 | - | - | - | | | 専門小売り |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 15.05 | 16.58 | 1,852 | 218,354 | | | 資本市場 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 178.49 | 201.18 | 1,098 | 129,451 | | | 資本市場 |
| SWISS RE LTD | 225.97 | 248.71 | 2,086 | 245,914 | | | 保険 |
| ALCON INC | 320.32 | 429.61 | 2,856 | 336,686 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| UBS GROUP AG | 3,016.86 | 3,314.28 | 4,540 | 535,105 | | | 資本市場 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 122,411 | 14,426,235 | | | <3.0%> |
| (デンマーク) | 百株 | 百株 | 千デンマーク・クローネ | 千円 | | | |
| CARLSBERG AS-B | 84.41 | 99.74 | 9,585 | 164,191 | | | 飲料 |
| A P MOLLER A/S | 4.91 | 5.68 | 7,196 | 123,277 | | | 海運業 |
| AP MOLLER MAERSK A | 2.73 | 2.55 | 2,996 | 51,325 | | | 海運業 |
| DANSKE BANK A/S | 510.34 | 593.05 | 6,505 | 111,443 | | | 銀行 |
| GENMAB A/S | 50.14 | 61.9 | 15,524 | 265,935 | | | バイオテクノロジー |
| NOVOZYMES-B SHS | 155.33 | 177.4 | 7,195 | 123,256 | | | 化学 |
| ROCKWOOL INTERNATIONAL AS | - | 8.13 | 1,843 | 31,585 | | | 建設関連製品 |
| NOVO NORDISK A/S-B | 1,369.25 | 1,540.44 | 70,860 | 1,213,835 | | | 医薬品 |
| GN STORE NORD A/S | - | 128.95 | 7,110 | 121,799 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 139.63 | 181.27 | 23,583 | 403,980 | | | 電気設備 |
| COLOPLAST-B | 97.29 | 107.34 | 11,056 | 189,389 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| DSV PANALPINA A S | 176.26 | 190.49 | 21,353 | 365,792 | | | 航空貨物・物流サービス |
| DEMANT A/S | 72.44 | 107.39 | 2,849 | 48,804 | | | ヘルスケア機器・用品 |
| H LUNDBECK A/S | 48.4 | 48.4 | 1,235 | 21,158 | | | 医薬品 |
| TRYG A/S | 111.07 | 111.07 | 2,228 | 38,166 | | | 保険 |
| PANDORA A/S | 82.51 | 82.51 | 5,052 | 86,556 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 75.39 | 93.36 | 5,355 | 91,733 | | | 化学 |
| AMBU A/S B | - | 141.56 | 4,675 | 80,095 | | | ヘルスケア機器・用品 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|------------------------------------|------------------|------------------|---------|-----------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 末 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (デンマーク) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| ISS A/S | 111.07 | — | — | — | 商業サービス・用品 |
| ORSTED A/S | 150.9 | 164.71 | 17,162 | 293,998 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 223,369 | 3,826,326 | |
| | 17銘柄 | 19銘柄 | — | <0.8%> | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| MOWI ASA | 351.83 | 435.37 | 8,374 | 104,176 | 食品 |
| DNB ASA | 713.52 | 807.09 | 13,280 | 165,211 | 銀行 |
| NORSK HYDRO ASA | 931.39 | 1,290.36 | 5,293 | 65,845 | 金属・鉱業 |
| TELENOR ASA | 547.66 | 630.38 | 8,945 | 111,276 | 各種電気通信サービス |
| SCHIBSTED ASA | — | 75.37 | 2,713 | 33,753 | メディア |
| ORKLA ASA | 649.38 | 652.83 | 5,291 | 65,830 | 食品 |
| EQUINOR ASA | 810.22 | 831.49 | 12,555 | 156,190 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 121.71 | 151.93 | 6,285 | 78,189 | 化学 |
| AKER BP ASA | 85.52 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 166.83 | 166.83 | 3,403 | 42,337 | 保険 |
| ADEVINTA ASA | — | 222.65 | 2,996 | 37,281 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SCHIBSTED ASA | 74.45 | 74.45 | 2,251 | 28,007 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 71,390 | 888,100 | |
| | 10銘柄 | 11銘柄 | — | <0.2%> | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 522.84 | 564.89 | 27,803 | 351,997 | 機械 |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 287.68 | 360.51 | 15,314 | 193,881 | 機械 |
| ERICSSON LM-B SHS | 2,361.6 | 2,649.68 | 30,100 | 381,070 | 通信機器 |
| LUNDBERGS B | 73.82 | 73.82 | 3,239 | 41,008 | 各種金融サービス |
| SKF AB-B SHS | 288.12 | 348.49 | 7,757 | 98,208 | 機械 |
| SANDVIK AB | 877.84 | 1,034 | 22,344 | 282,884 | 機械 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 1,308.27 | 1,449.9 | 13,692 | 173,351 | 銀行 |
| SKANSKA AB-B SHS | 244 | 316.53 | 6,580 | 83,311 | 建設・土木 |
| SWEDBANK AB | 719.58 | 798.25 | 11,940 | 151,163 | 銀行 |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | — | 529.45 | 8,023 | 101,581 | 紙製品・林産品 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 1,121.06 | 1,392.3 | 11,831 | 149,790 | 銀行 |
| VOLVO AB-B SHS | 1,192.27 | 1,305.9 | 27,450 | 347,517 | 機械 |
| SWEDISH MATCH AB | 129.41 | 138.45 | 8,525 | 107,936 | タバコ |
| TELE2 AB-B SHS | 346.18 | 470.55 | 5,187 | 65,677 | 無線通信サービス |
| INDUSTRIVARDEN A | — | 119.55 | 3,498 | 44,285 | 各種金融サービス |
| INDUSTRIVARDEN C | 114.03 | 114.03 | 3,183 | 40,305 | 各種金融サービス |
| ELECTROLUX AB-SER B | 191.91 | 191.91 | 4,055 | 51,337 | 家庭用耐久財 |
| SECURITAS AB-B SHS | 240.98 | 240.98 | 3,012 | 38,135 | 商業サービス・用品 |
| INVESTOR AB-B SHS | 351.8 | 395.67 | 25,750 | 325,997 | 各種金融サービス |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS | 602.83 | 688.14 | 12,376 | 156,682 | 専門小売り |
| ASSA ABLOY AB-B | 810.88 | 870.21 | 19,614 | 248,319 | 建設関連製品 |
| TELIA CO AB | 2,318.55 | 2,104.77 | 7,436 | 94,141 | 各種電気通信サービス |
| LUNDIN ENERGY AB | 121.46 | 147.39 | 3,746 | 47,432 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BOLIDEN AB | 218.55 | 283.76 | 8,816 | 111,615 | 金属・鉱業 |
| ALFA LAVAL AB | 233.43 | 283.92 | 7,072 | 89,537 | 機械 |
| KINNEVIK AB-B | 183.1 | 217.22 | 9,554 | 120,958 | 各種金融サービス |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA | 78.44 | — | — | — | 無線通信サービス |
| FASTIGHETS AB BALDER | — | 89.67 | 3,753 | 47,520 | 不動産管理・開発 |
| ICA GRUPPEN AB | 59.2 | 90.09 | 3,714 | 47,024 | 食品・生活必需品小売り |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 336.92 | 336.92 | 3,463 | 43,848 | 家庭用耐久財 |
| NIBE INDUSTRIER AB | — | 288.34 | 8,367 | 105,934 | 建設関連製品 |
| HEXAGON AB | 211.45 | 265.34 | 19,481 | 246,632 | 電子装置・機器・部品 |
| EPIROC AB-A | 489.55 | 607.5 | 10,409 | 131,784 | 機械 |
| EPIROC AB-B | 308.99 | 308.99 | 4,795 | 60,711 | 機械 |
| ESSITY AB-B | 466.4 | 521.43 | 13,739 | 173,944 | 家庭用品 |
| EQT AB | — | 209.34 | 5,442 | 68,906 | 資本市場 |
| EVOLUTION GAMING GROUP AB | — | 136.41 | 14,152 | 179,171 | ホテル・レストラン・レジャー |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 | |
|-------------------------------|------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | |
| NORDEA BANK ABP | 2,592.68 | 2,957.52 | 21,193 | 268,310 | 銀行 | |
| INVESTMENT AB LATOUR | — | 149.45 | 3,036 | 38,446 | コンプロマリット | |
| 小計 | 株数・金 銘柄 額 数<比 率> | 19,403.82 | 23,051.27 | 419,459 | 5,310,363 | |
| | | 32銘柄 | 38銘柄 | — | <1.1%> | |
| (ユーロ…イギリス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| UNILEVER PLC | 1,131.34 | — | — | — | パーソナル用品 | |
| 小計 | 株数・金 銘柄 額 数<比 率> | 1,131.34 | — | — | — | |
| | | 1銘柄 | —銘柄 | — | <—%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| CRH PLC | 619.9 | 716.53 | 2,635 | 335,855 | 建設資材 | |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 62.46 | 141.28 | 2,263 | 288,435 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| KERRY GROUP PLC-A | 122.58 | 147.3 | 1,596 | 203,487 | 食品 | |
| KINGSPAN GROUP PLC | 117.68 | 134.52 | 716 | 91,287 | 建設関連製品 | |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 173.97 | 208.7 | 874 | 111,387 | 容器・包装 | |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 822.56 | — | — | — | 銀行 | |
| AIB GROUP PLC | 413.52 | — | — | — | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金 銘柄 額 数<比 率> | 2,332.67 | 1,348.33 | 8,085 | 1,030,453 | |
| | | 7銘柄 | 5銘柄 | — | <0.2%> | |
| (ユーロ…オランダ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| AIRBUS SE | 451.22 | 531.76 | 4,903 | 624,884 | 航空宇宙・防衛 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 137.16 | 152.1 | 2,210 | 281,740 | 化学 | |
| ING GROEP NV-CVA | 3,045.08 | 3,448.92 | 2,879 | 366,963 | 銀行 | |
| RANDSTAD NV | 90.74 | 126.01 | 681 | 86,845 | 専門サービス | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 890.26 | 992.8 | 2,334 | 297,454 | 食品・生活必需品小売り | |
| HEINEKEN NV | 195.82 | 226.83 | 1,951 | 248,717 | 飲料 | |
| AKZO NOBEL | 174.91 | 179.59 | 1,530 | 195,042 | 化学 | |
| ASML HOLDING NV | 330.53 | 380.98 | 18,848 | 2,402,114 | 半導体・半導体製造装置 | |
| AEGON NV | 1,503.49 | 1,503.49 | 561 | 71,602 | 保険 | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 719.25 | 829.19 | 3,976 | 506,802 | ヘルスケア機器・用品 | |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 206.87 | 257.15 | 1,811 | 230,905 | 専門サービス | |
| STMICROELECTRONICS NV | 556.11 | 541.76 | 1,912 | 243,717 | 半導体・半導体製造装置 | |
| QIAGEN N.V. | 179.74 | 207.63 | 936 | 119,309 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| VOPAK (KON.) | 53.64 | 53.64 | 234 | 29,879 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 2,910.29 | 3,478.24 | 1,018 | 129,788 | 各種電気通信サービス | |
| HEINEKEN HOLDING NV-A | 97.91 | 100.04 | 743 | 94,789 | 飲料 | |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 397.52 | 553.04 | 540 | 68,928 | 飲料 | |
| FERRARI NV | 89.34 | 115.42 | 1,947 | 248,216 | 自動車 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 779.51 | 893.78 | 1,083 | 138,050 | 機械 | |
| PROSUS NV | 368.71 | 442.19 | 4,656 | 593,393 | インターネット販売・通信販売 | |
| JDE PEET'S BV | — | 73.08 | 235 | 30,044 | 食品 | |
| NN GROUP NV | 217.2 | 252.74 | 900 | 114,793 | 保険 | |
| ARGENX SE | — | 38.79 | 1,201 | 153,146 | バイオテクノロジー | |
| STELLANTIS NV | 790.84 | 1,769.58 | 2,347 | 299,168 | 自動車 | |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | 90 | 108.36 | 982 | 125,223 | インターネット販売・通信販売 | |
| ABN AMRO BANK NV | 342.51 | 342.51 | 300 | 38,280 | 銀行 | |
| EXOR NV | 79.71 | 99.66 | 672 | 85,729 | 各種金融サービス | |
| ALTICE EUROPE NV | 567.63 | — | — | — | 各種電気通信サービス | |
| ADYEN NV | 8.18 | 15.89 | 3,479 | 443,479 | 情報技術サービス | |
| 小計 | 株数・金 銘柄 額 数<比 率> | 15,274.17 | 17,715.17 | 64,885 | 8,269,017 | |
| | | 27銘柄 | 28銘柄 | — | <1.7%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| UMICORE | 141.15 | 176.54 | 839 | 107,046 | 化学 | |
| KBC GROUPE | 185.77 | 210.38 | 1,245 | 158,773 | 銀行 | |
| SOFINA | — | 13.82 | 406 | 51,867 | 各種金融サービス | |
| SOLVAY SA | 55.63 | 71.83 | 687 | 87,622 | 化学 | |
| AGEAS | 143.65 | 143.65 | 652 | 83,167 | 保険 | |
| UCB SA | 90.95 | 105.71 | 927 | 118,173 | 医薬品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|------------------|------------------|------------------|-------------|---------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ユーロ…ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| COLRUYT NV | 46.73 | 46.73 | 236 | 30,169 | 食品・生活必需品小売り |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 66.89 | 99.04 | 841 | 107,208 | 各種金融サービス |
| PROXIMUS | 142.83 | 137.39 | 233 | 29,730 | 各種電気通信サービス |
| GALAPAGOS NV | 34.26 | 34.26 | 242 | 30,859 | バイオテクノロジー |
| ELIA GROUP | - | 28.62 | 281 | 35,816 | 電力 |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 36.34 | - | - | - | メディア |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 587.31 | 663.27 | 3,488 | 444,612 | 飲料 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,531.51 11銘柄 | 1,731.24 12銘柄 | 10,083 - | 1,285,048 <0.3%> |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ARCELOR MITTAL (NL) | 467.14 | 615.94 | 1,150 | 146,676 | 金属・鉱業 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 8.99 | 113.3 | 922 | 117,605 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| TENARIS SA | 369.59 | 369.59 | 262 | 33,488 | エネルギー設備・サービス |
| SES FDR | 288.47 | 288.47 | 199 | 25,476 | メディア |
| AROUNDTOWN SA | 717.83 | 830.54 | 483 | 61,558 | 不動産管理・開発 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,852.02 5銘柄 | 2,217.84 5銘柄 | 3,019 - | 384,805 <0.1%> |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| AIR LIQUIDE | 363.17 | 412 | 5,557 | 708,296 | 化学 |
| AXA SA | 1,481.6 | 1,694.93 | 3,240 | 412,909 | 保険 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 444.49 | 507.07 | 1,140 | 145,332 | 総合公益事業 |
| DASSAULT AVIATION SA | 1.63 | 2.95 | 270 | 34,512 | 航空宇宙・防衛 |
| DANONE | 488.33 | 543.15 | 2,928 | 373,229 | 食品 |
| SAFRAN SA | 258.98 | 280.36 | 3,053 | 389,089 | 航空宇宙・防衛 |
| ACCOR SA | 122.77 | 173.8 | 519 | 66,247 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BOUYGUES | 175.72 | 214.17 | 718 | 91,570 | 建設・土木 |
| BNP PARIBAS | 864.34 | 1,019.91 | 4,731 | 602,949 | 銀行 |
| THALES SA | 85.49 | 105.13 | 818 | 104,368 | 航空宇宙・防衛 |
| CAPGEMINI SA | 125.15 | 149.12 | 2,017 | 257,122 | 情報技術サービス |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 42.64 | - | - | - | 食品・生活必需品小売り |
| INGENICO GROUP | 43.34 | - | - | - | 電子装置・機器・部品 |
| NATIXIS | 701.66 | 701.66 | 280 | 35,767 | 資本市場 |
| EIFFAGE | 64.61 | 84.65 | 690 | 87,942 | 建設・土木 |
| PUBLICIS GROUPE | 151.98 | 185.95 | 873 | 111,378 | メディア |
| FAURECIA | 61.17 | 61.17 | 268 | 34,269 | 自動車部品 |
| L'OREAL | 195.54 | 224.47 | 7,144 | 910,543 | パーソナル用品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 214.86 | 248.73 | 13,165 | 1,677,783 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BOLLORE | 713.47 | 713.47 | 258 | 32,951 | 娯楽 |
| MICHELIN(CGDE)-B | 124.22 | 148.02 | 1,727 | 220,139 | 自動車部品 |
| PERNOD-RICARD | 167.19 | 190.38 | 3,032 | 386,494 | 飲料 |
| PEUGEOT SA | 439.05 | - | - | - | 自動車 |
| RENAULT SA | 149.17 | 190.19 | 748 | 95,351 | 自動車 |
| REMY COINTREAU | 18.6 | 18.6 | 296 | 37,760 | 飲料 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 394.36 | 445.6 | 1,879 | 239,585 | 建設関連製品 |
| SEB SA | 15.51 | 22.18 | 371 | 47,374 | 家庭用耐久財 |
| SOCIETE GENERALE-A | 611.81 | 695.95 | 1,236 | 157,623 | 銀行 |
| VINCI S.A. | 392.37 | 472.57 | 4,048 | 515,881 | 建設・土木 |
| SODEXO | 70.75 | 91.78 | 684 | 87,208 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 436.56 | 483.76 | 6,240 | 795,289 | 電気設備 |
| VIVENDI SA | 679.89 | 709.95 | 1,852 | 236,142 | 娯楽 |
| TOTAL SE | 1,860.2 | 2,258.11 | 7,897 | 1,006,487 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VALEO | 196.53 | 196.53 | 635 | 81,048 | 自動車部品 |
| ORANGE | 1,512.46 | 1,840.93 | 1,794 | 228,649 | 各種電気通信サービス |
| HERMES INTL | 24.83 | 28.8 | 2,662 | 339,279 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 99.53 | 121.83 | 2,317 | 295,382 | ソフトウェア |
| KERING | 58.3 | 68.27 | 3,740 | 476,691 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CNP ASSURANCES | 139.87 | 139.87 | 187 | 23,921 | 保険 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-----------------------------|------------------|-------------------|-------------------|--------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| CARREFOUR SA | 510.94 | 499.26 | 721 | 91,907 | 食品・生活必需品小売り |
| ATOS SE | 73.04 | 89.72 | 592 | 75,463 | 情報技術サービス |
| SANOFI | 871.69 | 1,014.54 | 7,929 | 1,010,553 | 医薬品 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 59.35 | 76.86 | 580 | 73,932 | 娯楽 |
| TELEPERFORMANCE | 43.83 | 53.12 | 1,567 | 199,703 | 専門サービス |
| EURAZEO | 27.48 | 52.29 | 324 | 41,315 | 各種金融サービス |
| JC DECAUX SA | 60.58 | — | — | — | メディア |
| ESSILORLUXOTTICA | 217.61 | 249.84 | 3,420 | 435,884 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 862.05 | 986.85 | 1,073 | 136,768 | 銀行 |
| ORPEA | — | 49.32 | 574 | 73,192 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WENDEL | 22.2 | 22.2 | 216 | 27,570 | 各種金融サービス |
| ILIAD SA | 21.02 | 10.46 | 160 | 20,401 | 各種電気通信サービス |
| BIOMERIEUX | 32.48 | 32.48 | 407 | 51,988 | ヘルスケア機器・用品 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 18.84 | 23.87 | 969 | 123,504 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| ENGIE | 1,392.72 | 1,660.61 | 2,167 | 276,280 | 総合公益事業 |
| ALSTOM | 157.12 | 217.79 | 915 | 116,682 | 機械 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 125.42 | — | — | — | メディア |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 538 | 547.78 | 581 | 74,102 | 電力 |
| IPSEN SA | 36.46 | 36.46 | 271 | 34,569 | 医薬品 |
| ARKEMA SA | 50.33 | 63.93 | 571 | 72,820 | 化学 |
| LEGRAND SA | 206.73 | 238.06 | 1,798 | 229,176 | 電気設備 |
| ADP | 23.13 | 23.13 | 231 | 29,462 | 運送インフラ |
| SCOR SE | 101.16 | 156.67 | 436 | 55,625 | 保険 |
| BUREAU VERITAS SA | 231.79 | 298.1 | 668 | 85,135 | 専門サービス |
| GETLINK | 376.46 | 376.46 | 499 | 63,616 | 運送インフラ |
| SUEZ SA | 266.2 | 266.2 | 454 | 57,875 | 総合公益事業 |
| EDENRED | 191.88 | 214.88 | 1,023 | 130,376 | 情報技術サービス |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | — | 80.92 | 312 | 39,764 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WORLDLINE SA | 77.58 | 223.86 | 1,762 | 224,578 | 情報技術サービス |
| AMUNDI SA | 41.19 | 59.24 | 392 | 50,015 | 資本市場 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 20,629.42 67銘柄 | 23,068.91 64銘柄 | 119,655 — | 15,248,842 <3.2%> |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ADIDAS AG | 139 | 172.02 | 5,021 | 639,909 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 252.51 | 312.17 | 2,192 | 279,475 | 自動車 |
| COMMERZBANK AG | 831.18 | 831.18 | 425 | 54,233 | 銀行 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 314.63 | 390.3 | 1,410 | 179,809 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET | 98.82 | 98.82 | 374 | 47,717 | 各種電気通信サービス |
| FUCHS PETROLUB SE PREF | 55.46 | 55.46 | 267 | 34,137 | 化学 |
| HANNOVER RUECK SE | 48.68 | 48.68 | 691 | 88,093 | 保険 |
| GEA GROUP AG | 118.38 | 118.38 | 362 | 46,239 | 機械 |
| CONTINENTAL AG | 83.12 | 103.36 | 1,267 | 161,557 | 自動車部品 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 760.32 | 869.75 | 3,742 | 476,948 | 航空貨物・物流サービス |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD | 126.49 | 126.49 | 762 | 97,170 | 自動車 |
| MERCK KGAA | 98.5 | 118.74 | 1,697 | 216,390 | 医薬品 |
| RWE AG | 464.89 | 592.73 | 2,013 | 256,600 | 総合公益事業 |
| SAP SE | 760.71 | 934.54 | 10,145 | 1,292,925 | ソフトウェア |
| E.ON SE | 1,813.17 | 2,098.42 | 1,835 | 233,941 | 総合公益事業 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 75.85 | 86.02 | 665 | 84,848 | 家庭用品 |
| SIEMENS AG-REG | 591.13 | 686.52 | 9,200 | 1,172,542 | コンプロマリット |
| PUMA AG | 73.51 | 92.39 | 789 | 100,622 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BAYER AG | 720.11 | 887.08 | 4,785 | 609,901 | 医薬品 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 137.59 | 162.41 | 1,419 | 180,896 | 家庭用品 |
| DAIMLER AG | 694.81 | 780.56 | 5,047 | 643,202 | 自動車 |
| BASF SE | 705.54 | 832.15 | 5,560 | 708,620 | 化学 |
| BEIERSDORF AG | 83.71 | 83.71 | 770 | 98,209 | パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | 17.07 | 17.07 | 130 | 16,587 | 建設・土木 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 | | | |
|-----------------------------------|-----------|-----------|-------|-----------|-------------------------|---------|------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | | |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 120.31 | 145.71 | 932 | 118,880 | 建設資材 | | | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO | 162.14 | 201.91 | 1,239 | 157,939 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | | | |
| ALLIANZ SE | 329.44 | 375.04 | 7,333 | 934,585 | 保険 | | | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 160.96 | 279.9 | 298 | 38,042 | 旅客航空輸送業 | | | |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 110.91 | 123.01 | 2,873 | 366,200 | 保険 | | | |
| VOLKSWAGEN AG | 26.45 | 27.58 | 499 | 63,617 | 自動車 | | | |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 144.01 | 163.61 | 2,637 | 336,109 | 自動車 | | | |
| NEMETSCHKE SE | - | 50.95 | 295 | 37,659 | ソフトウェア | | | |
| THYSSENKRUPP AG | 271.1 | - | - | - | 金属・鉱業 | | | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 1,493.84 | 1,659.49 | 1,490 | 189,913 | 資本市場 | | | |
| BMW VORZUG | 41.16 | 41.16 | 225 | 28,771 | 自動車 | | | |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 2,635.92 | 2,993.58 | 4,443 | 566,339 | 各種電気通信サービス | | | |
| SARTORIUS AG | 27.12 | 30.44 | 1,464 | 186,593 | ヘルスケア機器・用品 | | | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 990.68 | 1,188.79 | 4,227 | 538,731 | 半導体・半導体製造装置 | | | |
| RATIONAL AG | - | 4.79 | 397 | 50,696 | 機械 | | | |
| CARL ZEISS MEDITEC AG | 37.71 | 37.71 | 504 | 64,301 | ヘルスケア機器・用品 | | | |
| BECHTLE AG | - | 25.11 | 425 | 54,272 | 情報技術サービス | | | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 145.25 | 167.52 | 2,288 | 291,623 | 資本市場 | | | |
| FRAPORT AG | 31.49 | - | - | - | 運送インフラ | | | |
| WIRECARD AG | 89.63 | - | - | - | 情報技術サービス | | | |
| LANXESS AG | 68.56 | 68.56 | 416 | 53,105 | 化学 | | | |
| MTU AERO ENGINES HOLDING AG | 41.68 | 48.73 | 947 | 120,756 | 航空宇宙・防衛 | | | |
| DEUTSCHE WOHNEN | 269.47 | 290.97 | 1,200 | 153,034 | 不動産管理・開発 | | | |
| SYMRISE AG | 99.88 | 113.08 | 1,179 | 150,377 | 化学 | | | |
| BRENNTAG SE | 123.53 | 140.44 | 921 | 117,408 | 商社・流通業 | | | |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 171.16 | 171.16 | 474 | 60,464 | 化学 | | | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 615.41 | 983.85 | 225 | 28,712 | 各種電気通信サービス | | | |
| LEG IMMOBILIEN AG | - | 59.34 | 700 | 89,265 | 不動産管理・開発 | | | |
| KION GROUP AG | 45.67 | 59.03 | 438 | 55,879 | 機械 | | | |
| VONOVIA SE | 386.17 | 454.51 | 2,508 | 319,733 | 不動産管理・開発 | | | |
| KNORR-BREMSE AG | 44.92 | 68.6 | 736 | 93,875 | 機械 | | | |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 114.68 | 238.05 | 1,162 | 148,136 | ヘルスケア機器・用品 | | | |
| METRO AG | 107.74 | - | - | - | 食品・生活必需品小売り | | | |
| TEAMVIEWER AG | - | 136.68 | 624 | 79,567 | ソフトウェア | | | |
| SIEMENS ENERGY AG | - | 358.31 | 1,121 | 142,970 | 電気設備 | | | |
| ZALANDO SE | 99.64 | 147.56 | 1,473 | 187,787 | インターネット販売・通信販売 | | | |
| SCOUT24 AG | - | 96.7 | 645 | 82,320 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | | | |
| COVESTRO AG | 127.08 | 163.37 | 957 | 121,962 | 化学 | | | |
| HELLOFRESH SE | - | 128.38 | 984 | 125,486 | インターネット販売・通信販売 | | | |
| UNIPER SE | 142.52 | 182.03 | 550 | 70,150 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | | | |
| DELIVERY HERO SE | 80.81 | 109.74 | 1,445 | 184,185 | インターネット販売・通信販売 | | | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 銘柄数 | 比率 | 18,422.22 | 22,034.34 | 110,876 | 14,130,044 | |
| (ユーロ…ポルトガル) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | | |
| JERONIMO MARTINS | 195.17 | 195.17 | 246 | 31,463 | 食品・生活必需品小売り | | | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 2,016.06 | 2,386.62 | 1,179 | 150,280 | 電力 | | | |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 400.88 | 400.88 | 361 | 46,050 | 石油・ガス・消耗燃料 | | | |
| 小計 | 株数 銘柄数 | 金額 銘柄数 | 比率 | 2,612.11 | 2,982.67 | 1,787 | 227,795 | |
| (ユーロ…スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | | | |
| IBERDROLA SA | 4,772.67 | 5,508.72 | 5,952 | 758,544 | 電力 | | | |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY | 158.85 | 212.06 | 714 | 91,046 | 電気設備 | | | |
| REPSOL SA | 1,149.98 | 1,359.9 | 1,206 | 153,791 | 石油・ガス・消耗燃料 | | | |
| TELEFONICA S.A | 3,677.55 | 4,558.87 | 1,715 | 218,623 | 各種電気通信サービス | | | |
| ENDESA S.A. | 234.17 | 277.36 | 608 | 77,515 | 電力 | | | |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 201.37 | 213.95 | 547 | 69,800 | 建設・土木 | | | |
| BANKINTER S.A. | 579.6 | - | - | - | 銀行 | | | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期末 | | 業種等 | |
|--|------------------|-------------------|-------------------|------------------|-------------------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…スペイン) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 5,235.94 | 5,782.51 | 2,544 | 324,246 | 銀行 | |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 236.12 | 236.12 | 495 | 63,161 | ガス | |
| BANCO SANTANDER SA | 12,640.63 | 15,869.57 | 4,435 | 565,265 | 銀行 | |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA | 345.96 | 345.96 | 517 | 65,979 | 電力 | |
| BANCO SABADELL | 4,136.31 | — | — | — | 銀行 | |
| INDITEX | 838.83 | 1,004.23 | 2,581 | 329,034 | 専門小売り | |
| MAPFRE SA | 844.74 | — | — | — | 保険 | |
| ENAGAS | 180.95 | 234.77 | 416 | 53,136 | ガス | |
| GRIFOLS SA | 235.18 | 235.18 | 534 | 68,154 | バイオテクノロジー | |
| FERROVIAL SA | 386.66 | 405.93 | 834 | 106,308 | 建設・土木 | |
| CAIXABANK | 2,972.24 | 3,073.31 | 692 | 88,241 | 銀行 | |
| AMADEUS IT GROUP SA | 338.91 | 411.18 | 2,226 | 283,802 | 情報技術サービス | |
| BANKIA SA | 1,006.75 | — | — | — | 銀行 | |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS | — | 213.57 | 8 | 1,129 | 建設・土木 | |
| AENA SME SA | 53.38 | 62.56 | 822 | 104,840 | 運送インフラ | |
| CELLNEX TELECOM SAU | 197.8 | 272.34 | 1,248 | 159,062 | 各種電気通信サービス | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 40,424.59 22銘柄 | 40,278.09 19銘柄 | 28,104 <0.7%> | 3,581,685 | |
| (ユーロ…イタリア) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 870.3 | 975.69 | 1,528 | 194,781 | 保険 | |
| INTESA SANPAOLO | 11,576.31 | 15,123.69 | 3,169 | 403,975 | 銀行 | |
| UNICREDIT SPA | 1,557.18 | 1,939.1 | 1,628 | 207,481 | 銀行 | |
| ENI SPA | 1,978.38 | 2,193.31 | 1,947 | 248,181 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| MEDIOBANCA SPA | 416.39 | 574.42 | 510 | 65,049 | 銀行 | |
| ENEL SPA | 6,323.33 | 7,299.44 | 6,181 | 787,727 | 電力 | |
| LEONARDO SPA | 283.16 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | |
| SNAM SPA | 1,691.63 | 1,712.94 | 766 | 97,622 | ガス | |
| TELECOM ITALIA SPA | 7,626.75 | 7,626.75 | 289 | 36,934 | 各種電気通信サービス | |
| TELECOM ITALIA-RNC | 4,975.96 | 4,975.96 | 213 | 27,204 | 各種電気通信サービス | |
| ATLANTIA SPA | 373.65 | 452.99 | 713 | 90,923 | 運送インフラ | |
| TERNA SPA | 1,136.54 | 1,136.54 | 701 | 89,366 | 電力 | |
| RECORDATI SPA | 68.59 | 103.03 | 459 | 58,599 | 医薬品 | |
| AMPLIFON SPA | — | 113.72 | 426 | 54,332 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| PRYSMIAN SPA | 214.52 | 223.28 | 634 | 80,811 | 電気設備 | |
| DIASORIN SPA | — | 22.23 | 412 | 52,580 | ヘルスケア機器・用品 | |
| MONCLER SPA | 143.53 | 175.67 | 900 | 114,712 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| NEXI SPA | — | 430.97 | 698 | 89,029 | 情報技術サービス | |
| FINECOBANK SPA | 450.48 | 538.18 | 810 | 103,324 | 銀行 | |
| POSTE ITALIANE SPA | 400.15 | 400.15 | 387 | 49,353 | 保険 | |
| INFRASTRUCTURE WIRELESS ITALIANE SPA | — | 233.44 | 216 | 27,607 | 各種電気通信サービス | |
| PIRELLI & C SPA | 340.86 | — | — | — | 自動車部品 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 40,427.71 18銘柄 | 46,251.5 20銘柄 | 22,595 <0.6%> | 2,879,599 | |
| (ユーロ…フィンランド) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| KESKO OYJ-B | — | 240.85 | 518 | 66,053 | 食品・生活必需品小売り | |
| WARTSILA OYJ | 349.35 | 349.35 | 298 | 38,021 | 機械 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 93.99 | — | — | — | 自動車部品 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 399.09 | 448.29 | 1,441 | 183,673 | 紙製品・林産品 | |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 419.15 | 532.5 | 878 | 111,904 | 紙製品・林産品 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 361.41 | 448.22 | 1,653 | 210,777 | 保険 | |
| FORTUM OYJ | 374.52 | 394.09 | 857 | 109,284 | 電力 | |
| NOKIA OYJ | 4,308 | 5,185.32 | 1,802 | 229,700 | 通信機器 | |
| ELISA OYJ | 107.87 | 136.42 | 676 | 86,214 | 各種電気通信サービス | |
| NELES OYJ | 85.85 | — | — | — | 機械 | |
| NESTE OYJ | 329.31 | 367.96 | 2,105 | 268,320 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| KONE OYJ | 265.02 | 298.9 | 2,070 | 263,900 | 機械 | |

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 | | 期 | | 業 | 種 | 等 | |
|-------------------------------|-----------------|------------|---------|------------|---------|--------|-----|-------------|---------|------------|---|
| | | 株 | 数 | 株 | 数 | 評 | | | | | 額 |
| | | | | | | 外 | 建 | | | | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | | | | | | | | | |
| ORION OYJ | | 百株 | 80.51 | 百株 | 80.51 | 千ユーロ | 288 | 千円 | 36,741 | 医薬品 | |
| 小計 | 株数・金額 柄数<比率> | 7,174.07 | 12銘柄 | 8,482.41 | 11銘柄 | 12,590 | - | 1,604,590 | <0.3%> | | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | | | | | | | |
| OMV AG | | 百株 | 128.17 | 百株 | 128.17 | 千ユーロ | 451 | 千円 | 57,528 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| VERBUND AG | | | 49.08 | | 69.24 | | 482 | | 61,458 | 電力 | |
| VOEST-ALPINE AG | | | 98.75 | | 98.75 | | 306 | | 39,113 | 金属・鉱業 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | | | 209.43 | | 242.04 | | 642 | | 81,864 | 銀行 | |
| ANDRITZ AG | | | 62.65 | | - | | - | | - | 機械 | |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL | | | 96.41 | | 179.11 | | 299 | | 38,119 | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 柄数<比率> | 644.49 | 6銘柄 | 717.31 | 5銘柄 | 2,182 | - | 278,083 | <0.1%> | | |
| 合計 | 株数・金額 柄数<比率> | 858,545.81 | 1,254銘柄 | 974,571.62 | 1,224銘柄 | - | - | 455,954,801 | <95.5%> | | |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(2) 外国新株予約権証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 | | 期 | | 業 | 種 | 等 | |
|---------------------------------|-------------------|---------|----|---|--------|----------|----|----|-------|--------|---|
| | | 証 | 券 | 証 | 券 | 評 | | | | | 額 |
| | | | | | | 外 | 建 | | | | |
| (スイス) | | | | | | | | | | | |
| CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23 | | | 証券 | | 証券 | 千スイス・フラン | 28 | 千円 | 3,416 | | |
| 合計 | 証券数・金額 銘柄数<比率> | - | - | - | 87,844 | - | - | - | 3,416 | <0.0%> | |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|----------------------------------|------------|------------|---------------|---------------|-----|-----|
| | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 率 | |
| 不動産ファンド (アメリカ) | 千□ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 8.646 | 12.006 | 2,077 | 218,413 | | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 12.027 | 12.947 | 1,218 | 128,069 | | 0.0 |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 17.771 | 22.693 | 849 | 89,336 | | 0.0 |
| SL GREEN | 7.097 | — | — | — | | — |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 108.247 | 127.559 | 1,081 | 113,708 | | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 56.079 | 66.35 | 7,143 | 750,967 | | 0.2 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 10.491 | 12.329 | 2,213 | 232,649 | | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 8.062 | 9.643 | 1,027 | 107,996 | | 0.0 |
| EQUINIX INC | 6.522 | 7.992 | 5,672 | 596,324 | | 0.1 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 13.649 | — | — | — | | — |
| DUKE REALTY TRUST | 27.278 | 31.929 | 1,327 | 139,558 | | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 31.583 | 38.831 | 6,386 | 671,311 | | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5.075 | 5.504 | 1,482 | 155,840 | | 0.0 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 27.869 | 35.108 | 2,369 | 249,038 | | 0.1 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 6 | — | — | — | | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 40.162 | 45.543 | 1,409 | 148,124 | | 0.0 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 8.778 | 9.838 | 2,596 | 272,958 | | 0.1 |
| WELLTOWER INC | 32.099 | 38.411 | 2,593 | 272,589 | | 0.1 |
| KIMCO REALTY | 32.98 | — | — | — | | — |
| IRON MOUNTAIN INC | 23.977 | 24.591 | 815 | 85,744 | | 0.0 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 13.626 | 16.087 | 1,009 | 106,165 | | 0.0 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 55.116 | 63.952 | 952 | 100,167 | | 0.0 |
| MID AMERICA | 8.834 | 10.854 | 1,499 | 157,613 | | 0.0 |
| REALTY INCOME CORP | 23.491 | 29.466 | 1,840 | 193,467 | | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | 11.403 | 14.499 | 762 | 80,199 | | 0.0 |
| UDR INC | 22.345 | 27.057 | 1,155 | 121,477 | | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 23.306 | 28.083 | 3,068 | 322,544 | | 0.1 |
| PUBLIC STORAGE | 12.188 | 13.834 | 3,207 | 337,177 | | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC | 7.418 | 9.67 | 1,438 | 151,246 | | 0.0 |
| VENTAS INC | 29.505 | 35.021 | 1,776 | 186,720 | | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST | 12.472 | 12.714 | 488 | 51,308 | | 0.0 |
| WEYERHAEUSER CO | 57.621 | 64.096 | 2,245 | 236,091 | | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 9.261 | 12.385 | 1,447 | 152,167 | | 0.0 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 15.605 | 23.492 | 3,290 | 345,875 | | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 39.953 | 53.911 | 1,212 | 127,510 | | 0.0 |
| AGNC INVESTMENT CORP | 44.741 | 46.028 | 752 | 79,108 | | 0.0 |
| VEREIT INC | 82.604 | 20.534 | 776 | 81,592 | | 0.0 |
| AMERICAN TOWER CORP | 34.213 | 39.736 | 9,027 | 948,983 | | 0.2 |
| WP CAREY INC | 13.039 | 15.529 | 1,093 | 114,905 | | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC | 42.384 | 50.475 | 1,564 | 164,483 | | 0.0 |
| VICI PROPERTIES INC | 34.2 | 47.083 | 1,283 | 134,919 | | 0.0 |
| 小 計 | □ 数 銘 柄 | □ 数 銘 柄 | 金 額 数<比 率> | 金 額 数<比 率> | | |
| | 1,077.717 | 1,135.78 | 80,159 | 8,426,360 | — | — |
| | 41銘柄<2.2%> | 37銘柄<1.8%> | — | — | — | 1.8 |
| (カナダ) | 千□ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| SMARTCENTRES REIT | 3.067 | — | — | — | | — |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 7.819 | 7.954 | 409 | 33,900 | | 0.0 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 10.748 | — | — | — | | — |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | 17.676 | — | — | — | | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 13.467 | 13.467 | 242 | 20,069 | | 0.0 |
| 小 計 | □ 数 銘 柄 | □ 数 銘 柄 | 金 額 数<比 率> | 金 額 数<比 率> | | |
| | 52.777 | 21.421 | 651 | 53,970 | — | — |
| | 5銘柄<0.0%> | 2銘柄<0.0%> | — | — | — | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|---------|------------|----|------------|-------------|------------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (オーストラリア) | | 千口 | | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % |
| MIRVAC GROUP | | 329.418 | | 329.418 | 764 | 62,362 | 0.0 |
| GPT GROUP | | 158.232 | | 158.232 | 653 | 53,325 | 0.0 |
| STOCKLAND | | 194.018 | | 194.018 | 909 | 74,251 | 0.0 |
| DEXUS | | 84.575 | | 108.972 | 950 | 77,539 | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | | 132.051 | | 148.357 | 2,664 | 217,422 | 0.0 |
| VICINITY CENTRES | | 270.443 | | 371.711 | 570 | 46,559 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | | 420.268 | | 420.268 | 1,130 | 92,250 | 0.0 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | 7,643 | 623,711 | - |
| | | 7銘柄<0.2%> | | 7銘柄<0.1%> | - | - | 0.1 |
| (香港) | | 千口 | | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % |
| LINK REIT | | 157.9 | | 200.2 | 13,473 | 182,700 | 0.0 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | 13,473 | 182,700 | - |
| | | 1銘柄<0.0%> | | 1銘柄<0.0%> | - | - | 0.0 |
| (シンガポール) | | 千口 | | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | | 199 | | 483.636 | 1,034 | 82,136 | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT | | 200.806 | | 292.606 | 898 | 71,289 | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 206.3 | | - | - | - | - |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | | 192.1 | | 192.1 | 286 | 22,715 | 0.0 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | - | | 270.1 | 521 | 41,369 | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 192.3 | | 192.3 | 399 | 31,742 | 0.0 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | 3,140 | 249,252 | - |
| | | 5銘柄<0.1%> | | 5銘柄<0.1%> | - | - | 0.1 |
| (イギリス) | | 千口 | | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| BRITISH LAND CO PLC | | 69.819 | | 69.819 | 321 | 46,842 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 55.843 | | 55.843 | 338 | 49,438 | 0.0 |
| SEGRO PLC | | 87.247 | | 100.956 | 977 | 142,532 | 0.0 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | 1,637 | 238,813 | - |
| | | 3銘柄<0.1%> | | 3銘柄<0.1%> | - | - | 0.1 |
| (フランス) | | 千口 | | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| GECINA SA | | 3.67 | | 3.67 | 433 | 55,189 | 0.0 |
| ICADE | | 2.234 | | - | - | - | - |
| KLEPIERRE | | 17.042 | | 17.099 | 323 | 41,272 | 0.0 |
| COVIVIO | | 4.265 | | 4.663 | 305 | 38,982 | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | | 10.898 | | 12.92 | 752 | 95,926 | 0.0 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | 1,815 | 231,370 | - |
| | | 5銘柄<0.1%> | | 4銘柄<0.0%> | - | - | 0.0 |
| 合計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | - | 10,006,178 | - |
| | | 67銘柄<2.7%> | | 59銘柄<2.1%> | - | - | 2.1 |

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 | 柄 | 別 | 当 期 | | 末 |
|-----|-------------------------------------|---|--------------|-------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 外 国 | S & P 5 0 0 E M I N I F U T | | 百万円 8,863 | | 百万円 - |
| | S & P / T S E 6 0 I X F U T | | 416 | | - |
| | S P I 2 0 0 F U T U R E S | | 275 | | - |
| | F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E | | 562 | | - |
| | D J E U R O S T O X X 5 0 | | 1,936 | | - |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|---------------------------|-------------------|-----|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| 株 式 | 千円 455,954,801 | | % 95.5 |
| 新 株 予 約 権 証 券 | 3,416 | | 0.0 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券 | 10,006,178 | | 2.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 11,688,217 | | 2.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 477,652,614 | | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、477,230,001千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.12円、1カナダ・ドル=82.84円、1オーストラリア・ドル=81.60円、1香港・ドル=13.56円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=75.90円、1イギリス・ポンド=145.85円、1イスラエル・シケル=32.31円、1スイス・フラン=117.85円、1デンマーク・クローネ=17.13円、1ノルウェー・クローネ=12.44円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1ユーロ=127.44円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

| 項 目 | 当 期 末 | | |
|---------------------------------|------------------|--|------------------|
| (A) 資 産 | 478,371,556,028円 | | |
| 一 般 株 券 等 | 7,543,114,076 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 455,954,801,985 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 3,416,297 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 872,963,897 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 9,133,215,008 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 997,758,204 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 327,168,116 | | |
| 株 券 (評 価 額) | 3,539,118,445 | | |
| (B) 負 債 | 805,612,996 | | |
| 未 払 金 | 725,661,696 | | |
| 未 払 金 | 79,951,300 | | |
| (C) 純 資 産 | 477,565,943,032 | | |
| 元 本 | 101,430,005,374 | | |
| 次 期 繰 越 損 益 | 376,135,937,658 | | |
| (D) 受 取 金 数 | 101,430,005,374円 | | |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D) | 47,083円 | | |
| (注1) 期首元本額 | 88,590,932,378円 | 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 109,409,614円 |
| 追加設定元本額 | 45,119,031,395円 | リスク抑制世界8資産バランスファンド | 1,213,146,637円 |
| 一部解約元本額 | 32,279,958,399円 | ワールドアセットバランス (基本コース) | 336,245,295円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | | ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) | 982,171,507円 |
| D I A M 外国株式パッシブ・ファンド | 3,590,651,003円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 12,186,690円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 2,310,337円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 5,775,603円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 6,547,566円 | リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 1,075,918円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 6,756,671円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 20,712,777円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 21,177,539円 | 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 33,065,020円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 17,784,106円 | リスクコントロール世界資産分散ファンド | 740,973,150円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 10,755,334円 | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 175,140,431円 |
| たわらノーロード 先進国株式 | 19,446,068,276円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 6,120,622円 |
| たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け> | 221,026,311円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 3,347,358円 |
| たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり> | 2,352,778,639円 | 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 3,322,497円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 410,571,761円 | 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 1,214,984円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 46,019,112円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 117,075,833円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 354,659,393円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 142,051,776円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 417,152,173円 | マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 6,645,402円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 1,077,196円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 72,091,910円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 132,195,005円 | M S C I コアサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定) | 257,923,303円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 345,649,707円 | D I A M 外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用) | 63,007,304円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 228,974,611円 | D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 1,445,094,587円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 343,116,453円 | D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 5,156,121,882円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 1,447円 | 外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定) | 862,725,175円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 628,040円 | D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 11,658,494円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 2,639,134円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 190,209,441円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 1,984,548円 | D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 47,142,712円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 4,398,037円 | D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 83,869,902円 |
| たわらノーロード 全世界株式 | 85,362,898円 | D I A M 国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 5,197,402円 |
| D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金> | 46,681,552,310円 | D I A M 国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 34,446,092円 |
| O n e D C 先進国株式インデックスファンド | 578,488,633円 | D I A M 国内重複バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 2,743,840円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 183,355,556円 | D I A M 国内重複バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 1,557,070円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 935,988,345円 | D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 12,351,541円 |
| D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 1,108,633,939円 | D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 42,816,355円 |
| D I A M D C バランス30インデックスファンド | 112,383,572円 | D I A M バランスファンドR25VA (適格機関投資家限定) | 298,196,031円 |
| D I A M D C バランス50インデックスファンド | 336,515,401円 | D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 415,545,865円 |
| D I A M D C バランス70インデックスファンド | 294,455,629円 | D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 1,340,967,617円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 26,718,430円 | D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) | 497,122,927円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 815,556,610円 | D I A M グローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 73,316,094円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリユーション | 168,120,959円 | D I A M アダプ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 487,021,391円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) | 207,380,963円 | D I A M 世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) | 21,947,333円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) | 175,357,524円 | D I A M 世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 4,736,583円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) | 291,398,144円 | D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 203,141,179円 |
| 投資のソムリエ | 4,677,116,550円 | D I A M 世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 15,672,025円 |
| グルーズコントロール | 247,166,541円 | D I A M 世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 65,152,864円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 287,425,394円 | D I A M 世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 103,614,222円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 195,280,389円 | D I A M 世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定) | 210,904,861円 |
| 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 114,819,293円 | 期末元本合計 | 101,430,005,374円 |
| D I A M コア資産設計ファンド (堅実型) | 1,868,239円 | | |
| D I A M コア資産設計ファンド (積極型) | 4,162,455円 | | |

■損益の状況

当期 自2020年2月18日 至2021年2月15日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--|---|--|
| (A) | 配当 受取 受取 の 支払 の 他 取 利 益 受 取 当 金 | | 6,240,305,046円 6,234,830,400 332,462 5,507,444 △365,260 |
| (B) | 有価証券 売買 損益 買 損 益 | | 50,582,940,100 87,299,316,083 △36,716,375,983 |
| (C) | 先物取引 取引 損益 取 引 損 益 | | 1,388,470,803 4,988,951,090 △3,600,480,287 |
| (D) | その他 費用 の 他 費 用 | | △87,341,531 △87,341,531 |
| (E) | 当期損益 繰越 金(A+B+C+D) | | 58,124,374,418 58,124,374,418 |
| (F) | 前期繰越 損益 金 | | 281,829,514,820 281,829,514,820 |
| (G) | 解約差 損益 金 | | △91,806,425,185 △91,806,425,185 |
| (H) | 追加信託 差損益 金 | | 127,988,473,605 127,988,473,605 |
| (I) | 合 計(E+F+G+H) | | 376,135,937,658 376,135,937,658 |
| | 次 期繰越 損益 金(I) | | 376,135,937,658 376,135,937,658 |

(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)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3) (H)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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第18期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2002年12月10日から無期限です。 |
| 運用方針 | 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、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には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | FTSE世界国債インデックス | | 債券組入率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|------|---------------------------------|------|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | （除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | 騰落率 | | | |
| 14期（2017年2月21日） | 17,364 | △2.9 | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 15期（2018年2月21日） | 17,876 | 2.9 | 108,792.68 | △2.7 | 97.9 | - | 248,485 |
| 16期（2019年2月21日） | 18,170 | 1.6 | 111,885.82 | 2.8 | 97.7 | - | 217,863 |
| 17期（2020年2月21日） | 19,586 | 7.8 | 113,733.36 | 1.7 | 98.1 | - | 197,670 |
| 18期（2021年2月22日） | 19,836 | 1.3 | 122,662.63 | 7.9 | 97.8 | - | 130,803 |
| | | | 124,229.95 | 1.3 | 98.4 | - | 137,037 |

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

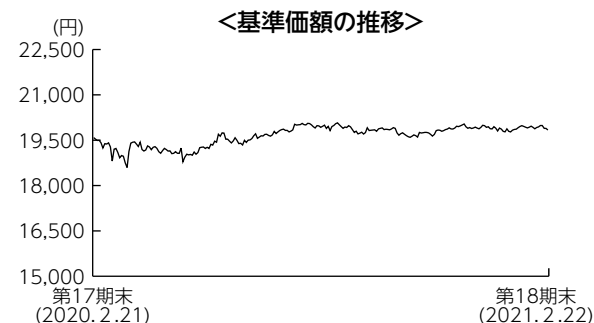
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 債券組入 比 | 債券先物 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--|--------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2020 年 2 月 21 日 | 円 19,586 | % - | ポイント 122,662.63 | % - | % 97.8 | % - |
| 2 月 末 | 19,413 | △0.9 | 121,401.29 | △1.0 | 97.3 | - |
| 3 月 末 | 19,435 | △0.8 | 121,796.59 | △0.7 | 97.4 | - |
| 4 月 末 | 19,066 | △2.7 | 119,329.72 | △2.7 | 96.1 | - |
| 5 月 末 | 19,338 | △1.3 | 120,973.12 | △1.4 | 97.3 | - |
| 6 月 末 | 19,646 | 0.3 | 123,063.01 | 0.3 | 98.4 | - |
| 7 月 末 | 19,841 | 1.3 | 123,870.50 | 1.0 | 99.0 | - |
| 8 月 末 | 19,819 | 1.2 | 124,064.52 | 1.1 | 99.4 | - |
| 9 月 末 | 19,912 | 1.7 | 124,690.18 | 1.7 | 97.8 | - |
| 10 月 末 | 19,615 | 0.1 | 122,727.67 | 0.1 | 98.2 | - |
| 11 月 末 | 19,817 | 1.2 | 124,001.42 | 1.1 | 99.1 | - |
| 12 月 末 | 19,982 | 2.0 | 125,045.38 | 1.9 | 98.6 | - |
| 2021 年 1 月 末 | 19,954 | 1.9 | 125,100.34 | 2.0 | 98.6 | - |
| (期 末) 2021 年 2 月 22 日 | 19,836 | 1.3 | 124,229.95 | 1.3 | 98.4 | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月22日から2021年2月22日まで）

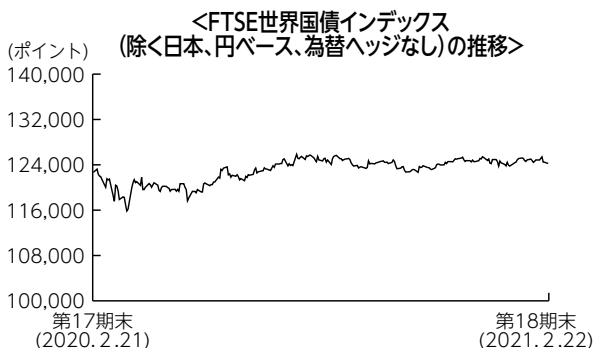


基準価額の推移

当期末の基準価額は19,836円となり、前期末比で1.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは低下（価格は上昇）しました。新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R B（米連邦準備理事会）が緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。これらを主因に基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは低下しました。一方、ドイツ債の利回りは上昇（価格は低下）しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R Bが緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。期末には新型コロナウイルスのワクチン期待を受けて利回りが上昇し始め、ドイツ債についても期待を受けて利回りは上昇しました。

為替市場ではドル／円は円高ドル安に、ユーロ／円は円安ユーロ高となりました。ドル／円は、F R Bによる緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続示唆、追加緩和期待から円高ドル安が進みました。ユーロ／円は、E C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和策が域内景気を下支えるとの見方やユーロ圏経済指標の改善などから円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

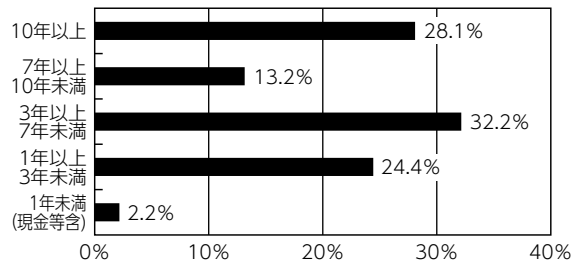
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

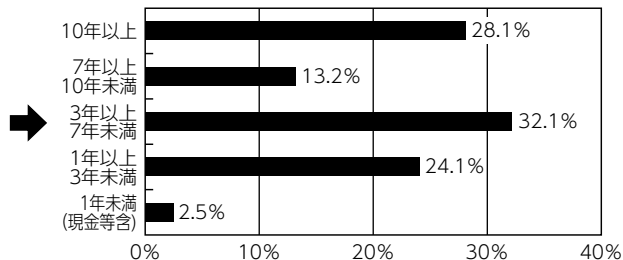
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

| 国 | 当ファンド | 世界国債インデックス | 差 |
|-----------|--------|------------|-------|
| 北米 | | | |
| 米国 | 48.3% | 48.8% | △0.5% |
| カナダ | 1.8% | 1.9% | △0.1% |
| 計 | 50.1% | 50.7% | △0.6% |
| 中南米 | | | |
| メキシコ | 0.7% | 0.9% | △0.1% |
| 計 | 0.7% | 0.9% | △0.1% |
| 欧州 | | | |
| オーストリア | 1.4% | 1.4% | 0.0% |
| ベルギー | 2.3% | 2.4% | △0.1% |
| フィンランド | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| フランス | 9.5% | 9.8% | △0.3% |
| ドイツ | 5.7% | 6.2% | △0.5% |
| アイルランド | 0.7% | 0.7% | 0.0% |
| イタリア | 8.9% | 8.8% | 0.1% |
| オランダ | 1.8% | 1.8% | 0.0% |
| スペイン | 5.3% | 5.5% | △0.2% |
| ユーロ計 | 36.1% | 37.2% | △1.1% |
| デンマーク | 0.4% | 0.5% | 0.0% |
| スウェーデン | 0.2% | 0.3% | △0.1% |
| 英国 | 6.2% | 6.4% | △0.1% |
| ポーランド | 0.5% | 0.6% | △0.1% |
| ノルウェー | 0.2% | 0.2% | △0.1% |
| 計 | 43.7% | 45.4% | △1.8% |
| アジア・オセアニア | | | |
| オーストラリア | 1.8% | 1.9% | 0.0% |
| シンガポール | 0.4% | 0.4% | 0.0% |
| マレーシア | 0.6% | 0.5% | 0.1% |
| 計 | 2.8% | 2.8% | 0.0% |
| アフリカ | | | |
| 南アフリカ | 0.5% | 0.5% | 0.0% |
| 計 | 0.5% | 0.5% | 0.0% |
| 現金など | 1.6% | - | - |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | - |

期末

| 国 | 当ファンド | 世界国債インデックス | 差 |
|-----------|--------|------------|-------|
| 北米 | | | |
| 米国 | 42.4% | 43.3% | △0.9% |
| カナダ | 2.0% | 2.0% | 0.0% |
| 計 | 44.3% | 45.2% | △0.9% |
| 中南米 | | | |
| メキシコ | 0.8% | 0.8% | 0.0% |
| 計 | 0.8% | 0.8% | 0.0% |
| 欧州 | | | |
| オーストリア | 1.5% | 1.6% | △0.1% |
| ベルギー | 2.5% | 2.6% | △0.1% |
| フィンランド | 0.6% | 0.7% | 0.0% |
| フランス | 10.6% | 10.7% | △0.2% |
| ドイツ | 7.5% | 7.7% | △0.2% |
| アイルランド | 0.8% | 0.9% | 0.0% |
| イタリア | 9.5% | 9.8% | △0.3% |
| オランダ | 1.8% | 1.9% | △0.1% |
| スペイン | 6.1% | 6.1% | 0.0% |
| ユーロ計 | 40.9% | 41.9% | △1.0% |
| デンマーク | 0.5% | 0.5% | 0.0% |
| スウェーデン | 0.3% | 0.3% | 0.0% |
| 英国 | 6.6% | 6.6% | 0.0% |
| ポーランド | 0.6% | 0.7% | 0.0% |
| ノルウェー | 0.2% | 0.3% | 0.0% |
| 計 | 49.2% | 50.3% | △1.1% |
| アジア・オセアニア | | | |
| オーストラリア | 2.8% | 2.3% | 0.5% |
| シンガポール | 0.4% | 0.4% | 0.0% |
| マレーシア | 0.5% | 0.5% | 0.0% |
| 計 | 3.6% | 3.2% | 0.4% |
| 中近東 | | | |
| イスラエル | 0.4% | 0.4% | 0.0% |
| 計 | 0.4% | 0.4% | 0.0% |
| 現金など | 1.6% | - | - |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | - |

(注) 世界国債インデックスとはF T S E世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動することをめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|-----------|-----|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) その他費用 | 2円 | 0.012% |
| （保管費用） | (2) | (0.011) |
| （その他） | (0) | (0.001) |
| 合 計 | 2 | 0.012 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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（19,648円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については10ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

公社債

| | | | 買付額 | 売付額 | |
|--------|--------------|--------|------------------------|------------------------|---------------|
| 外 | アメリカ | 国債証券 | 千アメリカ・ドル 204,013 | 千アメリカ・ドル 220,431 | |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダ・ドル 12,919 | 千カナダ・ドル 8,752 | |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル 19,582 | 千オーストラリア・ドル 4,973 | |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポール・ドル 1,694 | 千シンガポール・ドル 844 | |
| | イギリス | 国債証券 | 千イギリス・ポンド 22,124 | 千イギリス・ポンド 14,602 | |
| | イスラエル | 国債証券 | 千イスラエル・シケル 19,040 | 千イスラエル・シケル 567 | |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ 9,664 | 千デンマーク・クローネ 5,334 | |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ 6,951 | 千ノルウェー・クローネ 3,221 | |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデン・クローナ 15,553 | 千スウェーデン・クローナ 3,970 | |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ 64,559 | 千メキシコ・ペソ 27,641 | |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット 5,060 | 千マレーシア・リンギット 10,671 | |
| | 南アフリカ | 国債証券 | 千南アフリカ・ランド - | 千南アフリカ・ランド 85,263 | |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ 10,959 | 千ポーランド・ズロチ 5,220 | |
| 国 | ユー ロ 圏 | アイルランド | 国債証券 | 千ユーロ 3,473 | 千ユーロ 1,628 |
| | | オランダ | 国債証券 | 6,076 | 5,390 |
| | | ベルギー | 国債証券 | 8,408 | 6,178 |
| | | フランス | 国債証券 | 36,111 | 22,676 |
| | | ドイツ | 国債証券 | 43,157 | 22,151 |
| | | スペイン | 国債証券 | 22,043 | 12,904 |
| | | イタリア | 国債証券 | 32,711 | 28,279 |
| | | フィンランド | 国債証券 | 1,694 | 439 |
| オーストリア | 国債証券 | 5,421 | 3,790 | | |

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 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 | 千アメリカ・ドル 519,140 | 千アメリカ・ドル 550,714 | 千円 58,100,386 | % 42.4 | % - | % 18.2 | % 17.4 | % 6.7 |
| カ ナ ダ | 千カナダ・ドル 29,460 | 千カナダ・ドル 31,957 | 千円 2,675,453 | 2.0 | - | 0.9 | 0.7 | 0.3 |
| オーストラリア | 千オーストラリア・ドル 41,700 | 千オーストラリア・ドル 45,344 | 千円 3,772,248 | 2.8 | - | 1.9 | 0.7 | 0.2 |
| シンガポール | 千シンガポール・ドル 6,200 | 千シンガポール・ドル 6,929 | 千円 552,643 | 0.4 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| イギリス | 千イギリス・ポンド 49,770 | 千イギリス・ポンド 61,565 | 千円 9,110,469 | 6.6 | - | 5.0 | 1.1 | 0.5 |
| イスラエル | 千イスラエル・シケル 15,670 | 千イスラエル・シケル 17,913 | 千円 577,359 | 0.4 | - | 0.2 | 0.2 | 0.0 |
| デンマーク | 千デンマーク・クローネ 30,780 | 千デンマーク・クローネ 38,545 | 千円 662,988 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| ノルウェー | 千ノルウェー・クローネ 23,270 | 千ノルウェー・クローネ 24,312 | 千円 303,668 | 0.2 | - | 0.1 | 0.1 | - |
| スウェーデン | 千スウェーデン・クローナ 30,610 | 千スウェーデン・クローナ 33,818 | 千円 431,523 | 0.3 | - | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| メキシコ | 千メキシコ・ペソ 180,572 | 千メキシコ・ペソ 203,320 | 千円 1,047,101 | 0.8 | - | 0.5 | 0.3 | 0.0 |
| マレーシア | 千マレーシア・リンギット 21,930 | 千マレーシア・リンギット 23,693 | 千円 618,878 | 0.5 | - | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 28,350 | 千ポーランド・ズロチ 30,882 | 千円 881,086 | 0.6 | - | 0.3 | 0.2 | 0.2 |
| ユ ー ロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | |
| アイルランド | 7,940 | 9,015 | 1,153,117 | 0.8 | - | 0.6 | 0.2 | 0.1 |
| オランダ | 16,600 | 19,801 | 2,532,858 | 1.8 | - | 1.2 | 0.5 | 0.1 |
| ベルギー | 21,530 | 26,470 | 3,385,814 | 2.5 | - | 1.9 | 0.4 | 0.2 |
| フランス | 95,020 | 113,104 | 14,467,133 | 10.6 | - | 7.1 | 2.7 | 0.7 |
| ドイツ | 68,530 | 80,607 | 10,310,448 | 7.5 | - | 4.5 | 2.4 | 0.6 |
| スペイン | 54,310 | 64,919 | 8,303,795 | 6.1 | - | 4.0 | 1.4 | 0.6 |
| イタリア | 85,840 | 102,183 | 13,070,282 | 9.5 | - | 6.1 | 2.6 | 0.8 |
| フィンランド | 5,900 | 6,530 | 835,308 | 0.6 | - | 0.4 | 0.2 | 0.0 |
| オーストリア | 13,180 | 15,826 | 2,024,348 | 1.5 | - | 1.0 | 0.4 | 0.1 |
| 合 計 | - | - | 千円 134,816,915 | 98.4 | - | 54.9 | 32.0 | 11.4 |

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄 | 当 期 | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 末 償還年月日 |
|-------------------------|--------|--------|--------|------------------|----------|------------|------------|
| | | | | | 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 2.625 01/31/26 | 国債証券 | 2.6250 | 2,180 | 2,396 | 252,827 | 2026/01/31 | |
| US T N/B 2.25 01/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 350 | 371 | 39,146 | 2024/01/31 | |
| US T N/B 1.75 01/31/23 | 国債証券 | 1.7500 | 4,980 | 5,138 | 542,095 | 2023/01/31 | |
| US T N/B 2.5 01/31/24 | 国債証券 | 2.5000 | 3,890 | 4,151 | 438,000 | 2024/01/31 | |
| US T N/B 0.125 01/15/24 | 国債証券 | 0.1250 | 7,000 | 6,983 | 736,769 | 2024/01/15 | |
| US T N/B 1.5 01/31/27 | 国債証券 | 1.5000 | 2,490 | 2,592 | 273,551 | 2027/01/31 | |
| US T N/B 1.375 01/31/25 | 国債証券 | 1.3750 | 3,280 | 3,407 | 359,530 | 2025/01/31 | |
| US T N/B 6.0 02/15/26 | 国債証券 | 6.0000 | 840 | 1,063 | 112,235 | 2026/02/15 | |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国債証券 | 3.1250 | 680 | 818 | 86,326 | 2042/02/15 | |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国債証券 | 3.1250 | 1,440 | 1,731 | 182,671 | 2043/02/15 | |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 1,970 | 2,127 | 224,478 | 2046/02/15 | |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 国債証券 | 3.5000 | 900 | 1,135 | 119,785 | 2039/02/15 | |
| US T N/B 5.25 02/15/29 | 国債証券 | 5.2500 | 490 | 646 | 68,201 | 2029/02/15 | |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国債証券 | 5.3750 | 700 | 970 | 102,339 | 2031/02/15 | |
| US T N/B 4.5 02/15/36 | 国債証券 | 4.5000 | 730 | 1,009 | 106,521 | 2036/02/15 | |
| US T N/B 4.75 02/15/41 | 国債証券 | 4.7500 | 1,200 | 1,775 | 187,338 | 2041/02/15 | |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | 3.6250 | 1,630 | 2,113 | 222,976 | 2044/02/15 | |
| US T N/B 3.0 02/15/49 | 国債証券 | 3.0000 | 3,070 | 3,655 | 385,650 | 2049/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/22 | 国債証券 | 2.0000 | 8,470 | 8,630 | 910,479 | 2022/02/15 | |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国債証券 | 4.3750 | 550 | 763 | 80,586 | 2038/02/15 | |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国債証券 | 4.6250 | 750 | 1,086 | 114,619 | 2040/02/15 | |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 4,180 | 4,394 | 463,590 | 2026/02/15 | |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 国債証券 | 2.5000 | 2,080 | 2,249 | 237,286 | 2045/02/15 | |
| US T N/B 3.0 02/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 1,640 | 1,942 | 204,893 | 2047/02/15 | |
| US T N/B 3.0 02/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 2,540 | 3,013 | 317,963 | 2048/02/15 | |
| US T N/B 2.75 02/15/24 | 国債証券 | 2.7500 | 5,320 | 5,721 | 603,661 | 2024/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | 5,300 | 5,642 | 595,232 | 2025/02/15 | |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 国債証券 | 2.6250 | 4,110 | 4,586 | 483,909 | 2029/02/15 | |
| US T N/B 2.75 02/15/28 | 国債証券 | 2.7500 | 4,370 | 4,900 | 517,043 | 2028/02/15 | |
| US T N/B 2.0 02/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 4,370 | 4,532 | 478,215 | 2023/02/15 | |
| US T N/B 2.25 02/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 3,550 | 3,857 | 406,915 | 2027/02/15 | |
| US T N/B 2.125 02/29/24 | 国債証券 | 2.1250 | 1,300 | 1,374 | 145,014 | 2024/02/29 | |
| US T N/B 1.5 02/28/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,000 | 1,027 | 108,434 | 2023/02/28 | |
| US T N/B 2.5 02/28/26 | 国債証券 | 2.5000 | 2,550 | 2,789 | 294,267 | 2026/02/28 | |
| US T N/B 2.75 02/28/25 | 国債証券 | 2.7500 | 1,660 | 1,816 | 191,616 | 2025/02/28 | |
| US T N/B 1.875 02/28/22 | 国債証券 | 1.8750 | 1,680 | 1,710 | 180,494 | 2022/02/28 | |
| US T N/B 2.625 02/28/23 | 国債証券 | 2.6250 | 1,800 | 1,890 | 199,484 | 2023/02/28 | |
| US T N/B 2.0 02/15/50 | 国債証券 | 2.0000 | 3,270 | 3,176 | 335,147 | 2050/02/15 | |
| US T N/B 1.375 02/15/23 | 国債証券 | 1.3750 | 4,000 | 4,099 | 432,533 | 2023/02/15 | |
| US T N/B 1.125 02/28/27 | 国債証券 | 1.1250 | 1,100 | 1,120 | 118,248 | 2027/02/28 | |
| US T N/B 1.5 02/15/30 | 国債証券 | 1.5000 | 3,970 | 4,059 | 428,226 | 2030/02/15 | |
| US T N/B 1.125 02/28/25 | 国債証券 | 1.1250 | 1,000 | 1,029 | 108,566 | 2025/02/28 | |
| US T N/B 2.125 03/31/24 | 国債証券 | 2.1250 | 4,080 | 4,318 | 455,627 | 2024/03/31 | |
| US T N/B 1.75 03/31/22 | 国債証券 | 1.7500 | 6,990 | 7,118 | 751,041 | 2022/03/31 | |
| US T N/B 1.5 03/31/23 | 国債証券 | 1.5000 | 2,000 | 2,057 | 217,099 | 2023/03/31 | |
| US T N/B 2.625 03/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,150 | 2,343 | 247,221 | 2025/03/31 | |
| US T N/B 2.25 03/31/26 | 国債証券 | 2.2500 | 3,090 | 3,342 | 352,660 | 2026/03/31 | |
| US T N/B 2.5 03/31/23 | 国債証券 | 2.5000 | 3,020 | 3,171 | 334,565 | 2023/03/31 | |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 1,800 | 1,779 | 187,711 | 2027/03/31 | |

| 銘柄 | 柄 | 当 | | | | 期 | | 末 |
|-------------------------|------|--------|-------|----------|----------|------------|-------|---|
| | | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| US T N/B 0.375 03/31/22 | 国債証券 | 0.3750 | 1,500 | 1,504 | 158,756 | 2022/03/31 | | |
| US T N/B 0.5 03/31/25 | 国債証券 | 0.5000 | 800 | 802 | 84,693 | 2025/03/31 | | |
| US T N/B 0.5 03/15/23 | 国債証券 | 0.5000 | 2,000 | 2,015 | 212,648 | 2023/03/15 | | |
| US T N/B 1.625 04/30/23 | 国債証券 | 1.6250 | 3,000 | 3,097 | 326,786 | 2023/04/30 | | |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 国債証券 | 2.3750 | 1,760 | 1,917 | 202,260 | 2026/04/30 | | |
| US T N/B 2.75 04/30/23 | 国債証券 | 2.7500 | 2,490 | 2,632 | 277,697 | 2023/04/30 | | |
| US T N/B 2.25 04/30/24 | 国債証券 | 2.2500 | 3,300 | 3,510 | 370,317 | 2024/04/30 | | |
| US T N/B 0.125 04/30/22 | 国債証券 | 0.1250 | 1,000 | 1,000 | 105,555 | 2022/04/30 | | |
| US T N/B 0.25 04/15/23 | 国債証券 | 0.2500 | 2,000 | 2,005 | 211,560 | 2023/04/15 | | |
| US T N/B 0.5 04/30/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,000 | 1,959 | 206,730 | 2027/04/30 | | |
| US T N/B 0.375 04/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 2,000 | 1,995 | 210,480 | 2025/04/30 | | |
| US T N/B 6.25 05/15/30 | 国債証券 | 6.2500 | 710 | 1,024 | 108,108 | 2030/05/15 | | |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 1,200 | 1,690 | 178,367 | 2040/05/15 | | |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 1,040 | 1,474 | 155,562 | 2041/05/15 | | |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | 国債証券 | 3.0000 | 980 | 1,155 | 121,870 | 2042/05/15 | | |
| US T N/B 4.25 05/15/39 | 国債証券 | 4.2500 | 810 | 1,118 | 117,974 | 2039/05/15 | | |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 2,200 | 2,544 | 268,492 | 2043/05/15 | | |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 2,030 | 2,537 | 267,656 | 2044/05/15 | | |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 1,630 | 1,921 | 202,703 | 2045/05/15 | | |
| US T N/B 3.0 05/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 1,290 | 1,528 | 161,261 | 2047/05/15 | | |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 1,810 | 1,954 | 206,164 | 2046/05/15 | | |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 2,660 | 3,227 | 340,548 | 2048/05/15 | | |
| US T N/B 1.75 05/15/22 | 国債証券 | 1.7500 | 5,400 | 5,510 | 581,361 | 2022/05/15 | | |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 2,100 | 1,818 | 191,900 | 2040/05/15 | | |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | 国債証券 | 2.8750 | 3,090 | 3,597 | 379,554 | 2049/05/15 | | |
| US T N/B 4.5 05/15/38 | 国債証券 | 4.5000 | 540 | 761 | 80,300 | 2038/05/15 | | |
| US T N/B 1.75 05/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 2,620 | 2,714 | 286,343 | 2023/05/15 | | |
| US T N/B 2.5 05/15/24 | 国債証券 | 2.5000 | 4,240 | 4,548 | 479,820 | 2024/05/15 | | |
| US T N/B 2.125 05/15/25 | 国債証券 | 2.1250 | 5,150 | 5,516 | 582,036 | 2025/05/15 | | |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 4,430 | 5,011 | 528,743 | 2028/05/15 | | |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 2,810 | 3,081 | 325,127 | 2029/05/15 | | |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 3,100 | 3,392 | 357,915 | 2027/05/15 | | |
| US T N/B 5.0 05/15/37 | 国債証券 | 5.0000 | 500 | 735 | 77,554 | 2037/05/15 | | |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 3,090 | 3,246 | 342,523 | 2026/05/15 | | |
| US T N/B 1.625 05/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 2,900 | 2,997 | 316,228 | 2023/05/31 | | |
| US T N/B 2.0 05/31/24 | 国債証券 | 2.0000 | 4,770 | 5,040 | 531,777 | 2024/05/31 | | |
| US T N/B 1.25 05/15/50 | 国債証券 | 1.2500 | 4,180 | 3,361 | 354,635 | 2050/05/15 | | |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 国債証券 | 2.1250 | 2,050 | 2,206 | 232,782 | 2026/05/31 | | |
| US T N/B 2.75 05/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | 3,270 | 3,463 | 365,414 | 2023/05/31 | | |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 2,530 | 2,789 | 294,315 | 2025/05/31 | | |
| US T N/B 0.5 05/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 1,500 | 1,467 | 154,837 | 2027/05/31 | | |
| US T N/B 0.125 05/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 3,000 | 2,999 | 316,450 | 2023/05/15 | | |
| US T N/B 0.625 05/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 4,000 | 3,772 | 397,998 | 2030/05/15 | | |
| US T N/B 0.25 05/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | 4,470 | 4,431 | 467,532 | 2025/05/31 | | |
| US T N/B 1.375 06/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | 3,460 | 3,560 | 375,610 | 2023/06/30 | | |
| US T N/B 2.125 06/30/22 | 国債証券 | 2.1250 | 4,530 | 4,654 | 491,057 | 2022/06/30 | | |
| US T N/B 2.75 06/30/25 | 国債証券 | 2.7500 | 790 | 867 | 91,568 | 2025/06/30 | | |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 国債証券 | 1.8750 | 4,670 | 4,965 | 523,862 | 2026/06/30 | | |
| US T N/B 2.625 06/30/23 | 国債証券 | 2.6250 | 1,820 | 1,926 | 203,230 | 2023/06/30 | | |
| US T N/B 1.75 06/30/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,340 | 1,406 | 148,350 | 2024/06/30 | | |
| US T N/B 1.75 06/15/22 | 国債証券 | 1.7500 | 830 | 847 | 89,463 | 2022/06/15 | | |
| US T N/B 0.5 06/30/27 | 国債証券 | 0.5000 | 1,700 | 1,661 | 175,272 | 2027/06/30 | | |

| 銘柄 | 柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|-------------------------|------|--------|----|----------|----------|---------|------------|
| | | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 0.25 06/15/23 | 国債証券 | 0.2500 | | 2,800 | 2,807 | 296,150 | 2023/06/15 |
| US T N/B 0.25 06/30/25 | 国債証券 | 0.2500 | | 3,000 | 2,972 | 313,557 | 2025/06/30 |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | | 1,860 | 2,056 | 216,926 | 2025/07/31 |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | 国債証券 | 1.8750 | | 2,370 | 2,520 | 265,877 | 2026/07/31 |
| US T N/B 1.75 07/31/24 | 国債証券 | 1.7500 | | 3,690 | 3,875 | 408,881 | 2024/07/31 |
| US T N/B 2.75 07/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | | 3,270 | 3,477 | 366,869 | 2023/07/31 |
| US T N/B 0.125 07/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | | 1,600 | 1,599 | 168,727 | 2023/07/15 |
| US T N/B 0.375 07/31/27 | 国債証券 | 0.3750 | | 2,000 | 1,936 | 204,257 | 2027/07/31 |
| US T N/B 0.25 07/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | | 1,000 | 989 | 104,403 | 2025/07/31 |
| US T N/B 6.25 08/15/23 | 国債証券 | 6.2500 | | 1,000 | 1,151 | 121,518 | 2023/08/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/41 | 国債証券 | 3.7500 | | 710 | 930 | 98,172 | 2041/08/15 |
| US T N/B 5.5 08/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | | 650 | 860 | 90,749 | 2028/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | | 1,110 | 1,473 | 155,401 | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | | 1,430 | 1,621 | 171,019 | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | | 1,750 | 2,104 | 222,011 | 2044/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | | 790 | 1,124 | 118,603 | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | | 1,670 | 2,163 | 228,297 | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | | 1,890 | 2,183 | 230,394 | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25 | 国債証券 | 2.0000 | | 5,180 | 5,532 | 583,676 | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | | 1,880 | 2,130 | 224,744 | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/49 | 国債証券 | 2.2500 | | 2,400 | 2,464 | 259,984 | 2049/08/15 |
| US T N/B 2.5 08/15/23 | 国債証券 | 2.5000 | | 4,330 | 4,581 | 483,367 | 2023/08/15 |
| US T N/B 2.375 08/15/24 | 国債証券 | 2.3750 | | 3,920 | 4,203 | 443,510 | 2024/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 国債証券 | 2.2500 | | 2,370 | 2,440 | 257,496 | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | | 3,210 | 3,812 | 402,258 | 2048/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | | 2,690 | 2,923 | 308,449 | 2027/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26 | 国債証券 | 1.5000 | | 3,090 | 3,225 | 340,282 | 2026/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | | 3,680 | 4,168 | 439,803 | 2028/08/15 |
| US T N/B 1.625 08/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | | 3,980 | 4,069 | 429,353 | 2022/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/31/25 | 国債証券 | 2.7500 | | 1,640 | 1,804 | 190,403 | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | | 2,380 | 2,466 | 260,250 | 2029/08/15 |
| US T N/B 1.875 08/31/22 | 国債証券 | 1.8750 | | 3,680 | 3,779 | 398,704 | 2022/08/31 |
| US T N/B 1.875 08/31/24 | 国債証券 | 1.8750 | | 3,120 | 3,293 | 347,418 | 2024/08/31 |
| US T N/B 2.75 08/31/23 | 国債証券 | 2.7500 | | 2,170 | 2,311 | 243,869 | 2023/08/31 |
| US T N/B 1.5 08/15/22 | 国債証券 | 1.5000 | | 1,210 | 1,235 | 130,312 | 2022/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | | 4,100 | 3,536 | 373,108 | 2040/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/15/50 | 国債証券 | 1.3750 | | 4,540 | 3,772 | 397,956 | 2050/08/15 |
| US T N/B 0.125 08/31/22 | 国債証券 | 0.1250 | | 4,000 | 4,001 | 422,148 | 2022/08/31 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | | 6,210 | 5,833 | 615,385 | 2030/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国債証券 | 1.3750 | | 1,100 | 1,139 | 120,247 | 2026/08/31 |
| US T N/B 1.25 08/31/24 | 国債証券 | 1.2500 | | 2,440 | 2,521 | 266,027 | 2024/08/31 |
| US T N/B 0.25 08/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | | 1,000 | 988 | 104,296 | 2025/08/31 |
| US T N/B 0.125 08/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | | 2,000 | 1,998 | 210,859 | 2023/08/15 |
| US T N/B 3.0 09/30/25 | 国債証券 | 3.0000 | | 1,410 | 1,569 | 165,571 | 2025/09/30 |
| US T N/B 2.125 09/30/24 | 国債証券 | 2.1250 | | 2,930 | 3,121 | 329,279 | 2024/09/30 |
| US T N/B 1.375 09/30/23 | 国債証券 | 1.3750 | | 1,500 | 1,547 | 163,269 | 2023/09/30 |
| US T N/B 1.75 09/30/22 | 国債証券 | 1.7500 | | 5,250 | 5,388 | 568,500 | 2022/09/30 |
| US T N/B 2.875 09/30/23 | 国債証券 | 2.8750 | | 840 | 899 | 94,878 | 2023/09/30 |
| US T N/B 1.5 09/15/22 | 国債証券 | 1.5000 | | 750 | 766 | 80,852 | 2022/09/15 |
| US T N/B 0.125 09/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | | 2,000 | 1,998 | 210,810 | 2023/09/15 |
| US T N/B 0.375 09/30/27 | 国債証券 | 0.3750 | | 1,700 | 1,640 | 173,086 | 2027/09/30 |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | | 1,900 | 1,994 | 210,378 | 2026/09/30 |

| 銘柄 | 柄 | 当期 | | | | | 償還年月日 |
|-------------------------|------|--------|---------|----------|------------|------------|-------|
| | | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 0.25 09/30/25 | 国債証券 | 0.2500 | 3,000 | 2,963 | 312,617 | 2025/09/30 | |
| US T N/B 3.0 10/31/25 | 国債証券 | 3.0000 | 1,920 | 2,138 | 225,648 | 2025/10/31 | |
| US T N/B 1.625 10/31/23 | 国債証券 | 1.6250 | 4,000 | 4,156 | 438,484 | 2023/10/31 | |
| US T N/B 2.875 10/31/23 | 国債証券 | 2.8750 | 3,690 | 3,957 | 417,549 | 2023/10/31 | |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国債証券 | 1.6250 | 2,350 | 2,467 | 260,301 | 2026/10/31 | |
| US T N/B 1.5 10/31/24 | 国債証券 | 1.5000 | 2,200 | 2,294 | 242,054 | 2024/10/31 | |
| US T N/B 0.5 10/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 3,000 | 2,915 | 307,548 | 2027/10/31 | |
| US T N/B 0.25 10/31/25 | 国債証券 | 0.2500 | 2,000 | 1,973 | 208,164 | 2025/10/31 | |
| US T N/B 5.25 11/15/28 | 国債証券 | 5.2500 | 850 | 1,115 | 117,656 | 2028/11/15 | |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 900 | 1,208 | 127,522 | 2027/11/15 | |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 国債証券 | 3.0000 | 1,790 | 2,109 | 222,586 | 2044/11/15 | |
| US T N/B 4.25 11/15/40 | 国債証券 | 4.2500 | 510 | 709 | 74,894 | 2040/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 1,220 | 1,382 | 145,894 | 2042/11/15 | |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 760 | 913 | 96,410 | 2041/11/15 | |
| US T N/B 3.75 11/15/43 | 国債証券 | 3.7500 | 1,360 | 1,794 | 189,270 | 2043/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 2,140 | 2,424 | 255,755 | 2047/11/15 | |
| US T N/B 1.625 11/15/50 | 国債証券 | 1.6250 | 2,900 | 2,569 | 271,052 | 2050/11/15 | |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 1,240 | 1,464 | 154,500 | 2045/11/15 | |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 2,020 | 2,336 | 246,475 | 2046/11/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/24 | 国債証券 | 2.2500 | 4,690 | 5,023 | 529,933 | 2024/11/15 | |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 910 | 1,277 | 134,819 | 2039/11/15 | |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 2,660 | 3,377 | 356,378 | 2048/11/15 | |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 2,770 | 2,922 | 308,330 | 2049/11/15 | |
| US T N/B 2.25 11/15/25 | 国債証券 | 2.2500 | 5,190 | 5,609 | 591,776 | 2025/11/15 | |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 4,840 | 5,575 | 588,210 | 2028/11/15 | |
| US T N/B 1.625 11/15/22 | 国債証券 | 1.6250 | 5,620 | 5,766 | 608,404 | 2022/11/15 | |
| US T N/B 2.75 11/15/23 | 国債証券 | 2.7500 | 5,520 | 5,907 | 623,261 | 2023/11/15 | |
| US T N/B 2.0 11/15/26 | 国債証券 | 2.0000 | 2,640 | 2,826 | 298,190 | 2026/11/15 | |
| US T N/B 2.0 11/30/22 | 国債証券 | 2.0000 | 6,590 | 6,810 | 718,492 | 2022/11/30 | |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 3,270 | 3,555 | 375,063 | 2027/11/15 | |
| US T N/B 2.125 11/30/23 | 国債証券 | 2.1250 | 2,000 | 2,107 | 222,390 | 2023/11/30 | |
| US T N/B 1.375 11/15/40 | 国債証券 | 1.3750 | 2,300 | 2,073 | 218,764 | 2040/11/15 | |
| US T N/B 1.625 11/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 1,020 | 1,070 | 112,898 | 2026/11/30 | |
| US T N/B 1.75 11/15/29 | 国債証券 | 1.7500 | 1,940 | 2,029 | 214,088 | 2029/11/15 | |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | 国債証券 | 0.8750 | 6,400 | 6,137 | 647,506 | 2030/11/15 | |
| US T N/B 0.25 11/15/23 | 国債証券 | 0.2500 | 6,000 | 6,011 | 634,211 | 2023/11/15 | |
| US T N/B 0.125 11/30/22 | 国債証券 | 0.1250 | 5,340 | 5,341 | 563,524 | 2022/11/30 | |
| US T N/B 0.625 11/30/27 | 国債証券 | 0.6250 | 2,000 | 1,957 | 206,532 | 2027/11/30 | |
| US T N/B 1.5 11/30/24 | 国債証券 | 1.5000 | 2,000 | 2,086 | 220,099 | 2024/11/30 | |
| US T N/B 0.375 11/30/25 | 国債証券 | 0.3750 | 2,590 | 2,567 | 270,875 | 2025/11/30 | |
| US T N/B 2.625 12/31/23 | 国債証券 | 2.6250 | 3,060 | 3,272 | 345,226 | 2023/12/31 | |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 2,290 | 2,515 | 265,433 | 2025/12/31 | |
| US T N/B 2.25 12/31/24 | 国債証券 | 2.2500 | 3,000 | 3,216 | 339,322 | 2024/12/31 | |
| US T N/B 2.125 12/31/22 | 国債証券 | 2.1250 | 5,520 | 5,726 | 604,107 | 2022/12/31 | |
| US T N/B 1.75 12/31/26 | 国債証券 | 1.7500 | 740 | 781 | 82,498 | 2026/12/31 | |
| US T N/B 0.125 12/15/23 | 国債証券 | 0.1250 | 1,000 | 998 | 105,314 | 2023/12/15 | |
| US T N/B 1.75 12/31/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,600 | 1,684 | 177,754 | 2024/12/31 | |
| US T N/B 0.375 12/31/25 | 国債証券 | 0.3750 | 1,000 | 990 | 104,502 | 2025/12/31 | |
| US T N/B 0.625 12/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 1,000 | 977 | 103,142 | 2027/12/31 | |
| 小計 | - | - | 519,140 | 550,714 | 58,100,386 | - | |
| (カナダ) | | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 2.25 03/01/24 | 国債証券 | 2.2500 | 530 | 560 | 46,922 | 2024/03/01 | |

| 銘 | 柄 | 当期 | | | | | 末 | |
|--------------------------|------|--------|--------|-------------|-------------|------------|-------|--|
| | | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | |
| CANADA 0.5 03/01/22 | 国債証券 | 0.5000 | 300 | 301 | 25,209 | 2022/03/01 | | |
| CANADA 1.75 03/01/23 | 国債証券 | 1.7500 | 3,160 | 3,257 | 272,751 | 2023/03/01 | | |
| CANADA 1.25 03/01/25 | 国債証券 | 1.2500 | 700 | 720 | 60,283 | 2025/03/01 | | |
| CANADA 0.25 03/01/26 | 国債証券 | 0.2500 | 800 | 781 | 65,418 | 2026/03/01 | | |
| CANADA 1.5 05/01/22 | 国債証券 | 1.5000 | 920 | 934 | 78,257 | 2022/05/01 | | |
| CANADA 1.5 06/01/26 | 国債証券 | 1.5000 | 800 | 831 | 69,616 | 2026/06/01 | | |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,000 | 1,375 | 115,123 | 2029/06/01 | | |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 720 | 1,077 | 90,199 | 2033/06/01 | | |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 390 | 586 | 49,096 | 2037/06/01 | | |
| CANADA 2.5 06/01/24 | 国債証券 | 2.5000 | 1,600 | 1,709 | 143,158 | 2024/06/01 | | |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 680 | 956 | 80,070 | 2041/06/01 | | |
| CANADA 2.75 06/01/22 | 国債証券 | 2.7500 | 2,240 | 2,313 | 193,723 | 2022/06/01 | | |
| CANADA 1.5 06/01/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,210 | 1,244 | 104,185 | 2023/06/01 | | |
| CANADA 2.0 06/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 720 | 776 | 65,008 | 2028/06/01 | | |
| CANADA 2.25 06/01/25 | 国債証券 | 2.2500 | 1,300 | 1,391 | 116,489 | 2025/06/01 | | |
| CANADA 1.0 06/01/27 | 国債証券 | 1.0000 | 700 | 708 | 59,340 | 2027/06/01 | | |
| CANADA 2.25 06/01/29 | 国債証券 | 2.2500 | 610 | 670 | 56,143 | 2029/06/01 | | |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 1,810 | 1,832 | 153,378 | 2030/06/01 | | |
| CANADA 2.0 09/01/23 | 国債証券 | 2.0000 | 920 | 959 | 80,358 | 2023/09/01 | | |
| CANADA 1.0 09/01/22 | 国債証券 | 1.0000 | 1,500 | 1,518 | 127,152 | 2022/09/01 | | |
| CANADA 0.5 09/01/25 | 国債証券 | 0.5000 | 2,350 | 2,336 | 195,571 | 2025/09/01 | | |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 920 | 1,246 | 104,373 | 2045/12/01 | | |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 国債証券 | 2.7500 | 850 | 1,034 | 86,592 | 2048/12/01 | | |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 1,280 | 1,347 | 112,782 | 2051/12/01 | | |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 350 | 452 | 37,894 | 2064/12/01 | | |
| CANADA 0.5 12/01/30 | 国債証券 | 0.5000 | 1,100 | 1,031 | 86,351 | 2030/12/01 | | |
| 小計 | — | — | 29,460 | 31,957 | 2,675,453 | — | | |
| (オーストラリア) | | | % | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47 | 国債証券 | 3.0000 | 870 | 988 | 82,219 | 2047/03/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/25 | 国債証券 | 3.2500 | 2,720 | 3,045 | 253,353 | 2025/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 1,670 | 2,071 | 172,356 | 2027/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 04/21/24 | 国債証券 | 2.7500 | 1,980 | 2,143 | 178,346 | 2024/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 2,010 | 2,388 | 198,670 | 2026/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 5.5 04/21/23 | 国債証券 | 5.5000 | 2,510 | 2,800 | 232,976 | 2023/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 2,440 | 2,842 | 236,444 | 2029/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 国債証券 | 4.5000 | 980 | 1,300 | 108,149 | 2033/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 760 | 957 | 79,630 | 2037/04/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,740 | 1,888 | 157,097 | 2028/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 2,050 | 2,263 | 188,323 | 2030/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 740 | 812 | 67,595 | 2041/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 1,390 | 1,350 | 112,351 | 2032/05/21 | | |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 620 | 733 | 61,060 | 2039/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31 | 国債証券 | 1.5000 | 1,640 | 1,650 | 137,336 | 2031/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 530 | 595 | 49,562 | 2035/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 1,000 | 850 | 70,744 | 2051/06/21 | | |
| AUSTRALIAN 5.75 07/15/22 | 国債証券 | 5.7500 | 680 | 733 | 61,040 | 2022/07/15 | | |
| AUSTRALIAN 0.5 09/21/26 | 国債証券 | 0.5000 | 1,680 | 1,664 | 138,499 | 2026/09/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 国債証券 | 2.7500 | 1,780 | 2,001 | 166,541 | 2028/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 国債証券 | 2.7500 | 1,630 | 1,827 | 151,993 | 2027/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 1,860 | 2,085 | 173,533 | 2029/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 2.25 11/21/22 | 国債証券 | 2.2500 | 2,190 | 2,271 | 189,002 | 2022/11/21 | | |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 国債証券 | 1.0000 | 1,600 | 1,523 | 126,716 | 2031/11/21 | | |

| 銘柄 | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 期 間 | | 償 還 年 月 日 |
|----------------------------|------|--------|----------------------|----------------------|---------------|------------|
| | | | | 評 価 額 | | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (オーストラリア) | | | | | | |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/25 | 国債証券 | 0.2500 | 千オーストラリア・ドル 1,450 | 千オーストラリア・ドル 1,434 | 千円 119,342 | 2025/11/21 |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/24 | 国債証券 | 0.2500 | 1,440 | 1,439 | 119,773 | 2024/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 1,740 | 1,677 | 139,582 | 2030/12/21 |
| 小計 | — | — | 41,700 | 45,344 | 3,772,248 | — |
| (シンガポール) | | | | | | |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 国債証券 | 3.5000 | 千シンガポール・ドル 730 | 千シンガポール・ドル 843 | 千円 67,253 | 2027/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 国債証券 | 2.7500 | 420 | 513 | 40,914 | 2046/03/01 |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50 | 国債証券 | 1.8750 | 210 | 220 | 17,613 | 2050/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 国債証券 | 2.7500 | 380 | 454 | 36,250 | 2042/04/01 |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28 | 国債証券 | 2.6250 | 130 | 144 | 11,552 | 2028/05/01 |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25 | 国債証券 | 2.3750 | 340 | 366 | 29,194 | 2025/06/01 |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26 | 国債証券 | 2.1250 | 310 | 332 | 26,509 | 2026/06/01 |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 国債証券 | 2.8750 | 200 | 228 | 18,215 | 2029/07/01 |
| SINGAPORE 2.375 07/01/39 | 国債証券 | 2.3750 | 100 | 112 | 8,978 | 2039/07/01 |
| SINGAPORE 2.75 07/01/23 | 国債証券 | 2.7500 | 700 | 739 | 58,960 | 2023/07/01 |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 480 | 528 | 42,154 | 2036/08/01 |
| SINGAPORE 3.0 09/01/24 | 国債証券 | 3.0000 | 550 | 598 | 47,716 | 2024/09/01 |
| SINGAPORE 3.125 09/01/22 | 国債証券 | 3.1250 | 800 | 834 | 66,544 | 2022/09/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 国債証券 | 2.8750 | 370 | 426 | 33,998 | 2030/09/01 |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33 | 国債証券 | 3.3750 | 480 | 586 | 46,786 | 2033/09/01 |
| 小計 | — | — | 6,200 | 6,929 | 552,643 | — |
| (イギリス) | | | | | | |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44 | 国債証券 | 3.2500 | 千イギリス・ポンド 1,310 | 千イギリス・ポンド 1,842 | 千円 272,723 | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 国債証券 | 3.5000 | 1,280 | 1,882 | 278,641 | 2045/01/22 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60 | 国債証券 | 4.0000 | 870 | 1,631 | 241,423 | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49 | 国債証券 | 1.7500 | 890 | 997 | 147,593 | 2049/01/22 |
| UK TREASURY 0.875 01/31/46 | 国債証券 | 0.8750 | 250 | 229 | 33,909 | 2046/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/24 | 国債証券 | 0.1250 | 500 | 500 | 73,991 | 2024/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/28 | 国債証券 | 0.1250 | 1,000 | 976 | 144,542 | 2028/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/23 | 国債証券 | 0.1250 | 1,500 | 1,502 | 222,361 | 2023/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/30/26 | 国債証券 | 0.1250 | 1,200 | 1,191 | 176,244 | 2026/01/30 |
| UK TREASURY 5.0 03/07/25 | 国債証券 | 5.0000 | 1,410 | 1,684 | 249,239 | 2025/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 国債証券 | 4.2500 | 1,330 | 1,931 | 285,773 | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 1.0 04/22/24 | 国債証券 | 1.0000 | 1,120 | 1,152 | 170,511 | 2024/04/22 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 国債証券 | 4.2500 | 1,210 | 1,659 | 245,552 | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 0.625 06/07/25 | 国債証券 | 0.6250 | 1,250 | 1,273 | 188,463 | 2025/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47 | 国債証券 | 1.5000 | 910 | 963 | 142,551 | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 国債証券 | 3.7500 | 940 | 1,556 | 230,311 | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 国債証券 | 1.7500 | 910 | 1,055 | 156,180 | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 国債証券 | 2.5000 | 980 | 1,430 | 211,723 | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 国債証券 | 3.5000 | 960 | 1,781 | 263,612 | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26 | 国債証券 | 1.5000 | 900 | 959 | 141,928 | 2026/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27 | 国債証券 | 1.2500 | 1,260 | 1,328 | 196,608 | 2027/07/22 |
| UK TREASURY 0.5 07/22/22 | 国債証券 | 0.5000 | 1,920 | 1,934 | 286,259 | 2022/07/22 |
| UK TREASURY 0.75 07/22/23 | 国債証券 | 0.7500 | 1,560 | 1,587 | 234,847 | 2023/07/22 |
| UK TREASURY 0.25 07/31/31 | 国債証券 | 0.2500 | 750 | 710 | 105,086 | 2031/07/31 |
| UK TREASURY 0.625 07/31/35 | 国債証券 | 0.6250 | 800 | 755 | 111,850 | 2035/07/31 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 国債証券 | 4.2500 | 920 | 1,403 | 207,743 | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 2.25 09/07/23 | 国債証券 | 2.2500 | 1,180 | 1,246 | 184,385 | 2023/09/07 |
| UK TREASURY 2.75 09/07/24 | 国債証券 | 2.7500 | 480 | 524 | 77,655 | 2024/09/07 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25 | 国債証券 | 2.0000 | 790 | 854 | 126,416 | 2025/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 国債証券 | 4.5000 | 760 | 1,105 | 163,582 | 2034/09/07 |

| 銘柄 | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 期 間 | | 償 還 年 月 日 |
|---------------------------------|------|--------|-------------|-------------|-------------|------------|
| | | | | 評 価 額 | | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (イギリス) | | % | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 国債証券 | 1.7500 | 1,440 | 1,582 | 234,125 | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/22 | 国債証券 | 1.7500 | 1,530 | 1,571 | 232,601 | 2022/09/07 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券 | 1.6250 | 520 | 575 | 85,205 | 2054/10/22 |
| UK TREASURY 0.5 10/22/61 | 国債証券 | 0.5000 | 470 | 367 | 54,449 | 2061/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券 | 1.6250 | 580 | 701 | 103,738 | 2071/10/22 |
| UK TREASURY 1.25 10/22/41 | 国債証券 | 1.2500 | 880 | 888 | 131,413 | 2041/10/22 |
| UK TREASURY 0.625 10/22/50 | 国債証券 | 0.6250 | 1,050 | 887 | 131,403 | 2050/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券 | 1.6250 | 930 | 1,008 | 149,300 | 2028/10/22 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | 0.8750 | 910 | 929 | 137,602 | 2029/10/22 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/30 | 国債証券 | 0.3750 | 1,450 | 1,405 | 207,984 | 2030/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 国債証券 | 6.0000 | 760 | 1,076 | 159,354 | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | 4.7500 | 880 | 1,403 | 207,676 | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 国債証券 | 4.5000 | 1,280 | 2,094 | 309,883 | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 国債証券 | 4.2500 | 1,060 | 1,765 | 261,246 | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | 4.2500 | 1,020 | 1,895 | 280,491 | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 国債証券 | 4.2500 | 780 | 980 | 145,163 | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 国債証券 | 4.2500 | 960 | 1,486 | 220,009 | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 国債証券 | 4.7500 | 1,140 | 1,578 | 233,628 | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 国債証券 | 4.2500 | 990 | 1,712 | 253,474 | 2049/12/07 |
| 小計 | — | — | 49,770 | 61,565 | 9,110,469 | — |
| (イスラエル) | | % | 千イスラエル・シケル | 千イスラエル・シケル | 千円 | |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42 | 国債証券 | 5.5000 | 1,500 | 2,457 | 79,193 | 2042/01/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 国債証券 | 3.7500 | 1,260 | 1,669 | 53,806 | 2047/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27 | 国債証券 | 2.0000 | 2,610 | 2,830 | 91,218 | 2027/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24 | 国債証券 | 3.7500 | 2,600 | 2,881 | 92,859 | 2024/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30 | 国債証券 | 1.0000 | 950 | 947 | 30,529 | 2030/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23 | 国債証券 | 4.2500 | 2,920 | 3,169 | 102,152 | 2023/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37 | 国債証券 | 1.5000 | 500 | 484 | 15,608 | 2037/05/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22 | 国債証券 | 0.7500 | 300 | 302 | 9,750 | 2022/07/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 国債証券 | 1.7500 | 2,030 | 2,153 | 69,393 | 2025/08/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22 | 国債証券 | 1.2500 | 1,000 | 1,019 | 32,846 | 2022/11/30 |
| 小計 | — | — | 15,670 | 17,913 | 577,359 | — |
| (デンマーク) | | % | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | 千円 | |
| DENMARK 0.25 11/15/52 | 国債証券 | 0.2500 | 1,650 | 1,599 | 27,514 | 2052/11/15 |
| DENMARK 4.5 11/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 8,050 | 14,548 | 250,227 | 2039/11/15 |
| DENMARK 1.75 11/15/25 | 国債証券 | 1.7500 | 5,320 | 5,884 | 101,211 | 2025/11/15 |
| DENMARK 1.5 11/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 2,300 | 2,430 | 41,804 | 2023/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 7,130 | 7,536 | 129,636 | 2027/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 2,670 | 2,835 | 48,774 | 2029/11/15 |
| DENMARK 0.25 11/15/22 | 国債証券 | 0.2500 | 3,660 | 3,710 | 63,820 | 2022/11/15 |
| 小計 | — | — | 30,780 | 38,545 | 662,988 | — |
| (ノルウェー) | | % | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | |
| NORWAY 1.5 02/19/26 | 国債証券 | 1.5000 | 3,770 | 3,891 | 48,598 | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 1,000 | 1,044 | 13,042 | 2027/02/17 |
| NORWAY 3.0 03/14/24 | 国債証券 | 3.0000 | 6,200 | 6,658 | 83,169 | 2024/03/14 |
| NORWAY 1.75 03/13/25 | 国債証券 | 1.7500 | 3,800 | 3,955 | 49,405 | 2025/03/13 |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 2,070 | 2,198 | 27,457 | 2028/04/26 |
| NORWAY 2.0 05/24/23 | 国債証券 | 2.0000 | 1,000 | 1,034 | 12,923 | 2023/05/24 |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国債証券 | 1.3750 | 3,730 | 3,757 | 46,934 | 2030/08/19 |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国債証券 | 1.7500 | 1,700 | 1,772 | 22,137 | 2029/09/06 |
| 小計 | — | — | 23,270 | 24,312 | 303,668 | — |

| 銘 | 柄 | 当期 | | | | | 償還年月日 |
|-----------------------------|------|---------|---------|--------------|--------------|------------|-------|
| | | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (スウェーデン) | | | % | 千スウェーデン・クナ | 千スウェーデン・クナ | 千円 | |
| SWEDEN 3.5 03/30/39 | 国債証券 | 3.5000 | 3,270 | 4,838 | 61,740 | 2039/03/30 | |
| SWEDEN 0.75 05/12/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,540 | 1,613 | 20,589 | 2028/05/12 | |
| SWEDEN 2.5 05/12/25 | 国債証券 | 2.5000 | 6,180 | 6,890 | 87,926 | 2025/05/12 | |
| SWEDEN 0.125 05/12/31 | 国債証券 | 0.1250 | 2,200 | 2,155 | 27,505 | 2031/05/12 | |
| SWEDEN 3.5 06/01/22 | 国債証券 | 3.5000 | 3,000 | 3,146 | 40,153 | 2022/06/01 | |
| SWEDEN 1.5 11/13/23 | 国債証券 | 1.5000 | 8,200 | 8,604 | 109,789 | 2023/11/13 | |
| SWEDEN 1.0 11/12/26 | 国債証券 | 1.0000 | 4,250 | 4,506 | 57,505 | 2026/11/12 | |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | 0.7500 | 1,970 | 2,062 | 26,313 | 2029/11/12 | |
| 小計 | — | — | 30,610 | 33,818 | 431,523 | — | |
| (メキシコ) | | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26 | 国債証券 | 5.7500 | 14,859 | 15,407 | 79,350 | 2026/03/05 | |
| MEXICAN BONDS 03/09/23 | 国債証券 | 6.7500 | 20,000 | 21,027 | 108,292 | 2023/03/09 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | 8.5000 | 17,109 | 20,314 | 104,618 | 2029/05/31 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 10,000 | 11,329 | 58,346 | 2031/05/29 | |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 18,071 | 20,262 | 104,352 | 2027/06/03 | |
| MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22 | 国債証券 | 6.5000 | 7,830 | 8,066 | 41,542 | 2022/06/09 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24 | 国債証券 | 8.0000 | 10,000 | 11,134 | 57,343 | 2024/09/05 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 13,643 | 14,895 | 76,713 | 2042/11/13 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 9,254 | 10,313 | 53,112 | 2047/11/07 | |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 8,125 | 9,596 | 49,422 | 2038/11/18 | |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 8,085 | 10,834 | 55,799 | 2036/11/20 | |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 7,000 | 7,917 | 40,776 | 2034/11/23 | |
| MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24 | 国債証券 | 10.0000 | 22,596 | 26,847 | 138,264 | 2024/12/05 | |
| MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23 | 国債証券 | 8.0000 | 14,000 | 15,372 | 79,167 | 2023/12/07 | |
| 小計 | — | — | 180,572 | 203,320 | 1,047,101 | — | |
| (マレーシア) | | | % | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27 | 国債証券 | 3.8920 | 800 | 858 | 22,423 | 2027/03/15 | |
| MALAYSIA 3.48 03/15/23 | 国債証券 | 3.4800 | 1,220 | 1,258 | 32,867 | 2023/03/15 | |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26 | 国債証券 | 4.3920 | 3,070 | 3,362 | 87,826 | 2026/04/15 | |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 1,800 | 2,008 | 52,448 | 2030/04/15 | |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 1,210 | 1,234 | 32,232 | 2033/04/15 | |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37 | 国債証券 | 4.7620 | 1,200 | 1,349 | 35,236 | 2037/04/07 | |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 国債証券 | 3.7330 | 2,000 | 2,133 | 55,725 | 2028/06/15 | |
| MALAYSIA 4.181 07/15/24 | 国債証券 | 4.1810 | 2,430 | 2,595 | 67,806 | 2024/07/15 | |
| MALAYSIA 4.921 07/06/48 | 国債証券 | 4.9210 | 2,600 | 2,934 | 76,659 | 2048/07/06 | |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34 | 国債証券 | 3.8280 | 600 | 605 | 15,815 | 2034/07/05 | |
| MALAYSIA 3.418 08/15/22 | 国債証券 | 3.4180 | 3,000 | 3,067 | 80,122 | 2022/08/15 | |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 2,000 | 2,286 | 59,713 | 2043/09/30 | |
| 小計 | — | — | 21,930 | 23,693 | 618,878 | — | |
| (ポーランド) | | | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | |
| POLAND 2.5 01/25/23 | 国債証券 | 2.5000 | 2,850 | 2,981 | 85,062 | 2023/01/25 | |
| POLAND 5.75 04/25/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,440 | 1,968 | 56,166 | 2029/04/25 | |
| POLAND 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 3,010 | 3,373 | 96,231 | 2028/04/25 | |
| POLAND 2.25 04/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 1,500 | 1,539 | 43,927 | 2022/04/25 | |
| POLAND 2.5 04/25/24 | 国債証券 | 2.5000 | 2,290 | 2,447 | 69,821 | 2024/04/25 | |
| POLAND 2.5 07/25/26 | 国債証券 | 2.5000 | 2,080 | 2,277 | 64,976 | 2026/07/25 | |
| POLAND 3.25 07/25/25 | 国債証券 | 3.2500 | 2,380 | 2,662 | 75,948 | 2025/07/25 | |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 2,280 | 2,511 | 71,645 | 2027/07/25 | |
| POLAND 07/25/22 | 国債証券 | — | 1,200 | 1,199 | 34,226 | 2022/07/25 | |
| POLAND 5.75 09/23/22 | 国債証券 | 5.7500 | 1,720 | 1,876 | 53,528 | 2022/09/23 | |
| POLAND 4.0 10/25/23 | 国債証券 | 4.0000 | 3,940 | 4,340 | 123,836 | 2023/10/25 | |
| POLAND 2.75 10/25/29 | 国債証券 | 2.7500 | 210 | 236 | 6,758 | 2029/10/25 | |

| 銘柄 | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 期 間 | | 償 還 年 月 日 |
|---------------------------|------|--------|------------|------------|-------------|------------|
| | | | | 評 価 額 | | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (ポーランド) | | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | |
| POLAND 2.25 10/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 600 | 639 | 18,255 | 2024/10/25 |
| POLAND 1.25 10/25/30 | 国債証券 | 1.2500 | 2,850 | 2,828 | 80,701 | 2030/10/25 |
| 小 計 | — | — | 28,350 | 30,882 | 881,086 | — |
| (ユーロ…アイルランド) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| IRISH 2.0 02/18/45 | 国債証券 | 2.0000 | 560 | 746 | 95,441 | 2045/02/18 |
| IRISH 1.35 03/18/31 | 国債証券 | 1.3500 | 210 | 239 | 30,637 | 2031/03/18 |
| IRISH 3.4 03/18/24 | 国債証券 | 3.4000 | 510 | 572 | 73,204 | 2024/03/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 国債証券 | 5.4000 | 800 | 993 | 127,088 | 2025/03/13 |
| IRISH 3.9 03/20/23 | 国債証券 | 3.9000 | 570 | 623 | 79,736 | 2023/03/20 |
| IRISH 0.8 03/15/22 | 国債証券 | 0.8000 | 370 | 375 | 48,008 | 2022/03/15 |
| IRISH 1.5 05/15/50 | 国債証券 | 1.5000 | 400 | 487 | 62,335 | 2050/05/15 |
| IRISH 1.3 05/15/33 | 国債証券 | 1.3000 | 340 | 389 | 49,840 | 2033/05/15 |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 国債証券 | 2.4000 | 630 | 776 | 99,305 | 2030/05/15 |
| IRISH 0.9 05/15/28 | 国債証券 | 0.9000 | 430 | 466 | 59,681 | 2028/05/15 |
| IRISH 1.1 05/15/29 | 国債証券 | 1.1000 | 380 | 419 | 53,719 | 2029/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26 | 国債証券 | 1.0000 | 980 | 1,053 | 134,768 | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 国債証券 | 1.7000 | 400 | 488 | 62,484 | 2037/05/15 |
| IRISH 0.4 05/15/35 | 国債証券 | 0.4000 | 240 | 246 | 31,485 | 2035/05/15 |
| IRISH 0.2 05/15/27 | 国債証券 | 0.2000 | 280 | 289 | 37,051 | 2027/05/15 |
| IRISH 0.0 10/18/31 | 国債証券 | 0.0000 | 360 | 358 | 45,872 | 2031/10/18 |
| IRISH 10/18/22 | 国債証券 | 0.0000 | 220 | 222 | 28,416 | 2022/10/18 |
| IRISH 0.2 10/18/30 | 国債証券 | 0.2000 | 260 | 266 | 34,040 | 2030/10/18 |
| 小 計 | — | — | 7,940 | 9,015 | 1,153,117 | — |
| (ユーロ…オランダ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,060 | 1,856 | 237,460 | 2042/01/15 |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 960 | 1,580 | 202,134 | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/52 | 国債証券 | 0.0000 | 570 | 521 | 66,732 | 2052/01/15 |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/23 | 国債証券 | 3.7500 | 390 | 422 | 54,100 | 2023/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | 850 | 1,204 | 154,070 | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | 国債証券 | 4.0000 | 950 | 1,556 | 199,028 | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | 国債証券 | 2.5000 | 780 | 1,027 | 131,440 | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40 | 国債証券 | 0.5000 | 590 | 634 | 81,131 | 2040/01/15 |
| NETHERLANDS 01/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 830 | 846 | 108,247 | 2024/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/27 | 国債証券 | 0.0000 | 460 | 473 | 60,539 | 2027/01/15 |
| NETHERLANDS 1.75 07/15/23 | 国債証券 | 1.7500 | 2,110 | 2,233 | 285,722 | 2023/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 940 | 992 | 127,004 | 2026/07/15 |
| NETHERLANDS 2.25 07/15/22 | 国債証券 | 2.2500 | 980 | 1,019 | 130,462 | 2022/07/15 |
| NETHERLANDS 2.0 07/15/24 | 国債証券 | 2.0000 | 820 | 894 | 114,426 | 2024/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 国債証券 | 0.2500 | 1,020 | 1,058 | 135,379 | 2025/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 国債証券 | 0.7500 | 850 | 923 | 118,071 | 2028/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 700 | 755 | 96,602 | 2027/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 790 | 828 | 105,927 | 2029/07/15 |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 950 | 972 | 124,375 | 2030/07/15 |
| 小 計 | — | — | 16,600 | 19,801 | 2,532,858 | — |
| (ユーロ…ベルギー) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/22 | 国債証券 | 4.0000 | 420 | 441 | 56,473 | 2022/03/28 |
| BELGIUM 5.5 03/28/28 | 国債証券 | 5.5000 | 1,240 | 1,760 | 225,203 | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | 国債証券 | 4.2500 | 1,060 | 1,827 | 233,799 | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26 | 国債証券 | 4.5000 | 820 | 1,031 | 131,896 | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32 | 国債証券 | 4.0000 | 530 | 766 | 98,035 | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35 | 国債証券 | 5.0000 | 1,090 | 1,826 | 233,596 | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33 | 国債証券 | 1.2500 | 710 | 811 | 103,806 | 2033/04/22 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ベルギー) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | 国債証券 | 3.7500 | 650 | 1,112 | 142,359 | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47 | 国債証券 | 1.6000 | 640 | 783 | 100,199 | 2047/06/22 |
| BELGIUM 1.7 06/22/50 | 国債証券 | 1.7000 | 490 | 617 | 78,957 | 2050/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57 | 国債証券 | 2.2500 | 420 | 609 | 77,973 | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 国債証券 | 2.1500 | 420 | 615 | 78,676 | 2066/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26 | 国債証券 | 1.0000 | 1,020 | 1,100 | 140,806 | 2026/06/22 |
| BELGIUM 2.6 06/22/24 | 国債証券 | 2.6000 | 1,050 | 1,163 | 148,792 | 2024/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 国債証券 | 1.0000 | 810 | 897 | 114,848 | 2031/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/23 | 国債証券 | 2.2500 | 830 | 886 | 113,400 | 2023/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28 | 国債証券 | 0.8000 | 880 | 951 | 121,745 | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.4 06/22/40 | 国債証券 | 0.4000 | 320 | 316 | 40,517 | 2040/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29 | 国債証券 | 0.9000 | 1,010 | 1,103 | 141,206 | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 国債証券 | 3.0000 | 670 | 922 | 118,055 | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 国債証券 | 1.9000 | 550 | 692 | 88,625 | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25 | 国債証券 | 0.8000 | 1,140 | 1,207 | 154,391 | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27 | 国債証券 | 0.8000 | 850 | 913 | 116,837 | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 国債証券 | 1.4500 | 230 | 271 | 34,712 | 2037/06/22 |
| BELGIUM 0.1 06/22/30 | 国債証券 | 0.1000 | 800 | 815 | 104,354 | 2030/06/22 |
| BELGIUM 4.25 09/28/22 | 国債証券 | 4.2500 | 1,190 | 1,284 | 164,250 | 2022/09/28 |
| BELGIUM 0.5 10/22/24 | 国債証券 | 0.5000 | 530 | 551 | 70,513 | 2024/10/22 |
| BELGIUM 0.2 10/22/23 | 国債証券 | 0.2000 | 660 | 674 | 86,307 | 2023/10/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/27 | 国債証券 | 0.0000 | 500 | 511 | 65,471 | 2027/10/22 |
| 小計 | — | — | 21,530 | 26,470 | 3,385,814 | — |
| (ユーロ…フランス) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FRANCE OAT 02/25/22 | 国債証券 | 0.0000 | 690 | 694 | 88,821 | 2022/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,100 | 1,113 | 142,487 | 2023/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26 | 国債証券 | 0.0000 | 1,500 | 1,535 | 196,426 | 2026/02/25 |
| FRANCE OAT 03/25/24 | 国債証券 | 0.0000 | 2,720 | 2,770 | 354,339 | 2024/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/25 | 国債証券 | 0.0000 | 2,470 | 2,524 | 322,898 | 2025/03/25 |
| FRANCE OAT 03/25/23 | 国債証券 | 0.0000 | 2,700 | 2,735 | 349,943 | 2023/03/25 |
| FRANCE BTAN 8.5 04/25/23 | 国債証券 | 8.5000 | 1,030 | 1,236 | 158,103 | 2023/04/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26 | 国債証券 | 3.5000 | 2,820 | 3,408 | 435,949 | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 国債証券 | 4.5000 | 2,180 | 3,907 | 499,797 | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 国債証券 | 4.0000 | 1,060 | 2,102 | 268,932 | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 国債証券 | 4.0000 | 1,090 | 2,266 | 289,912 | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 国債証券 | 5.5000 | 2,540 | 3,749 | 479,635 | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 3.0 04/25/22 | 国債証券 | 3.0000 | 2,350 | 2,450 | 313,451 | 2022/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 1,650 | 2,716 | 347,506 | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 1,800 | 2,911 | 372,455 | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48 | 国債証券 | 2.0000 | 1,690 | 2,269 | 290,233 | 2048/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50 | 国債証券 | 1.5000 | 1,870 | 2,277 | 291,284 | 2050/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52 | 国債証券 | 0.7500 | 1,380 | 1,387 | 177,469 | 2052/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 940 | 1,257 | 160,785 | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72 | 国債証券 | 0.5000 | 300 | 250 | 32,008 | 2072/05/25 |
| FRANCE OAT 2.25 05/25/24 | 国債証券 | 2.2500 | 1,980 | 2,165 | 276,933 | 2024/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | 2.5000 | 2,940 | 3,661 | 468,371 | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 2,750 | 2,961 | 378,755 | 2028/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 国債証券 | 1.5000 | 3,590 | 4,161 | 532,264 | 2031/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/25 | 国債証券 | 0.5000 | 2,620 | 2,736 | 350,084 | 2025/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 国債証券 | 0.5000 | 2,140 | 2,265 | 289,789 | 2029/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 国債証券 | 1.2500 | 2,340 | 2,678 | 342,620 | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26 | 国債証券 | 0.5000 | 2,070 | 2,176 | 278,364 | 2026/05/25 |

| 銘 | 柄 | 当 期 | | | | | 末 | |
|----------------------------|------|--------|--------|---------|------------|-------------|---|-----------|
| | | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | | 償 還 年 月 日 |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (ユーロ…フランス) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 国債証券 | 1.0000 | 1,650 | 1,794 | 229,560 | 2027/05/25 | | |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40 | 国債証券 | 0.5000 | 700 | 708 | 90,570 | 2040/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/23 | 国債証券 | 1.7500 | 3,130 | 3,299 | 422,007 | 2023/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 国債証券 | 1.2500 | 2,190 | 2,515 | 321,805 | 2036/05/25 | | |
| FRANCE OAT 05/25/22 | 国債証券 | 0.0000 | 2,190 | 2,207 | 282,375 | 2022/05/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 国債証券 | 1.7500 | 1,990 | 2,477 | 316,939 | 2039/06/25 | | |
| FRANCE OAT 4.25 10/25/23 | 国債証券 | 4.2500 | 2,730 | 3,090 | 395,284 | 2023/10/25 | | |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25 | 国債証券 | 6.0000 | 1,800 | 2,358 | 301,617 | 2025/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 2,780 | 3,365 | 430,494 | 2027/10/25 | | |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 国債証券 | 4.0000 | 1,520 | 2,486 | 318,067 | 2038/10/25 | | |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 国債証券 | 5.7500 | 2,260 | 3,779 | 483,444 | 2032/10/25 | | |
| FRANCE OAT 2.25 10/25/22 | 国債証券 | 2.2500 | 2,030 | 2,128 | 272,281 | 2022/10/25 | | |
| FRANCE OAT 1.75 11/25/24 | 国債証券 | 1.7500 | 2,680 | 2,915 | 372,985 | 2024/11/25 | | |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25 | 国債証券 | 1.0000 | 2,220 | 2,380 | 304,526 | 2025/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26 | 国債証券 | 0.2500 | 3,850 | 4,000 | 511,672 | 2026/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 2,340 | 2,524 | 322,868 | 2028/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30 | 国債証券 | 0.0000 | 2,200 | 2,215 | 283,329 | 2030/11/25 | | |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29 | 国債証券 | 0.0000 | 2,450 | 2,483 | 317,675 | 2029/11/25 | | |
| 小 計 | - | - | 95,020 | 113,104 | 14,467,133 | - | | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24 | 国債証券 | 6.2500 | 840 | 1,009 | 129,077 | 2024/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5.6250 | 1,160 | 1,663 | 212,761 | 2028/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 国債証券 | 6.2500 | 710 | 1,141 | 145,960 | 2030/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 国債証券 | 5.5000 | 1,240 | 1,974 | 252,550 | 2031/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 国債証券 | 4.0000 | 1,790 | 2,971 | 380,038 | 2037/01/04 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 | 国債証券 | 0.5000 | 1,860 | 1,948 | 249,230 | 2025/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26 | 国債証券 | 0.5000 | 1,810 | 1,913 | 244,799 | 2026/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 1,900 | 2,009 | 257,043 | 2029/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,420 | 1,482 | 189,649 | 2023/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 1,430 | 1,534 | 196,261 | 2028/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,500 | 1,611 | 206,122 | 2024/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | 国債証券 | 0.2500 | 1,960 | 2,059 | 263,449 | 2027/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 800 | 825 | 105,600 | 2031/02/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 1,690 | 1,749 | 223,796 | 2030/02/15 | | |
| BUNDESUBL 04/14/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,030 | 1,045 | 133,747 | 2023/04/14 | | |
| BUNDESUBL 04/05/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,540 | 1,574 | 201,335 | 2024/04/05 | | |
| BUNDESUBL 0.0 04/11/25 | 国債証券 | 0.0000 | 1,250 | 1,284 | 164,339 | 2025/04/11 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24 | 国債証券 | 1.5000 | 1,410 | 1,511 | 193,332 | 2024/05/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23 | 国債証券 | 1.5000 | 1,650 | 1,731 | 221,527 | 2023/05/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35 | 国債証券 | 0.0000 | 1,600 | 1,623 | 207,699 | 2035/05/15 | | |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 国債証券 | 6.5000 | 710 | 1,036 | 132,551 | 2027/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 600 | 837 | 107,173 | 2028/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,140 | 2,046 | 261,708 | 2039/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 1,100 | 1,859 | 237,901 | 2042/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 国債証券 | 2.5000 | 1,760 | 2,755 | 352,481 | 2044/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 1,180 | 2,277 | 291,365 | 2040/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22 | 国債証券 | 1.7500 | 1,540 | 1,591 | 203,522 | 2022/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 1,420 | 2,378 | 304,297 | 2034/07/04 | | |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 1,750 | 2,801 | 358,330 | 2046/08/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 1,620 | 2,091 | 267,533 | 2048/08/15 | | |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 | 国債証券 | 1.0000 | 1,770 | 1,903 | 243,435 | 2025/08/15 | | |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,300 | 2,461 | 314,801 | 2027/08/15 | | |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|---------------------------|------|--------|--------|--------|------------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| DEUTSCHLAND 08/15/26 | 国債証券 | 0.0000 | 1,680 | 1,737 | 222,237 | 2026/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,440 | 1,521 | 194,610 | 2028/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 | 国債証券 | 2.0000 | 4,550 | 4,858 | 621,485 | 2023/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24 | 国債証券 | 1.0000 | 1,340 | 1,420 | 181,684 | 2024/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 1,910 | 1,979 | 253,198 | 2029/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 国債証券 | 0.0000 | 1,070 | 1,008 | 129,048 | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 2,000 | 2,067 | 264,453 | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 500 | 518 | 66,381 | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22 | 国債証券 | 1.5000 | 1,650 | 1,705 | 218,190 | 2022/09/04 |
| BUNDESUBL 10/18/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,130 | 1,158 | 148,192 | 2024/10/18 |
| BUNDESUBL 10/07/22 | 国債証券 | 0.0000 | 1,400 | 1,415 | 181,074 | 2022/10/07 |
| BUNDESUBL 10/13/23 | 国債証券 | 0.0000 | 1,280 | 1,304 | 166,811 | 2023/10/13 |
| BUNDESUBL 0.0 10/10/25 | 国債証券 | 0.0000 | 1,300 | 1,339 | 171,294 | 2025/10/10 |
| BUNDESUBL 0.0 10/10/25 | 国債証券 | 0.0000 | 300 | 309 | 39,592 | 2025/10/10 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27 | 国債証券 | 0.0000 | 1,500 | 1,553 | 198,764 | 2027/11/15 |
| 小計 | — | — | 68,530 | 80,607 | 10,310,448 | — |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 5.85 01/31/22 | 国債証券 | 5.8500 | 1,810 | 1,918 | 245,400 | 2022/01/31 |
| SPAIN 6.0 01/31/29 | 国債証券 | 6.0000 | 1,580 | 2,319 | 296,634 | 2029/01/31 |
| SPAIN 4.8 01/31/24 | 国債証券 | 4.8000 | 1,130 | 1,305 | 167,019 | 2024/01/31 |
| SPAIN 4.2 01/31/37 | 国債証券 | 4.2000 | 1,380 | 2,112 | 270,198 | 2037/01/31 |
| SPAIN 5.4 01/31/23 | 国債証券 | 5.4000 | 1,460 | 1,627 | 208,161 | 2023/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/25 | 国債証券 | 0.0000 | 1,400 | 1,417 | 181,312 | 2025/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/26 | 国債証券 | 0.0000 | 500 | 505 | 64,681 | 2026/01/31 |
| SPAIN 1.6 04/30/25 | 国債証券 | 1.6000 | 1,450 | 1,566 | 200,434 | 2025/04/30 |
| SPAIN 3.8 04/30/24 | 国債証券 | 3.8000 | 1,270 | 1,442 | 184,462 | 2024/04/30 |
| SPAIN 1.5 04/30/27 | 国債証券 | 1.5000 | 1,210 | 1,331 | 170,255 | 2027/04/30 |
| SPAIN 1.95 04/30/26 | 国債証券 | 1.9500 | 1,270 | 1,413 | 180,831 | 2026/04/30 |
| SPAIN 1.4 04/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 1,240 | 1,363 | 174,414 | 2028/04/30 |
| SPAIN 1.45 04/30/29 | 国債証券 | 1.4500 | 1,170 | 1,297 | 165,900 | 2029/04/30 |
| SPAIN 0.4 04/30/22 | 国債証券 | 0.4000 | 1,570 | 1,587 | 203,015 | 2022/04/30 |
| SPAIN 0.5 04/30/30 | 国債証券 | 0.5000 | 1,150 | 1,178 | 150,752 | 2030/04/30 |
| SPAIN 0.1 04/30/31 | 国債証券 | 0.1000 | 600 | 584 | 74,788 | 2031/04/30 |
| SPAIN 0.0 04/30/23 | 国債証券 | 0.0000 | 990 | 1,000 | 127,947 | 2023/04/30 |
| SPAIN 5.9 07/30/26 | 国債証券 | 5.9000 | 1,170 | 1,559 | 199,413 | 2026/07/30 |
| SPAIN 4.9 07/30/40 | 国債証券 | 4.9000 | 1,170 | 2,018 | 258,214 | 2040/07/30 |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 1,270 | 2,167 | 277,244 | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66 | 国債証券 | 3.4500 | 960 | 1,568 | 200,686 | 2066/07/30 |
| SPAIN 4.65 07/30/25 | 国債証券 | 4.6500 | 1,370 | 1,672 | 213,954 | 2025/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30 | 国債証券 | 1.9500 | 1,460 | 1,692 | 216,473 | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32 | 国債証券 | 5.7500 | 1,520 | 2,428 | 310,616 | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 1,240 | 1,515 | 193,803 | 2033/07/30 |
| SPAIN 1.4 07/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 1,210 | 1,333 | 170,511 | 2028/07/30 |
| SPAIN 1.85 07/30/35 | 国債証券 | 1.8500 | 1,290 | 1,503 | 192,345 | 2035/07/30 |
| SPAIN 0.25 07/30/24 | 国債証券 | 0.2500 | 940 | 960 | 122,873 | 2024/07/30 |
| SPAIN 0.35 07/30/23 | 国債証券 | 0.3500 | 1,420 | 1,448 | 185,248 | 2023/07/30 |
| SPAIN 0.8 07/30/27 | 国債証券 | 0.8000 | 1,200 | 1,266 | 161,987 | 2027/07/30 |
| SPAIN 2.75 10/31/24 | 国債証券 | 2.7500 | 1,540 | 1,717 | 219,729 | 2024/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/28 | 国債証券 | 5.1500 | 1,180 | 1,640 | 209,797 | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/44 | 国債証券 | 5.1500 | 830 | 1,552 | 198,523 | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 10/31/46 | 国債証券 | 2.9000 | 1,180 | 1,659 | 212,220 | 2046/10/31 |
| SPAIN 2.7 10/31/48 | 国債証券 | 2.7000 | 860 | 1,178 | 150,763 | 2048/10/31 |

| 銘柄 | 当 | | | 期 | | 末 |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…スペイン) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 1.0 10/31/50 | 国債証券 | 1.0000 | 870 | 827 | 105,834 | 2050/10/31 |
| SPAIN 2.15 10/31/25 | 国債証券 | 2.1500 | 1,380 | 1,537 | 196,709 | 2025/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 1,480 | 1,627 | 208,133 | 2027/10/31 |
| SPAIN 1.3 10/31/26 | 国債証券 | 1.3000 | 1,550 | 1,680 | 214,917 | 2026/10/31 |
| SPAIN 0.6 10/31/29 | 国債証券 | 0.6000 | 1,480 | 1,535 | 196,390 | 2029/10/31 |
| SPAIN 4.4 10/31/23 | 国債証券 | 4.4000 | 480 | 543 | 69,499 | 2023/10/31 |
| SPAIN 0.45 10/31/22 | 国債証券 | 0.4500 | 1,340 | 1,361 | 174,183 | 2022/10/31 |
| SPAIN 1.2 10/31/40 | 国債証券 | 1.2000 | 970 | 1,018 | 130,298 | 2040/10/31 |
| SPAIN 1.25 10/31/30 | 国債証券 | 1.2500 | 1,770 | 1,932 | 247,206 | 2030/10/31 |
| 小計 | - | - | 54,310 | 64,919 | 8,303,795 | - |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 国債証券 | 0.8500 | 1,400 | 1,456 | 186,335 | 2027/01/15 |
| ITALY BTPS 0.0 01/15/24 | 国債証券 | 0.0000 | 1,000 | 1,006 | 128,741 | 2024/01/15 |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,280 | 2,008 | 256,884 | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 国債証券 | 4.0000 | 1,660 | 2,373 | 303,632 | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 1,390 | 1,554 | 198,774 | 2028/02/01 |
| ITALY BTPS 0.35 02/01/25 | 国債証券 | 0.3500 | 1,080 | 1,099 | 140,671 | 2025/02/01 |
| ITALY BTPS 0.5 02/01/26 | 国債証券 | 0.5000 | 300 | 306 | 39,255 | 2026/02/01 |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 国債証券 | 2.7000 | 1,020 | 1,298 | 166,138 | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 1,020 | 1,472 | 188,339 | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/24 | 国債証券 | 4.5000 | 1,090 | 1,245 | 159,300 | 2024/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 国債証券 | 2.8000 | 590 | 766 | 98,031 | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/25 | 国債証券 | 5.0000 | 1,790 | 2,157 | 275,965 | 2025/03/01 |
| ITALY BTPS 5.0 03/01/22 | 国債証券 | 5.0000 | 1,700 | 1,793 | 229,406 | 2022/03/01 |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26 | 国債証券 | 4.5000 | 1,630 | 1,994 | 255,091 | 2026/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 2,490 | 2,742 | 350,735 | 2032/03/01 |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40 | 国債証券 | 3.1000 | 810 | 1,067 | 136,523 | 2040/03/01 |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 1,090 | 1,435 | 183,565 | 2035/03/01 |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 国債証券 | 3.5000 | 1,540 | 1,947 | 249,140 | 2030/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/15/23 | 国債証券 | 0.9500 | 1,070 | 1,098 | 140,476 | 2023/03/15 |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/23 | 国債証券 | 0.9500 | 920 | 943 | 120,718 | 2023/03/01 |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 1,020 | 1,084 | 138,752 | 2036/03/01 |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41 | 国債証券 | 1.8000 | 600 | 655 | 83,791 | 2041/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 国債証券 | 0.9500 | 600 | 591 | 75,633 | 2037/03/01 |
| ITALY BTPS 1.35 04/15/22 | 国債証券 | 1.3500 | 980 | 999 | 127,816 | 2022/04/15 |
| ITALY BTPS 1.2 04/01/22 | 国債証券 | 1.2000 | 770 | 783 | 100,209 | 2022/04/01 |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 1,510 | 1,623 | 207,690 | 2030/04/01 |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31 | 国債証券 | 0.9000 | 1,000 | 1,027 | 131,490 | 2031/04/01 |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 国債証券 | 6.0000 | 970 | 1,484 | 189,831 | 2031/05/01 |
| ITALY BTPS 4.5 05/01/23 | 国債証券 | 4.5000 | 1,400 | 1,548 | 198,031 | 2023/05/01 |
| ITALY BTPS 1.85 05/15/24 | 国債証券 | 1.8500 | 810 | 863 | 110,393 | 2024/05/15 |
| ITALY BTPS 1.45 05/15/25 | 国債証券 | 1.4500 | 1,340 | 1,425 | 182,335 | 2025/05/15 |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26 | 国債証券 | 1.6000 | 1,100 | 1,188 | 152,055 | 2026/06/01 |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25 | 国債証券 | 1.5000 | 1,690 | 1,802 | 230,610 | 2025/06/01 |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 国債証券 | 2.2000 | 920 | 1,034 | 132,351 | 2027/06/01 |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26 | 国債証券 | 2.1000 | 1,630 | 1,806 | 231,125 | 2026/07/15 |
| ITALY BTPS 1.75 07/01/24 | 国債証券 | 1.7500 | 1,200 | 1,277 | 163,407 | 2024/07/01 |
| ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 国債証券 | 1.8500 | 900 | 974 | 124,616 | 2025/07/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 国債証券 | 5.0000 | 1,610 | 2,448 | 313,227 | 2034/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 国債証券 | 5.0000 | 1,330 | 2,175 | 278,248 | 2039/08/01 |
| ITALY BTPS 4.75 08/01/23 | 国債証券 | 4.7500 | 1,900 | 2,136 | 273,237 | 2023/08/01 |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 940 | 1,049 | 134,278 | 2027/08/01 |

| 銘柄 | 種類 | 当 | 利率 | 額面金額 | 期 | | 末 | |
|--------------------------|------|---|--------|--------|---------|------------|------------|-------|
| | | | | | 評価額 | | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…イタリア) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 国債証券 | | 3.0000 | 1,330 | 1,611 | 206,138 | 2029/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.9 08/01/22 | 国債証券 | | 0.9000 | 980 | 997 | 127,633 | 2022/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 国債証券 | | 0.9500 | 1,170 | 1,214 | 155,341 | 2030/08/01 | |
| ITALY BTPS 0.3 08/15/23 | 国債証券 | | 0.3000 | 1,000 | 1,014 | 129,739 | 2023/08/15 | |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | | 2.9500 | 940 | 1,206 | 154,346 | 2038/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | | 4.7500 | 970 | 1,629 | 208,416 | 2044/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | | 3.2500 | 990 | 1,376 | 176,028 | 2046/09/01 | |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | | 4.7500 | 1,390 | 1,842 | 235,636 | 2028/09/01 | |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 国債証券 | | 5.0000 | 1,150 | 1,897 | 242,768 | 2040/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | | 2.4500 | 870 | 1,062 | 135,841 | 2050/09/01 | |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51 | 国債証券 | | 1.7000 | 700 | 726 | 92,956 | 2051/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | | 2.4500 | 1,600 | 1,908 | 244,090 | 2033/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.75 09/01/24 | 国債証券 | | 3.7500 | 1,010 | 1,148 | 146,940 | 2024/09/01 | |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | | 3.8500 | 840 | 1,299 | 166,197 | 2049/09/01 | |
| ITALY BTPS 5.5 09/01/22 | 国債証券 | | 5.5000 | 1,150 | 1,252 | 160,192 | 2022/09/01 | |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | | 2.2500 | 1,020 | 1,201 | 153,665 | 2036/09/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 09/15/22 | 国債証券 | | 1.4500 | 900 | 925 | 118,388 | 2022/09/15 | |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 国債証券 | | 0.9500 | 600 | 627 | 80,222 | 2027/09/15 | |
| ITALY BTPS 0.65 10/15/23 | 国債証券 | | 0.6500 | 980 | 1,004 | 128,441 | 2023/10/15 | |
| ITALY BTPS 2.45 10/01/23 | 国債証券 | | 2.4500 | 930 | 996 | 127,430 | 2023/11/01 | |
| ITALY BTPS 9.0 11/01/23 | 国債証券 | | 9.0000 | 1,190 | 1,487 | 190,250 | 2023/11/01 | |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国債証券 | | 7.2500 | 1,080 | 1,517 | 194,063 | 2026/11/01 | |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 国債証券 | | 6.5000 | 1,790 | 2,528 | 323,473 | 2027/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | | 5.2500 | 1,750 | 2,464 | 315,192 | 2029/11/01 | |
| ITALY BTPS 5.5 11/01/22 | 国債証券 | | 5.5000 | 1,960 | 2,153 | 275,399 | 2022/11/01 | |
| ITALY BTPS 1.45 11/15/24 | 国債証券 | | 1.4500 | 1,040 | 1,101 | 140,904 | 2024/11/15 | |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25 | 国債証券 | | 2.5000 | 1,250 | 1,398 | 178,894 | 2025/11/15 | |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25 | 国債証券 | | 2.0000 | 970 | 1,063 | 135,971 | 2025/12/01 | |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | | 1.2500 | 1,350 | 1,437 | 183,865 | 2026/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/24 | 国債証券 | | 2.5000 | 1,170 | 1,285 | 164,476 | 2024/12/01 | |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28 | 国債証券 | | 2.8000 | 1,200 | 1,422 | 181,987 | 2028/12/01 | |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 国債証券 | | 1.6500 | 1,480 | 1,630 | 208,521 | 2030/12/01 | |
| 小計 | - | - | - | 85,840 | 102,183 | 13,070,282 | - | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| FINLAND 2.0 04/15/24 | 国債証券 | | 2.0000 | 280 | 303 | 38,830 | 2024/04/15 | |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 国債証券 | | 0.7500 | 380 | 414 | 52,981 | 2031/04/15 | |
| FINLAND 1.375 04/15/47 | 国債証券 | | 1.3750 | 130 | 163 | 20,898 | 2047/04/15 | |
| FINLAND 0.5 04/15/26 | 国債証券 | | 0.5000 | 430 | 452 | 57,907 | 2026/04/15 | |
| FINLAND 1.125 04/15/34 | 国債証券 | | 1.1250 | 290 | 330 | 42,293 | 2034/04/15 | |
| FINLAND 1.5 04/15/23 | 国債証券 | | 1.5000 | 340 | 355 | 45,518 | 2023/04/15 | |
| FINLAND 04/15/22 | 国債証券 | | 0.0000 | 120 | 120 | 15,463 | 2022/04/15 | |
| FINLAND 0.125 04/15/36 | 国債証券 | | 0.1250 | 210 | 209 | 26,765 | 2036/04/15 | |
| FINLAND 4.0 07/04/25 | 国債証券 | | 4.0000 | 430 | 517 | 66,188 | 2025/07/04 | |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 国債証券 | | 2.7500 | 380 | 468 | 59,870 | 2028/07/04 | |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 国債証券 | | 2.6250 | 350 | 521 | 66,657 | 2042/07/04 | |
| FINLAND 0.5 09/15/29 | 国債証券 | | 0.5000 | 570 | 606 | 77,525 | 2029/09/15 | |
| FINLAND 0.875 09/15/25 | 国債証券 | | 0.8750 | 300 | 319 | 40,918 | 2025/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/28 | 国債証券 | | 0.5000 | 240 | 254 | 32,613 | 2028/09/15 | |
| FINLAND 0.5 09/15/27 | 国債証券 | | 0.5000 | 300 | 318 | 40,704 | 2027/09/15 | |
| FINLAND 1.625 09/15/22 | 国債証券 | | 1.6250 | 400 | 414 | 53,013 | 2022/09/15 | |
| FINLAND 09/15/23 | 国債証券 | | 0.0000 | 230 | 233 | 29,925 | 2023/09/15 | |
| FINLAND 0.25 09/15/40 | 国債証券 | | 0.2500 | 170 | 169 | 21,636 | 2040/09/15 | |

| 銘柄 | 柄 | 当期 | | | | 期末 | |
|-----------------------|---|------|--------|--------|--------|-------------|------------|
| | | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FINLAND 0.0 09/15/30 | | 国債証券 | 0.0000 | 170 | 172 | 22,059 | 2030/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/24 | | 国債証券 | 0.0000 | 180 | 184 | 23,536 | 2024/09/15 |
| 小計 | | — | — | 5,900 | 6,530 | 835,308 | — |
| (ユーロ…オーストリア) | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62 | | 国債証券 | 3.8000 | 210 | 457 | 58,552 | 2062/01/26 |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47 | | 国債証券 | 1.5000 | 520 | 659 | 84,407 | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29 | | 国債証券 | 0.5000 | 340 | 361 | 46,200 | 2029/02/20 |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28 | | 国債証券 | 0.7500 | 820 | 884 | 113,179 | 2028/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/30 | | 国債証券 | 0.0000 | 840 | 853 | 109,145 | 2030/02/20 |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | | 国債証券 | 4.8500 | 590 | 753 | 96,360 | 2026/03/15 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | | 国債証券 | 4.1500 | 890 | 1,456 | 186,298 | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51 | | 国債証券 | 0.7500 | 180 | 193 | 24,758 | 2051/03/20 |
| AUSTRIA 3.65 04/20/22 | | 国債証券 | 3.6500 | 280 | 293 | 37,587 | 2022/04/20 |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27 | | 国債証券 | 0.5000 | 520 | 550 | 70,465 | 2027/04/20 |
| AUSTRIA 0.0 04/20/23 | | 国債証券 | 0.0000 | 200 | 202 | 25,932 | 2023/04/20 |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34 | | 国債証券 | 2.4000 | 480 | 629 | 80,544 | 2034/05/23 |
| AUSTRIA 0.85 06/30/20 | | 国債証券 | 0.8500 | 170 | 171 | 21,910 | 2120/06/30 |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | | 国債証券 | 3.1500 | 470 | 770 | 98,504 | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | | 国債証券 | 6.2500 | 670 | 959 | 122,698 | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/23 | | 国債証券 | 0.0000 | 650 | 659 | 84,363 | 2023/07/15 |
| AUSTRIA 07/15/24 | | 国債証券 | 0.0000 | 800 | 816 | 104,386 | 2024/07/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17 | | 国債証券 | 2.1000 | 380 | 684 | 87,492 | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 09/20/22 | | 国債証券 | 0.0000 | 470 | 474 | 60,729 | 2022/09/20 |
| AUSTRIA 1.65 10/21/24 | | 国債証券 | 1.6500 | 540 | 584 | 74,825 | 2024/10/21 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | | 国債証券 | 0.7500 | 680 | 727 | 93,079 | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25 | | 国債証券 | 1.2000 | 640 | 692 | 88,612 | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 1.75 10/20/23 | | 国債証券 | 1.7500 | 750 | 797 | 102,015 | 2023/10/20 |
| AUSTRIA 0.0 10/20/40 | | 国債証券 | 0.0000 | 200 | 188 | 24,080 | 2040/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86 | | 国債証券 | 1.5000 | 150 | 209 | 26,841 | 2086/11/02 |
| AUSTRIA 3.4 11/22/22 | | 国債証券 | 3.4000 | 740 | 792 | 101,373 | 2022/11/22 |
| 小計 | | — | — | 13,180 | 15,826 | 2,024,348 | — |
| 合計 | | — | — | — | — | 134,816,915 | — |

■投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

| 項目 | 当期 | | 期末 |
|--------------|-------------|----|--------|
| | 評価額 | 比率 | 率 |
| 公社債 | 134,816,915 | | 97.7% |
| コール・ローン等、その他 | 3,110,505 | | 2.3% |
| 投資信託財産総額 | 137,927,421 | | 100.0% |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、136,245,185千円、98.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.50円、1カナダ・ドル=83.72円、1オーストラリア・ドル=83.19円、1シンガポール・ドル=79.75円、1イギリス・ポンド=147.98円、1イスラエル・シケル=32.23円、1デンマーク・クローネ=17.20円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローナ=12.76円、1メキシコ・ペソ=5.15円、1マレーシア・リンギット=26.12円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、1ユーロ=127.91円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|------------------|
| (A) 資 産 | 139,026,864,416円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 1,966,445,647 |
| 公 社 債(評価額) | 134,816,915,952 |
| 未 収 入 金 | 1,420,260,588 |
| 未 収 利 息 | 784,425,849 |
| 前 払 費 用 | 38,816,380 |
| (B) 負 債 | 1,989,330,062 |
| 未 払 金 | 1,924,681,062 |
| 未 払 解 約 金 | 64,649,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 137,037,534,354 |
| 元 本 | 69,085,269,493 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 67,952,264,861 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 69,085,269,493口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 19,836円 |

| | | | |
|--------------------------------|-----------------|--|-----------------|
| (注1) 期首元本額 | 66,784,593,799円 | グループコントロール | 2,047,605,074円 |
| 追加設定元本額 | 22,324,176,727円 | D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 112,880,979円 |
| 一部解約元本額 | 20,023,501,033円 | 4資産分散投資・ハイクラス<DC年金> | 216,614,702円 |
| (注2) 期末における元本の内訳 | | D I AMコア資産設計ファンド (堅実型) | 7,184,218円 |
| D I AM外国債券パッシブ・ファンド | 7,285,630,090円 | D I AMコア資産設計ファンド (積極型) | 13,602,076円 |
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 6,005,013円 | 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 109,987,588円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 17,901,375円 | 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 157,862,427円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 16,109,682円 | 4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金> | 2,708,262円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 58,667,541円 | D I AMパッシブ資産分散ファンド | 1,153,273,300円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 49,579,939円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 288,411,930円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 22,987,271円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 353,533,881円 |
| たわらノーロード 先進国債券 | 9,989,838,812円 | マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 161,736,477円 |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> | 186,647,242円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 179,290,591円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 971,663,519円 | D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け) | 6,015,406,638円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 26,728,812円 | D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) | 3,819,894,345円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 121,338,758円 | 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 2,325,976,349円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 25,135,439円 | 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 5,699,054,337円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 4,073,309円 | D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定) | 61,358,370円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 220,889,452円 | インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 471,072,165円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 214,665,752円 | D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 503,573,522円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 46,211,416円 | D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 298,873,925円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 2,643,196円 | D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 27,070,483円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型) | 275,405円 | D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 51,781,571円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 1,559,857円 | D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 12,259,425円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 3,960,740円 | D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 1,487,646円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 1,185,878円 | D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定) | 41,773,382円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 1,140,370円 | D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 62,816,454円 |
| D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金> | 5,996,521,601円 | D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定) | 2,343,965,366円 |
| One D C 先進国債券インデックスファンド | 286,853,098円 | D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定) | 1,733,964,005円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型 | 632,089,833円 | D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定) | 3,001,729,443円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型 | 1,830,048,277円 | D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定) | 553,039,600円 |
| D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 1,993,683,959円 | D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定) | 192,002,729円 |
| D I AM DCバランス30インデックスファンド | 361,021,755円 | D I AMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定) | 2,181,197,557円 |
| D I AM DCバランス50インデックスファンド | 767,057,750円 | D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家向け) | 541,945,752円 |
| D I AM DCバランス70インデックスファンド | 628,680,822円 | D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定) | 3,548,316円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 16,652,719円 | D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定) | 456,033,204円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 516,637,062円 | D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定) | 467,152,429円 |
| マネックス資産設計ファンド エポリューション | 28,446,399円 | D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定) | 632,499,155円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10) | 125,346,778円 | D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定) | 66,775,811円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20) | 95,961,436円 | 期末元本合計 | 69,085,269,493円 |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30) | 160,485,652円 | | |

■損益の状況

当期 自2020年2月22日 至2021年2月22日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 2,666,161,128 | 円 |
| | 受取利息 | 2,666,403,831 | |
| | 支払利息 | △242,703 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △1,147,059,846 | |
| | 売却益 | 6,089,848,393 | |
| | 売却損 | △7,236,908,239 | |
| (C) | その他の費用 | △15,375,562 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 1,503,725,720 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 64,019,323,522 | |
| (F) | 解約差損益金 | △19,145,002,454 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 21,574,218,073 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 67,952,264,861 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 67,952,264,861 | |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)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3) (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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021年4月19日）

（計算期間 2020年4月21日～2021年4月19日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第13期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2008年2月20日から無期限です。 |
| 運用方針 | 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。 ※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。 |
| 主な組入制限 | 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には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | MSCIエマージング・マーケット・インデックス | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託 受益証券・ 投資証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|-------|---|-------|--------|--------|-------------------------------|-----------|
| | 期中騰落率 | 期中騰落率 | （円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | 期中騰落率 | | | | |
| 9期(2017年4月18日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | % | 百万円 |
| 10期(2018年4月18日) | 10,121 | 17.7 | 224,042.80 | 18.1 | 95.8 | 3.2 | 0.9 | 40,863 |
| 11期(2019年4月18日) | 12,241 | 20.9 | 273,007.15 | 21.9 | 92.1 | 7.1 | 0.7 | 66,443 |
| 12期(2020年4月20日) | 12,260 | 0.2 | 276,323.22 | 1.2 | 94.4 | 4.4 | 0.6 | 61,535 |
| 13期(2021年4月19日) | 9,723 | △20.7 | 225,442.54 | △18.4 | 64.7 | 34.8 | 0.4 | 41,166 |
| | 14,848 | 52.7 | 347,921.32 | 54.3 | 93.2 | 6.1 | 0.7 | 58,156 |

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

(注4) 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、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

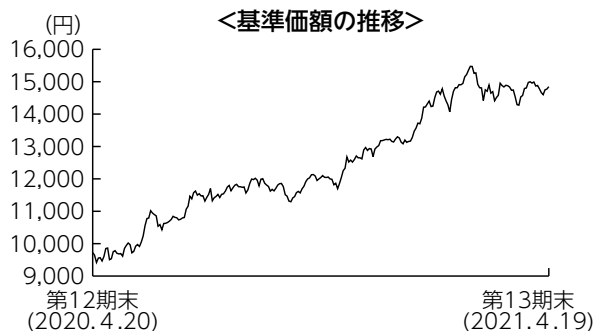
| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCIエマージング・ マーケット・インデックス (円換算ベース、 配当込み、 為替ハッジなし) (ベンチマーク) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入 比率 |
|------------------------|------------|--------|--|--------|-------------|-------------|--------------------------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | | | |
| (期 首) 2020年 4 月 20日 | 円 9,723 | % - | ポイント 225,442.54 | % - | % 64.7 | % 34.8 | % 0.4 |
| 4 月 末 | 9,849 | 1.3 | 227,970.80 | 1.1 | 81.4 | 18.0 | 0.6 |
| 5 月 末 | 9,914 | 2.0 | 231,228.40 | 2.6 | 80.9 | 18.6 | 0.5 |
| 6 月 末 | 10,751 | 10.6 | 249,884.32 | 10.8 | 81.8 | 17.6 | 0.6 |
| 7 月 末 | 11,425 | 17.5 | 265,622.22 | 17.8 | 86.3 | 13.2 | 0.6 |
| 8 月 末 | 11,961 | 23.0 | 277,724.79 | 23.2 | 78.8 | 21.3 | 0.5 |
| 9 月 末 | 11,453 | 17.8 | 266,257.94 | 18.1 | 88.4 | 11.3 | 0.5 |
| 10 月 末 | 11,865 | 22.0 | 276,133.80 | 22.5 | 86.6 | 10.9 | 0.5 |
| 11 月 末 | 12,924 | 32.9 | 301,472.79 | 33.7 | 88.8 | 11.2 | 0.6 |
| 12 月 末 | 13,281 | 36.6 | 309,849.39 | 37.4 | 88.8 | 11.1 | 0.6 |
| 2021年 1 月 末 | 14,286 | 46.9 | 333,543.05 | 48.0 | 87.4 | 11.5 | 0.5 |
| 2 月 末 | 14,808 | 52.3 | 348,027.62 | 54.4 | 90.2 | 9.4 | 0.6 |
| 3 月 末 | 14,790 | 52.1 | 346,561.35 | 53.7 | 90.6 | 8.8 | 0.7 |
| (期 末) 2021年 4 月 19日 | 14,848 | 52.7 | 347,921.32 | 54.3 | 93.2 | 6.1 | 0.7 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年4月21日から2021年4月19日まで）

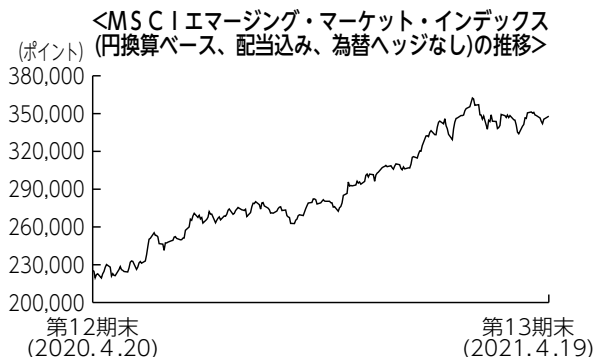


基準価額の推移

当期末の基準価額は14,848円となり、前期末比で52.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場ではブラジルレアルやトルコリラなど一部の通貨に対しては円高となったものの、経済活動正常化や米国などの金融緩和政策の長期化期待などから新興国株式市場が大きく上昇し、当ファンドの基準価額は大幅に上昇しました。



投資環境

新興国株式市場は大幅に上昇しました。前期後半には新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から急落しましたが、当期は中国の経済活動正常化に向けた動きや、米国の景気対策法案などへの期待などから上昇して始まりました。感染者数の急増や変異株の発生などから調整する局面もありましたが、ワクチン接種の進展や、米国などの金融緩和政策の長期化見通し、原油価格の上昇なども新興国市場の株価の押し上げに寄与しました。

為替市場では多くの通貨に対して円安となりました。米ドルは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因となり2020年は円高が進みましたが、米国の長期金利が上昇したことなどから期末にかけては反転し、前期末比では円安となり期末を迎えました。トルコやブラジルなど政権運営が不安視された通貨は売られた一方で、ワクチン接種の進展や経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退したことで、多くの通貨は買われる展開となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

| No. | 業種 | 組入比率 |
|-----|--------------------|------|
| 1 | 銀行 | 9.9% |
| 2 | 小売 | 7.2 |
| 3 | メディア・娯楽 | 5.7 |
| 4 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.5 |
| 5 | 半導体・半導体製造装置 | 4.6 |
| 6 | 素材 | 4.4 |
| 7 | エネルギー | 3.8 |
| 8 | 電気通信サービス | 2.8 |
| 9 | 保険 | 2.4 |
| 10 | 食品・飲料・タバコ | 2.4 |

期末

| No. | 業種 | 組入比率 |
|-----|------------------------|-------|
| 1 | 銀行 | 12.2% |
| 2 | 小売 | 10.7 |
| 3 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 8.9 |
| 4 | メディア・娯楽 | 8.8 |
| 5 | 半導体・半導体製造装置 | 8.8 |
| 6 | 素材 | 7.9 |
| 7 | エネルギー | 4.4 |
| 8 | 食品・飲料・タバコ | 3.1 |
| 9 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 3.1 |
| 10 | 自動車・自動車部品 | 3.1 |



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で54.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.6%下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---|---|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券) | 16円 (13) (0) (3) (0) (0) | 0.129% (0.103) (0.000) (0.024) (0.001) (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (b) 有価証券取引税 (株 式) (新株予約権証券) (投資信託受益証券) (投資証券) | 24 (24) (0) (0) (0) | 0.189 (0.189) (0.000) (0.000) (0.000) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) その他費用 (保管費用) (その他) | 53 (20) (33) | 0.422 (0.160) (0.263) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 92 | 0.740 | |
| 期中の平均基準価額は12,484円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2020年4月21日から2021年4月19日まで)

(1) 株 式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-----------------------------|--------------------------------|-------------------------------|---------------------|----------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | ア メ リ カ | 百株 30,118.24 (986.04) | 千アメリカ・ドル 109,114 (-) | 百株 25,525.12 | 千アメリカ・ドル 88,941 |
| | 香 港 | 百株 833,381.5 (7,599.46) | 千香港・ドル 1,158,175 (△453) | 百株 776,777.28 | 千香港・ドル 1,028,621 |
| | 台 湾 | 百株 305,005.81 (2,051.47) | 千台湾・ドル 2,200,153 (△703) | 百株 275,527.49 | 千台湾・ドル 2,045,510 |
| | イ ギ リ ス | 百株 206.46 (-) | 千イギリス・ポンド 354 (-) | 百株 147.57 | 千イギリス・ポンド 240 |
| | ト ル コ | 百株 17,335.31 (113.61) | 千トルコ・リラ 17,867 (-) | 百株 12,882.33 | 千トルコ・リラ 15,046 |
| | メ キ シ コ | 百株 55,241.7 (2,817) | 千メキシコ・ペソ 167,171 (-) | 百株 52,011.5 | 千メキシコ・ペソ 151,205 |
| | フ ィ リ ピ ン | 百株 52,701.05 (98) | 千フィリピン・ペソ 225,431 (-) | 百株 37,520.2 | 千フィリピン・ペソ 188,928 |
| チ リ | 百株 403,132.31 (13.27) | 千チリ・ペソ 2,509,611 (-) | 百株 405,277.9 | 千チリ・ペソ 2,359,687 | |

| | | 買 付 | | 売 付 | | |
|---|-----------------|-----------------------------|-----------------------------------|--------------------------------|----------------------------|-------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| 外 | コ ロ ン ビ ア | 百株 4,814.77 (-) | 千コロンビア・ペソ 4,502,054 (-) | 百株 6,468.93 | 千コロンビア・ペソ 4,217,249 | |
| | ク ウ ェ ー ト | 百株 17,130.65 (484.17) | 千クウェート・ディナール 1,161 (-) | 百株 6,290.66 | 千クウェート・ディナール 462 | |
| | カ タ ー ル | 百株 21,809.88 (-) | 千カタール・リアル 15,567 (-) | 百株 18,139.96 | 千カタール・リアル 12,770 | |
| | サ ウ ジ ア ラ ビ ア | 百株 17,724.81 (△21.21) | 千サウジアラビア・リアル 64,847 (-) | 百株 14,757.05 | 千サウジアラビア・リアル 51,001 | |
| | イ ン ド | 百株 75,353.25 (180.45) | 千インド・ルピー 4,094,916 (-) | 百株 55,579.7 | 千インド・ルピー 3,272,493 | |
| | イ ン ド ネ シ ア | 百株 300,530 (-) | 千インドネシア・ルピア 128,240,205 (-) | 百株 267,842.25 | 千インドネシア・ルピア 112,747,590 | |
| | ア ラ ブ 首 長 国 連 邦 | 百株 19,617.86 (-) | 千アラブ首長国連邦・ディルハム 11,982 (-) | 百株 13,893.46 | 千アラブ首長国連邦・ディルハム 9,433 | |
| | ブ ラ ジ ル | 百株 59,872 (3,647.5) | 千ブラジル・レアル 164,011 (-) | 百株 53,899.85 | 千ブラジル・レアル 137,598 | |
| | チ ェ コ | 百株 970.34 (-) | 千チェコ・コルナ 15,606 (-) | 百株 875.68 | 千チェコ・コルナ 13,752 | |
| | 韓 国 | 百株 13,954.52 (327.42) | 千韓国・ウォン 88,387,518 (-) | 百株 12,506.12 | 千韓国・ウォン 81,184,557 | |
| | 中 国 | 百株 141,564 (790.3) | 千オフショア・人民元 214,252 (-) | 百株 129,404.7 | 千オフショア・人民元 187,189 | |
| | マ レ ー シ ア | 百株 68,756 (14,327.48) | 千マレーシア・リンギット 42,923 (-) | 百株 66,813.77 | 千マレーシア・リンギット 34,985 | |
| | 南 ア フ リ カ | 百株 31,942.27 (686.25) | 千南アフリカ・ランド 365,541 (△1,269) | 百株 30,178.38 | 千南アフリカ・ランド 329,000 | |
| | タ イ | 百株 138,933 (311) | 千タイ・バーツ 406,376 (△70) | 百株 137,748 | 千タイ・バーツ 343,329 | |
| | ポ ー ラ ン ド | 百株 5,306.23 (-) | 千ポーランド・ズロチ 17,734 (-) | 百株 4,806.86 | 千ポーランド・ズロチ 14,622 | |
| | 国 | ハ ン ガ リ ー | 百株 718.7 (-) | 千ハンガリー・フォリント 407,657 (-) | 百株 559.96 | 千ハンガリー・フォリント 360,195 |
| | | ユ ー ロ | 百株 - | 千ユーロ - | 百株 - | 千ユーロ - |
| | | ベ ル ギ ー | 百株 - | 千ユーロ (△0.54) | 百株 27 | 千ユーロ 33 |
| | ギ リ シ ャ | 百株 2,184.29 (-) | 千ユーロ 652 (-) | 百株 3,567.96 | 千ユーロ 701 | |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および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。

(2) 新株予約権証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|---|---------|--------------|-------------|---------------|
| | | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外国 | イ | 証券 - | 千タイ・パーツ - | 証券 7,030 | 千タイ・パーツ 54 |
| | | (7,030) | (70) | (-) | (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------------|---------|---------|------------|---------|------------|
| | | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| メキシコ | | 千□ | 千メキシコ・ペソ | 千□ | 千メキシコ・ペソ |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | 196.6 | (-) | 27,388 | 170.9 | 24,472 |
| GRUPO TELEVISIA SAB | 267 | (-) | 7,841 | 228.9 | 6,365 |
| CEMEX SAB DE CV | 1,548.9 | (-) | 12,028 | 1,288.7 | 11,598 |
| MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV | 67.7 | (-) | 4,683 | 64.7 | 4,594 |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | 283.5 | (-) | 5,230 | 294.5 | 6,037 |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 36.3 | (-) | 3,382 | 18.1 | 1,677 |
| | | | (-) | (-) | (-) |
| ブラジル | | 千□ | 千ブラジル・レアル | 千□ | 千ブラジル・レアル |
| SUL AMERICA SA | 23.8 | (1.387) | 1,021 | 26.1 | 980 |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA | 43.6 | (-) | 1,347 | 35.5 | 1,123 |
| ENERGISA SA | 24.8 | (-) | 1,150 | 13.4 | 552 |
| KLABIN SA | 62.5 | (-) | 1,301 | 39 | 926 |
| BANCO INTER SA | 6.7 | (-) | 1,041 | - | - |
| BANCO BTG PACTUAL SA | 20.2 | (-) | 1,243 | 14.6 | 983 |
| | | | (-) | (-) | (-) |
| 南アフリカ | | 千□ | 千南アフリカ・ランド | 千□ | 千南アフリカ・ランド |
| REDEFINE PROPERTIES LTD | - | (-) | - | 152.868 | 314 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 419.976 | (-) | 5,392 | 355.861 | 4,551 |
| FORTRESS REIT LTD | - | (-) | - | 54.518 | 626 |
| | | | (-) | (-) | (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|---------------|----------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 | 株式先物取引 | 百万円 94,579 | 百万円 108,526 | 百万円 - | 百万円 - |

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------------|---------------|
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 126,856,147千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 47,327,953千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 2.68 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2020年4月21日から2021年4月19日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

(1) 外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 | | 末 | | 業 種 等 |
|---------------------------------------|----------|----------|-----------|-------------|--|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| TRIP.COM GROUP LTD ADR | 236.39 | 294.2 | 1,074 | 116,714 | | インターネット販売・通信販売 |
| CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR | 100.55 | 154.93 | 165 | 17,996 | | 金属・鉱業 |
| SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF | 242.1 | 242.1 | 134 | 14,652 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CREDICORP LTD | 34.47 | 43.46 | 612 | 66,604 | | 銀行 |
| SINA CORP | 37.64 | — | — | — | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | 297.41 | 316.8 | 266 | 28,915 | | 無線通信サービス |
| NETEASE INC-ADR | 35.13 | 254.46 | 2,717 | 295,297 | | 娯楽 |
| GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR | 33.43 | — | — | — | | 銀行 |
| SOUTHERN COPPER CORP | 42.94 | 45.18 | 344 | 37,408 | | 金属・鉱業 |
| TELECOM ARGENTINA SA SP ADR | 37.89 | 37.89 | 18 | 2,021 | | 各種電気通信サービス |
| YPF SA ADR | 15.94 | 42.48 | 16 | 1,827 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUKOIL SPON ADR | 208.53 | 261.36 | 2,090 | 227,138 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GAZPROM PAO ADR | 2,639.51 | 3,686.81 | 2,271 | 246,775 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR | 787.21 | 893.51 | 318 | 34,563 | | 銀行 |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL CO | 940 | — | — | — | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE | 547.36 | 963.88 | 89 | 9,677 | | 不動産管理・開発 |
| SURGUTNEFTEGAZ ADR | 432.84 | 550.84 | 254 | 27,664 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 51JOB INC ADR | 15.26 | 21.3 | 134 | 14,576 | | 専門サービス |
| X5 RETAIL GROUP NV GDR | 68.74 | 70.85 | 223 | 24,242 | | 食品・生活必需品小売り |
| NOVATEK PJSC GDR | 46.01 | 58.75 | 1,130 | 122,887 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BAIDU INC -SPON ADR | 135.55 | 165.07 | 3,525 | 383,052 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NOVOLIPETSK STEEL GDR | 81.7 | 73.5 | 255 | 27,777 | | 金属・鉱業 |
| BANCO MACRO SA ADR | 32.36 | — | — | — | | 銀行 |
| MMC NORILSK NICKEL ADR | 315.94 | 410.9 | 1,383 | 150,375 | | 金属・鉱業 |
| ROSNEFT OIL CO GDR | 615.61 | 678.41 | 491 | 53,444 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH | 70.71 | 947.65 | 1,422 | 154,560 | | 各種消費者サービス |
| SEVERSTAL GDR | 122.6 | 167.71 | 387 | 42,059 | | 金属・鉱業 |
| TATNEFT ADR | 130.78 | 157.61 | 724 | 78,710 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR | 147.36 | — | — | — | | 金属・鉱業 |
| VTB BANK OJSC GDR | 820 | 1,120 | 135 | 14,676 | | 銀行 |
| DP WORLD PLC | 60.42 | — | — | — | | 運送インフラ |
| MAGNIT PJSC GDR | 201.42 | 230.51 | 327 | 35,592 | | 食品・生活必需品小売り |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | 222.33 | 274.29 | 779 | 84,733 | | インターネット販売・通信販売 |
| 21VIANET GROUP INC ADR | — | 41.06 | 114 | 12,452 | | 情報技術サービス |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR | 190.58 | 234.7 | 1,393 | 151,382 | | 各種消費者サービス |
| MAIL.RU GROUP LTD GDR | — | 68.53 | 157 | 17,126 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| YANDEX NV | — | 190.65 | 1,180 | 128,294 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| NOAH HOLDINGS LTD ADR | 16.3 | 17.16 | 70 | 7,685 | | 資本市場 |
| SBERBANK ADR | 1,341.38 | 1,688.88 | 2,567 | 279,032 | | 銀行 |
| PHOSAGRO PJSC GDR | 92.54 | 83.08 | 153 | 16,628 | | 化学 |
| HUAZHU GROUP LTD ADR | 55.08 | 88.28 | 505 | 54,974 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| JOYY INC-ADR | 31.62 | 36.17 | 352 | 38,307 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| DAQO NEW ENERGY CORP ADR | — | 35.01 | 245 | 26,728 | | 半導体・半導体製造装置 |
| GDS HOLDINGS LTD ADR | 32.56 | 58.26 | 449 | 48,795 | | 情報技術サービス |
| ZAI LAB LTD ADR | 16.93 | 44.44 | 730 | 79,333 | | バイオテクノロジー |
| BEST INC ADR | 85.74 | — | — | — | | 航空貨物・物流サービス |
| TCS GROUP HOLDING PLC GDR | — | 79.99 | 486 | 52,828 | | 銀行 |
| HUYA INC ADR | 15.6 | 42.04 | 76 | 8,300 | | 娯楽 |
| BILIBILI INC ADR | — | 98.16 | 1,015 | 110,372 | | 娯楽 |
| NIO INC ADR | 234.28 | 785.09 | 2,833 | 307,876 | | 自動車 |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR | 46.89 | 235.57 | 424 | 46,177 | | 娯楽 |
| 58.COM INC ADR | 51.12 | — | — | — | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| AUTOHOME INC ADR | 30.96 | 37.89 | 355 | 38,655 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|------------------|-------------------|-------------------|-------------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR | — | 73.6 | 74 | 8,125 | 娯楽 |
| GSX TECHEDU INC ADR | — | 42.75 | 109 | 11,845 | 各種消費者サービス |
| LUCKIN COFFEE INC ADR | 30.29 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| WEIBO CORP ADR | 19.47 | 30.03 | 148 | 16,145 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR | — | 29.11 | 129 | 14,018 | 情報技術サービス |
| RLX TECHNOLOGY INC ADR | — | 80 | 72 | 7,910 | タバコ |
| KE HOLDINGS INC ADR | — | 68.69 | 353 | 38,461 | 不動産管理・開発 |
| JD.COM INC ADR | 362.26 | 528.21 | 4,069 | 442,173 | インターネット販売・通信販売 |
| LI AUTO INC ADR | — | 121.2 | 233 | 25,390 | 自動車 |
| XPENG INC ADR | — | 93.72 | 289 | 31,487 | 自動車 |
| LUFAX HOLDING LTD ADR | — | 112.72 | 155 | 16,902 | 消費者金融 |
| LOBANT SA | 19.17 | 21.45 | 485 | 52,752 | 情報技術サービス |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 850.33 | 1,154.1 | 27,547 | 2,993,280 | インターネット販売・通信販売 |
| MOMO INC SPON ADR | 63.37 | 77.93 | 115 | 12,566 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| BAOZUN INC-SPN ADR | 20.7 | 41.12 | 145 | 15,861 | インターネット販売・通信販売 |
| PINDUODUO INC ADR | 96.03 | 240.48 | 3,205 | 348,346 | インターネット販売・通信販売 |
| YUM CHINA HOLDINGS INC | 176.25 | 244.85 | 1,471 | 159,898 | ホテル・レストラン・レジャー |
| IQIYI INC ADR | 69.53 | 154.4 | 234 | 25,534 | 娯楽 |
| POLYUS PJSC GDR | 25.09 | 39.46 | 389 | 42,341 | 金属・鉱業 |
| HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR | 37.6 | 37.61 | 110 | 11,953 | 医薬品 |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR | 158.27 | 256.08 | 757 | 82,280 | 航空貨物・物流サービス |
| BEIGENE LTD ADR | — | 28.31 | 864 | 93,989 | バイオテクノロジー |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 13,926.07 60銘柄 | 19,505.23 66銘柄 | 75,374 — | 8,190,166 <14.1%> |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| JIANGXI COPPER CO LTD | 380 | 670 | 1,183 | 16,541 | 金属・鉱業 |
| JIANGSU EXPRESS | 360 | 900 | 844 | 11,801 | 運送インフラ |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 580 | 1,620 | 905 | 12,660 | 旅客航空輸送業 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | — | 64 | 686 | 9,596 | 飲料 |
| CHINA MOBILE LIMITED | 2,995 | — | — | — | 無線通信サービス |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 615 | 785 | 3,795 | 53,060 | 建設資材 |
| DATANG INTERNATIONAL POWER GEN | 1,000 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BEIJING ENTERPRISES | 190 | 215 | 567 | 7,935 | ガス |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL IN | 2,500 | 1,800 | 491 | 6,869 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY | 1,820 | 2,580 | 5,740 | 80,252 | ヘルスケア・テクノロジー |
| YANZHOU COAL MINING CO LTD | 700 | 700 | 753 | 10,529 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD | — | 460 | 1,228 | 17,170 | 不動産管理・開発 |
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP | 365 | 405 | 2,083 | 29,130 | パーソナル用品 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H | 380 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT | 800 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| CNOOC LTD | 8,790 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 1,700 | 1,420 | 1,036 | 14,491 | 自動車 |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 2,340 | 5,656 | 5,424 | 75,828 | 医薬品 |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME | 1,871.2 | 2,436.2 | 4,908 | 68,627 | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 1,568.88 | 1,988.88 | 7,478 | 104,545 | 不動産管理・開発 |
| CITIC LTD | 2,800 | 3,470 | 2,737 | 38,274 | コングロマリット |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL | 940 | 960 | 574 | 8,025 | 運送インフラ |
| LENOVO GROUP LTD | 3,800 | 4,540 | 4,912 | 68,673 | コンピュータ・周辺機器 |
| PETRO CHINA CO LTD | 10,700 | 11,200 | 3,169 | 44,311 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 2,567.42 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD | 993.9 | 1,121.9 | 1,682 | 23,526 | 保険 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR | 12,912 | 15,432 | 6,589 | 92,120 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 370 | 490 | 896 | 12,535 | 情報技術サービス |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD | 1,010 | 1,530 | 3,771 | 52,724 | ソフトウェア |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 396 | 501 | 6,663 | 93,152 | ガス |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 1,700 | 2,080 | 1,807 | 25,269 | ガス |
| TOWNGAS CHINA CO LTD | 100 | — | — | — | ガス |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|----------|-----------|-------------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD | 800 | 1,520 | 948 | 13,259 | 運送インフラ |
| YUJEXIU PROPERTY CO LTD | 4,200 | 3,160 | 578 | 8,084 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD | 880 | 1,140 | 1,461 | 20,431 | 運送インフラ |
| ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD | 1,460 | 1,460 | 553 | 7,735 | 金属・鉱業 |
| (THE) WHARF HOLDINGS LTD | 610 | 870 | 2,001 | 27,973 | 不動産管理・開発 |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING | 610 | 910 | 1,183 | 16,538 | 運送インフラ |
| CHINA EVERBRIGHT LTD | 620 | 440 | 429 | 6,003 | 資本市場 |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 922 | 1,654 | 5,483 | 76,652 | ガス |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 425 | 460 | 2,148 | 30,031 | 電子装置・機器・部品 |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD | 2,600 | 3,680 | 8,022 | 112,153 | 自動車 |
| SHENZHEN INVESTMENT LTD | 1,480 | 2,160 | 635 | 8,877 | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | 440 | 560 | 2,304 | 32,215 | ガス |
| BYD CO LTD | 270 | 480 | 8,457 | 118,237 | 自動車 |
| CHINA TELECOM CORP LTD | 7,000 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD | 580 | 1,180 | 933 | 13,048 | エネルギー設備・サービス |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 9,100 | 5,400 | 572 | 8,002 | 娯楽 |
| SINOTRANS LTD | 2,480 | — | — | — | 航空貨物・物流サービス |
| MAANSHAN IRON & STEEL | 160 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP | 1,925.92 | 2,525.92 | 1,288 | 18,009 | 商業サービス・用品 |
| LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD | 700 | 700 | 500 | 6,996 | 紙製品・林産品 |
| CHINA YOUZAN LTD | — | 8,800 | 2,226 | 31,125 | ソフトウェア |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 3,477.88 | 4,337.88 | 2,984 | 41,722 | 保険 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY | 1,580 | 1,350 | 710 | 9,927 | 航空宇宙・防衛 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS | 1,012 | 912 | 926 | 12,953 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD | 1,190 | 1,795 | 4,397 | 61,480 | 自動車 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 3,560 | 4,600 | 7,240 | 101,220 | 保険 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 3,070 | 3,390 | 3,606 | 50,425 | 金属・鉱業 |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H | 1,040 | 1,520 | 2,337 | 32,681 | ヘルスケア機器・用品 |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 1,567 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| WEICHAI POWER CO LTD | 814.4 | 1,354.4 | 2,660 | 37,187 | 機械 |
| CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO | 340 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL | 2,930 | — | — | — | 化学 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL | 170 | — | — | — | コンプロマリット |
| SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD | 540 | — | — | — | 運送インフラ |
| TINGYI HOLDING CORP | 860 | 1,060 | 1,539 | 21,516 | 食品 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 160 | 280 | 2,107 | 29,455 | 飲料 |
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD | 1,300 | 1,780 | 2,153 | 30,110 | 水道 |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD | 1,480 | 2,140 | 980 | 13,702 | 医薬品 |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS | 733.33 | 913.33 | 5,854 | 81,845 | 飲料 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD | 740 | 680 | 497 | 6,958 | 運送インフラ |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 3,455 | 6,512.5 | 5,249 | 73,382 | 医薬品 |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 1,390 | 1,740 | 7,821 | 109,341 | 食品 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 2,804 | 3,503 | 221,389 | 3,095,026 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 2,695 | 3,635 | 32,751 | 457,863 | 保険 |
| LI NING CO LTD | 1,015 | 1,325 | 7,950 | 111,141 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD | 3,280 | 2,600 | 806 | 11,267 | 水道 |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | 4,352.4 | 6,892.4 | 937 | 13,104 | 専門小売り |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 2,100 | 5,000 | 910 | 12,721 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AIR CHINA / HONG KONG | 540 | 760 | 506 | 7,076 | 旅客航空輸送業 |
| ZTE CORP | 430.88 | 442.88 | 862 | 12,060 | 通信機器 |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD | 1,260 | — | — | — | 電気設備 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 1,750 | 1,965 | 3,261 | 45,601 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD | 690 | 1,855 | 2,240 | 31,326 | 海運業 |
| BANK OF COMMUNICATIONS | 3,792.05 | 5,752.05 | 2,881 | 40,287 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD | 1,162.5 | 1,102.5 | 587 | 8,215 | 建設・土木 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 390 | 415 | 1,933 | 27,035 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK | 46,635.3 | 58,105.3 | 38,000 | 531,252 | 銀行 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|-----------|-----------|-----------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| SHENZHOI INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD | 384 | 514 | 9,077 | 126,899 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 1,740 | 1,400 | 1,022 | 14,287 | 自動車 |
| AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD | 640 | 980 | 1,205 | 16,851 | 不動産管理・開発 |
| MINTH GROUP LTD | — | 460 | 1,449 | 20,257 | 自動車部品 |
| SSY GROUP LTD | 980 | 1,320 | 653 | 9,134 | 医薬品 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD | 600 | 840 | 955 | 13,363 | 紙製品・林産品 |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL | 1,660 | 2,380 | 2,832 | 39,594 | 建設資材 |
| BANK OF CHINA LTD | 37,952 | 48,042 | 14,796 | 206,861 | 銀行 |
| SHUI ON LAND LTD | 3,880 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | 600 | 675 | 1,586 | 22,175 | 不動産管理・開発 |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD | — | 600 | 580 | 8,119 | 不動産管理・開発 |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD | 804 | 992 | 992 | 13,868 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 1,824.7 | 2,399.7 | 14,254 | 199,273 | 銀行 |
| IND & COMM BK OF CHINA - H | 31,332.35 | 36,942.35 | 20,096 | 280,951 | 銀行 |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD | 355 | 495 | 375 | 5,252 | 金属・鉱業 |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING | 565 | 535 | 985 | 13,776 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES | 1,196 | 1,676 | 593 | 8,294 | 建設・土木 |
| CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD | 1,990 | — | — | — | 建設・土木 |
| CHINA COAL ENERGY CO | 430 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 400 | 330 | 1,036 | 14,486 | 機械 |
| ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD | 170 | 313 | 982 | 13,739 | 電気設備 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD | 560 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD | 3,851.42 | 4,941.42 | 4,793 | 67,008 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | 1,320 | 2,400 | 1,250 | 17,480 | 金属・鉱業 |
| CHINA CITIC BANK-H | 3,848 | 5,968 | 2,506 | 35,041 | 銀行 |
| KWG GROUP HOLDINGS LTD | 445 | 650 | 855 | 11,958 | 不動産管理・開発 |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 362 | 448 | 8,288 | 115,866 | 電子装置・機器・部品 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 550 | 670 | 9,413 | 131,600 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | — | 200 | 525 | 7,339 | 家庭用品 |
| FOSUN INTERNATIONAL | 1,265.28 | 1,430.28 | 1,630 | 22,794 | コンプロマリット |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 2,860 | 3,000 | 909 | 12,707 | 不動産管理・開発 |
| CHINA AOYUAN GROUP LTD | 410 | 850 | 699 | 9,779 | 不動産管理・開発 |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 1,340 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 1,500 | 1,620 | 626 | 8,764 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SOHO CHINA LTD | 1,115 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| KINGSOFT CORP LTD | 450 | 520 | 2,800 | 39,146 | ソフトウェア |
| SINOTRUK HONG KONG LTD | 385 | 350 | 749 | 10,471 | 機械 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 2,050 | 3,180 | 1,259 | 17,604 | 建設・土木 |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | 540 | 1,010 | 972 | 13,597 | 食品 |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | 250 | 425 | 1,870 | 26,142 | 通信機器 |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP | 870 | — | — | — | 建設・土木 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 2,670 | 2,840 | 1,672 | 23,385 | 食品 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 1,336 | 1,604 | 4,707 | 65,814 | 保険 |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 980 | 1,100 | 1,544 | 21,590 | 不動産管理・開発 |
| CRRG CORP LTD - H | 1,934.5 | — | — | — | 機械 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | 770 | 980 | 1,636 | 22,879 | 医薬品 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 1,260 | 835 | 587 | 8,206 | 食品・生活必需品小売り |
| BBMG CORP | 460 | — | — | — | 建設資材 |
| CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD | 236 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| SINOPHARM GROUP CO | 616 | 760 | 1,683 | 23,533 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA RESOURCES CEMENT | 1,340 | 1,120 | 992 | 13,872 | 建設資材 |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD | 80 | — | — | — | 建設・土木 |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD | 1,265.27 | 1,785.27 | 1,280 | 17,894 | 自動車 |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 845 | 1,290 | 1,517 | 21,208 | 金属・鉱業 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK | 600 | 1,980 | 665 | 9,300 | 銀行 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP | 1,880 | 1,940 | 2,095 | 29,290 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 305 | 642 | 1,029 | 14,396 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|----------|----------|-----------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 1,230 | 1,640 | 5,092 | 71,188 | 不動産管理・開発 |
| YUZHOU PROPERTIES CO LTD | 860 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | 566 | 612 | 681 | 9,531 | 機械 |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 885 | 1,020 | 5,283 | 73,864 | 不動産管理・開発 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 353 | 603 | 1,781 | 24,910 | 保険 |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 3,021.56 | 3,996.56 | 1,734 | 24,248 | 銀行 |
| KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 1,260 | 1,250 | 472 | 6,605 | 不動産管理・開発 |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 68 | 310 | 424 | 5,937 | 電気設備 |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | 680 | 790 | 1,493 | 20,873 | 建設関連製品 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 1,240 | 2,500 | 857 | 11,987 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA | 13,380 | 15,470 | 4,811 | 67,260 | 銀行 |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD | 310 | 300 | 1,672 | 23,381 | 専門小売り |
| FAR EAST HORIZON LTD | 1,450 | 1,030 | 942 | 13,175 | 各種金融サービス |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP | — | 460 | 2,265 | 31,671 | ヘルスケア機器・用品 |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 915 | 1,305 | 2,516 | 35,174 | 資本市場 |
| SEAZEN GROUP LIMITED | 780 | 1,180 | 1,126 | 15,754 | 不動産管理・開発 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 1,220 | 936 | 650 | 9,094 | 資本市場 |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD | 4,610 | 4,610 | 1,170 | 16,369 | 保険 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 320 | 255 | 930 | 13,011 | 医薬品 |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 1,640 | 2,260 | 1,602 | 22,400 | 不動産管理・開発 |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD | 1,235 | — | — | — | 建設・土木 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | 1,955 | 1,065 | 508 | 7,101 | 資本市場 |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP | 9,860 | 9,860 | 0 | 0 | 半導体・半導体製造装置 |
| NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD | 200 | — | — | — | 自動車部品 |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 3,230 | 3,230 | 0 | 0 | 食品 |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD | 720 | 720 | 853 | 11,937 | 商業サービス・用品 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | 260 | — | — | — | 資本市場 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | 3,700 | 5,370 | 2,953 | 41,289 | 銀行 |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | 200 | 260 | 1,986 | 27,769 | 食品 |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP | 320 | 780 | 1,232 | 17,228 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD | — | 125 | 200 | 2,796 | 各種消費者サービス |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | 630 | 900 | 6,939 | 97,007 | 商業サービス・用品 |
| ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD | 630 | 920 | 489 | 6,842 | 不動産管理・開発 |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | 167 | 283 | 2,696 | 37,703 | ヘルスケア・テクノロジー |
| CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD | 190 | 520 | 867 | 12,125 | 各種消費者サービス |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | — | 375 | 561 | 7,853 | 金属・鉱業 |
| AK MEDICAL HOLDINGS LTD | — | 200 | 189 | 2,653 | ヘルスケア機器・用品 |
| A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD | 160 | 237.5 | 782 | 10,940 | 商業サービス・用品 |
| CHINA TOWER CORP LTD | 21,000 | 27,060 | 3,111 | 43,504 | 各種電気通信サービス |
| XIAOMI CORP | 5,190 | 8,778 | 22,866 | 319,676 | コンピュータ・周辺機器 |
| WUXI APPTec CO LTD | 96 | 165.6 | 2,601 | 36,370 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WEIMOB INC | — | 1,070 | 1,806 | 25,250 | ソフトウェア |
| MEITUAN | 502 | 2,200 | 63,844 | 892,539 | インターネット販売・通信販売 |
| TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD | — | 444 | 833 | 11,656 | インターネット販売・通信販売 |
| HAILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD | 100 | 440 | 2,217 | 31,002 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | 2,200 | 2,340 | 3,093 | 43,246 | 半導体・半導体製造装置 |
| INNOVENT BIOLOGICS INC | 400 | 620 | 4,650 | 65,007 | バイオテクノロジー |
| EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD | — | 420 | 757 | 10,592 | 商業サービス・用品 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD | 4,560 | 6,650 | 1,057 | 14,781 | 資本市場 |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | — | 420 | 1,465 | 20,491 | 専門小売り |
| LOGAN GROUP COMPANY LTD | 640 | 1,110 | 1,387 | 19,397 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD | 825 | 995 | 3,706 | 51,815 | 建設・土木 |
| POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD | — | 58 | 305 | 4,265 | 不動産管理・開発 |
| JINXIN FERTILITY GROUP LTD | — | 780 | 1,425 | 19,933 | ヘルスケア・アロパイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD | 280 | 270 | 434 | 6,069 | 各種消費者サービス |
| CANSINO BIOLOGICS INC | — | 40 | 1,071 | 14,975 | 医薬品 |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | 720 | 620 | 642 | 8,979 | 専門小売り |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|------------------|----------------|-------------------|------------------------|----------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | |
| HANSON PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 160 | 660 | 2,362 | 33,031 | 医薬品 |
| CHINA FEIHE LTD | — | 830 | 1,859 | 25,991 | 食品 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD | — | 77 | 1,114 | 15,576 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | — | 350 | 1,795 | 25,101 | タバコ |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | — | 440 | 1,328 | 18,576 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KUAISHOU TECHNOLOGY | — | 132 | 3,194 | 44,657 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HAIER SMART HOME CO LTD | — | 1,226 | 4,143 | 57,931 | 家庭用耐久財 |
| MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD | — | 250 | 887 | 12,407 | ソフトウェア |
| NONGFU SPRING CO LTD | — | 190 | 759 | 10,611 | 飲料 |
| CHINA BOHAI BANK CO LTD | — | 2,220 | 752 | 10,521 | 銀行 |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC | — | 180 | 1,926 | 26,925 | インターネット販売・通信販売 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD | — | 80 | 1,071 | 14,975 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 645.61 | 926.61 | 2,617 | 36,595 | 不動産管理・開発 |
| LUYE PHARMA GROUP LTD | 530 | — | — | — | 医薬品 |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD | 240 | 280 | 1,372 | 19,180 | 半導体・半導体製造装置 |
| CGN POWER CO LTD | 5,450 | 4,500 | 819 | 11,449 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BAIC MOTOR CORP LTD | 820 | — | — | — | 自動車 |
| GF SECURITIES CO LTD | 756 | 682 | 793 | 11,097 | 資本市場 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 216 | 252 | 1,126 | 15,747 | 自動車部品 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD | 726 | 484 | 548 | 7,673 | 資本市場 |
| 3SBIO INC | 780 | 905 | 631 | 8,831 | バイオテクノロジー |
| LEGEND HOLDINGS CORP | 135 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 1,040 | 940 | 476 | 6,662 | 医薬品 |
| CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD | 5,210 | 4,610 | 470 | 6,573 | 資本市場 |
| CHINA LITERATURE LTD | 60 | 162 | 1,282 | 17,925 | メディア |
| DALI FOODS GROUP CO LTD | 780 | 1,465 | 653 | 9,134 | 食品 |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD | 270 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD | — | 640 | 405 | 5,672 | 各種消費者サービス |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD | — | 650 | 468 | 6,551 | 不動産管理・開発 |
| CHINA REINSURANCE GROUP CORP | 4,850 | — | — | — | 保険 |
| BOC AVIATION LTD | 131 | 107 | 778 | 10,882 | 商社・流通業 |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD | 87 | 262 | 1,222 | 17,086 | 保険 |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD | — | 540 | 941 | 13,165 | 自動車 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD | 768 | 688 | 1,318 | 18,428 | 資本市場 |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 390 | 2,015 | 21,157 | 295,781 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| 小 計 | 株 数 455,669.75 | 株 数 519,873.43 | 外 貨 建 金 額 839,112 | 邦 貨 換 算 金 額 11,730,787 | |
| | 銘 柄 数 <比率> 207銘柄 | 銘 柄 数 202銘柄 | | <20.2%> | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP | 210 | 320 | 8,816 | 33,807 | 通信機器 |
| ACER INC | 1,405.32 | 2,065.32 | 7,053 | 27,047 | コンピュータ・周辺機器 |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 365.54 | 445.54 | 17,286 | 66,292 | コンピュータ・周辺機器 |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 256.16 | 266.16 | 13,281 | 50,931 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASIA CEMENT CORP | 939.28 | 1,319.28 | 6,457 | 24,764 | 建設資材 |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP | 170 | 190 | 4,683 | 17,960 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 3,627.79 | 4,572.67 | 4,558 | 17,482 | 銀行 |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP | 410 | 540 | 6,291 | 24,124 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | 250 | 380 | 6,783 | 26,011 | コンピュータ・周辺機器 |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | — | 770 | 6,937 | 26,604 | 電子装置・機器・部品 |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 399.75 | 479.75 | 4,226 | 16,208 | コンピュータ・周辺機器 |
| QUANTA COMPUTER INC | 1,358.58 | 1,818.58 | 17,803 | 68,274 | コンピュータ・周辺機器 |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 320.7 | 807.77 | 3,521 | 13,505 | 不動産管理・開発 |
| EVA AIRWAYS CORP | 841.25 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 337.6 | 437.6 | 9,080 | 34,820 | コンピュータ・周辺機器 |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 2,347.71 | 2,447.61 | 4,356 | 16,707 | 銀行 |
| CHINA AIRLINES | 681.56 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO | 1,241.69 | 841.69 | 4,351 | 16,687 | 自動車部品 |
| CHINA STEEL CORP | 5,780.58 | 7,590.58 | 26,680 | 102,315 | 金属・鉱業 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---------------------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN | 1,779.94 | 889.73 | 2,295 | 8,802 | 保険 |
| ADVANTECH CO LTD | 138.89 | 206.75 | 7,339 | 28,145 | コンピュータ・周辺機器 |
| COMPAL ELECTRONICS INC | 2,393.04 | 2,133.04 | 5,791 | 22,208 | コンピュータ・周辺機器 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 966.63 | 1,206.63 | 35,776 | 137,196 | 電子装置・機器・部品 |
| NANYA TECHNOLOGY CORP | 670 | 790 | 7,797 | 29,901 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 1,753.27 | 2,234.27 | 25,470 | 97,674 | 各種電気通信サービス |
| AU OPTRONICS CORP | 3,911.94 | 5,371.94 | 13,886 | 53,251 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 778 | 958 | 9,503 | 36,443 | 無線通信サービス |
| EVERGREEN MARINE CORP | 988.2 | 1,278.2 | 8,091 | 31,027 | 海運業 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 1,788.24 | 1,688.24 | 5,385 | 20,652 | コンピュータ・周辺機器 |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 203.07 | 217.68 | 4,538 | 17,404 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ECLAT TEXTILE CO LTD | 73.22 | 113.22 | 5,830 | 22,360 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 242.85 | 352.85 | 21,559 | 82,674 | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 2,166.33 | 2,426.33 | 26,446 | 101,418 | 化学 |
| FORMOSA TAFFETA CO LTD | 190 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO | 1,755.94 | 2,265.94 | 20,846 | 79,942 | 化学 |
| GIANT MANUFACTURING | 111.51 | 161.51 | 5,733 | 21,987 | レジャー用品 |
| MEDIATEK INC | 745.07 | 915.07 | 89,219 | 342,138 | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 3,249.36 | 4,169.36 | 25,016 | 95,931 | 保険 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 3,994.59 | 4,669.44 | 8,988 | 34,469 | 銀行 |
| HOTAI MOTOR CO LTD | 150 | 190 | 11,286 | 43,279 | 専門小売り |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD | 690 | 890 | 5,856 | 22,457 | 無線通信サービス |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 5,141.41 | 6,001.46 | 14,853 | 56,960 | 各種金融サービス |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 3,769.41 | 4,889.41 | 24,373 | 93,468 | 保険 |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING | 7,584.03 | 7,274.03 | 8,183 | 31,381 | 保険 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD | 5,255.45 | 7,084.48 | 19,092 | 73,216 | 銀行 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 6,082.25 | 7,622.25 | 94,134 | 360,988 | 電子装置・機器・部品 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | 5,214.95 | 6,164.95 | 19,758 | 75,770 | 銀行 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 52.2 | 62.2 | 19,530 | 74,896 | 電子装置・機器・部品 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 4,285.93 | 5,280.58 | 7,234 | 27,742 | 銀行 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO | 4,830.61 | 7,910.61 | 7,515 | 28,818 | 保険 |
| INVENTEC CO LTD | 1,460.05 | 1,200.05 | 3,252 | 12,471 | コンピュータ・周辺機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 938.45 | 1,288.45 | 8,117 | 31,127 | コンピュータ・周辺機器 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD | 4,714.43 | 5,534.43 | 7,194 | 27,590 | 銀行 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 9,120.48 | 10,870.48 | 24,186 | 92,751 | 銀行 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD | 5,028.52 | 5,729.77 | 13,006 | 49,877 | 銀行 |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 355.6 | 375.6 | 4,169 | 15,987 | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP | 2,528.28 | 3,258.28 | 29,291 | 112,328 | 化学 |
| WISTRON CORP | 1,359.16 | 1,579.16 | 5,203 | 19,953 | コンピュータ・周辺機器 |
| POU CHEN CORP | 1,459.9 | 1,789.9 | 6,336 | 24,298 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP | 2,402.97 | 3,052.97 | 22,347 | 85,699 | 食品 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 293.92 | 373.92 | 10,245 | 39,289 | 食品・生活必需品小売り |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 484.8 | 644.8 | 6,576 | 25,221 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PHISON ELECTRONICS CORP | 56.58 | 106.58 | 5,270 | 20,210 | 半導体・半導体製造装置 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 283.93 | 465.89 | 2,394 | 9,183 | 不動産管理・開発 |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD | 118.29 | - | - | - | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 455.88 | 435.88 | 3,125 | 11,984 | 電子装置・機器・部品 |
| STANDARD FOODS CORP | 256.39 | - | - | - | 食品 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP | 478.99 | 628.99 | 3,497 | 13,411 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN CEMENT CORP | 2,496.84 | 3,131.71 | 15,345 | 58,846 | 建設資材 |
| TATUNG CO LTD | 610 | - | - | - | 家庭用耐久財 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR | 12,020.83 | 14,990.83 | 914,440 | 3,506,696 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 5,665.25 | 7,285.25 | 39,340 | 150,862 | 半導体・半導体製造装置 |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 2,170 | 1,800 | 6,444 | 24,711 | 半導体・半導体製造装置 |
| YAGEO CORP | 131.6 | 201.6 | 11,108 | 42,597 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | 1,090 | 1,510 | 4,665 | 17,892 | 運送インフラ |
| INNOLUX CORPORATION | 5,143.45 | 5,123.45 | 12,475 | 47,841 | 電子装置・機器・部品 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|------------------|------------------|-----------|-------------|----------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 722.03 | 1,242.03 | 5,936 | 22,766 | 電子装置・機器・部品 |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP | — | 140 | 4,655 | 17,850 | 電子装置・機器・部品 |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 86.45 | 174.75 | 7,365 | 28,246 | 機械 |
| PEGATRON CORP | 1,025.54 | 1,035.54 | 7,611 | 29,187 | コンピュータ・周辺機器 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 40 | 70 | 7,560 | 28,991 | 機械 |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP | 140 | 220 | 8,426 | 32,312 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHAILLEASE HOLDING CO LTD | 650.29 | 674.7 | 14,168 | 54,334 | 各種金融サービス |
| ONENESS BIOTECH CO LTD | — | 160 | 3,864 | 14,817 | 医薬品 |
| ASMEDIA TECHNOLOGY INC | — | 20 | 2,580 | 9,893 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | 223.85 | 293.85 | 3,276 | 12,564 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING | 4,516.74 | 5,189.54 | 11,001 | 42,189 | 銀行 |
| SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD | 1,769.93 | 1,999.93 | 8,489 | 32,556 | 銀行 |
| WIWYNN CORP | 30 | 40 | 3,512 | 13,467 | コンピュータ・周辺機器 |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 1,779.03 | 2,049.03 | 23,154 | 88,791 | 半導体・半導体製造装置 |
| SILERGY CORP | — | 50 | 13,200 | 50,619 | 半導体・半導体製造装置 |
| GLOBALWAFERS CO LTD | 90 | 120 | 9,564 | 36,676 | 半導体・半導体製造装置 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | 60 | 120 | 5,088 | 19,511 | 家庭用耐久財 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,010,996 | 7,711,771 | |
| | | | — | <13.3%> | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 97.78 | 156.67 | 243 | 36,629 | 金属・鉱業 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 243 | 36,629 | |
| | | | — | <0.1%> | |
| (トルコ) | 百株 | 百株 | 千トルコ・リラ | 千円 | |
| AKBANK TAS | 1,660.79 | 2,388.37 | 1,187 | 15,955 | 銀行 |
| ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS | 35.73 | — | — | — | 飲料 |
| ARCELIK | 8.01 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| AELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 91.92 | 448.98 | 682 | 9,179 | 航空宇宙・防衛 |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | 887.23 | 961.86 | 1,764 | 23,711 | 金属・鉱業 |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 46.68 | 46.68 | 864 | 11,620 | 自動車 |
| KOC HOLDING AS | 302.17 | 537.7 | 977 | 13,139 | コングロマリット |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | — | 900 | 661 | 8,891 | コングロマリット |
| TURK HAVA YOLLARI | 430.05 | 442.06 | 514 | 6,922 | 旅客航空輸送業 |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 549.66 | 626.54 | 944 | 12,699 | 無線通信サービス |
| TURKIYE GARANTI BANKASI AS | 1,316.2 | 1,141.53 | 831 | 11,170 | 銀行 |
| TURKIYE IS BANKASI | 694.78 | 662.05 | 325 | 4,369 | 銀行 |
| TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE | 72.64 | 62.01 | 553 | 7,438 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS | — | 2,392.3 | 516 | 6,945 | 銀行 |
| HACI OMER SABANCI HOLDING AS | 213.6 | 210.58 | 172 | 2,320 | 各種金融サービス |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 191.76 | 277.55 | 1,906 | 25,629 | 食品・生活必需品小売り |
| TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | 30.4 | — | — | — | 運送インフラ |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 11,903 | 159,992 | |
| | | | — | <0.3%> | |
| (メキシコ) | 百株 | 百株 | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| ALFA SAB DE CV | 861 | — | — | — | コングロマリット |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV | 106 | — | — | — | 複合小売り |
| GRUPO BIMBO SAB DE CV | 720 | 850 | 3,542 | 19,331 | 食品 |
| GRUMA SAB DE CV | 103.85 | 106.15 | 2,668 | 14,560 | 食品 |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA | 77.6 | 164.6 | 2,584 | 14,103 | 運送インフラ |
| GRUPO CARSO SAB DE CV | 92 | 349 | 2,134 | 11,644 | コングロマリット |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | 1,332 | 1,621 | 19,722 | 107,616 | 銀行 |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 327.25 | 530.25 | 2,776 | 15,152 | 化学 |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 75.55 | 76.35 | 2,167 | 11,828 | 金属・鉱業 |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV | 910 | 863 | 3,105 | 16,947 | 家庭用品 |
| ALSEA SAB DE CV | 294 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV | 100.75 | 120.4 | 4,343 | 23,698 | 運送インフラ |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV | 1,747.52 | 1,939.52 | 20,107 | 109,713 | 金属・鉱業 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------------|-------------------|--------------------|----------------|--------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (メキシコ) | 百株 | 百株 | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV | 16,379.78 | 21,166.78 | 30,649 | 167,238 | 無線通信サービス |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA SA | 1,521 | 966 | 1,863 | 10,167 | 銀行 |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 258 | 231 | 2,406 | 13,131 | 飲料 |
| WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | 2,535 | 3,200 | 20,364 | 111,120 | 食品・生活必需品小売り |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 198.4 | 240.85 | 5,155 | 28,133 | 運送インフラ |
| INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV | 187 | 292 | 2,491 | 13,594 | ガス |
| TELESITES SAB DE CV | - | 773 | 1,524 | 8,317 | 各種電気通信サービス |
| BECLE SAB DE CV | - | 384 | 1,865 | 10,176 | 飲料 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 27,826.7 19銘柄 | 33,873.9 18銘柄 | 129,474 - | 706,478 <1.2%> |
| (フィリピン) | 百株 | 百株 | 千フィリピン・ペソ | 千円 | |
| AYALA LAND INC | 3,801 | 4,255 | 14,147 | 31,771 | 不動産管理・開発 |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 1,096.3 | 943.3 | 3,301 | 7,414 | Conglomerate |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND | 248.2 | 1,075.2 | 8,924 | 20,040 | 銀行 |
| AYALA CORP | 154.33 | 185.83 | 14,085 | 31,632 | Conglomerate |
| GLOBE TELECOM INC | 15.55 | 14.2 | 2,627 | 5,899 | 無線通信サービス |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC | 620.8 | 461.2 | 5,898 | 13,246 | 運送インフラ |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | 1,519.9 | 1,934.8 | 11,299 | 25,374 | Conglomerate |
| JOLLIBEE FOODS CORP | 289.3 | 325.9 | 5,849 | 13,137 | ホテル・レストラン・レジャー |
| METROPOLITAN BANK & TRUST | 1,186.75 | 615.75 | 2,752 | 6,181 | 銀行 |
| BDO UNIBANK INC | 912.73 | 1,222.33 | 12,810 | 28,767 | 銀行 |
| MEGAWORLD CORP | 1,980 | 8,790 | 2,971 | 6,672 | 不動産管理・開発 |
| PLDT INC | 47.05 | 52.6 | 6,601 | 14,824 | 無線通信サービス |
| ROBINSONS LAND CORP | 940 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| SECURITY BANK CORP | 113.1 | - | - | - | 銀行 |
| SM PRIME HOLDINGS INC | 4,911.75 | 6,363.75 | 22,814 | 51,233 | 不動産管理・開発 |
| UNIVERSAL ROBINA CORP | 414.9 | 548.4 | 7,046 | 15,825 | 食品 |
| SM INVESTMENTS CORP | 106.38 | 164.63 | 16,100 | 36,157 | Conglomerate |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP | 3,529 | 9,019 | 3,652 | 8,202 | 各種金融サービス |
| ABOITIZ POWER CORP | 510 | 957 | 2,253 | 5,061 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| MANILA ELECTRIC COMPANY | 148 | 177.1 | 4,848 | 10,889 | 電力 |
| PUREGOLD PRICE CLUB INC | - | 676 | 2,467 | 5,541 | 食品・生活必需品小売り |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC | 24.11 | 66.01 | 3,541 | 7,953 | Conglomerate |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 22,569.15 21銘柄 | 37,848 20銘柄 | 153,995 - | 345,826 <0.6%> |
| (チリ) | 百株 | 百株 | 千チリ・ペソ | 千円 | |
| BANCO SANTANDER CHILE | 27,996.58 | 36,313.83 | 164,138 | 25,331 | 銀行 |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES | 33.79 | 27.73 | 107,866 | 16,646 | 銀行 |
| BANCO DE CHILE | 25,958.42 | 27,690.44 | 239,522 | 36,964 | 銀行 |
| EMPRESAS CMPC SA | 390.74 | 601.53 | 141,022 | 21,763 | 紙製品・林産品 |
| EMPRESAS COPEC SA | 180.31 | 224.18 | 202,501 | 31,251 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS SA | 53.63 | 105.81 | 72,479 | 11,185 | 飲料 |
| ENTEL CHILE SA | 66.1 | - | - | - | 無線通信サービス |
| ENEL AMERICAS SA | 19,544.64 | 19,059.81 | 215,375 | 33,238 | 電力 |
| COLBUN SA | 2,568.74 | 5,804.23 | 79,221 | 12,226 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AGUAS ANDINAS SA | 868.53 | - | - | - | 水道 |
| EMBOTELLADORA ANDINA SA | 200.26 | 200.26 | 38,249 | 5,902 | 飲料 |
| LATAM AIRLINES GROUP SA | 38.99 | - | - | - | 旅客航空輸送業 |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA | 40.1 | 74.92 | 290,315 | 44,803 | 化学 |
| FALABELLA SA | 514.1 | 561.57 | 193,741 | 29,899 | 複合小売り |
| ITAU CORPBANCA | 12,369.77 | - | - | - | 銀行 |
| CENCOSUD SA | 732.05 | 811.21 | 136,372 | 21,045 | 食品・生活必需品小売り |
| CENCOSUD SHOPPING SA | - | 292.31 | 45,541 | 7,028 | 不動産管理・開発 |
| ENEL CHILE SA | 17,039.55 | 14,696.15 | 82,445 | 12,723 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 108,596.3 17銘柄 | 106,463.98 14銘柄 | 2,008,795 - | 310,011 <0.5%> |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---------------------------------------|------------------|------------------|--------------|-------------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (コロンビア) | 百株 | 百株 | 千コロンビア・ペソ | 千円 | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP | 216.75 | 231.25 | 523,550 | 15,789 | 電力 |
| ECOPETROL SA | 2,603.36 | 2,812.3 | 647,110 | 19,515 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF | 1,960.73 | — | — | — | 銀行 |
| GRUPO ARGOS SA | 148.97 | — | — | — | 建設資材 |
| BANCOLOMBIA SA | 67.47 | 129.5 | 392,903 | 11,849 | 銀行 |
| BANCOLOMBIA SA-PREF | 275.34 | 309.57 | 943,878 | 28,465 | 銀行 |
| GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA | 92.36 | 228.2 | 467,810 | 14,108 | 各種金融サービス |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,975,252 | 89,727 | |
| | 7銘柄 | 5銘柄 | — | <0.2%> | |
| (クウェート) | 百株 | 百株 | 千クウェート・ディナール | 千円 | |
| KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP | — | 2,546.84 | 183 | 66,219 | 銀行 |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC | — | 1,262.48 | 76 | 27,491 | 無線通信サービス |
| GULF BANK KSCP | — | 1,426.6 | 30 | 10,973 | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP | — | 4,183.85 | 345 | 124,798 | 銀行 |
| AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC | — | 532.37 | 40 | 14,572 | 航空貨物・物流サービス |
| MABANEV CO KPSC | — | 532.93 | 37 | 13,587 | 不動産管理・開発 |
| BOUBYAN BANK KSCP | — | 839.09 | 52 | 19,089 | 銀行 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 11,324.16 | 276,731 | |
| | —銘柄 | 7銘柄 | — | <0.5%> | |
| (カタール) | 百株 | 百株 | 千カタール・リアル | 千円 | |
| QATAR INSURANCE CO SAQ | 822.82 | — | — | — | 保険 |
| QATAR NATIONAL BANK | 2,186.04 | 2,728.04 | 4,858 | 143,572 | 銀行 |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC | 758.09 | 902.99 | 472 | 13,976 | 銀行 |
| OOREDOO QSC | 534.59 | 400.49 | 281 | 8,317 | 各種電気通信サービス |
| QATAR FUEL QSC | 292.53 | 284.78 | 509 | 15,063 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 326.18 | 246.05 | 419 | 12,382 | 総合公益事業 |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC | 286.75 | 510.28 | 464 | 13,721 | 銀行 |
| INDUSTRIES QATAR QSC | 940.11 | 1,233.12 | 1,542 | 45,584 | コンプロマリット |
| QATAR ISLAMIC BANK SAQ | 589.69 | 758.19 | 1,357 | 40,104 | 銀行 |
| QATAR GAS TRANSPORT CO LTD | — | 1,389.61 | 445 | 13,160 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MASRAF AL RAYAN | 1,604.22 | 2,423.81 | 1,079 | 31,908 | 銀行 |
| BARWA REAL ESTATE CO | 1,000.55 | 1,384.49 | 449 | 13,292 | 不動産管理・開発 |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO | 1,769.57 | 2,519.21 | 466 | 13,771 | 化学 |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数・金額 銘柄数<比率> | 11,111.14 | 364,855 | |
| | 12銘柄 | 12銘柄 | 12,347 | <0.6%> | |
| (サウジアラビア) | 百株 | 百株 | 千サウジアラビア・リアル | 千円 | |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO | 124.66 | 154.78 | 1,105 | 32,059 | 化学 |
| JARIR MARKETING CO | 21.89 | 40.04 | 764 | 22,185 | 専門小売り |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | 20.3 | 41.55 | 329 | 9,546 | 保険 |
| ETIHAD ETISALAT CO | 207.81 | 185 | 566 | 16,422 | 無線通信サービス |
| SAUDI BRITISH BANK | 365.42 | 445.2 | 1,271 | 36,873 | 銀行 |
| AL RAJHI BANK | 578.93 | 746.13 | 7,050 | 204,547 | 銀行 |
| ARAB NATIONAL BANK | 303.9 | 344.64 | 743 | 21,575 | 銀行 |
| BANK ALBILAD | 210.92 | 264.91 | 943 | 27,358 | 銀行 |
| BANK AL-JAZIRA | 294.76 | 354.4 | 589 | 17,087 | 銀行 |
| BANQUE SAUDI FRANSI | 273.61 | 371.02 | 1,320 | 38,317 | 銀行 |
| RIYAD BANK | 594.73 | 739.24 | 1,840 | 53,398 | 銀行 |
| SAMBA FINANCIAL GROUP | 487.48 | — | — | — | 銀行 |
| SAUDI TELECOM CO | 190.84 | 362.86 | 4,455 | 129,266 | 各種電気通信サービス |
| SABIC AGRI-NUTRIENTS CO | 86.58 | 120.5 | 1,286 | 37,334 | 化学 |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 353.28 | 551.48 | 6,452 | 187,181 | 化学 |
| SAUDI CEMENT CO | 27.73 | 64.77 | 414 | 12,025 | 建設資材 |
| SAUDI ELECTRICITY CO | 407.14 | 459.63 | 1,151 | 33,401 | 電力 |
| SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP | 76.5 | 186.28 | 642 | 18,643 | 化学 |
| SAVOLA GROUP | 140.14 | 145.38 | 610 | 17,713 | 食品 |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO | 284.89 | 225.28 | 385 | 11,188 | 化学 |
| ALMARAI CO JSC | 130.48 | 165.75 | 860 | 24,955 | 食品 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--|------------------|----------|--------------|---------|-----------|--|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (サウジアラビア) | 百株 | 百株 | 千サウジアラビア・リアル | 千円 | | | |
| EMAAR ECONOMIC CITY | 153.95 | 283.11 | 298 | 8,656 | | | 不動産管理・開発 |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO | 249.29 | 162.78 | 388 | 11,257 | | | 化学 |
| ADVANCED PETROCHEMICAL CO | 37.51 | 83.95 | 675 | 19,604 | | | 化学 |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 484.81 | 392.76 | 677 | 19,665 | | | 化学 |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO | 208.3 | 310.11 | 305 | 8,861 | | | 不動産管理・開発 |
| RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO | 60.66 | 107.17 | 197 | 5,720 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA | — | 218.18 | 333 | 9,683 | | | 無線通信サービス |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO | 7.18 | 29.68 | 338 | 9,815 | | | 保険 |
| ALINMA BANK | 500.3 | 615.01 | 1,100 | 31,936 | | | 銀行 |
| ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO | — | 35.16 | 462 | 13,402 | | | 食品・生活必需品小売り |
| SAUDI ARABIAN MINING CO | 225.49 | 270.62 | 1,550 | 44,984 | | | 金属・鉱業 |
| SAUDI AIRLINES CATERING CO | 31.19 | 30.88 | 235 | 6,835 | | | ホテル・レストラン・レジャー |
| SAUDI ARABIAN OIL CO | 545.76 | 1,312.38 | 4,665 | 135,346 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO | — | 27.12 | 353 | 10,259 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| THE SAUDI NATIONAL BANK | 573.06 | 1,358.29 | 7,416 | 215,145 | | | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 33銘柄 | 35銘柄 | 51,784 | 1,502,259 | | <2.6%> |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | | | |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD | 1,400.2 | 1,742.43 | 336,654 | 494,882 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 282.46 | 373.5 | 15,455 | 22,719 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ASIAN PAINTS LTD | 144.6 | 242.86 | 64,690 | 95,095 | | | 化学 |
| EICHER MOTORS LTD | 5.58 | 87.39 | 21,278 | 31,278 | | | 自動車 |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 134.74 | 166.36 | 22,511 | 33,092 | | | 建設資材 |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 405.49 | 517.85 | 42,549 | 62,547 | | | 自動車 |
| SHREE CEMENT LTD | 5.11 | 5.81 | 17,907 | 26,323 | | | 建設資材 |
| ICICI BANK LTD | 2,368.52 | 3,142.49 | 178,163 | 261,900 | | | 銀行 |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD | 202.28 | 372.98 | 8,822 | 12,969 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| STATE BANK OF INDIA LTD | 945.52 | 1,136.74 | 38,637 | 56,797 | | | 銀行 |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 66.92 | 206.08 | 11,705 | 17,206 | | | 陸運・鉄道 |
| LIC HOUSING FINANCE LTD | 144.36 | — | — | — | | | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| TATA STEEL LTD | 138.26 | 473.87 | 42,186 | 62,013 | | | 金属・鉱業 |
| TATA MOTORS LTD | 581.68 | 929.53 | 28,815 | 42,358 | | | 自動車 |
| JSW STEEL LTD | 381.77 | 519.94 | 32,205 | 47,341 | | | 金属・鉱業 |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | — | 370.48 | 24,870 | 36,559 | | | 食品 |
| TATA POWER CO LTD | 371.95 | — | — | — | | | 電力 |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD | 33.56 | 70.36 | 26,008 | 38,232 | | | 食品 |
| NESTLE INDIA LTD | 11.92 | 18.49 | 31,899 | 46,891 | | | 食品 |
| GAIL INDIA LTD | 979.27 | 834.49 | 11,649 | 17,124 | | | ガス |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD | — | 345.09 | 60,877 | 89,489 | | | 銀行 |
| VEDANTA LTD | 874.77 | 1,176.59 | 27,273 | 40,091 | | | 金属・鉱業 |
| AXIS BANK LTD | 1,059.19 | 1,410.99 | 94,423 | 138,802 | | | 銀行 |
| TITAN COMPANY LTD | 163.05 | 228.71 | 35,428 | 52,079 | | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 1,078.1 | 1,391.96 | 14,935 | 21,955 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD | 20.97 | 65.31 | 10,259 | 15,081 | | | パーソナル用品 |
| LUPIN LTD | 123.45 | 127.8 | 13,493 | 19,835 | | | 医薬品 |
| ACC LTD | — | 35.92 | 6,759 | 9,936 | | | 建設資材 |
| BAJAJ FINANCE LTD | 94.3 | 167.57 | 77,360 | 113,719 | | | 消費者金融 |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP | 808.64 | 1,046.63 | 269,407 | 396,029 | | | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD | 311.62 | 465.43 | 9,027 | 13,269 | | | メディア |
| INFOSYS LTD | 1,672.84 | 2,079 | 281,444 | 413,723 | | | 情報技術サービス |
| WIPRO LTD | 491.1 | 631.91 | 29,649 | 43,584 | | | 情報技術サービス |
| MRF LTD | — | 0.96 | 7,811 | 11,482 | | | 自動車部品 |
| INDIAN OIL CORP LTD | 728.1 | 1,430.83 | 12,898 | 18,961 | | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 400.78 | 504.39 | 124,024 | 182,315 | | | 家庭用品 |
| TRENT LTD | — | 93.85 | 6,979 | 10,259 | | | 複合小売り |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD | — | 47.7 | 14,600 | 21,463 | | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 551.59 | 677.21 | 68,584 | 100,819 | | | 情報技術サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|---|----------|----------|----------|---------|--|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | | |
| DABUR INDIA LTD | 229.89 | 343.49 | 19,750 | 29,033 | | パーソナル用品 |
| HERO MOTOCORP LTD | 41.43 | 77.01 | 22,293 | 32,771 | | 自動車 |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD | — | 70.63 | 11,917 | 17,519 | | 自動車部品 |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD | 58.8 | 75.27 | 36,831 | 54,142 | | 医薬品 |
| IPCA LABORATORIES LTD | — | 57.43 | 12,301 | 18,082 | | 医薬品 |
| BHARTI AIRTEL LTD | 1,217.56 | 1,524.71 | 82,448 | 121,199 | | 無線通信サービス |
| UNITED SPIRITS LTD | 175.15 | 150.17 | 7,794 | 11,458 | | 飲料 |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 362.94 | 542.74 | 35,063 | 51,543 | | 医薬品 |
| DIVI'S LABORATORIES LTD | 43.4 | 72.41 | 27,674 | 40,680 | | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 54.52 | 86.24 | 57,333 | 84,279 | | 自動車 |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 114.18 | 178.68 | 17,028 | 25,031 | | 医薬品 |
| HAVELLS INDIA LTD | 156.33 | 116.19 | 11,740 | 17,258 | | 電気設備 |
| INDRAPRASTHA GAS LTD | — | 246.03 | 12,674 | 18,631 | | ガス |
| BIOCON LTD | — | 219.17 | 9,048 | 13,301 | | バイオテクノロジー |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 426.76 | 676.1 | 14,329 | 21,065 | | 自動車部品 |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD | 37.77 | 93.53 | 12,888 | 18,945 | | 消費者金融 |
| PETRONET LNG LTD | 418.74 | 569.37 | 12,557 | 18,459 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CIPLA LTD/INDIA | 187.92 | 277.24 | 26,006 | 38,229 | | 医薬品 |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 262.27 | 446.07 | 60,627 | 89,122 | | 建設・土木 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 53.62 | 73.11 | 49,094 | 72,169 | | 建設資材 |
| ASHOK LEYLAND LTD | 500.57 | — | — | — | | 機械 |
| BOSCH LTD | 2.22 | — | — | — | | 自動車部品 |
| TATA CONSULTANCY SERVICES LTD | 439.12 | 572.48 | 182,915 | 268,886 | | 情報技術サービス |
| NTPC LTD | 1,142.12 | 2,766.29 | 28,340 | 41,660 | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 55.89 | 53.27 | 9,162 | 13,469 | | 各種金融サービス |
| YES BANK LTD | — | 7,148.5 | 10,436 | 15,342 | | 銀行 |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 468.06 | 345.17 | 10,379 | 15,257 | | 建設資材 |
| BHARAT FORGE LTD | 76.44 | 158.49 | 9,299 | 13,670 | | 自動車部品 |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 561.31 | 967.13 | 35,783 | 52,602 | | 金属・鋳業 |
| ITC LTD | 1,760.58 | 1,874.66 | 38,983 | 57,305 | | タバコ |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD | 71.98 | 86.76 | 15,822 | 23,258 | | 化学 |
| UNITED PHOSPHORUS LTD | 301.31 | 297.92 | 18,225 | 26,791 | | 化学 |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | — | 25.21 | 6,603 | 9,707 | | 医薬品 |
| SIEMENS INDIA LTD | 26.78 | 36.37 | 6,720 | 9,878 | | コングロメリット |
| INFO EDGE INDIA LTD | 21.51 | 42.16 | 19,706 | 28,968 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 156.95 | 257.69 | 18,860 | 27,724 | | パーソナル用品 |
| TECH MAHINDRA LTD | 204.62 | 406.6 | 41,078 | 60,385 | | 情報技術サービス |
| MARICO LTD | 282.57 | 266.96 | 11,317 | 16,637 | | パーソナル用品 |
| PAGE INDUSTRIES LTD | 1.91 | 3.78 | 11,422 | 16,790 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DLF LTD | 240.13 | 337.09 | 8,509 | 12,509 | | 不動産管理・開発 |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 959.97 | 1,403.37 | 29,449 | 43,291 | | 電力 |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD | 354.33 | 317.46 | 23,984 | 35,256 | | 運送インフラ |
| BAJAJ FINSERV LTD | 21.74 | 24.28 | 23,854 | 35,066 | | 各種金融サービス |
| BAJAJ AUTO LTD | 33.92 | 43.88 | 15,948 | 23,444 | | 自動車 |
| JUBILANT FOODWORKS LTD | — | 57.44 | 16,201 | 23,814 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| MUTHOOT FINANCE LTD | — | 49.65 | 5,799 | 8,525 | | 消費者金融 |
| COAL INDIA LTD | 544.64 | 994.58 | 12,715 | 18,692 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD | 86.21 | — | — | — | | 消費者金融 |
| INDUS TOWERS LTD | 140.7 | 373.74 | 9,702 | 14,262 | | 各種電気通信サービス |
| PI INDUSTRIES LTD | — | 41.33 | 10,313 | 15,160 | | 化学 |
| TATA STEEL LTD-PARTLY PAID | 23.33 | — | — | — | | 金属・鋳業 |
| LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD | — | 27.48 | 11,239 | 16,521 | | 情報技術サービス |
| ADANI GREEN ENERGY LTD | — | 253.35 | 28,086 | 41,286 | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | 216.72 | 445.36 | 30,758 | 45,215 | | 保険 |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | 25.14 | 24.25 | 7,104 | 10,444 | | 資本市場 |
| BANDHAN BANK LTD | 99.23 | 389.9 | 12,580 | 18,492 | | 銀行 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | |
| BERGER PAINTS INDIA LTD | 79.54 | 125.56 | 9,232 | 13,571 | 化学 |
| AVENUE SUPERMARTS LTD | 65.1 | 88.1 | 25,724 | 37,814 | 食品・生活必需品小売り |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | 79.31 | 115.17 | 16,321 | 23,992 | 保険 |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD | 115.66 | 190.44 | 8,589 | 12,627 | 保険 |
| INTERGLOBE AVIATION LTD | 36.35 | 48.93 | 7,745 | 11,385 | 旅客航空輸送業 |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD | 149.7 | 240.46 | 21,982 | 32,314 | 保険 |
| 小計 | 株数・金 銘柄数<比率> | 株数・金 銘柄数<比率> | 3,477,282 | 5,111,604 | |
| | 85銘柄 | 96銘柄 | - | <8.8%> | |
| (パキスタン) | 百株 | 百株 | 千パキスタン・ルピー | 千円 | |
| MCB BANK LTD | 124 | 124 | 2,154 | 1,529 | 銀行 |
| OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD | 218.68 | 218.68 | 2,166 | 1,538 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HABIB BANK LTD | 193 | 193 | 2,287 | 1,624 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金 銘柄数<比率> | 株数・金 銘柄数<比率> | 6,608 | 4,691 | |
| | 3銘柄 | 3銘柄 | - | <0.0%> | |
| (インドネシア) | 百株 | 百株 | 千インドネシア・ルピア | 千円 | |
| ANEKA TAMBANG TBK PT | - | 5,717 | 1,366,363 | 10,247 | 金属・鉱業 |
| BARITO PACIFIC TBK PT | 14,625 | 14,709 | 1,434,127 | 10,755 | 化学 |
| UNITED TRACTORS TBK PT | 1,039.01 | 848.01 | 1,871,982 | 14,039 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT | 2,769 | 3,529 | 2,364,430 | 17,733 | 食品 |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT | 3,608 | 4,805 | 3,039,162 | 22,793 | 家庭用品 |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 10,655 | 13,067 | 6,860,175 | 51,451 | 自動車 |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 24,831 | 31,399 | 10,550,064 | 79,125 | 各種電気通信サービス |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT | 2,440 | 3,868 | 2,988,030 | 22,410 | 食品 |
| GUDANG GARAM TBK PT | 158 | 324 | 1,179,360 | 8,845 | タバコ |
| HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK | 4,563 | - | - | - | タバコ |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT | 1,098 | 678 | 883,095 | 6,623 | 建設資材 |
| INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT | 1,428 | 1,908 | 1,893,690 | 14,202 | 紙製品・林産品 |
| BUKIT ASAM TBK PT | 2,300 | - | - | - | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANK MANDIRI | 9,617 | 11,831 | 7,453,530 | 55,901 | 銀行 |
| PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT | 868 | - | - | - | 紙製品・林産品 |
| BANK RAKYAT INDONESIA | 27,728 | 34,221 | 14,851,914 | 111,389 | 銀行 |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | 4,772 | 8,222 | 966,085 | 7,245 | ガス |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT | 4,400 | 3,443 | 2,048,585 | 15,364 | 銀行 |
| KALBE FARMA TBK PT | 13,344 | 10,057 | 1,503,521 | 11,276 | 医薬品 |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 1,009 | 1,498 | 1,595,370 | 11,965 | 建設資材 |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 4,753 | 6,028 | 18,912,850 | 141,846 | 銀行 |
| XL AXIATA TBK PT | 355 | - | - | - | 無線通信サービス |
| JASA MARGA PERSERO TBK PT | 416.25 | - | - | - | 運送インフラ |
| BUMI SERPONG DAMAI PT | 6,631 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| ADARO ENERGY PT | 6,845 | 9,341 | 1,106,908 | 8,301 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PAKUWON JATI TBK | 2,185 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | 774 | 1,650 | 1,476,750 | 11,075 | 食品 |
| BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT | 1,579 | - | - | - | 銀行 |
| ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT | 1,104 | - | - | - | 専門小売り |
| SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT | - | 17,183 | 1,950,270 | 14,627 | 各種電気通信サービス |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | - | 4,256 | 1,034,208 | 7,756 | 金属・鉱業 |
| 小計 | 株数・金 銘柄数<比率> | 株数・金 銘柄数<比率> | 87,330,471 | 654,978 | |
| | 28銘柄 | 22銘柄 | - | <1.1%> | |
| (アラブ首長国連邦) | 百株 | 百株 | 千アラブ首長国連邦・ディルハム | 千円 | |
| ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC | - | 1,142.69 | 562 | 16,658 | 銀行 |
| DUBAI ISLAMIC BANK PJSC | 630.16 | 942.96 | 427 | 12,656 | 銀行 |
| EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC | 876.04 | 1,071.47 | 2,348 | 69,590 | 各種電気通信サービス |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC | 1,545.32 | 1,764.04 | 1,102 | 32,667 | 銀行 |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC | 1,363.91 | 1,680.85 | 2,430 | 72,015 | 銀行 |
| EMAAR PROPERTIES PJSC | 2,271.65 | 1,873.97 | 740 | 21,932 | 不動産管理・開発 |
| ALDAR PROPERTIES PJSC | 1,419.95 | 2,243.84 | 816 | 24,200 | 不動産管理・開発 |
| EMIRATES NBD BANK PJSC | - | 1,385.97 | 1,621 | 48,047 | 銀行 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|---|----------|-----------|--------|---------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アラブ首長国連邦) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| EMAAR MALLS PJSC | 953.55 | 2,679.19 | 506 | 15,003 | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 9,060.58 | 14,784.98 | 10,555 | 312,773 | |
| | 7銘柄 | 9銘柄 | - | <0.5%> | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| BRF SA | 325.92 | 296.92 | 700 | 13,618 | 食品 |
| VALE SA | 1,557.21 | 2,252.21 | 24,474 | 475,870 | 金属・鉱業 |
| CIA PARANAENSE DE ENERGIA | - | 790 | 516 | 10,045 | 電力 |
| RAIA DROGASIL SA | 120 | 635 | 1,571 | 30,557 | 食品・生活必需品小売り |
| TIM PARTICIPACOES SA | 483 | - | - | - | 無線通信サービス |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 94.5 | 112.5 | 408 | 7,946 | 電力 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA | 178 | 197 | 700 | 13,616 | 電力 |
| BANCO DO BRASIL SA | 439 | 564 | 1,679 | 32,645 | 銀行 |
| ITAU SA | 2,183.6 | 2,433.6 | 2,506 | 48,736 | 銀行 |
| LOJAS AMERICANAS SA | 318.74 | 531.74 | 1,254 | 24,399 | 複合小売り |
| GERDAU SA | 495.3 | 671.3 | 2,183 | 42,459 | 金属・鉱業 |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO | 65.06 | - | - | - | 食品・生活必需品小売り |
| PETROLEO BRASILEIRO SA | 1,839.1 | 2,230.1 | 5,051 | 98,211 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 382 | 392 | 846 | 16,463 | 専門小売り |
| PETROLEO BRASILEIRO SA | 2,056.12 | 2,958.12 | 6,788 | 131,998 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COGNA EDUCACAO | 642.47 | - | - | - | 各種消費者サービス |
| CCR SA | 539.2 | 653.2 | 801 | 15,583 | 運送インフラ |
| WEG SA | 424.72 | 524.72 | 4,042 | 78,608 | 電気設備 |
| BANCO BRADESCO SA PREF | 2,168.85 | 2,820.85 | 7,362 | 143,149 | 銀行 |
| BANCO BRADESCO SA | 600.25 | 713.25 | 1,649 | 32,062 | 銀行 |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 195.06 | 410.06 | 1,968 | 38,270 | 金属・鉱業 |
| BRADESCAR SA | - | 102 | 743 | 14,447 | 金属・鉱業 |
| SUZANO SA | 282.75 | 464.75 | 3,305 | 64,265 | 紙製品・林産品 |
| CPFL ENERGIA SA | - | 222 | 693 | 13,480 | 電力 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 2,352.47 | 2,994.47 | 8,369 | 162,731 | 銀行 |
| PORTO SEGURO SA | 46 | - | - | - | 保険 |
| B2W CIA DIGITAL | 91 | 154 | 1,050 | 20,420 | インターネット販売・通信販売 |
| BRASKEM SA | 103.3 | - | - | - | 化学 |
| ENGIE BRASIL SA | 110.87 | 179.87 | 754 | 14,667 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ALPARGATAS SA | - | 85 | 324 | 6,304 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LOCALIZA RENT A CAR | 272.89 | 389.89 | 2,502 | 48,653 | 陸運・鉄道 |
| TELEFONICA BRASIL S.A. | 228.28 | - | - | - | 各種電気通信サービス |
| LOJAS RENNEN SA | 433.37 | 450.37 | 2,112 | 41,068 | 複合小売り |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 442.04 | 379.04 | 799 | 15,542 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSAN SA | 101 | 144 | 1,307 | 25,422 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOTVS SA | - | 236 | 735 | 14,293 | ソフトウェア |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 417 | 685 | 1,708 | 33,216 | 電力 |
| EMBRAER SA | 211.6 | - | - | - | 航空宇宙・防衛 |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | 294.65 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| JBS SA | 453 | 695 | 2,321 | 45,147 | 食品 |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS | 549.49 | 508.69 | 656 | 12,758 | 電力 |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 182.98 | 179.98 | 773 | 15,043 | 水道 |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA | 206.4 | - | - | - | 不動産管理・開発 |
| HYPERA SA | 211 | 182 | 644 | 12,526 | 医薬品 |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO | 1,013.16 | 1,271.16 | 7,042 | 136,924 | 資本市場 |
| MAGAZINE LUIZA SA | 375 | 1,810 | 3,967 | 77,141 | 複合小売り |
| CIELO SA | 465.07 | - | - | - | 情報技術サービス |
| TELEFONICA BRASIL SA | - | 322.28 | 1,422 | 27,658 | 各種電気通信サービス |
| VIA VAREJO S/A | - | 683 | 870 | 16,931 | 専門小売り |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | 296 | 423 | 1,003 | 19,516 | 保険 |
| NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA | 251 | 342 | 2,828 | 54,992 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA | 122 | 591 | 906 | 17,627 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ATACADO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA | 163 | 299 | 693 | 13,481 | 食品・生活必需品小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------------|-------------------|-----------|-----------|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジル・レアル | 千円 | |
| AMBEV SA | 2,326.95 | 2,925.95 | 4,623 | 89,886 | 飲料 |
| NATURA & CO HOLDING SA | 345 | 571 | 2,864 | 55,688 | パーソナル用品 |
| TIM SA | - | 622 | 763 | 14,839 | 無線通信サービス |
| RUMO SA | 571 | 797 | 1,674 | 32,557 | 陸運・鉄道 |
| IRB BRASIL RESSEGUROS S/A | 250 | - | - | - | 保険 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 37,896.02 47銘柄 | 121,969 | 2,371,483 | |
| (チェコ) | 百株 | 百株 | 千チェコ・コルナ | 千円 | |
| KOMERCNI BANKA AS | 46.48 | 62.5 | 4,237 | 21,257 | 銀行 |
| CEZ | 80.01 | 98.49 | 5,870 | 29,447 | 電力 |
| MONETA MONEY BANK AS | 209.73 | 269.89 | 2,163 | 10,851 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 430.88 3銘柄 | 12,270 | 61,557 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 33.54 | 73 | 162,790 | 15,839 | メディア |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 15.15 | 20.68 | 221,276 | 21,530 | 自動車 |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC | 13.75 | 18.56 | 354,496 | 34,492 | 保険 |
| DB INSURANCE CO LTD | 16.28 | 38.43 | 174,664 | 16,994 | 保険 |
| COWAY CO LTD | 27.6 | 23.34 | 155,677 | 15,147 | 家庭用耐久財 |
| KT&G CORP | 59.33 | 64.55 | 534,474 | 52,004 | タバコ |
| S-1 CORPORATION | 4.87 | 7.94 | 64,790 | 6,304 | 商業サービス・用品 |
| KOREA GAS CORP | 26.07 | 13.03 | 43,324 | 4,215 | ガス |
| CJ CORP | 3.09 | 10.01 | 97,497 | 9,486 | コングロマリット |
| KAKAO CORP | 25.98 | 175.75 | 2,091,425 | 203,495 | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| CJ ENM CO LTD | 5.63 | 2.99 | 42,936 | 4,177 | インターネット販売・通信販売 |
| DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE | 31.83 | 24.97 | 70,914 | 6,900 | 機械 |
| KMW CO LTD | 8.63 | 13.34 | 81,774 | 7,956 | 通信機器 |
| SK TELECOM CO LTD | 10.13 | 25.24 | 762,248 | 74,166 | 無線通信サービス |
| DAELIM INDUSTRIAL CO | 16.47 | - | - | - | 建設・土木 |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 223.72 | 215.11 | 215,110 | 20,930 | 資本市場 |
| NCSOFT CORPORATION | 8.24 | 10.26 | 935,712 | 91,044 | 娯楽 |
| LG UPLUS CORP | 115.51 | 156.81 | 206,205 | 20,063 | 各種電気通信サービス |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD | - | 152.61 | 213,654 | 20,788 | 電気設備 |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT | 50.23 | - | - | - | 建設・土木 |
| POSCO INTERNATIONAL CORP | 16.34 | - | - | - | 商社・流通業 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 4.74 | 5.62 | 876,720 | 85,304 | パーソナル用品 |
| LG CHEM LTD | 22.58 | 28.06 | 2,516,982 | 244,902 | 化学 |
| LG CHEM LTD | 3.54 | 4.99 | 202,344 | 19,688 | 化学 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | 0.78 | 2.03 | 137,228 | 13,352 | パーソナル用品 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | 225.41 | 273.94 | 1,010,838 | 98,354 | 銀行 |
| S-OIL CORP | 25.95 | 24.6 | 194,832 | 18,957 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HANWHA SOLUTIONS CORPORATION | 32.34 | 65.26 | 330,215 | 32,129 | 化学 |
| MERITZ SECURITIES CO LTD | 134.12 | 202.52 | 94,475 | 9,192 | 資本市場 |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD | 25.6 | 52.63 | 218,940 | 21,302 | 資本市場 |
| POSCO CHEMICAL CO LTD | 6.83 | 13.38 | 227,460 | 22,131 | 建設資材 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 8.37 | 10.44 | 298,584 | 29,052 | 化学 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 10.53 | 16.75 | 140,700 | 13,690 | 専門小売り |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD | 18.35 | 22.28 | 305,236 | 29,699 | 機械 |
| HYUNDAI MOBIS | 32.73 | 41.29 | 1,263,474 | 122,936 | 自動車部品 |
| SK HYNIX INC | 267.27 | 333.67 | 4,587,962 | 446,408 | 半導体・半導体製造装置 |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | 42.68 | 45.34 | 213,778 | 20,800 | 建設・土木 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 7.44 | 15.15 | 168,922 | 16,436 | 自動車 |
| HYUNDAI MOTOR CO | 76.24 | 92.1 | 2,132,115 | 207,454 | 自動車 |
| HYUNDAI STEEL CO | 44.76 | 45.33 | 222,117 | 21,611 | 金属・鉱業 |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA | 158.08 | 211.14 | 193,193 | 18,797 | 銀行 |
| KCC CORP | 4.02 | - | - | - | 化学 |
| KIA CORPORATION | 132.1 | 163.27 | 1,418,816 | 138,050 | 自動車 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--|----------|--------|------------|-----------|--|----------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | | |
| KOREA ZINC CO LTD | 4.27 | 4.65 | 195,997 | 19,070 | | 金属・鉱業 |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP | 129.26 | 164.88 | 394,887 | 38,422 | | 電力 |
| HANWHA CORP | 18.37 | 24.18 | 76,287 | 7,422 | | コングロマリット |
| KOREAN AIR CO LTD | 8.79 | 97.24 | 257,686 | 25,072 | | 旅客航空輸送業 |
| OCI COMPANY LTD | 5.28 | — | — | — | | 化学 |
| CJ LOGISTICS | 4.33 | 4.51 | 80,954 | 7,876 | | 陸運・鉄道 |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD | 12.71 | 10.93 | 273,250 | 26,587 | | 化学 |
| DOUZONE BIZON CO LTD | — | 10.2 | 89,862 | 8,743 | | ソフトウェア |
| HLB INC | 17.32 | 48.88 | 172,057 | 16,741 | | レジャー用品 |
| LG ELECTRONICS INC | 46.01 | 66.67 | 1,123,389 | 109,305 | | 家庭用耐久財 |
| LOTTE CORP | 21.83 | 15.91 | 54,889 | 5,340 | | コングロマリット |
| LG CORP | 46.92 | 52.51 | 577,610 | 56,201 | | コングロマリット |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 51.45 | 91.63 | 109,956 | 10,698 | | 資本市場 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCTION | 25.23 | 47.63 | 213,620 | 20,785 | | 建設・土木 |
| NAVER CORP | 68.85 | 75.17 | 2,942,905 | 286,344 | | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD | 2.34 | — | — | — | | 複合小売り |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD | 21.33 | 22.41 | 237,546 | 23,113 | | 資本市場 |
| OTTOGI CORP | 1.21 | 0.66 | 37,620 | 3,660 | | 食品 |
| AMOREPACIFIC GROUP | 8.4 | 20.01 | 140,070 | 13,628 | | パーソナル用品 |
| KANGWON LAND INC | 65.2 | 87.13 | 211,725 | 20,600 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| POSCO | 38.29 | 46.03 | 1,581,130 | 153,843 | | 金属・鉱業 |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | 47.34 | 88.11 | 128,640 | 12,516 | | 建設・土木 |
| SAMSUNG SDI CO LTD | 27.24 | 33.81 | 2,346,414 | 228,306 | | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | 28.89 | 35.6 | 688,860 | 67,026 | | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 2,336.06 | 2,913 | 24,440,070 | 2,378,018 | | コンピュータ・周辺機器 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD | 242.94 | 267.7 | 197,830 | 19,248 | | 機械 |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD | 403.27 | 494.02 | 3,715,030 | 361,472 | | コンピュータ・周辺機器 |
| SHINSEGAE CO LTD | 4.13 | 5.13 | 142,357 | 13,851 | | 複合小売り |
| SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 15.63 | 140,357 | 13,656 | | 医薬品 |
| YUHAN CORP | 27.09 | 37.2 | 249,240 | 24,251 | | 医薬品 |
| HANON SYSTEMS | 110.87 | 101.46 | 181,106 | 17,621 | | 自動車部品 |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD | 30.18 | 31.66 | 75,192 | 7,316 | | 保険 |
| GS HOLDINGS CORP | 21.16 | 28.79 | 119,910 | 11,667 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LG DISPLAY CO LTD | 108.38 | 140.45 | 346,911 | 33,754 | | 電子装置・機器・部品 |
| CELLTRION INC | 46.63 | 59.4 | 1,829,520 | 178,012 | | バイオテクノロジー |
| HELIXMITH CO LTD | 9.58 | — | — | — | | バイオテクノロジー |
| HANA FINANCIAL GROUP | 154.1 | 190.41 | 780,681 | 75,960 | | 銀行 |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 7.41 | 11.32 | 208,854 | 20,321 | | 航空貨物・物流サービス |
| CELLTRION PHARM INC | — | 9.88 | 154,128 | 14,996 | | 医薬品 |
| LOTTE SHOPPING CO | 5.5 | 5.38 | 66,443 | 6,464 | | 複合小売り |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | 37.37 | 43.61 | 352,368 | 34,285 | | 保険 |
| AMOREPACIFIC CORP | 16.57 | 17.7 | 465,510 | 45,294 | | パーソナル用品 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 3.68 | — | — | — | | パーソナル用品 |
| SAMSUNG CARD CO | 8.75 | 30.26 | 104,397 | 10,157 | | 消費者金融 |
| SK INNOVATION CO LTD | 24.96 | 34.79 | 961,943 | 93,597 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 4.84 | 4.66 | 195,487 | 19,020 | | 食品 |
| STX PAN OCEAN CO LTD | 215.02 | 195.95 | 124,232 | 12,087 | | 海運業 |
| LG INNOTEK CO LTD | 6.98 | 7.64 | 165,788 | 16,131 | | 電子装置・機器・部品 |
| SK HOLDINGS CO LTD | 15.27 | 19.45 | 556,270 | 54,125 | | コングロマリット |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 196.69 | 245.61 | 1,294,364 | 125,941 | | 銀行 |
| MEDY-TOX INC | 2.29 | — | — | — | | バイオテクノロジー |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD | 45.7 | 36.64 | 128,240 | 12,477 | | 航空宇宙・防衛 |
| BNK FINANCIAL GROUP INC | 214.32 | — | — | — | | 銀行 |
| HANMI PHARM CO LTD | 4.16 | 2.87 | 101,454 | 9,871 | | 医薬品 |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 113.69 | — | — | — | | 保険 |
| FILA HOLDINGS CORP | 24.24 | 25.17 | 115,278 | 11,216 | | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SEEGENE INC | — | 9.79 | 194,821 | 18,956 | | バイオテクノロジー |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|------------------|-------------------|-------------------|-----------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千韓国・ウォン | 千円 | |
| E-MART CO LTD | 11.97 | 10.07 | 171,190 | 16,656 | 食品・生活必需品小売り |
| GS RETAIL CO LTD | 8.21 | 6.53 | 24,520 | 2,385 | 食品・生活必需品小売り |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | 47.69 | 38.56 | 191,064 | 18,590 | 自動車部品 |
| HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION | 12.33 | — | — | — | 建設・土木 |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD | 5.76 | 23.05 | 136,225 | 13,254 | 機械 |
| BGF RETAIL CO LTD | 2.53 | 3.44 | 54,868 | 5,338 | 食品・生活必需品小売り |
| ORION CORP REPUBLIC OF KOREA | 13.23 | 17.03 | 205,211 | 19,967 | 食品 |
| SK CHEMICALS CO LTD | — | 4.09 | 112,475 | 10,943 | 化学 |
| NETMARBLE CORP | 8.62 | 14.5 | 211,700 | 20,598 | 娯楽 |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 246.32 | 299.5 | 306,987 | 29,869 | 銀行 |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | — | 11.69 | 130,343 | 12,682 | 医薬品 |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 15.37 | 21.86 | 419,712 | 40,837 | 情報技術サービス |
| ALTEOGEN INC | — | 23.29 | 216,597 | 21,074 | バイオテクノロジー |
| SAMSUNG C&T CORP | 41.71 | 54.59 | 758,801 | 73,831 | コンプロマリット |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD | 8.24 | 10.33 | 858,423 | 83,524 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| PEARL ABYSS CORP | 3.14 | 20.8 | 139,360 | 13,559 | 娯楽 |
| DOOSAN BOBCAT INC | 9.89 | 29.22 | 120,970 | 11,770 | 機械 |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | 27.41 | 38.5 | 510,510 | 49,672 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 7,601.96 110銘柄 | 9,377.78 106銘柄 | 77,096.014 — | 7,501.442 <12.9%> |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| EVE ENERGY CO LTD | 27 | 90.32 | 647 | 10,769 | 電気設備 |
| LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD | 173 | — | — | — | 化学 |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD | 54 | 54 | 87 | 1,449 | 電子装置・機器・部品 |
| ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD | — | 58 | 135 | 2,251 | 電子装置・機器・部品 |
| BEIJING THUNISOFT CORP LTD | — | 64 | 118 | 1,971 | ソフトウェア |
| BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD | 30 | 30 | 146 | 2,444 | 飲料 |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD | — | 120 | 148 | 2,470 | 半導体・半導体製造装置 |
| JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD | 35 | 18 | 171 | 2,851 | 金属・鉱業 |
| XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD | 323 | — | — | — | 化学 |
| UNISPLENDOR CORP LTD | 56 | 75.4 | 145 | 2,427 | 電子装置・機器・部品 |
| WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD | — | 163 | 119 | 1,988 | 電子装置・機器・部品 |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD | — | 191 | 282 | 4,704 | 紙製品・林産品 |
| SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD | — | 40 | 112 | 1,870 | 通信機器 |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD | 12 | 12 | 160 | 2,677 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| JOYOUNG CO LTD | — | 51 | 165 | 2,757 | 家庭用耐久財 |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD | — | 164 | 353 | 5,884 | 電気設備 |
| HUAGONG TECH CO LTD | — | 75 | 156 | 2,601 | 電子装置・機器・部品 |
| CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC | 3 | 9 | 391 | 6,520 | 医薬品 |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD | 81 | 103.3 | 221 | 3,687 | 機械 |
| YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 66 | 120 | 2,001 | 医薬品 |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD | 52 | 53 | 311 | 5,185 | 娯楽 |
| SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD | — | 59 | 108 | 1,813 | コンピュータ・周辺機器 |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD | — | 191 | 356 | 5,940 | 電子装置・機器・部品 |
| HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD | 238 | 238 | 98 | 1,631 | 保険 |
| SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD | 66 | 66 | 215 | 3,592 | 家庭用耐久財 |
| BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD | 103 | 66.5 | 353 | 5,875 | 建設資材 |
| GEM CO LTD | 291 | 291 | 245 | 4,082 | 金属・鉱業 |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD | — | 44 | 526 | 8,763 | ソフトウェア |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD | 69 | 69 | 347 | 5,775 | バイオテクノロジー |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD | — | 186 | 130 | 2,179 | 娯楽 |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD | — | 24 | 158 | 2,638 | 電気設備 |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD | 36 | 61.2 | 204 | 3,406 | 電子装置・機器・部品 |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD | 59.04 | 59.04 | 209 | 3,487 | 家庭用耐久財 |
| ZHEJIANG NHU CO LTD | 42 | 58 | 211 | 3,515 | 医薬品 |
| SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD | 19 | 19 | 49 | 816 | 医薬品 |
| AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD | 18 | 27 | 203 | 3,394 | 電子装置・機器・部品 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|--------|------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD | — | 66 | 168 | 2,806 | 食品 |
| CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD | — | 39 | 168 | 2,805 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC | — | 34 | 149 | 2,491 | 機械 |
| BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC | — | 51 | 225 | 3,746 | 建設関連製品 |
| CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD | 142 | 15 | 24 | 415 | 情報技術サービス |
| BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD | 154 | 26 | 44 | 745 | 情報技術サービス |
| GUANGDONG HAID GROUP CO LTD | 37 | 46 | 344 | 5,735 | 食品 |
| GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD | — | 124 | 428 | 7,127 | 電気設備 |
| AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD | — | 110 | 109 | 1,815 | 航空宇宙・防衛 |
| WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD | — | 84 | 207 | 3,458 | 自動車部品 |
| VENUSTECH GROUP INC | 95 | — | — | — | ソフトウェア |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD | 76 | 120 | 1,212 | 20,173 | 食品 |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | 37 | 48 | 842 | 14,017 | バイオテクノロジー |
| GLODON CO LTD | 23 | — | — | — | ソフトウェア |
| ADDSINO CO LTD | — | 102 | 179 | 2,980 | 通信機器 |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 112 | 112 | 143 | 2,385 | コンピュータ・周辺機器 |
| TRANSFAR ZHILIAN CO LTD | — | 314 | 200 | 3,338 | 化学 |
| NAVINFO CO LTD | 218 | 56 | 84 | 1,413 | 家庭用耐久財 |
| JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD | 143 | 143 | 102 | 1,706 | 不動産管理・開発 |
| WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD | — | 27.3 | 47 | 782 | ヘルスケア・テクノロジー |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD | 120 | 26 | 54 | 906 | 医薬品 |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC | 60 | 78 | 333 | 5,552 | バイオテクノロジー |
| RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD | 96 | 259 | 712 | 11,857 | 化学 |
| CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 60 | 144 | 2,405 | 医薬品 |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD | 53 | 32 | 339 | 5,644 | 半導体・半導体製造装置 |
| INSUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD | 35.7 | 35.7 | 96 | 1,614 | コンピュータ・周辺機器 |
| JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | — | 149 | 236 | 3,937 | 医薬品 |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD | 127 | 127 | 155 | 2,593 | コンピュータ・周辺機器 |
| O-FILM TECH CO LTD | 86 | 86 | 74 | 1,245 | 電子装置・機器・部品 |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD | — | 500 | 319 | 5,308 | 金属・鉱業 |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD | 86 | 124.8 | 741 | 12,336 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD | 184 | 139 | 578 | 9,627 | 電子装置・機器・部品 |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD | — | 48 | 542 | 9,026 | 飲料 |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD | 69 | 69 | 191 | 3,190 | ヘルスケア機器・用品 |
| XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD | 382 | 382 | 285 | 4,754 | 機械 |
| CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 67 | 13 | 26 | 438 | 医薬品 |
| DONG-E-E-JIAO CO LTD | — | 49 | 176 | 2,935 | 医薬品 |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO | 153 | 153 | 155 | 2,584 | 通信機器 |
| ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD | — | 210 | 234 | 3,907 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| HUADONG MEDICINE CO LTD | — | 75 | 312 | 5,204 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD | 50 | 50 | 168 | 2,802 | エネルギー設備・サービス |
| WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY | 66 | 66 | 143 | 2,394 | 娯楽 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD | 68 | 48 | 1,136 | 18,907 | 飲料 |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD | 74 | 74 | 589 | 9,815 | 機械 |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 149.5 | 149.5 | 120 | 2,007 | 食品 |
| NORTHEAST SECURITIES CO LTD | 177 | 177 | 149 | 2,480 | 資本市場 |
| TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD | 213 | 178 | 499 | 8,314 | 半導体・半導体製造装置 |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD | 33 | 59.4 | 119 | 1,984 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 38 | 38 | 117 | 1,960 | ソフトウェア |
| RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD | 160 | 160 | 104 | 1,730 | 不動産管理・開発 |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD | 21 | 21 | 249 | 4,154 | 資本市場 |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD | — | 364.8 | 342 | 5,700 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD | — | 143 | 168 | 2,805 | 娯楽 |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD | 198.5 | 291.54 | 970 | 16,146 | 電子装置・機器・部品 |
| SHANXI SECURITIES CO LTD | — | 275 | 192 | 3,198 | 資本市場 |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD | 269 | 445 | 408 | 6,798 | メディア |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD | 111 | 199 | 352 | 5,861 | 食品 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|-------|-----------|-------------|----------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD | 65 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |
| DHC SOFTWARE CO LTD | 262 | 38 | 28 | 474 | 情報技術サービス |
| IFLYTEK CO LTD | 75 | 113 | 523 | 8,706 | ソフトウェア |
| HESTEEL CO LTD | — | 1,047 | 279 | 4,652 | 金属・鉱業 |
| GOERTEK INC | 105 | 87 | 256 | 4,269 | 電子装置・機器・部品 |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD | — | 213 | 163 | 2,718 | 資本市場 |
| BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD | 374 | 575 | 442 | 7,367 | 商業サービス・用品 |
| BANK OF NINGBO CO LTD | 126 | 191 | 721 | 12,001 | 銀行 |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD | 43 | 146 | 376 | 6,270 | 電子装置・機器・部品 |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION | 474 | 474 | 427 | 7,107 | 家庭用耐久財 |
| CHANGJIANG SECURITIES CO LTD | 568 | 283 | 205 | 3,414 | 資本市場 |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD | 376 | 376 | 382 | 6,363 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD | 122 | 124 | 196 | 3,262 | 自動車 |
| WESTERN SECURITIES CO LTD | 423 | 227 | 194 | 3,237 | 資本市場 |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD | 79 | 82 | 324 | 5,403 | 食品 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD | 30 | 38 | 428 | 7,124 | 医薬品 |
| AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUTRY GROUP | 107 | 107 | 260 | 4,334 | 航空宇宙・防衛 |
| EAST MONEY INFORMATION CO LTD | 202 | 278.4 | 795 | 13,236 | 資本市場 |
| JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD | 30 | 48 | 766 | 12,756 | 飲料 |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD | 123 | 146 | 3,822 | 63,607 | 飲料 |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD | 208 | 208 | 153 | 2,551 | バイオテクノロジー |
| SUNING.COM CO LTD | 291 | 237 | 169 | 2,823 | 専門小売り |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 791 | 1,256 | 874 | 14,547 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD | 192 | 499 | 607 | 10,114 | 不動産管理・開発 |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI | 107 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| MIDEA GROUP CO LTD | — | 136 | 1,086 | 18,082 | 家庭用耐久財 |
| HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD | 322 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD | 170 | 170 | 188 | 3,137 | 資本市場 |
| PING AN BANK CO LTD | 670 | 614 | 1,243 | 20,701 | 銀行 |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD | 121 | 302.8 | 475 | 7,906 | 食品 |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD | 657 | 1,287 | 588 | 9,787 | 資本市場 |
| CHINA VANKE CO LTD | 373 | 374 | 1,079 | 17,968 | 不動産管理・開発 |
| ZTE CORP | 97 | 216 | 612 | 10,193 | 通信機器 |
| ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | 405 | 285 | 351 | 5,843 | 機械 |
| WEICHAI POWER CO LTD | 220 | 170 | 320 | 5,341 | 機械 |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC | — | 42 | 176 | 2,934 | 医薬品 |
| GF SECURITIES CO LTD | 183 | 391 | 584 | 9,734 | 資本市場 |
| XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD | 62 | 211 | 277 | 4,617 | 電気設備 |
| BYD CO LTD | 100 | 71 | 1,173 | 19,530 | 自動車 |
| GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD | — | 341 | 287 | 4,783 | 電子装置・機器・部品 |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD | — | 39 | 343 | 5,724 | 化学 |
| LOMON BILLIONS GROUP CO LTD | 110 | 110 | 317 | 5,275 | 化学 |
| NANJI E-COMMERCE CO LTD | 129 | 129 | 115 | 1,921 | メディア |
| CHACHA FOOD CO LTD | — | 29 | 149 | 2,495 | 食品 |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 80 | 225 | 3,751 | 医薬品 |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 12 | 15 | 226 | 3,772 | 半導体・半導体製造装置 |
| JIANGXI ZHENGGBANG TECHNOLOGY CO LTD | — | 36 | 48 | 811 | 食品 |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD | — | 494 | 381 | 6,354 | 金属・鉱業 |
| PERFECT WORLD CO LTD/CHINA | 37 | 55.5 | 119 | 1,983 | 娯楽 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD | 12 | 12 | 281 | 4,692 | 飲料 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD | 120 | 156 | 202 | 3,377 | 化学 |
| ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD | — | 66 | 220 | 3,672 | 半導体・半導体製造装置 |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD | 42 | 6 | 43 | 722 | 家庭用耐久財 |
| NINESTAR CORP | — | 57 | 141 | 2,354 | コンピュータ・周辺機器 |
| YUNDA HOLDING CO LTD | 54 | 70.2 | 89 | 1,491 | 航空貨物・物流サービス |
| GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD | 338 | 338 | 112 | 1,867 | 半導体・半導体製造装置 |
| GIANT NETWORK GROUP CO LTD | — | 120 | 171 | 2,857 | 娯楽 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|-------|------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD | — | 42 | 344 | 5,738 | 電子装置・機器・部品 |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD | — | 16 | 156 | 2,608 | 医薬品 |
| ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD | — | 5 | 143 | 2,382 | 医薬品 |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD | 151 | 151 | 172 | 2,869 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC | — | 53 | 99 | 1,659 | 電気設備 |
| SF HOLDING CO LTD | 50 | 150 | 955 | 15,903 | 航空貨物・物流サービス |
| FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD | — | 236 | 161 | 2,682 | 資本市場 |
| SHANDONG SINOCCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD | 65 | 65 | 285 | 4,747 | 化学 |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD | 655.9 | 637.9 | 529 | 8,810 | 銀行 |
| CSC FINANCIAL CO LTD | 63 | 136 | 407 | 6,787 | 資本市場 |
| AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD | — | 50 | 314 | 5,226 | 航空宇宙・防衛 |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD | — | 21 | 226 | 3,775 | 化学 |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD | 171 | 164 | 478 | 7,966 | 化学 |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD | — | 31 | 325 | 5,421 | 飲料 |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD | — | 225 | 267 | 4,451 | 資本市場 |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | — | 13 | 93 | 1,552 | 食品・生活必需品小売り |
| CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD | — | 52 | 198 | 3,305 | 食品 |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD | — | 31.5 | 218 | 3,642 | 通信機器 |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD | — | 33 | 374 | 6,226 | 容器・包装 |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD | — | 27 | 382 | 6,365 | 電子装置・機器・部品 |
| JUEWEI FOOD CO LTD | — | 31 | 240 | 4,004 | 食品 |
| OPPEIN HOME GROUP INC | — | 21 | 325 | 5,417 | 家庭用耐久財 |
| JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD | 236 | 236 | 172 | 2,863 | 銀行 |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD | 43.2 | 43.2 | 301 | 5,017 | 金属・鉱業 |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD | 95 | 95 | 146 | 2,440 | 食品 |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD | — | 30 | 102 | 1,697 | 通信機器 |
| C&S PAPER CO LTD | — | 78 | 222 | 3,699 | 家庭用品 |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD | 5 | 8.4 | 66 | 1,103 | 電子装置・機器・部品 |
| ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 27 | 179 | 2,983 | 医薬品 |
| GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD | — | 16 | 137 | 2,294 | ヘルスケア機器・用品 |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD | 29 | 13.3 | 115 | 1,924 | ヘルスケア機器・用品 |
| BGI GENOMICS CO LTD | — | 13 | 164 | 2,744 | バイオテクノロジー |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD | — | 30 | 198 | 3,310 | 化学 |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | 16 | 20 | 257 | 4,286 | バイオテクノロジー |
| CAITONG SECURITIES CO LTD | 127 | 127 | 135 | 2,246 | 資本市場 |
| BANK OF CHENGDU CO LTD | 270 | 270 | 284 | 4,731 | 銀行 |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD | — | 19 | 248 | 4,143 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| NANJING SECURITIES CO LTD | 98 | 98 | 92 | 1,541 | 資本市場 |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD | 144 | 144 | 207 | 3,450 | 電子装置・機器・部品 |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD | 34 | 36 | 1,447 | 24,095 | ヘルスケア機器・用品 |
| OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD | — | 53 | 133 | 2,222 | 各種消費者サービス |
| HUAXI SECURITIES CO LTD | 155 | 155 | 154 | 2,576 | 資本市場 |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC | 11 | 12 | 307 | 5,122 | ソフトウェア |
| OVCTEK CHINA INC | — | 29 | 281 | 4,692 | ヘルスケア機器・用品 |
| SG MICRO CORP | — | 6 | 150 | 2,502 | 半導体・半導体製造装置 |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD | 41 | 77 | 2,570 | 42,777 | 電気設備 |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC | 6 | 24.4 | 424 | 7,065 | 半導体・半導体製造装置 |
| WUXI APPTTEC CO LTD | 32 | 55.6 | 748 | 12,458 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD | 25 | 35 | 337 | 5,610 | 電子装置・機器・部品 |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD | — | 10 | 710 | 11,830 | 電子装置・機器・部品 |
| WILL SEMICONDUCTOR LTD | 14 | 37 | 1,035 | 17,227 | 半導体・半導体製造装置 |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD | — | 967 | 482 | 8,029 | 資本市場 |
| PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD | — | 817 | 192 | 3,208 | 金属・鉱業 |
| PROYA COSMETICS CO LTD | — | 9 | 153 | 2,552 | パーソナル用品 |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD | — | 609 | 353 | 5,888 | 陸運・鉄道 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD | — | 1,077 | 591 | 9,839 | 銀行 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD | — | 61 | 440 | 7,329 | 食品 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|-------|-----------|-------------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | |
| INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD | — | 8 | 119 | 1,981 | ヘルスケア機器・用品 |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD | — | 6 | 141 | 2,359 | 食品 |
| PETROCHINA CO LTD | 128 | 1,109 | 477 | 7,954 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD | 1,633 | 2,118 | 1,150 | 19,138 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD | 2,306 | 2,744 | 919 | 15,297 | 銀行 |
| BANK OF CHINA LTD | 840 | 840 | 278 | 4,640 | 銀行 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP | 351 | 421 | 187 | 3,117 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 100 | 100 | 306 | 5,097 | 保険 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD | 61 | 155 | 307 | 5,112 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD | 647 | 736 | 3,660 | 60,921 | 銀行 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD | 339 | 377 | 2,853 | 47,492 | 保険 |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD | 653 | 688 | 1,437 | 23,917 | 銀行 |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD | 948 | 978 | 1,030 | 17,153 | 銀行 |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD | 1,399 | 1,382 | 682 | 11,361 | 銀行 |
| SAIC MOTOR CORP LTD | 175 | 239 | 489 | 8,145 | 自動車 |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD | 37 | 46 | — | 157,307 | 飲料 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD | 1,232 | 1,265 | 618 | 10,293 | 銀行 |
| CITIC SECURITIES CO LTD | 404 | 466 | 1,103 | 18,355 | 資本市場 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD | 165 | 325 | 1,129 | 18,788 | 保険 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD | 383 | 383 | 177 | 2,950 | 運送インフラ |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD | 628 | 758 | 1,551 | 25,820 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| DAQIN RAILWAY CO LTD | 661 | 977 | 675 | 11,234 | 陸運・鉄道 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD | 1,598 | 1,097 | 428 | 7,137 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD | 1,467 | — | — | — | 建設・土木 |
| CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD | 736 | — | — | — | 機械 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD | 242 | 661 | 719 | 11,967 | 資本市場 |
| HUAXIA BANK CO LTD | 229 | 1,129 | 709 | 11,798 | 銀行 |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD | 228 | 163 | 636 | 10,584 | 食品 |
| BANK OF BEIJING CO LTD | 880 | 879 | 416 | 6,933 | 銀行 |
| CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD | 795 | — | — | — | 無線通信サービス |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD | 407 | 705 | 583 | 9,702 | 金属・鉱業 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD | 107 | 140 | 705 | 11,739 | 建設資材 |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD | 157 | 335 | 619 | 10,302 | 資本市場 |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL INC | — | 78 | 32 | 536 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD | — | 165 | 540 | 9,000 | 自動車 |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD | 246 | 451 | 653 | 10,875 | 不動産管理・開発 |
| CRRC CORP LTD | 1,101 | — | — | — | 機械 |
| JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD | 138 | 196.6 | 1,584 | 26,376 | 医薬品 |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD | 366 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD | 298 | — | — | — | 建設・土木 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD | 197 | 461 | 774 | 12,880 | 資本市場 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD | 497 | — | — | — | 建設・土木 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 71 | 120 | 561 | 9,349 | 保険 |
| HAIER SMART HOME CO LTD | 286 | 317 | 997 | 16,601 | 家庭用耐久財 |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD | 333 | 270 | 859 | 14,306 | 機械 |
| GD POWER DEVELOPMENT CO LTD | 618 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK CORP | — | 766 | 556 | 9,254 | 銀行 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 36 | 79 | 339 | 5,643 | 医薬品 |
| GEMDALE CORP | 106 | 106 | 127 | 2,116 | 不動産管理・開発 |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD | 75 | 221 | 518 | 8,624 | 半導体・半導体製造装置 |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD | 71 | 103 | 1,066 | 17,748 | 化学 |
| CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD | 99 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| SHANGHAI ORIENTAL PEARL GROUP CO LTD | 384 | — | — | — | メディア |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD | 700 | 935 | 956 | 15,917 | 金属・鉱業 |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD | 159 | 580 | 503 | 8,377 | 資本市場 |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD | 120 | 316 | 315 | 5,248 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD | 145 | 243 | 733 | 12,212 | 電気設備 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|---|----------|--------|------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD | 298 | 298 | 132 | 2,206 | エネルギー設備・サービス |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD | 82 | 67 | 1,915 | 31,871 | 専門小売り |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD | 1,739 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD | 73 | 6 | 52 | 877 | 飲料 |
| NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD | 669 | — | — | — | 運送インフラ |
| AVIC CAPITAL CO LTD | 322 | 250 | 99 | 1,651 | 各種金融サービス |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD | 658 | 951 | 402 | 6,694 | 金属・鉱業 |
| AIR CHINA LTD | 284 | 284 | 260 | 4,329 | 旅客航空輸送業 |
| TBEA CO LTD | 457 | 267 | 299 | 4,989 | 電気設備 |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD | 425 | 314 | 206 | 3,443 | 建設・土木 |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD | 336 | — | — | — | 建設・土木 |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD | 264 | 843 | 332 | 5,527 | 建設・土木 |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD | 33 | 33 | 184 | 3,071 | 運送インフラ |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | 69 | 69 | 189 | 3,158 | 医薬品 |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LTD | — | 343 | 159 | 2,659 | 資本市場 |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD | 84 | 83 | 228 | 3,795 | 自動車部品 |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD | 148 | 148 | 187 | 3,113 | 資本市場 |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD | 48 | 48 | 67 | 1,119 | 化学 |
| SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD | 237 | 237 | 288 | 4,799 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD | 187 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AECC AVIATION POWER CO LTD | 93 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| BANK OF NANJING CO LTD | 156 | 291 | 269 | 4,479 | 銀行 |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | 76 | 76 | 131 | 2,191 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD | — | 22 | 33 | 549 | 海運業 |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD | 618 | 602 | 336 | 5,600 | 金属・鉱業 |
| ZHONGJIN GOLD CORP LTD | — | 327 | 279 | 4,658 | 金属・鉱業 |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD | 282 | 282 | 244 | 4,073 | 資本市場 |
| BEIJING TONGRENTANG CO LTD | 106 | — | — | — | 医薬品 |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD | 68 | 95.2 | 192 | 3,195 | 金属・鉱業 |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD | 76 | 76 | 255 | 4,252 | 電気設備 |
| BBMG CORP | 542 | 542 | 156 | 2,606 | 建設資材 |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD | 294 | 294 | 187 | 3,121 | 食品・生活必需品小売り |
| YANZHOU COAL MINING CO LTD | 186 | 186 | 278 | 4,633 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ZHENGZHOU YUTONG BUS CO LTD | — | 125 | 183 | 3,057 | 機械 |
| SHENERGY CO LTD | 464 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD | 882 | 386 | 220 | 3,667 | 旅客航空輸送業 |
| LIAONING CHENG DA CO LTD | — | 16 | 35 | 585 | 販売 |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD | 150.19 | 150.19 | 181 | 3,016 | 電気設備 |
| AISINO CORP | 103 | — | — | — | ソフトウェア |
| SHANXI LUJIAN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD | — | 77 | 49 | 830 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HUNDSUN TECHNOLOGIES INC | 18 | 56.4 | 464 | 7,724 | ソフトウェア |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD | 65 | 162.5 | 584 | 9,724 | ソフトウェア |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | 327 | 327 | 223 | 3,716 | 旅客航空輸送業 |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD | 1,068 | 590 | 175 | 2,916 | 建設・土木 |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | 17 | 126 | 567 | 9,450 | 自動車部品 |
| XIAMEN C & D INC | 304 | 189 | 165 | 2,748 | 商社・流通業 |
| YOUNGOR GROUP CO LTD | — | 256 | 201 | 3,352 | 不動産管理・開発 |
| AVIC HELICOPTER CO LTD | 46 | 46 | 236 | 3,933 | 航空宇宙・防衛 |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD | 168 | 168 | 147 | 2,460 | 資本市場 |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD | — | 147 | 482 | 8,021 | 医薬品 |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD | 850 | 394 | 224 | 3,737 | 化学 |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD | 140 | 196 | 178 | 2,977 | 電気設備 |
| ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD | 17 | 18 | 556 | 9,255 | 医薬品 |
| TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 90 | 109 | 1,824 | 医薬品 |
| GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | — | 266 | 129 | 2,160 | 金属・鉱業 |
| SHANXI XINGHUAJUN FEN WINE FACTORY CO LTD | 17 | 27 | 947 | 15,770 | 飲料 |
| FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD | 114 | 12 | 22 | 369 | 通信機器 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--|----------|--------|------------|-------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD | — | 263 | 129 | 2,162 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHANGHAI AJ GROUP CO LTD | 157 | — | — | — | 各種金融サービス |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD | — | 250 | 305 | 5,079 | 専門小売り |
| CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD | — | 259 | 183 | 3,047 | 航空宇宙・防衛 |
| CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD | — | 31 | 159 | 2,655 | ソフトウェア |
| ZHEJIANG JUHUA CO LTD | — | 226 | 199 | 3,324 | 化学 |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD | 1,602 | 262 | 96 | 1,613 | 金属・鉱業 |
| BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD | — | 54 | 195 | 3,257 | バイオテクノロジー |
| SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD | 129 | 129 | 94 | 1,573 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD | 126 | 126 | 135 | 2,258 | 電気設備 |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD | — | 300 | 195 | 3,250 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| JIANGSU HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD | — | 42 | 214 | 3,574 | 食品 |
| INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD | — | 199 | 203 | 3,391 | 機械 |
| JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD | — | 64 | 129 | 2,157 | バイオテクノロジー |
| ZHEJIANG HUAIHAI PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 58.3 | 109 | 1,825 | 医薬品 |
| GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD | 119 | 119 | 153 | 2,554 | 運送インフラ |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD | — | 118 | 158 | 2,639 | 医薬品 |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD | 45 | 45 | 107 | 1,788 | 電子装置・機器・部品 |
| TONGWEI CO LTD | 116 | 103 | 326 | 5,428 | 食品 |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD | — | 11 | 68 | 1,134 | ソフトウェア |
| CHONGQING BREWERY CO LTD | — | 25 | 306 | 5,100 | 飲料 |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD | 53 | 53 | 291 | 4,848 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HUAXIN CEMENT CO LTD | — | 56 | 130 | 2,178 | 建設資材 |
| CHINA RAILWAY HI-TECH INDUSTRY CO LTD | 228 | — | — | — | 建設・土木 |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD | — | 93 | 334 | 5,571 | 化学 |
| CHINA JUSHI CO LTD | 234 | 234 | 428 | 7,126 | 建設資材 |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD | 53 | 22.24 | 185 | 3,094 | 機械 |
| HENG TONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD | 67 | 40 | 48 | 810 | 通信機器 |
| TONGKUN GROUP CO LTD | — | 157 | 321 | 5,355 | 化学 |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD | — | 17 | 201 | 3,347 | 化学 |
| ANGEL YEAST CO LTD | — | 49 | 287 | 4,783 | 食品 |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD | 65 | 128 | 1,092 | 18,180 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD | — | 18 | 337 | 5,613 | 自動車部品 |
| HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD | — | 68 | 134 | 2,233 | 医薬品 |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD | 323.51 | 323.51 | 367 | 6,110 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD | 74 | 102.8 | 1,716 | 28,568 | 食品 |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD | — | 50 | 263 | 4,384 | 飲料 |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP | 124 | 12 | 22 | 379 | 自動車部品 |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD | 58 | 58 | 294 | 4,899 | 電気設備 |
| DONGXING SECURITIES CO LTD | 132 | 132 | 144 | 2,409 | 資本市場 |
| JUNEYAO AIRLINES CO LTD | 128 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD | 215 | 506 | 810 | 13,481 | 資本市場 |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD | 214 | 597 | 318 | 5,295 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD | — | 34 | 215 | 3,587 | 飲料 |
| HUAAN SECURITIES CO LTD | 165 | 165 | 102 | 1,707 | 資本市場 |
| BANK OF JIANGSU CO LTD | 218 | 1,173 | 726 | 12,082 | 銀行 |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD | 236 | 236 | 355 | 5,910 | 銀行 |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD | — | 90 | 481 | 8,005 | 自動車部品 |
| AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD | — | 11 | 125 | 2,086 | ヘルスケア機器・用品 |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD | — | 20 | 43 | 727 | 医薬品 |
| SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD | 12 | 12 | 126 | 2,099 | 半導体・半導体製造装置 |
| JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD | — | 15 | 122 | 2,046 | 家庭用耐久財 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD | — | 392 | 392 | 6,529 | 資本市場 |
| SDIC CAPITAL CO LTD | 65 | 433 | 558 | 9,288 | 資本市場 |
| CHINA GRAND AUTOMOTIVE SERVICES CO LTD | 351 | — | — | — | 専門小売り |
| TOPCHOICE MEDICAL CORP | — | 8 | 223 | 3,720 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD | — | 48 | 378 | 6,294 | 半導体・半導体製造装置 |

| 銘 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|--------------------------|--------------------|--------------------|--------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| TOLY BREAD CO LTD | — | 36 | 181 | 3,015 | 食品 |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD | — | 22 | 185 | 3,088 | 食品・生活必需品小売り |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD | 21 | 29.4 | 256 | 4,270 | 機械 |
| ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA | 449 | 194 | 171 | 2,847 | 資本市場 |
| SPRING AIRLINES CO LTD | 75 | 42 | 250 | 4,168 | 旅客航空輸送業 |
| EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD | 160 | 160 | 252 | 4,193 | 資本市場 |
| DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD | 75 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| SHANGHAI M&G STATIONERY INC | — | 63 | 574 | 9,560 | 商業サービス・用品 |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LTD | 292 | 292 | 162 | 2,711 | 不動産管理・開発 |
| FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD | 106 | 107 | 508 | 8,456 | 不動産管理・開発 |
| 小 計 | 株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 64,044.54 259銘柄 | 76,994.14 358銘柄 | 143,687 — | 2,391,132 <4.1%> |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千マレーシア・リンギット | 千円 | |
| AMMB HOLDINGS BHD | 844 | 814 | 246 | 6,491 | 銀行 |
| GENTING PLANTATIONS BHD | 141 | 141 | 125 | 3,314 | 食品 |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 2,774 | 3,589 | 1,539 | 40,525 | 銀行 |
| DIGI.COM BHD | 1,208 | 2,353 | 1,000 | 26,321 | 無線通信サービス |
| MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD | 588.2 | 897.2 | 567 | 14,948 | 運送インフラ |
| RHB BANK BHD | 577.8 | 834.8 | 442 | 11,645 | 銀行 |
| HAP SENG CONSOLIDATED BHD | 344 | 317 | 262 | 6,900 | コングロマリット |
| TOP GLOVE CORP BHD | 563 | 2,627 | 1,463 | 38,513 | ヘルスケア機器・用品 |
| GAMUDA BHD | 696 | 1,002 | 352 | 9,283 | 建設・土木 |
| GENTING BHD | 1,367 | 1,072 | 523 | 13,769 | ホテル・レストラン・レジャー |
| YTL CORP BHD | 1,070.1 | — | — | — | 総合公益事業 |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD | 87.56 | 252.56 | 422 | 11,128 | 銀行 |
| HONG LEONG BANK BHD | 237.08 | 349.08 | 629 | 16,556 | 銀行 |
| IJM CORP BHD | 1,080.6 | — | — | — | 建設・土木 |
| IOI CORP BHD | 1,222.13 | 1,908.13 | 776 | 20,440 | 食品 |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD | 265 | 226 | 500 | 13,181 | 食品 |
| FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | 88 | 116 | 348 | 9,159 | 飲料 |
| MALAYAN BANKING BHD | 1,785.75 | 2,543.75 | 2,106 | 55,437 | 銀行 |
| MISC BHD | 561.8 | 1,008.8 | 688 | 18,108 | 海運業 |
| NESTLE MALAYSIA BHD | 29 | 41 | 559 | 14,730 | 食品 |
| PPB GROUP BHD | 262.6 | 462.6 | 859 | 22,623 | 食品 |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 208 | 223 | 451 | 11,891 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETRONAS GAS BHD | 394 | 396 | 625 | 16,468 | ガス |
| GENTING MALAYSIA BHD | 1,396 | 2,198 | 641 | 16,893 | ホテル・レストラン・レジャー |
| TELEKOM MALAYSIA BHD | 567 | 595 | 351 | 9,239 | 各種電気通信サービス |
| TENAGA NASIONAL BHD | 1,524.5 | 1,396.5 | 1,407 | 37,051 | 電力 |
| QL RESOURCES BHD | 372 | 509.5 | 308 | 8,126 | 食品 |
| DIALOG GROUP BHD | 1,504.44 | 2,339.44 | 725 | 19,088 | エネルギー設備・サービス |
| PUBLIC BANK BHD(LOCAL) | 1,545.3 | 8,914.5 | 3,744 | 98,547 | 銀行 |
| AIRASIA GROUP BHD | 555 | — | — | — | 旅客航空輸送業 |
| CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD | 70 | — | — | — | 飲料 |
| KOSSAN RUBBER INDUSTRIES | — | 828 | 318 | 8,390 | ヘルスケア機器・用品 |
| SUPERMAX CORP BHD | — | 745.71 | 395 | 10,422 | ヘルスケア機器・用品 |
| SIME DARBY BERHAD | 1,531 | 1,395 | 326 | 8,591 | コングロマリット |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 765 | 1,072 | 1,084 | 28,554 | ヘルスケア機器・用品 |
| AXIATA GROUP BERHAD | 1,528 | 1,701 | 646 | 17,013 | 無線通信サービス |
| MAXIS BHD | 910 | 1,308 | 614 | 16,180 | 無線通信サービス |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 1,323 | 1,362 | 1,080 | 28,428 | 化学 |
| IHH HEALTHCARE BHD | 1,148 | 1,687 | 909 | 23,933 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 145 | 357 | 144 | 3,805 | 運送インフラ |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD | 880 | 788 | 851 | 22,400 | 金属・鋳業 |
| SIME DARBY PLANTATION BHD | 876 | 934 | 418 | 11,013 | 食品 |
| 小 計 | 株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 33,034.86 40銘柄 | 49,304.57 38銘柄 | 28,461 — | 749,121 <1.3%> |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 | |
|--|------------------|----------|--------|---------|-------------------------|--------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | — | 71.63 | 2,005 | 15,225 | 金属・鉱業 | |
| BIDVEST GROUP LTD | 159.91 | 162 | 2,869 | 21,775 | コングロマリット | |
| CLICKS GROUP LTD | 108.58 | 155.31 | 3,834 | 29,105 | 食品・生活必需品小売り | |
| DISCOVERY LTD | 226.58 | 211.37 | 2,972 | 22,559 | 保険 | |
| GOLD FIELDS LTD | 437.64 | 557.34 | 7,972 | 60,508 | 金属・鉱業 | |
| REMGRO LTD | 228.62 | 260 | 2,896 | 21,987 | 各種金融サービス | |
| THE FOSCHINI GROUP LTD | 75.72 | — | — | — | 専門小売り | |
| NORTHAM PLATINUM LTD | 126.32 | 236.02 | 6,510 | 49,415 | 金属・鉱業 | |
| MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD | 395.05 | — | — | — | 保険 | |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD | — | 285.37 | 1,892 | 14,360 | 金属・鉱業 | |
| EXXARO RESOURCES LTD | 79.98 | 141.15 | 2,544 | 19,316 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 26.28 | 38.02 | 5,327 | 40,435 | 銀行 | |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 54.22 | — | — | — | 保険 | |
| MTN GROUP LTD | 867.7 | 1,063.52 | 9,867 | 74,893 | 無線通信サービス | |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 216.67 | 265.08 | 8,488 | 64,430 | 金属・鉱業 | |
| TELKOM SA SOC LTD | 74.7 | — | — | — | 各種電気通信サービス | |
| FIRSTRAND LTD | 1,694.08 | 3,039.68 | 15,946 | 121,031 | 各種金融サービス | |
| PSG GROUP LTD | 49.09 | — | — | — | コングロマリット | |
| NASPERS LTD | 217.22 | 265.6 | 94,288 | 715,645 | インターネット販売・通信販売 | |
| NEDBANK GROUP LTD | 213.34 | 234.74 | 3,481 | 26,422 | 銀行 | |
| PICK'N PAY STORES LTD | 149.15 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り | |
| RMB HOLDINGS LTD | 412 | — | — | — | 各種金融サービス | |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 30.72 | 29.67 | 6,188 | 46,967 | 金属・鉱業 | |
| SASOL LTD | 228.48 | 312.58 | 7,299 | 55,399 | 化学 | |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 192.18 | 325.94 | 4,835 | 36,700 | 食品・生活必需品小売り | |
| MR PRICE GROUP LTD | 148.01 | 182.1 | 3,596 | 27,294 | 専門小売り | |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 649.38 | 842.71 | 10,372 | 78,724 | 銀行 | |
| SPAR GROUP LTD/THE | 80.76 | 94.14 | 1,806 | 13,713 | 食品・生活必需品小売り | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 611.53 | 542.19 | 2,877 | 21,843 | 複合小売り | |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | 206.4 | 241.12 | 3,563 | 27,047 | 医薬品 | |
| ABSA GROUP LTD | 307.37 | 391.86 | 5,009 | 38,019 | 銀行 | |
| TIGER BRANDS LTD | 72.48 | 118.03 | 2,438 | 18,510 | 食品 | |
| SANLAM LTD | 960.98 | 1,195.61 | 6,813 | 51,716 | 保険 | |
| INVESTEC LTD | 252.13 | — | — | — | 資本市場 | |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 412.26 | 489.66 | 14,002 | 106,281 | 金属・鉱業 | |
| KUMBA IRON ORE LTD | 30.74 | 31.73 | 2,044 | 15,514 | 金属・鉱業 | |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD | 806.61 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| RMI HOLDINGS | 482.13 | 358.36 | 1,110 | 8,426 | 保険 | |
| VODACOM GROUP PTY LTD | 323.22 | 432.18 | 5,502 | 41,760 | 無線通信サービス | |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 151.82 | 221.85 | 2,120 | 16,097 | 不動産管理・開発 | |
| OLD MUTUAL LTD | 2,218.19 | 2,929.73 | 3,937 | 29,886 | 保険 | |
| REINET INVESTMENTS SCA | 80.54 | 77.43 | 2,241 | 17,011 | 資本市場 | |
| PEPKOR HOLDINGS LTD | 166.33 | — | — | — | 専門小売り | |
| MULTICHOICE GROUP LTD | 249.88 | 272.58 | 3,489 | 26,481 | メディア | |
| SIBANYE STILLWATER LTD | 912.18 | 1,755.33 | 12,799 | 97,150 | 金属・鉱業 | |
| BID CORP LTD | 175.18 | 180.86 | 5,363 | 40,706 | 食品・生活必需品小売り | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 44銘柄 | 36銘柄 | 278,309 | 2,112,368 | <3.6%> |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | |
| BANGKOK BANK PCL | 235 | 277 | 3,420 | 11,904 | 銀行 | |
| BERLI JUCKER PCL NVDR | 779 | 1,011 | 3,740 | 13,017 | 食品・生活必需品小売り | |
| KRUNG THAI BANK PCL NVDR | 1,462 | 1,036 | 1,181 | 4,110 | 銀行 | |
| RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR | 236 | 342 | 1,701 | 5,921 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR | 297 | 432 | 4,514 | 15,710 | 銀行 | |
| TRUE CORP PCL NVDR | 5,859.55 | 5,093.55 | 1,660 | 5,778 | 各種電気通信サービス | |
| KASIKORNBANK PCL NVDR | 352 | 267 | 3,591 | 12,497 | 銀行 | |
| TMB BANK PCL -NVDR | 13,362 | — | — | — | 銀行 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 業種等 |
|--|------------------|-------------------|-------------------|--------------|-------------------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千タイ・パーツ | 千円 | |
| IRPC PCL NVDR | 3,796 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR | 2,119 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR | 164 | 124 | 2,170 | 7,551 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHIN CORP PCL | 1,002 | 1,366 | 7,991 | 27,809 | 無線通信サービス |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PCL | 2,092 | 2,497 | 7,366 | 25,634 | 食品 |
| ADVANCED INFO SERVICE PCL | 585 | 664 | 11,155 | 38,820 | 無線通信サービス |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 3,186.2 | 4,308.2 | 6,031 | 20,989 | 専門小売り |
| DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR | — | 208 | 7,737 | 26,926 | 電子装置・機器・部品 |
| PTT PCL | 5,678 | 7,056 | 28,047 | 97,605 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 1,464 | 1,471 | 2,147 | 7,473 | 食品 |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR | — | 656 | 4,952 | 17,235 | 消費者金融 |
| LAND AND HOUSES PCL NVDR | 3,678 | 6,511 | 5,404 | 18,806 | 不動産管理・開発 |
| SIAM CEMENT PCL NVDR | 386.5 | 489.5 | 20,069 | 69,841 | 建設資材 |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR | 2,107 | 2,345 | 15,359 | 53,451 | 運送インフラ |
| KASIKORN BANK PCL - FOREIGN | 566 | 686 | 9,261 | 32,228 | 銀行 |
| CENTRAL PATTANA PCL NVDR | 1,178 | 1,328 | 7,005 | 24,378 | 不動産管理・開発 |
| BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR | 4,221 | 5,106 | 11,182 | 38,913 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR | 239 | 415 | 5,727 | 19,929 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 1,265.1 | 1,695.1 | 5,127 | 17,844 | ホテル・レストラン・レジャー |
| THAI OIL PCL NVDR | 813 | 858 | 4,783 | 16,646 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CP ALL PCL NVDR | 2,843 | 3,704 | 23,705 | 82,495 | 食品・生活必需品小売り |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL | 4,168 | 3,561 | 3,204 | 11,153 | 陸運・鉄道 |
| PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR | 728.45 | 706.45 | 8,194 | 28,517 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL | 132 | 292 | 919 | 3,200 | 無線通信サービス |
| INDORAMA VENTURES PCL NVDR | 536.22 | 1,234.22 | 5,677 | 19,757 | 化学 |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 1,246.08 | 1,452.08 | 9,075 | 31,582 | 化学 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR | 934 | 760 | 4,465 | 15,538 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR | 4,208 | 6,136 | 4,908 | 17,082 | 運送インフラ |
| B GRIMM POWER PCL NVDR | 481 | 566 | 2,447 | 8,518 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR | 1,220 | 2,077 | 6,802 | 23,671 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| OSOTSPA PCL NVDR | 267 | 237 | 799 | 2,783 | 飲料 |
| BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR | — | 1,053 | 2,148 | 7,475 | 資本市場 |
| ASSET WORLD CORP PCL NVDR | — | 3,536 | 1,676 | 5,832 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR | 614.33 | 919.33 | 3,125 | 10,877 | 複合小売り |
| SRI SAWAD POWER 1979 PCL NVDR | 460 | 568 | 4,671 | 16,257 | 消費者金融 |
| SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR | — | 906 | 4,009 | 13,951 | ヘルスケア機器・用品 |
| PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR | — | 1,966 | 5,996 | 20,867 | 専門小売り |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR | 307 | 611 | 4,002 | 13,927 | 消費者金融 |
| GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR | 255 | 491 | 3,559 | 12,387 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 75,522.43 41銘柄 | 77,018.43 44銘柄 | 280,720 — | 976,906 <1.7%> |
| (ポーランド) | 百株 | 百株 | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | |
| BANK MILLENNIUM SA | 55.36 | — | — | — | 銀行 |
| MBANK | 6.68 | — | — | — | 銀行 |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA | 82.1 | 97.85 | 1,952 | 55,801 | 金属・鉱業 |
| BANK PEKAO SA | 68.11 | 97.3 | 741 | 21,204 | 銀行 |
| ORANGE POLSKA SA | 297.77 | 307.83 | 220 | 6,313 | 各種電気通信サービス |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN | 157.33 | 164.47 | 1,104 | 31,574 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LPP SA | 0.57 | 0.67 | 582 | 16,652 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SANTANDER BANK POLSKA SA | 24.25 | 16 | 338 | 9,686 | 銀行 |
| CD PROJEKT RED SA | 34.22 | 42.92 | 758 | 21,686 | 娯楽 |
| POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA | 440.83 | 578.12 | 1,916 | 54,782 | 銀行 |
| CCC SA | 20.25 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GRUPA LOTOS SA | 39.78 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA | 821.78 | 885.35 | 617 | 17,654 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CYFROWY POLSAT SA | 124.85 | 122.39 | 373 | 10,670 | メディア |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | 416.93 | 521.92 | 443 | 12,681 | 電力 |

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|--|--|---|--|---|--|----|--|-----|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ポーランド) POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA DINO POLSKA SA AMREST HOLDINGS SE ALLEGRO.EU SA | 百株 309.05 17.97 44 - | 百株 363.09 34.34 - | 千ポーランド・ズロチ 1,178 900 - | 千円 33,679 25,728 - | 保険 食品・生活必需品小売り ホテル・レストラン・レジャー インターネット販売・通信販売 | | | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ハンガリー) RICHTER GEDEON NYRT MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT OTP BANK NYRT | 百株 75.42 179.55 115.07 | 百株 83.93 307.03 137.82 | 千ハンガリー・フォリント 72,725 63,616 181,853 | 千円 26,184 22,904 65,474 | 医薬品 石油・ガス・消耗燃料 銀行 | | | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ユーロ圏・ベルギー) TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA | 百株 27 | 百株 - | 千ユーロ - | 千円 - | 建設資材 | | | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| (ユーロ圏・ギリシャ) ALPHA BANK A.E. NATIONAL BANK OF GREECE HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA FF GROUP EUROBANK ERGASIAS SERVICES MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN OPAP SA JUMBO SA | 百株 383.28 263.48 145.18 31.3 748.45 22.65 91.84 54.3 | 百株 - - 131.62 31.3 - - 112.46 81.43 | 千ユーロ - - 186 0 - - 139 125 | 千円 - - 24,295 0 - - 18,068 16,311 | 銀行 銀行 各種電気通信サービス 繊維・アパレル・贅沢品 銀行 石油・ガス・消耗燃料 ホテル・レストラン・レジャー 専門小売り | | | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 株数 | 株数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別(ユーロは国別)株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注4) 銘柄コード等の変更があった銘柄や普通株と優先株は、別銘柄として掲載しております。

(2) 外国新株予約権証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|--------------------------------------|-----------------|--------------|---------------|-------------|--------------|----------|
| | 証券数 | 証券数 | 証券数 | 証券数 | 評価額 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (タイ) MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | 証券 9,465 | 証券 9,465 | 証券 9,465 | 証券 9,465 | 千タイ・パーツ 6 | 千円 22 |
| 合計 | 証券数・金額 9,465 | 証券数 9,465 | 証券数・金額 1銘柄 | 証券数 1銘柄 | — | 22 |
| | 銘柄数<比率> | | 銘柄数<比率> | | — | <0.0%> |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|---|---|--|--|--|--|---|
| | □数 | □数 | □数 | □数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (メキシコ) FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D GRUPO TELEvisa SAB CEMEX SAB DE CV MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV FIBRA UNO ADMINISTRACION SA COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 千□ 96.1 103.8 688.475 25 184.9 23.3 | 千□ 121.8 141.9 948.675 28 173.9 41.5 | 千□ 121.8 141.9 948.675 28 173.9 41.5 | 千□ 121.8 141.9 948.675 28 173.9 41.5 | 千メキシコ・ペソ 19,446 7,394 14,268 2,182 4,345 3,907 | 千円 106,110 40,347 77,853 11,906 23,712 21,322 |
| 小計 | □数・金額 1,121,575 | □数 1,455,775 | □数・金額 6銘柄<0.3%> | □数 6銘柄<0.5%> | 51,544 | 281,252 |
| | 銘柄数<比率> | | 銘柄数<比率> | | — | — |
| (ブラジル) SUL AMERICA SA BANCO SANTANDER BRASIL SA ENERGISA SA KLABIN SA BANCO INTER SA BANCO BTG PACTUAL SA | 千□ 16.269 13.6 6.1 25.2 — 7.2 | 千□ 15.356 21.7 17.5 48.7 6.7 12.8 | 千□ 15.356 21.7 17.5 48.7 6.7 12.8 | 千□ 15.356 21.7 17.5 48.7 6.7 12.8 | 千ブラジル・レアル 495 840 759 1,434 1,283 1,294 | 千円 9,637 16,349 14,773 27,885 24,954 25,171 |
| 小計 | □数・金額 68,369 | □数 122,756 | □数・金額 5銘柄<0.1%> | □数 6銘柄<0.2%> | 6,108 | 118,772 |
| | 銘柄数<比率> | | 銘柄数<比率> | | — | — |
| (南アフリカ) REDEFINE PROPERTIES LTD GROWTHPOINT PROPERTIES LTD FORTRESS REIT LTD | 千□ 152.868 195.763 54.518 | 千□ — 259.878 — | 千□ — 259.878 — | 千□ — 259.878 — | 千南アフリカ・ランド — 3,513 — | 千円 — 26,667 — |
| 小計 | □数・金額 403,149 | □数 259,878 | □数・金額 3銘柄<0.1%> | □数 1銘柄<0.0%> | 3,513 | 26,667 |
| | 銘柄数<比率> | | 銘柄数<比率> | | — | — |
| 合計 | □数・金額 1,593,093 | □数 1,838,409 | □数・金額 14銘柄<0.4%> | □数 13銘柄<0.7%> | — | 426,693 |
| | 銘柄数<比率> | | 銘柄数<比率> | | — | — |

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 | 柄 | 別 | 当 期 | | 末 |
|----|------|------|-------|-------|-----|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 外国 | MINI | MSCI | EMG | MKT | |
| | | | | | |
| | | | 百万円 | | 百万円 |
| | | | 3,529 | | - |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|---------------------------|------------|-----|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| 株 式 | 千円 | | % |
| 株 式 | 54,202,064 | | 93.2 |
| 新 株 予 約 権 証 券 | 22 | | 0.0 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券 | 426,693 | | 0.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 3,557,058 | | 6.1 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 58,185,838 | | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、57,732,994千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年4月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円、1香港・ドル=13.98円、1台湾・ドル=3.834円、1イギリス・ポンド=150.16円、1トルコ・リラ=13.441円、1メキシコ・ペソ=5.456円、1フィリピン・ペソ=2.245円、100チリ・ペソ=15.432円、100コロンビア・ペソ=3.015円、1クウェート・ディナール=361.12円、1カタール・リアル=29.55円、1サウジアラビア・リアル=29.01円、1インド・ルピー=1.47円、1パキスタン・ルピー=0.71円、100インドネシア・ルピア=0.75円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=29.63円、1ブラジル・レアル=19.443円、1チェコ・コルナ=5.016円、100韓国・ウォン=9.73円、1オフショア・人民元=16.641円、1マレーシア・リンギット=26.32円、1南アフリカ・ランド=7.59円、1タイ・バーツ=3.48円、1ポーランド・ズロチ=28.585円、100ハンガリー・フォリント=36.004円、1ユーロ=129.99円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月19日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 58,509,394,890円 |
| コ ー ル ・ オ ー ン 等 | 1,276,474,139 |
| 株 式(評価額) | 54,202,064,012 |
| 新 株 予 約 権 証 券(評価額) | 22,727 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 376,312,788 |
| 投 資 証 券(評価額) | 50,380,494 |
| 未 収 入 金 | 373,640,526 |
| 未 収 配 当 金 | 165,569,137 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 2,064,931,067 |
| (B) 負 債 | 352,908,406 |
| 未 払 金 | 323,744,406 |
| 未 払 解 約 金 | 29,164,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B) | 58,156,486,484 |
| 元 本 | 39,168,921,759 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 18,987,564,725 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 39,168,921,759口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) | 14,848円 |

(注1) 期首元本額 42,338,367,514円
追加設定元本額 58,867,382,355円
一部解約元本額 62,036,828,110円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金> 7,303,162,651円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) 185,855,235円
M I T O ラップ型ファンド (安定型) 2,697,665円
M I T O ラップ型ファンド (中立型) 7,179,516円
M I T O ラップ型ファンド (積極型) 8,468,656円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 26,478,400円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 17,278,421円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 12,542,068円
たわらノーロード 新興国株式 7,174,858,507円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 1,931,172,828円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 1,470,308,318円
たわらノーロード バランス (堅実型) 13,218,963円
たわらノーロード バランス (標準型) 47,765,417円
たわらノーロード バランス (積極型) 75,926,200円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) 820,678円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 88,359,021円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 183,683,859円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 118,365,981円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) 197,378,656円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 241,783円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 1,840,624円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 979,657円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 2,408,534円

たわらノーロード 全世界株式 53,106,539円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド 164,452,087円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 394,963,051円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) 329,145,943円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) 368,217,240円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) 734,808,944円
投資のソムリエ 6,896,439,394円
クルーズコントロール 568,471,089円
投資のソムリエ<DC年金> 379,244,915円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 320,081,299円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) 10,065,760円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) 21,890,292円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 279,169,620円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,945,535,376円
ワールドアセットバランス (基本コース) 923,919,156円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 3,075,512,899円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 9,417,970円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 4,450,393円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 2,736,375円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 22,664,724円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 1,870,907,574円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 278,541,972円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 5,321,207円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 2,715,829円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 2,737,979円
エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用) 16,310,910円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 158,553,968円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定) 301,892,339円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定) 156,655,277円
期末元本合計 39,168,921,759円

■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|----------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 846,342,300円 | |
| | 受取配当金 | 844,040,668 | |
| | 受取利息 | 1,509,514 | |
| | その他の収益 | 958,033 | |
| | 支払利息 | △165,915 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | 18,837,435,578 | |
| | 売却益 | 21,609,017,908 | |
| | 売却損 | △2,771,582,330 | |
| (C) | 先物取引等取引損益 | 3,036,790,791 | |
| | 取引益 | 3,424,054,030 | |
| | 取引損 | △387,263,239 | |
| (D) | その他費用 | △229,252,031 | |
| (E) | 当期損益金(A+B+C+D) | 22,491,316,638 | |
| (F) | 前期繰越損益金 | △1,171,540,034 | |
| (G) | 解約差損益金 | △17,439,135,474 | |
| (H) | 追加信託差損益金 | 15,106,923,595 | |
| (I) | 合計(E+F+G+H) | 18,987,564,725 | |
| | 次期繰越損益金(I) | 18,987,564,725 | |

(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)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3) (H)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。

i シェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F

当ファンドは「グローバル8資産ラップファンド（安定型）／（中立型）／（積極型）」が投資対象とする外国投資信託です。

当ファンドの仕組みは以下の通りです。

| | |
|------|---|
| 運用方針 | 新興国の米ドル建ての債券等（国債・社債等）を主要投資対象として、J.P.モルガン E M B I グローバル・コア・インデックスに連動する運用成果をめざす E T F です。 |
| 運用会社 | ブラックロック・グループ |

以下は、2020年10月31日現在の財務諸表の原文を抜粋し、一部翻訳したものです。

損益計算書 2020年10月31日に終了した会計期間 (米ドル建て表示)

純投資収益

| | |
|----------------|-------------|
| 配当金－関連会社 | \$ 462,142 |
| 受取利息－関連会社以外 | 664,356,364 |
| 利息の現物支給－関連会社以外 | 24,347,042 |
| その他収入－関連会社以外 | 178,968 |
| 投資収益合計 | 689,344,516 |

費用

| | |
|--------|-------------|
| 投資顧問報酬 | 58,033,230 |
| 雑支出 | 264 |
| 費用合計 | 58,033,494 |
| 純投資収益 | 631,311,022 |

実現および未実現純利益（損失）

| | |
|----------------|----------------|
| 実現純利益（損失）： | |
| 投資－関連会社以外 | (448,337,489) |
| 現物償還－関連会社以外 | 122,240,841 |
| 実現純損失 | (326,096,648) |
| 未実現評価益（損）の純変動： | |
| 投資－関連会社以外 | (306,762,768) |
| 未実現評価益（損）の純変動 | (306,762,768) |
| 実現および未実現純損失 | (632,859,416) |
| 運用による純資産の純減 | \$ (1,548,394) |

投資明細書
2020年10月31日時点

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 | 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|--|--------------|---------------|
| Corporate Bonds & Notes^(a) | | | Indonesia — 1.1% | | |
| Azerbaijan — 0.4% | | | Indonesia Asahan Aluminium Persero PT | | |
| Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 03/24/26 ^(b) | \$ 55,500 | \$ 63,217,969 | 4.75%, 05/15/25 (Call 04/15/25) ^(b) | \$ 11,900 | \$ 12,926,375 |
| Bahrain — 0.2% | | | 5.45%, 05/15/30 (Call 02/15/30) ^(e) | 1,000 | 1,135,000 |
| Oil and Gas Holding Co. BSCC (The), 7.50%, 10/25/27 ^(b) | 28,450 | 29,956,962 | 5.45%, 05/15/30 (Call 02/15/30) ^(b) | 11,000 | 12,485,000 |
| Chile — 1.7% | | | 6.53%, 11/15/28 ^(b) | 8,784 | 10,617,660 |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile | | | Pelabuhan Indonesia II PT, 4.25%, 05/05/25 ^(b) | 9,743 | 10,528,529 |
| 3.00%, 09/30/29 (Call 06/30/29) ^(b) | 28,371 | 29,949,137 | Pertamina Persero PT | | |
| 3.15%, 01/14/30 (Call 10/14/29) ^(b) | 30,540 | 32,477,381 | 4.18%, 01/21/50 (Call 07/21/49) ^(b) | 11,486 | 11,414,212 |
| 3.63%, 08/01/27 (Call 05/01/27) ^(b) | 34,977 | 38,190,512 | 4.30%, 05/20/23 ^(b) | 17,594 | 18,853,071 |
| 3.70%, 01/30/50 (Call 07/30/49) ^(b) | 50,500 | 52,630,469 | 5.63%, 05/20/43 ^(b) | 14,059 | 16,484,177 |
| 4.38%, 02/05/49 (Call 08/05/48) ^(b) | 33,333 | 38,707,946 | 6.00%, 05/03/42 ^(b) | 12,236 | 14,882,035 |
| 4.50%, 09/16/25 ^(b) | 27,537 | 31,142,626 | 6.45%, 05/30/44 ^(b) | 15,395 | 20,051,988 |
| 4.50%, 08/01/47 (Call 02/01/47) ^(b) | 33,918 | 39,927,846 | Perusahaan Listrik Negara PT | | |
| Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA, 4.70%, 05/07/50 (Call 11/07/49) ^(b) | 28,625 | 34,487,400 | 4.13%, 05/15/27 ^(b) | 15,080 | 16,371,225 |
| | | 297,513,317 | 5.25%, 10/24/42 ^(b) | 9,747 | 11,178,591 |
| China — 2.6% | | | 5.45%, 05/21/28 ^(b) | 8,465 | 9,930,503 |
| Amber Circle Funding Ltd., 3.25%, 12/04/22 ^(b) | 8,835 | 9,152,508 | 6.15%, 05/21/48 ^(b) | 10,419 | 13,248,410 |
| China Minmetals Corp., 3.75%, (Call 11/13/22) ^{(b)(c)(d)} | 15,212 | 15,459,195 | Perusahaan Perseoran Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4.00%, 06/30/50 (Call 12/30/49) ^(b) | | |
| CNAC HK Finbridge Co. Ltd. | | | 11,200 | 11,077,500 | 191,184,276 |
| 3.00%, 09/22/30 ^(b) | 6,000 | 5,885,964 | Kazakhstan — 1.1% | | |
| 3.38%, 06/19/24 ^(b) | 17,150 | 17,771,688 | Development Bank of Kazakhstan JSC, 4.13%, 12/10/22 ^(b) | | |
| 4.13%, 07/19/27 ^(b) | 14,122 | 15,154,671 | 26,048 | 27,260,860 | |
| 4.63%, 03/14/23 ^(b) | 18,024 | 19,060,380 | KazMunayGas National Co. JSC | | |
| 5.13%, 03/14/28 ^(b) | 25,660 | 28,994,517 | 4.75%, 04/19/27 ^(b) | 28,576 | 32,165,860 |
| CNOOC Curtis Funding No. 1 Pty Ltd., 4.50%, 10/03/23 ^(b) | 20,540 | 22,536,231 | 5.38%, 04/24/30 ^(b) | 34,522 | 41,167,485 |
| Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd., 3.38%, (Call 09/03/24) ^{(b)(c)(d)} | 12,893 | 13,094,453 | 5.75%, 04/19/47 ^(b) | 32,535 | 40,441,005 |
| Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd., 4.88%, 05/17/42 ^(b) | 14,302 | 18,485,335 | 6.38%, 10/24/48 ^(b) | 41,524 | 54,866,699 |
| Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd., 4.38%, 10/17/23 ^(b) | 21,357 | 23,340,425 | | | 195,901,909 |
| Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd., 4.38%, 04/10/24 ^(b) | 20,913 | 22,952,018 | Malaysia — 1.7% | | |
| Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd., 3.25%, 04/28/25 ^(b) | 22,712 | 24,500,570 | Petronas Capital Ltd. | | |
| Sinopec Group Overseas Development 2017 Ltd., 3.63%, 04/12/27 ^(b) | 12,174 | 13,385,678 | 3.50%, 03/18/25 ^(b) | 42,934 | 47,160,316 |
| Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd. | | | 3.50%, 04/21/30 (Call 01/21/30) ^(b) | 63,414 | 70,614,026 |
| 2.15%, 05/13/25 (Call 04/13/25) ^(b) | 15,647 | 16,140,165 | 4.50%, 03/18/45 ^(b) | 37,477 | 48,017,406 |
| 2.70%, 05/13/30 (Call 02/13/30) ^(b) | 23,108 | 23,988,993 | 4.55%, 04/21/50 (Call 10/21/49) ^(b) | 74,312 | 92,716,481 |
| 2.95%, 11/12/29 (Call 08/12/29) ^(b) | 16,773 | 17,721,723 | 4.80%, 04/21/60 (Call 10/21/59) ^(b) | 27,672 | 37,313,962 |
| SPIC MTN Co. Ltd., 1.63%, 07/27/25 ^(b) | 16,741 | 16,709,852 | | | 295,822,191 |
| State Grid Overseas Investment 2013 Ltd., 3.13%, 05/22/23 ^(b) | 11,247 | 11,851,526 | Mexico — 2.5% | | |
| State Grid Overseas Investment 2014 Ltd., 4.13%, 05/07/24 ^(b) | 25,907 | 28,524,117 | Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/Cayman Islands, 4.38%, 10/14/25 ^(b) | | |
| State Grid Overseas Investment 2016 Ltd. | | | 6,140 | 6,606,256 | |
| 1.63%, 08/05/30 (Call 05/05/30) ^(b) | 20,779 | 19,999,788 | Comision Federal de Electricidad | | |
| 3.50%, 05/04/27 ^(b) | 31,985 | 35,423,387 | 4.75%, 02/23/27 ^(b) | 6,698 | 7,309,192 |
| Three Gorges Finance I Cayman Islands Ltd., 3.15%, 06/02/26 ^(b) | 16,439 | 17,870,179 | 4.88%, 01/15/24 ^(b) | 10,655 | 11,600,631 |
| | | 438,003,363 | Mexico City Airport Trust, 5.50%, 07/31/47 (Call 01/31/47) ^(b) | | |
| | | | 17,880 | 15,297,794 | |
| | | | Petroleos Mexicanos | | |
| | | | 3.50%, 01/30/23 | 9,660 | 9,418,500 |
| | | | 4.50%, 01/23/26 | 11,591 | 10,220,944 |
| | | | 4.88%, 01/18/24 | 9,383 | 9,166,429 |
| | | | 5.35%, 02/12/28 | 20,665 | 17,651,836 |
| | | | 5.95%, 01/28/31 (Call 10/28/30) | 28,181 | 23,552,271 |
| | | | 6.35%, 02/12/48 | 24,140 | 18,274,736 |
| | | | 6.38%, 01/23/45 | 13,656 | 10,213,049 |
| | | | 6.49%, 01/23/27 (Call 11/23/26) | 19,395 | 18,042,199 |
| | | | 6.50%, 03/13/27 | 47,356 | 43,715,507 |
| | | | 6.50%, 01/23/29 | 16,865 | 14,866,846 |
| | | | 6.50%, 06/02/41 | 12,914 | 9,976,065 |
| | | | 6.63%, 06/15/35 | 22,967 | 18,914,703 |
| | | | 6.75%, 09/21/47 | 50,652 | 39,229,974 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Mexico (continued) | | |
| 6.84%, 01/23/30 (Call 10/23/29) | \$ 36,822 | \$ 32,922,322 |
| 6.88%, 10/16/25 (Call 09/16/25) ^(e) | 5,500 | 5,395,500 |
| 6.88%, 08/04/26 | 24,329 | 23,353,407 |
| 6.95%, 01/28/60 (Call 07/28/59) | 34,266 | 26,796,012 |
| 7.69%, 01/23/50 (Call 07/23/49) | 69,106 | 57,354,525 |
| | | 429,878,698 |
| Panama — 0.2% | | |
| Banco Nacional de Panama | | |
| 2.50%, 08/11/30 (Call 05/11/30) ^(e) | 24,814 | 24,653,727 |
| 2.50%, 08/11/30 (Call 05/11/30) ^(b) | 1,100 | 1,092,894 |
| | | 25,746,621 |
| Peru — 0.4% | | |
| Petroleos del Peru SA | | |
| 4.75%, 06/19/32 ^(b) | 26,767 | 29,261,684 |
| 5.63%, 06/19/47 ^(b) | 27,657 | 31,698,034 |
| | | 60,959,718 |
| Philippines — 0.2% | | |
| Power Sector Assets & Liabilities Management Corp., | | |
| 7.39%, 12/02/24 ^(b) | 25,853 | 32,364,724 |
| Russia — 0.2% | | |
| Vnesheconombank Via VEB Finance PLC | | |
| 5.94%, 11/21/23 ^(b) | 17,772 | 19,593,630 |
| 6.80%, 11/22/25 ^(b) | 16,745 | 19,842,825 |
| | | 39,436,455 |
| South Africa — 0.4% | | |
| Eskom Holdings SOC Ltd. | | |
| 6.35%, 08/10/28 ^(b) | 22,029 | 22,710,522 |
| 6.75%, 08/06/23 ^(b) | 23,915 | 22,614,622 |
| 7.13%, 02/11/25 ^(b) | 28,605 | 26,781,431 |
| | | 72,106,575 |
| United Arab Emirates — 1.3% | | |
| Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4.60%, 11/02/47 ^(b) | | |
| 25,487 | | 30,385,283 |
| DP World Crescent Ltd. | | |
| 3.88%, 07/18/29 ^(b) | 10,600 | 11,037,250 |
| 3.91%, 05/31/23 ^(b) | 13,749 | 14,522,381 |
| 4.85%, 09/26/28 ^(b) | 10,700 | 11,877,000 |
| DP World PLC | | |
| 5.63%, 09/25/48 ^(b) | 16,844 | 19,181,105 |
| 6.85%, 07/02/37 ^(b) | 19,030 | 23,841,022 |
| DP World Salaam, 6.00%, (Call 01/01/26) ^{(b)(c)(d)} | 17,209 | 17,983,405 |
| MDGH - GMTN BV | | |
| 2.50%, 11/07/24 (Call 10/07/24) ^(b) | 12,128 | 12,677,550 |
| 2.50%, 05/21/26 (Call 04/21/26) ^(b) | 10,773 | 11,257,785 |
| 2.88%, 05/21/30 (Call 02/21/30) ^(b) | 11,746 | 12,472,784 |
| 3.95%, 05/21/50 (Call 11/21/49) ^(b) | 16,960 | 19,419,200 |
| MDGH-GMTN BV | | |
| 2.88%, 11/07/29 (Call 08/07/29) ^(b) | 14,153 | 15,055,254 |
| 3.70%, 11/07/49 (Call 05/07/49) ^(b) | 20,750 | 22,779,609 |
| | | 222,489,628 |
| Venezuela — 0.0% | | |
| Petroleos de Venezuela SA | | |
| 5.38%, 04/12/27 ^{(b)(f)} | 24,185 | 689,273 |
| 5.50%, 04/12/37 ^{(b)(f)} | 22,444 | 628,438 |
| 6.00%, 05/16/24 ^{(b)(f)} | 32,388 | 906,847 |
| 6.00%, 11/15/26 ^{(b)(f)} | 30,450 | 867,835 |
| 9.00%, 11/17/21 ^{(b)(f)} | 28,268 | 791,505 |
| 9.75%, 05/17/35 ^{(b)(f)} | 31,912 | 1,037,120 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|---|--------------|---------------|
| Venezuela (continued) | | |
| 12.75%, 02/17/22 ^{(b)(f)} | \$ 14,002 | \$ 392,064 |
| | | 5,313,082 |
| Total Corporate Bonds & Notes — 14.0% | | |
| (Cost: \$2,440,597,173) | | 2,399,895,488 |
| Foreign Government Obligations^(e) | | |
| Angola — 1.0% | | |
| Angolan Government International Bond | | |
| 8.00%, 11/26/29 ^(b) | 43,525 | 33,459,844 |
| 8.25%, 05/09/28 ^(b) | 45,640 | 35,770,350 |
| 9.13%, 11/26/49 ^(b) | 37,165 | 28,198,944 |
| 9.38%, 05/08/48 ^(b) | 48,340 | 36,919,675 |
| 9.50%, 11/12/25 ^(b) | 38,930 | 33,236,487 |
| | | 167,585,300 |
| Argentina — 1.4% | | |
| Argentine Republic Government International Bond | | |
| 0.13%, 07/09/30 (Call 11/30/20) ^(g) | 178,193 | 64,594,927 |
| 0.13%, 07/09/35 (Call 11/30/20) ^(g) | 227,062 | 74,362,737 |
| 0.13%, 01/09/38 (Call 11/30/20) ^(g) | 124,869 | 46,279,349 |
| 0.13%, 07/09/41 (Call 11/30/20) ^(g) | 106,515 | 36,088,622 |
| 0.13%, 07/09/46 (Call 11/30/20) ^(g) | 25,272 | 8,238,770 |
| 1.00%, 07/09/29 (Call 11/30/20) | 31,208 | 12,795,347 |
| | | 242,359,752 |
| Azerbaijan — 0.5% | | |
| Republic of Azerbaijan International Bond | | |
| 3.50%, 09/01/32 ^(b) | 29,300 | 28,329,438 |
| 4.75%, 03/18/24 ^(b) | 34,500 | 36,397,500 |
| State Oil Co. of the Azerbaijan Republic, 4.75%, | | |
| 03/13/23 ^(b) | 23,350 | 24,262,109 |
| | | 88,989,047 |
| Bahrain — 2.2% | | |
| Bahrain Government International Bond | | |
| 5.45%, 09/16/32 ^(e) | 18,200 | 17,796,187 |
| 5.45%, 09/16/32 ^(b) | 7,500 | 7,333,594 |
| 5.63%, 09/30/31 ^(b) | 26,945 | 26,641,869 |
| 6.00%, 09/19/44 ^(b) | 34,430 | 32,098,216 |
| 6.13%, 08/01/23 ^(b) | 40,480 | 43,098,550 |
| 6.75%, 09/20/29 ^(b) | 34,865 | 37,730,467 |
| 7.00%, 01/26/26 ^(b) | 30,240 | 34,142,850 |
| 7.00%, 10/12/28 ^(b) | 43,317 | 47,743,456 |
| 7.38%, 05/14/30 ^(b) | 27,290 | 30,215,147 |
| CBB International Sukuk Co. 5 SPC, 5.62%, 02/12/24 ^(b) | 25,980 | 27,368,306 |
| CBB International Sukuk Co. 7 SPC, 6.88%, 10/05/25 ^(b) | 24,643 | 27,792,683 |
| CBB International Sukuk Programme Co. SPC | | |
| 3.95%, 09/16/27 ^(e) | 20,050 | 19,899,625 |
| 3.95%, 09/16/27 ^(b) | 6,000 | 5,955,000 |
| 4.50%, 03/30/27 ^(b) | 25,860 | 26,466,094 |
| | | 384,279,044 |
| Bolivia — 0.1% | | |
| Bolivian Government International Bond, 4.50%, | | |
| 03/20/28 ^(b) | 23,630 | 20,491,641 |
| Brazil — 3.5% | | |
| Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e | | |
| Social, 5.75%, 09/26/23 ^(b) | 20,756 | 22,896,463 |
| Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais, 5.33%, | | |
| 02/15/28 ^(b) | 13,042 | 13,731,202 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Brazil (continued) | | |
| Brazilian Government International Bond | | |
| 2.63%, 01/05/23 | \$ 29,267 | \$ 30,263,907 |
| 2.88%, 06/06/25 | 22,923 | 23,182,316 |
| 3.88%, 06/12/30 | 39,063 | 39,551,288 |
| 4.25%, 01/07/25 | 67,416 | 72,998,887 |
| 4.50%, 05/30/29 (Call 02/28/29) | 33,908 | 36,376,926 |
| 4.63%, 01/13/28 (Call 10/13/27) | 51,247 | 55,474,877 |
| 4.75%, 01/14/50 (Call 07/14/49) | 42,200 | 41,408,750 |
| 5.00%, 01/27/45 | 51,245 | 52,702,280 |
| 5.63%, 01/07/41 | 36,000 | 39,442,500 |
| 5.63%, 02/21/47 | 44,637 | 48,933,311 |
| 6.00%, 04/07/26 | 37,386 | 43,391,126 |
| 7.13%, 01/20/37 | 25,274 | 31,687,278 |
| 8.25%, 01/20/34 | 17,165 | 23,237,119 |
| 8.88%, 04/15/24 | 16,474 | 20,355,686 |
| | | 595,633,916 |
| Chile — 1.2% | | |
| Chile Government International Bond | | |
| 2.45%, 01/31/31 (Call 10/31/30) | 43,190 | 44,836,619 |
| 3.24%, 02/06/28 (Call 11/06/27) | 54,221 | 60,134,478 |
| 3.50%, 01/25/50 (Call 07/25/49) | 62,820 | 69,200,156 |
| 3.86%, 06/21/47 | 33,563 | 38,933,080 |
| | | 213,104,333 |
| China — 1.1% | | |
| China Development Bank, 1.00%, 10/27/25 ^(b) | 5,000 | 4,967,450 |
| China Government International Bond | | |
| 0.40%, 10/21/23 ^(a) | 9,200 | 9,211,243 |
| 0.55%, 10/21/25 ^(a) | 8,400 | 8,360,268 |
| 1.20%, 10/21/30 ^(a) | 6,400 | 6,346,387 |
| 1.88%, 12/03/22 ^(b) | 17,500 | 18,046,875 |
| 1.95%, 12/03/24 ^(b) | 25,795 | 27,108,933 |
| 2.13%, 12/03/29 ^(b) | 24,970 | 26,686,687 |
| 2.63%, 11/02/27 ^(b) | 13,156 | 14,331,818 |
| 3.25%, 10/19/23 ^(b) | 23,563 | 25,529,038 |
| 3.50%, 10/19/28 ^(b) | 15,479 | 17,989,500 |
| Export-Import Bank of China (The) | | |
| 2.88%, 04/26/26 ^(b) | 15,523 | 16,900,511 |
| 3.63%, 07/31/24 ^(b) | 16,964 | 18,464,254 |
| | | 193,942,964 |
| Colombia — 3.4% | | |
| Colombia Government International Bond | | |
| 2.63%, 03/15/23 (Call 12/15/22) | 18,273 | 18,712,694 |
| 3.00%, 01/30/30 (Call 10/30/29) | 30,062 | 30,691,423 |
| 3.13%, 04/15/31 (Call 01/15/31) | 21,084 | 21,632,184 |
| 3.88%, 04/25/27 (Call 01/25/27) | 47,208 | 50,913,828 |
| 4.00%, 02/26/24 (Call 11/26/23) | 40,933 | 43,593,645 |
| 4.13%, 05/15/51 (Call 11/15/50) | 30,619 | 32,073,403 |
| 4.50%, 01/28/26 (Call 10/28/25) | 28,131 | 31,163,873 |
| 4.50%, 03/15/29 (Call 12/15/28) | 38,130 | 42,753,263 |
| 5.00%, 06/15/45 (Call 12/15/44) | 84,834 | 98,460,461 |
| 5.20%, 05/15/49 (Call 11/15/48) | 34,773 | 41,890,598 |
| 5.63%, 02/26/44 (Call 08/26/43) | 44,824 | 55,371,648 |
| 6.13%, 01/18/41 | 45,130 | 58,118,978 |
| 7.38%, 09/18/37 | 32,622 | 45,864,493 |
| 8.13%, 05/21/24 | 19,153 | 23,098,518 |
| | | 594,339,009 |
| Costa Rica — 0.6% | | |
| Costa Rica Government International Bond | | |
| 4.25%, 01/26/23 ^(b) | 23,998 | 21,868,177 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Costa Rica (continued) | | |
| 6.13%, 02/19/31 ^(b) | \$ 33,050 | \$ 27,297,234 |
| 7.00%, 04/04/44 ^(b) | 27,092 | 21,080,963 |
| 7.16%, 03/12/45 ^(b) | 36,040 | 28,449,075 |
| | | 98,695,449 |
| Croatia — 0.6% | | |
| Croatia Government International Bond | | |
| 5.50%, 04/04/23 ^(b) | 37,880 | 41,821,887 |
| 6.00%, 01/26/24 ^(b) | 48,261 | 55,650,966 |
| | | 97,472,853 |
| Dominican Republic — 2.9% | | |
| Dominican Republic International Bond | | |
| 4.50%, 01/30/30 ^(b) | 25,773 | 26,006,568 |
| 4.88%, 09/23/32 ^(a) | 28,400 | 28,941,375 |
| 4.88%, 09/23/32 ^(b) | 3,507 | 3,573,852 |
| 5.50%, 01/27/25 ^(b) | 38,071 | 40,676,484 |
| 5.88%, 04/18/24 ^(b) | 26,895 | 28,441,463 |
| 5.88%, 01/30/60 ^(a) | 2,500 | 2,399,219 |
| 5.88%, 01/30/60 ^(b) | 78,123 | 74,973,667 |
| 5.95%, 01/25/27 ^(b) | 43,680 | 47,652,150 |
| 6.00%, 07/19/28 ^(b) | 32,677 | 36,036,604 |
| 6.40%, 06/05/49 ^(b) | 39,748 | 40,443,590 |
| 6.50%, 02/15/48 ^(b) | 25,861 | 26,612,585 |
| 6.85%, 01/27/45 ^(b) | 51,668 | 55,446,222 |
| 6.88%, 01/29/26 ^(b) | 37,402 | 42,205,819 |
| 7.45%, 04/30/44 ^(b) | 36,988 | 42,258,790 |
| | | 495,668,388 |
| Ecuador — 1.5% | | |
| Ecuador Government International Bond | | |
| 0.00%, 07/31/30 ^{(a)(h)} | 26,894 | 12,110,670 |
| 0.00%, 07/31/30 ^{(b)(h)} | 1,257 | 565,905 |
| 0.05%, 07/31/40 ^{(b)(g)} | 1,568 | 776,712 |
| 0.50%, 07/31/30 ^{(a)(g)} | 98,965 | 65,316,605 |
| 0.50%, 07/31/30 ^{(b)(g)} | 3,259 | 2,151,205 |
| 0.50%, 07/31/35 ^{(a)(g)} | 221,528 | 121,840,400 |
| 0.50%, 07/31/35 ^{(b)(g)} | 6,807 | 3,744,142 |
| 0.50%, 07/31/40 ^{(a)(g)} | 89,838 | 44,497,836 |
| | | 251,003,475 |
| Egypt — 2.8% | | |
| Egypt Government International Bond | | |
| 5.58%, 02/21/23 ^(b) | 28,483 | 29,275,183 |
| 5.75%, 05/29/24 ^(b) | 34,138 | 34,927,441 |
| 5.88%, 06/11/25 ^(b) | 37,697 | 38,674,766 |
| 6.59%, 02/21/28 ^(b) | 29,629 | 29,823,440 |
| 7.05%, 01/15/32 ^(b) | 26,702 | 26,101,205 |
| 7.50%, 01/31/27 ^(b) | 46,530 | 49,220,016 |
| 7.60%, 03/01/29 ^(b) | 41,343 | 42,996,720 |
| 7.63%, 05/29/32 ^(b) | 37,850 | 38,311,297 |
| 7.90%, 02/21/48 ^(b) | 37,307 | 35,383,358 |
| 8.50%, 01/31/47 ^(b) | 62,139 | 61,672,958 |
| 8.70%, 03/01/49 ^(b) | 39,052 | 39,235,056 |
| 8.88%, 05/29/50 ^(b) | 49,569 | 50,049,200 |
| | | 475,670,640 |
| El Salvador — 0.4% | | |
| El Salvador Government International Bond | | |
| 7.12%, 01/20/50 (Call 07/06/49) ^(b) | 28,940 | 21,822,569 |
| 7.65%, 06/15/35 ^(b) | 25,600 | 20,304,000 |
| 9.50%, 07/15/52 (Call 01/15/52) ^(a) | 16,760 | 14,555,012 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| El Salvador (continued) | | |
| 9.50%, 07/15/52 (Call 01/15/52) ^(b) | \$ 11,892 | \$ 10,327,459 |
| | | 67,009,040 |
| Ethiopia — 0.1% | | |
| Ethiopia International Bond, 6.63%, 12/11/24 ^(b) | 25,200 | 25,326,000 |
| Gabon — 0.3% | | |
| CBB International Sukuk Programme Co. SPC, 6.25%, 11/14/24 ^(b) | 26,800 | 28,893,750 |
| Gabon Government International Bond, 6.63%, 02/06/31 ^(b) | 25,900 | 23,107,656 |
| | | 52,001,406 |
| Ghana — 1.3% | | |
| Ghana Government International Bond | | |
| 6.38%, 02/11/27 ^(b) | 31,783 | 29,458,868 |
| 7.63%, 05/16/29 ^(b) | 25,949 | 24,002,825 |
| 7.88%, 02/11/35 ^(b) | 25,170 | 22,330,509 |
| 8.13%, 01/18/26 ^(b) | 27,039 | 27,148,730 |
| 8.13%, 03/26/32 ^(b) | 33,082 | 30,363,073 |
| 8.63%, 06/16/49 ^(b) | 29,182 | 25,534,250 |
| 8.95%, 03/26/51 ^(b) | 28,536 | 25,566,473 |
| 10.75%, 10/14/30 ^(b) | 27,000 | 33,024,375 |
| | | 217,429,103 |
| Guatemala — 0.3% | | |
| Guatemala Government Bond, 6.13%, 06/01/50(Call 12/01/49) ^(b) | 36,300 | 44,796,469 |
| Hungary — 1.3% | | |
| Hungary Government International Bond | | |
| 5.38%, 02/21/23 | 42,682 | 47,110,257 |
| 5.38%, 03/25/24 | 52,200 | 59,866,875 |
| 5.75%, 11/22/23 | 48,932 | 56,195,344 |
| 7.63%, 03/29/41 | 32,764 | 58,319,920 |
| | | 221,492,396 |
| India — 0.5% | | |
| Export-Import Bank of India | | |
| 3.25%, 01/15/30 ^(b) | 26,030 | 26,477,391 |
| 3.38%, 08/05/26 ^(b) | 26,520 | 27,962,025 |
| 3.88%, 02/01/28 ^(b) | 27,200 | 28,740,064 |
| | | 83,179,480 |
| Indonesia — 3.9% | | |
| Indonesia Government International Bond | | |
| 2.85%, 02/14/30 | 13,992 | 14,722,208 |
| 2.95%, 01/11/23 | 7,462 | 7,766,226 |
| 3.38%, 04/15/23 ^(b) | 14,743 | 15,576,901 |
| 3.50%, 01/11/28 | 14,363 | 15,682,601 |
| 3.70%, 10/30/49 | 12,830 | 13,643,903 |
| 3.85%, 07/18/27 ^(b) | 9,719 | 10,864,020 |
| 3.85%, 10/15/30 | 19,266 | 21,963,240 |
| 4.10%, 04/24/28 | 11,480 | 13,008,275 |
| 4.13%, 01/15/25 ^(b) | 22,701 | 25,254,862 |
| 4.20%, 10/15/50 | 19,354 | 22,353,870 |
| 4.35%, 01/08/27 ^(b) | 12,558 | 14,343,591 |
| 4.35%, 01/11/48 | 19,405 | 22,406,711 |
| 4.45%, 04/15/70 | 12,303 | 14,525,229 |
| 4.63%, 04/15/43 ^(b) | 14,119 | 16,492,757 |
| 4.75%, 01/08/26 ^(b) | 23,512 | 27,222,487 |
| 4.75%, 02/11/29 | 15,228 | 18,083,250 |
| 4.75%, 07/18/47 ^(b) | 10,517 | 12,857,033 |
| 5.13%, 01/15/45 ^(b) | 18,563 | 23,279,162 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|---|--------------|---------------|
| Indonesia (continued) | | |
| 5.25%, 01/17/42 ^(b) | \$ 21,891 | \$ 27,486,887 |
| 5.25%, 01/08/47 ^(b) | 16,903 | 22,000,311 |
| 5.35%, 02/11/49 | 10,899 | 14,546,759 |
| 5.38%, 10/17/23 ^(b) | 8,977 | 10,107,541 |
| 5.88%, 01/15/24 ^(b) | 21,268 | 24,365,152 |
| 5.95%, 01/08/46 ^(b) | 9,861 | 13,885,521 |
| 6.63%, 02/17/37 ^(b) | 15,209 | 21,226,061 |
| 6.75%, 01/15/44 ^(b) | 17,029 | 25,543,500 |
| 7.75%, 01/17/38 ^(b) | 20,313 | 31,307,411 |
| 8.50%, 10/12/35 ^(b) | 17,257 | 27,600,414 |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III | | |
| 2.80%, 06/23/30 ^(b) | 14,170 | 14,595,100 |
| 3.75%, 03/01/23 ^(b) | 11,631 | 12,379,746 |
| 4.15%, 03/29/27 ^(b) | 19,124 | 21,466,690 |
| 4.33%, 05/28/25 ^(b) | 21,323 | 23,975,048 |
| 4.35%, 09/10/24 ^(b) | 16,252 | 18,100,665 |
| 4.40%, 03/01/28 ^(b) | 17,892 | 20,419,245 |
| 4.45%, 02/20/29 ^(b) | 12,098 | 13,939,164 |
| 4.55%, 03/29/26 ^(b) | 17,343 | 19,814,377 |
| | | 672,805,918 |
| Iraq — 0.5% | | |
| Iraq International Bond | | |
| 5.80%, 01/15/28 (Call 12/14/20) ^(b) | 66,366 | 57,219,612 |
| 6.75%, 03/09/23 ^(b) | 25,440 | 23,667,150 |
| | | 80,886,762 |
| Ivory Coast — 0.5% | | |
| Ivory Coast Government International Bond | | |
| 5.75%, 12/31/32 (Call 12/30/20) ^{(b)(i)} | 27,370 | 26,668,722 |
| 6.13%, 06/15/33 ^(b) | 34,878 | 35,139,585 |
| 6.38%, 03/03/28 ^(b) | 26,189 | 27,441,161 |
| | | 89,249,468 |
| Jamaica — 0.9% | | |
| Jamaica Government International Bond | | |
| 6.75%, 04/28/28 | 38,558 | 44,353,749 |
| 7.88%, 07/28/45 | 48,872 | 63,365,603 |
| 8.00%, 03/15/39 | 32,587 | 43,228,692 |
| | | 150,948,044 |
| Jordan — 0.7% | | |
| Jordan Government International Bond | | |
| 5.75%, 01/31/27 ^(b) | 26,230 | 27,000,506 |
| 5.85%, 07/07/30 ^(b) | 34,225 | 34,396,125 |
| 6.13%, 01/29/26 ^(b) | 29,162 | 30,647,439 |
| 7.38%, 10/10/47 ^(b) | 26,649 | 27,473,454 |
| | | 119,517,524 |
| Kazakhstan — 1.3% | | |
| Kazakhstan Government International Bond | | |
| 3.88%, 10/14/24 ^(b) | 38,779 | 42,378,176 |
| 4.88%, 10/14/44 ^(b) | 29,003 | 38,338,341 |
| 5.13%, 07/21/25 ^(b) | 68,486 | 79,465,162 |
| 6.50%, 07/21/45 ^(b) | 39,922 | 62,902,101 |
| | | 223,083,780 |
| Kenya — 0.8% | | |
| Kenya Government International Bond | | |
| 6.88%, 06/24/24 ^(b) | 51,570 | 54,438,581 |
| 7.25%, 02/28/28 ^(b) | 25,880 | 27,044,600 |
| 8.00%, 05/22/32 ^(b) | 30,320 | 31,807,575 |
| 8.25%, 02/28/48 ^(b) | 30,180 | 30,745,875 |
| | | 144,036,631 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|---|--------------|----------------|
| Kuwait — 0.8% | | |
| Kuwait International Government Bond, 3.50%, 03/20/27 ^(b) | \$ 121,700 | \$ 137,521,000 |
| Lebanon — 0.2% | | |
| Lebanon Government International Bond | | |
| 6.00%, 01/27/23 ^{(b)(f)} | 25,692 | 3,540,679 |
| 6.10%, 10/04/22 ^{(b)(f)} | 33,071 | 4,535,896 |
| 6.60%, 11/27/26 ^{(b)(f)} | 40,307 | 5,554,808 |
| 6.65%, 02/26/30 ^{(b)(f)} | 31,945 | 4,322,558 |
| 6.75%, 11/29/27 ^{(b)(f)} | 26,540 | 3,657,544 |
| 6.85%, 03/23/27 ^{(b)(f)} | 29,931 | 4,124,866 |
| 7.00%, 03/23/32 ^{(b)(f)} | 25,509 | 3,371,494 |
| | | 29,107,845 |
| Malaysia — 0.8% | | |
| 1MDB Global Investments Ltd., 4.40%, 03/09/23 ^(b) | 78,000 | 77,610,000 |
| Malaysia Sovereign Sukuk Bhd, 3.04%, 04/22/25 ^(b) | 25,334 | 27,503,224 |
| Malaysia Sukuk Global Bhd, 3.18%, 04/27/26 ^(b) | 26,811 | 29,776,967 |
| | | 134,890,191 |
| Mexico — 2.8% | | |
| Mexico Government International Bond | | |
| 3.25%, 04/16/30 (Call 01/16/30) | 26,704 | 27,638,640 |
| 3.60%, 01/30/25 | 20,961 | 22,592,028 |
| 3.75%, 01/11/28 | 18,348 | 19,861,710 |
| 3.90%, 04/27/25 (Call 03/27/25) | 8,621 | 9,416,826 |
| 4.00%, 10/02/23 | 24,964 | 27,132,747 |
| 4.13%, 01/21/26 | 18,283 | 20,345,551 |
| 4.15%, 03/28/27 | 21,836 | 24,303,468 |
| 4.35%, 01/15/47 | 17,193 | 18,090,260 |
| 4.50%, 04/22/29 | 28,248 | 31,937,895 |
| 4.50%, 01/31/50 (Call 07/31/49) | 22,862 | 24,633,805 |
| 4.60%, 01/23/46 | 24,540 | 26,587,556 |
| 4.60%, 02/10/48 | 20,449 | 22,116,872 |
| 4.75%, 04/27/32 (Call 01/27/32) | 19,126 | 21,863,409 |
| 4.75%, 03/08/44 | 34,796 | 38,493,075 |
| 5.00%, 04/27/51 (Call 10/27/50) | 21,791 | 24,907,113 |
| 5.55%, 01/21/45 | 23,505 | 28,654,064 |
| 5.75%, 10/12/2110 | 24,192 | 28,138,320 |
| 6.05%, 01/11/40 | 25,758 | 32,422,882 |
| 6.75%, 09/27/34 | 14,532 | 19,432,009 |
| 8.30%, 08/15/31 | 8,188 | 11,816,307 |
| | | 480,384,537 |
| Mongolia — 0.0% | | |
| Mongolia Government International Bond, 5.13%, 12/05/22 ^(b) | 7,345 | 7,530,920 |
| Morocco — 0.2% | | |
| Morocco Government International Bond, 4.25%, 12/11/22 ^(b) | 35,875 | 37,523,008 |
| Nigeria — 1.4% | | |
| Nigeria Government International Bond | | |
| 6.50%, 11/28/27 ^(b) | 37,627 | 36,404,122 |
| 7.14%, 02/23/30 ^(b) | 33,086 | 31,959,008 |
| 7.63%, 11/21/25 ^(b) | 29,376 | 30,835,620 |
| 7.63%, 11/28/47 ^(b) | 41,472 | 37,765,440 |
| 7.70%, 02/23/38 ^(b) | 33,723 | 31,046,237 |
| 7.88%, 02/16/32 ^(b) | 41,899 | 40,602,750 |
| 8.75%, 01/21/31 ^(b) | 27,156 | 28,148,891 |
| | | 236,762,068 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Oman — 2.6% | | |
| Oman Government International Bond | | |
| 4.13%, 01/17/23 ^(b) | \$ 29,669 | \$ 29,140,521 |
| 4.75%, 06/15/26 ^(b) | 61,785 | 56,398,120 |
| 5.38%, 03/08/27 ^(b) | 49,395 | 45,165,553 |
| 5.63%, 01/17/28 ^(b) | 64,680 | 59,202,412 |
| 6.00%, 08/01/29 ^(b) | 56,048 | 51,178,830 |
| 6.50%, 03/08/47 ^(b) | 49,305 | 39,875,419 |
| 6.75%, 10/28/27 ^(a) | 16,150 | 15,665,500 |
| 6.75%, 01/17/48 ^(b) | 70,847 | 57,873,143 |
| Oman Sovereign Sukuk Co. | | |
| 4.40%, 06/01/24 ^(b) | 48,072 | 47,996,888 |
| 5.93%, 10/31/25 ^(b) | 35,591 | 37,459,528 |
| | | 439,955,914 |
| Pakistan — 0.5% | | |
| Pakistan Government International Bond | | |
| 6.88%, 12/05/27 ^(b) | 42,655 | 41,441,998 |
| 8.25%, 04/15/24 ^(b) | 27,904 | 29,159,680 |
| Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd. (The), 5.63%, 12/05/22 ^(b) | | |
| | 21,896 | 21,772,835 |
| | | 92,374,513 |
| Panama — 3.1% | | |
| Panama Government International Bond | | |
| 2.25%, 09/29/32 (Call 06/29/32) | 29,250 | 29,747,250 |
| 3.16%, 01/23/30 (Call 10/23/29) | 40,059 | 43,676,828 |
| 3.75%, 03/16/25 (Call 12/16/24) | 32,337 | 35,378,699 |
| 3.87%, 07/23/60 (Call 01/23/60) | 44,382 | 49,943,619 |
| 3.88%, 03/17/28 (Call 12/17/27) | 31,886 | 36,100,931 |
| 4.00%, 09/22/24 (Call 06/24/24) | 32,258 | 35,322,510 |
| 4.30%, 04/29/53 | 45,181 | 54,527,819 |
| 4.50%, 05/15/47 (Call 11/15/46) | 29,230 | 36,025,975 |
| 4.50%, 04/16/50 (Call 10/16/49) | 43,091 | 53,109,658 |
| 4.50%, 04/01/56 (Call 10/01/55) | 64,135 | 79,078,455 |
| 6.70%, 01/26/36 | 52,049 | 75,031,887 |
| | | 527,943,631 |
| Paraguay — 0.4% | | |
| Paraguay Government International Bond | | |
| 4.95%, 04/28/31 (Call 01/28/31) ^(b) | 26,652 | 31,084,561 |
| 6.10%, 08/11/44 ^(b) | 27,298 | 35,231,481 |
| | | 66,316,042 |
| Peru — 2.5% | | |
| Peruvian Government International Bond | | |
| 2.39%, 01/23/26 (Call 12/23/25) | 27,386 | 28,755,300 |
| 2.78%, 01/23/31 (Call 10/23/30) | 55,924 | 60,565,692 |
| 4.13%, 08/25/27 | 30,023 | 34,854,826 |
| 5.63%, 11/18/50 | 69,593 | 110,979,087 |
| 6.55%, 03/14/37 | 28,317 | 42,785,217 |
| 7.35%, 07/21/25 | 42,567 | 54,392,645 |
| 8.75%, 11/21/33 | 55,546 | 93,542,936 |
| | | 425,875,703 |
| Philippines — 3.5% | | |
| Philippine Government International Bond | | |
| 2.46%, 05/05/30 | 22,036 | 23,550,975 |
| 2.95%, 05/05/45 | 28,761 | 30,217,026 |
| 3.00%, 02/01/28 | 37,159 | 40,774,199 |
| 3.70%, 03/01/41 | 40,107 | 45,909,981 |
| 3.70%, 02/02/42 | 40,710 | 46,854,666 |
| 3.75%, 01/14/29 | 32,965 | 38,167,289 |
| 3.95%, 01/20/40 | 38,794 | 45,643,566 |
| 4.20%, 01/21/24 | 32,373 | 35,893,564 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Philippines (continued) | | |
| 5.00%, 01/13/37 | \$ 28,381 | \$ 36,913,038 |
| 5.50%, 03/30/26 | 20,264 | 25,026,040 |
| 6.38%, 01/15/32 | 18,373 | 25,865,739 |
| 6.38%, 10/23/34 | 38,584 | 55,693,592 |
| 7.75%, 01/14/31 | 32,464 | 49,132,235 |
| 9.50%, 02/02/30 | 42,199 | 69,061,301 |
| 10.63%, 03/16/25 | 24,056 | 34,114,415 |
| | | 602,817,626 |
| Poland — 1.0% | | |
| Republic of Poland Government International Bond | | |
| 3.00%, 03/17/23 | 50,300 | 53,207,969 |
| 3.25%, 04/06/26 | 48,816 | 55,085,805 |
| 4.00%, 01/22/24 | 53,725 | 59,646,032 |
| | | 167,939,806 |
| Qatar — 4.3% | | |
| Qatar Government International Bond | | |
| 3.25%, 06/02/26 ^(b) | 46,220 | 50,957,550 |
| 3.38%, 03/14/24 ^(b) | 29,823 | 32,087,684 |
| 3.40%, 04/16/25 ^(b) | 30,767 | 33,795,627 |
| 3.75%, 04/16/30 ^(b) | 42,157 | 48,981,164 |
| 3.88%, 04/23/23 ^(b) | 42,635 | 45,739,361 |
| 4.00%, 03/14/29 ^(b) | 53,252 | 62,304,840 |
| 4.40%, 04/16/50 ^(b) | 67,578 | 85,824,060 |
| 4.50%, 04/23/28 ^(b) | 42,660 | 51,085,350 |
| 4.63%, 06/02/46 ^(b) | 26,465 | 34,627,798 |
| 4.82%, 03/14/49 ^(b) | 80,522 | 107,421,381 |
| 5.10%, 04/23/48 ^(b) | 81,103 | 111,896,795 |
| 5.75%, 01/20/42 ^(b) | 12,621 | 18,525,262 |
| 6.40%, 01/20/40 ^(b) | 11,532 | 17,730,450 |
| 9.75%, 06/15/30 ^(b) | 14,774 | 24,797,236 |
| SoQ Sukuk A QSC, 3.24%, 01/18/23 ^(b) | 22,702 | 23,900,949 |
| | | 749,675,507 |
| Romania — 1.4% | | |
| Romanian Government International Bond | | |
| 3.00%, 02/14/31 ^(b) | 36,920 | 38,154,512 |
| 4.00%, 02/14/51 ^(b) | 57,870 | 58,774,219 |
| 4.38%, 08/22/23 ^(b) | 37,952 | 41,308,380 |
| 4.88%, 01/22/24 ^(b) | 24,970 | 27,701,094 |
| 5.13%, 06/15/48 ^(b) | 32,206 | 38,858,552 |
| 6.13%, 01/22/44 ^(b) | 24,392 | 32,852,975 |
| | | 237,649,732 |
| Russia — 3.7% | | |
| Russian Foreign Bond-Eurobond | | |
| 1.00%, 03/31/30 ^{(b)(g)} | 29,460 | 33,805,567 |
| 4.25%, 06/23/27 ^(b) | 40,200 | 45,237,562 |
| 4.38%, 03/21/29 ^(b) | 48,800 | 55,891,250 |
| 4.75%, 05/27/26 ^(b) | 51,600 | 58,840,125 |
| 4.88%, 09/16/23 ^(b) | 50,800 | 55,657,750 |
| 5.10%, 03/28/35 ^(b) | 63,200 | 76,669,500 |
| 5.25%, 06/23/47 ^(b) | 112,000 | 147,000,000 |
| 5.63%, 04/04/42 ^(b) | 48,400 | 63,555,250 |
| 5.88%, 09/16/43 ^(b) | 26,000 | 35,433,125 |
| 12.75%, 06/24/28 ^(b) | 41,284 | 70,750,455 |
| | | 642,840,584 |
| Saudi Arabia — 4.6% | | |
| KSA Sukuk Ltd. | | |
| 2.97%, 10/29/29 ^(b) | 25,699 | 27,401,559 |
| 3.63%, 04/20/27 ^(b) | 45,459 | 50,459,490 |
| 4.30%, 01/19/29 ^(b) | 22,532 | 26,277,945 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Saudi Arabia (continued) | | |
| Saudi Government International Bond | | |
| 2.50%, 02/03/27 ^(b) | \$ 15,795 | \$ 16,545,263 |
| 2.75%, 02/03/32 ^(b) | 11,642 | 12,151,338 |
| 2.88%, 03/04/23 ^(b) | 27,242 | 28,433,837 |
| 2.90%, 10/22/25 ^(b) | 29,252 | 31,226,510 |
| 3.25%, 10/26/26 ^(b) | 55,880 | 60,856,812 |
| 3.25%, 10/22/30 ^(b) | 17,966 | 19,560,483 |
| 3.63%, 03/04/28 ^(b) | 51,454 | 56,937,067 |
| 3.75%, 01/21/55 ^(b) | 31,907 | 33,990,926 |
| 4.00%, 04/17/25 ^(b) | 52,188 | 57,879,754 |
| 4.38%, 04/16/29 ^(b) | 45,380 | 53,349,862 |
| 4.50%, 04/17/30 ^(b) | 35,114 | 42,059,988 |
| 4.50%, 10/26/46 ^(b) | 69,522 | 82,035,960 |
| 4.50%, 04/22/60 ^(b) | 33,511 | 40,768,226 |
| 4.63%, 10/04/47 ^(b) | 48,821 | 58,890,331 |
| 5.00%, 04/17/49 ^(b) | 36,816 | 46,986,420 |
| 5.25%, 01/16/50 ^(b) | 39,019 | 51,627,014 |
| | | 797,438,785 |
| Senegal — 0.3% | | |
| Senegal Government International Bond | | |
| 6.25%, 05/23/33 ^(b) | 27,923 | 28,394,201 |
| 6.75%, 03/13/48 ^(b) | 29,260 | 28,528,500 |
| | | 56,922,701 |
| South Africa — 2.3% | | |
| Republic of South Africa Government International Bond | | |
| 4.30%, 10/12/28 | 44,353 | 43,022,410 |
| 4.67%, 01/17/24 | 32,585 | 33,868,034 |
| 4.85%, 09/27/27 | 22,443 | 22,779,645 |
| 4.85%, 09/30/29 | 43,661 | 43,251,678 |
| 4.88%, 04/14/26 | 32,029 | 33,220,079 |
| 5.00%, 10/12/46 | 22,621 | 19,036,985 |
| 5.38%, 07/24/44 | 23,984 | 21,248,325 |
| 5.65%, 09/27/47 | 35,412 | 31,926,131 |
| 5.75%, 09/30/49 | 69,199 | 62,365,599 |
| 5.88%, 09/16/25 | 47,018 | 51,293,699 |
| 5.88%, 06/22/30 | 33,255 | 35,125,594 |
| | | 397,138,179 |
| Sri Lanka — 0.9% | | |
| Sri Lanka Government International Bond | | |
| 5.75%, 04/18/23 ^(b) | 33,326 | 19,162,450 |
| 6.20%, 05/11/27 ^(b) | 41,392 | 22,248,200 |
| 6.75%, 04/18/28 ^(b) | 31,259 | 16,752,870 |
| 6.83%, 07/18/26 ^(b) | 24,478 | 13,286,965 |
| 6.85%, 03/14/24 ^(b) | 27,338 | 15,531,401 |
| 6.85%, 11/03/25 ^(b) | 42,469 | 23,596,838 |
| 7.55%, 03/28/30 ^(b) | 40,878 | 22,099,669 |
| 7.85%, 03/14/29 ^(b) | 37,015 | 19,999,667 |
| | | 152,678,060 |
| Trinidad And Tobago — 0.1% | | |
| Trinidad & Tobago Government International Bond, | | |
| 4.50%, 08/04/26 ^(b) | 22,932 | 23,963,940 |
| Tunisia — 0.1% | | |
| Banque Centrale de Tunisie International Bond, 5.75%, | | |
| 01/30/25 ^(b) | 26,828 | 22,577,439 |
| Turkey — 3.6% | | |
| Hazine Mustesarifigi Varlik Kiralama AS | | |
| 4.49%, 11/25/24 ^(b) | 8,132 | 7,682,199 |
| 5.00%, 04/06/23 ^(b) | 13,433 | 13,113,966 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|--|--------------|---------------|
| Turkey (continued) | | |
| Turkey Government International Bond | | |
| 3.25%, 03/23/23 | \$ 17,502 | \$ 16,522,982 |
| 4.25%, 03/13/25 | 20,092 | 18,327,671 |
| 4.25%, 04/14/26 | 14,634 | 13,010,541 |
| 4.88%, 10/09/26 | 34,641 | 31,241,852 |
| 4.88%, 04/16/43 | 37,008 | 27,062,100 |
| 5.13%, 02/17/28 | 27,325 | 24,293,633 |
| 5.25%, 03/13/30 | 22,756 | 19,854,610 |
| 5.60%, 11/14/24 | 29,194 | 28,044,486 |
| 5.75%, 03/22/24 | 29,893 | 29,005,552 |
| 5.75%, 05/11/47 | 42,415 | 32,977,662 |
| 6.00%, 03/25/27 | 33,768 | 31,836,892 |
| 6.00%, 01/14/41 | 31,906 | 25,843,860 |
| 6.13%, 10/24/28 | 26,333 | 24,613,126 |
| 6.35%, 08/10/24 | 28,545 | 28,143,586 |
| 6.38%, 10/14/25 | 24,500 | 23,887,500 |
| 6.63%, 02/17/45 | 37,149 | 32,052,621 |
| 6.75%, 05/30/40 | 19,031 | 16,860,277 |
| 6.88%, 03/17/36 | 34,917 | 32,167,286 |
| 7.25%, 12/23/23 | 21,207 | 21,664,276 |
| 7.25%, 03/05/38 | 11,667 | 11,028,961 |
| 7.38%, 02/05/25 | 40,413 | 41,360,180 |
| 7.63%, 04/26/29 | 30,452 | 30,708,939 |
| 8.00%, 02/14/34 | 13,668 | 14,026,785 |
| 11.88%, 01/15/30 | 16,840 | 21,744,650 |
| | | 617,076,193 |
| Ukraine — 2.1% | | |
| Ukraine Government International Bond | | |
| 7.25%, 03/15/33 ^(a) | 50,000 | 47,000,000 |
| 7.25%, 03/15/33 ^(b) | 4,800 | 4,512,000 |
| 7.38%, 09/25/32 ^(b) | 78,912 | 75,558,240 |
| 7.75%, 09/01/23 ^(b) | 37,271 | 38,705,933 |
| 7.75%, 09/01/24 ^(b) | 34,713 | 35,852,020 |
| 7.75%, 09/01/25 ^(b) | 36,473 | 37,293,642 |
| 7.75%, 09/01/26 ^(b) | 35,833 | 36,213,726 |
| 7.75%, 09/01/27 ^(b) | 35,993 | 36,240,452 |
| 9.75%, 11/01/28 ^(b) | 43,753 | 47,567,715 |
| | | 358,943,728 |
| United Arab Emirates — 2.9% | | |
| Abu Dhabi Government International Bond | | |
| 0.75%, 09/02/23 ^(a) | 14,125 | 14,107,344 |
| 0.75%, 09/02/23 ^(b) | 2,700 | 2,696,625 |
| 1.70%, 03/02/31 ^(a) | 17,000 | 16,702,500 |
| 1.70%, 03/02/31 ^(b) | 1,600 | 1,572,000 |
| 2.13%, 09/30/24 ^(a) | 32,303 | 33,675,877 |
| 2.50%, 10/11/22 ^(b) | 3,100 | 3,209,469 |
| 2.50%, 04/16/25 ^(b) | 33,645 | 35,630,055 |
| 2.50%, 09/30/29 ^(b) | 35,795 | 37,942,700 |
| 2.70%, 09/02/70 ^(a) | 19,400 | 17,654,000 |
| 2.70%, 09/02/70 ^(b) | 1,200 | 1,092,000 |
| 3.13%, 05/03/26 ^(b) | 31,890 | 35,029,172 |
| 3.13%, 10/11/27 ^(b) | 42,336 | 46,992,960 |
| 3.13%, 04/16/30 ^(b) | 35,025 | 38,965,312 |
| 3.13%, 09/30/49 ^(b) | 43,414 | 45,733,936 |
| 3.88%, 04/16/50 ^(b) | 46,024 | 54,624,735 |
| 4.13%, 10/11/47 ^(b) | 35,392 | 43,443,680 |
| Emirate of Dubai Government International Bonds, | | |
| 3.90%, 09/09/50 ^(b) | 8,275 | 7,775,914 |

| 銘柄 | 額面 (単位：千) | 評価額 |
|---|--------------|-------------------|
| United Arab Emirates (continued) | | |
| Financ Department Government of Sharjah | | |
| 4.00%, 07/28/50 ^(a) | \$ 9,096 | \$ 9,050,520 |
| 4.00%, 07/28/50 ^(b) | 3,604 | 3,585,980 |
| RAK Capital, 3.09%, 03/31/25 ^(b) | 12,232 | 12,950,630 |
| Sharjah Sukuk Program Ltd. | | |
| 2.94%, 06/10/27 ^(b) | 8,800 | 9,042,000 |
| 3.85%, 04/03/26 ^(b) | 13,963 | 15,119,311 |
| 4.23%, 03/14/28 ^(b) | 13,889 | 15,412,450 |
| Series NOV, 3.23%, 10/23/29 ^(b) | 4,375 | 4,541,731 |
| | | 506,550,901 |
| Uruguay — 2.4% | | |
| Uruguay Government International Bond | | |
| 4.38%, 10/27/27 | 42,133 | 49,190,783 |
| 4.38%, 01/23/31 (Call 10/23/30) | 51,919 | 62,708,038 |
| 4.50%, 08/14/24 | 26,712 | 29,174,012 |
| 4.98%, 04/20/55 | 70,724 | 93,576,824 |
| 5.10%, 06/18/50 | 104,859 | 139,855,298 |
| 7.63%, 03/21/36 | 27,086 | 42,195,032 |
| | | 416,699,987 |
| Venezuela — 0.0% | | |
| Venezuela Government International Bond | | |
| 9.25%, 09/15/27 ^(b) | 2,528 | 221,200 |
| 12.75%, 08/23/22 ^{(b)(f)} | 4,840 | 423,500 |
| | | 644,700 |
| Vietnam — 0.2% | | |
| Vietnam Government International Bond, 4.80%, | | |
| 11/19/24 ^(b) | 24,400 | 27,229,505 |
| Zambia — 0.1% | | |
| Zambia Government International Bond | | |
| 8.50%, 04/14/24 ^(b) | 25,000 | 10,781,250 |
| 8.97%, 07/30/27 ^(b) | 32,170 | 13,511,400 |
| | | 24,292,650 |
| Total Foreign Government Obligations — 84.4% | | |
| (Cost: \$14,800,663,089) | | 14,530,263,227 |
| Short-Term Investments | | |
| Money Market Funds — 0.6% | | |
| BlackRock Cash Funds: Treasury, SL Agency Shares, | | |
| 0.04% ^{(g)(i)} | 98,130 | 98,130,000 |
| Total Short-Term Investments — 0.6% | | |
| (Cost: \$98,130,000) | | 98,130,000 |
| Total Investments in Securities — 99.0% | | |
| (Cost: \$17,339,390,262) | | 17,028,288,715 |
| Other Assets, Less Liabilities — 1.0% | | |
| | | 179,968,411 |
| Net Assets — 100.0% | | |
| | | \$ 17,208,257,126 |

(a) U.S. dollar denominated security issued by foreign domiciled entity.

(b) This security may be resold to qualified foreign investors and foreign institutional buyers under Regulation S of the Securities Act of 1933.

(c) Perpetual security with no stated maturity date.

(d) Variable rate security. Interest rate resets periodically. The rate shown is the effective interest rate as of period end. Security description also includes the reference rate and spread if published and available.

(e) Security exempt from registration pursuant to Rule 144A under the Securities Act of 1933, as amended. These securities may be resold in transactions exempt from registration to qualified institutional investors.

- ^(f) Issuer filed for bankruptcy and/or is in default.
- ^(g) Step coupon security. Coupon rate will either increase (step-up bond) or decrease (step-down bond) at regular intervals until maturity. Interest rate shown reflects the rate currently in effect.
- ^(h) Zero-coupon bond.
- ⁽ⁱ⁾ Affiliate of the Fund.
- ^(j) Annualized 7-day yield as of period-end.

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期 (決算日 2021年6月7日)

(計算期間 2020年6月9日~2021年6月7日)

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 信託期間 | 2006年8月4日から無期限です。 |
| 運用方針 | 東証R E I T指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証R E I T指数 | | 投資証券 組入比率 | 不動産 投信先 物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|------------------|--------|------------------|------------------|--------------|-------------------|-----------|
| | 期 騰 落 率 | 中 率 | (配当込み) ベンチマーク | 期 騰 落 率 | | | |
| 11期(2017年6月6日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 12期(2018年6月6日) | 17,626 | △3.6 | 3,285.51 | △3.8 | 98.3 | 1.5 | 29,280 |
| 13期(2019年6月6日) | 18,181 | 3.1 | 3,386.35 | 3.1 | 97.8 | 1.7 | 35,462 |
| 14期(2020年6月8日) | 20,819 | 14.5 | 3,880.89 | 14.6 | 97.4 | 2.0 | 33,154 |
| 15期(2021年6月7日) | 19,706 | △5.3 | 3,696.98 | △4.7 | 97.4 | 2.2 | 41,885 |
| | 24,869 | 26.2 | 4,660.79 | 26.1 | 97.6 | 2.2 | 88,531 |

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 東証R E I T指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(㈩東京証券取引所)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・ノウハウおよび東証R E I T指数の商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

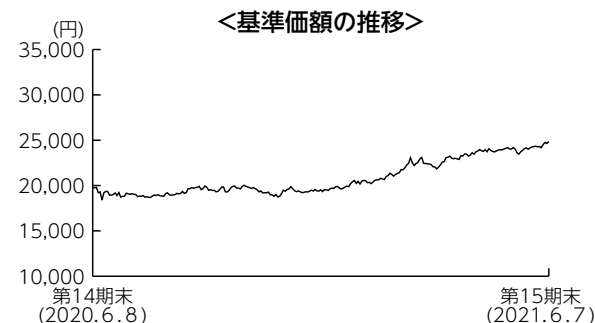
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 R E I T 指 数 | | 投 資 証 券 組 入 比 率 | 不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率 |
|---------------------------|-------------|--------|--------------------------------|--------|-----------------|-----------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2020 年 6 月 8 日 | 円 19,706 | % - | ポ イ ン ト 3,696.98 | % - | % 97.4 | % 2.2 |
| 6 月 末 | 18,802 | △4.6 | 3,525.99 | △4.6 | 97.4 | 2.1 |
| 7 月 末 | 18,855 | △4.3 | 3,535.10 | △4.4 | 97.8 | 2.0 |
| 8 月 末 | 19,918 | 1.1 | 3,735.15 | 1.0 | 97.5 | 2.2 |
| 9 月 末 | 19,726 | 0.1 | 3,698.94 | 0.1 | 97.4 | 2.3 |
| 10 月 末 | 18,737 | △4.9 | 3,512.43 | △5.0 | 96.9 | 2.6 |
| 11 月 末 | 19,393 | △1.6 | 3,635.82 | △1.7 | 97.6 | 2.1 |
| 12 月 末 | 20,558 | 4.3 | 3,854.76 | 4.3 | 97.5 | 2.2 |
| 2021 年 1 月 末 | 21,354 | 8.4 | 4,004.00 | 8.3 | 97.3 | 2.5 |
| 2 月 末 | 22,451 | 13.9 | 4,207.24 | 13.8 | 97.4 | 2.4 |
| 3 月 末 | 23,468 | 19.1 | 4,399.26 | 19.0 | 97.8 | 2.2 |
| 4 月 末 | 24,106 | 22.3 | 4,518.99 | 22.2 | 97.6 | 2.2 |
| 5 月 末 | 24,284 | 23.2 | 4,551.00 | 23.1 | 97.7 | 2.2 |
| (期 末) 2021 年 6 月 7 日 | 24,869 | 26.2 | 4,660.79 | 26.1 | 97.6 | 2.2 |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年6月9日から2021年6月7日まで）

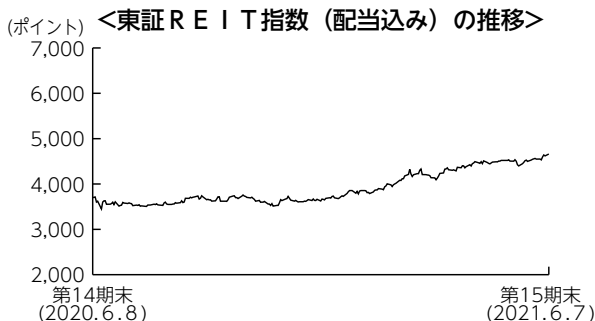


基準価額の推移

当期末の基準価額は24,869円となり、前期末比で26.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種進展を背景に景気回復期待が高まり、東証REIT指数（配当込み）が上昇したことにより当ファンドの基準価額も上昇しました。



投資環境

リート市場は上昇しました。期の前半は新型コロナウイルスのワクチンへの期待などがプラス要因となる一方、相次ぐ公募増資の発表による需給悪化懸念や不動産市況の先行き不透明感などがマイナス要因となり、方向感の定まらない展開となりました。後半に入ると、決算でリート各社の底堅い業績が確認できたことや、欧米でのワクチン接種進展を背景とした景気回復期待などにより上昇基調となりました。

ポートフォリオについて

リーートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で26.1%上昇しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、リーートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---------------------------|-----|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (先物・オプション) | 0円 | 0.001% | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (投資証券) | (0) | (0.001) | |
| 合 計 | 0 | 0.001 | |
| 期中の平均基準価額は20,817円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月9日から2021年6月7日まで)

(1) 投資証券

| | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|-------------------------|---|----------|---|-----------|---|--------|---|-----------|
| | 口 | 数 | 金 | 額 | 口 | 数 | 金 | 額 |
| | | 千口 | | 千円 | | 千口 | | 千円 |
| 国内 | | | | | | | | |
| エスコンジャパンリート投資法人 | | 1.82 | | 218,315 | | 1.136 | | 135,907 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| サンケイリアルエステート投資法人 | | 2.886 | | 305,490 | | 1.695 | | 183,412 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| S O S I L A 物流リート投資法人 | | 2.753 | | 373,847 | | 1.774 | | 240,901 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | 3.49 | | 2,140,566 | | 2.389 | | 1,446,998 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| MCUBS MidCity投資法人 | | 5.636 | | 468,036 | | 3.093 | | 246,384 |
| | | (△8.322) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 森ヒルズリート投資法人 | | 11.894 | | 1,743,930 | | 8.222 | | 1,201,899 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 産業ファンド投資法人 | | 14.707 | | 2,747,827 | | 9.853 | | 1,812,555 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | 9.543 | | 3,125,584 | | 6.655 | | 2,152,600 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | | 6.91 | | 1,373,500 | | 4.712 | | 933,600 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| アクティブア・プロパティーズ投資法人 | | 5.033 | | 2,264,531 | | 3.513 | | 1,589,952 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| GLP投資法人 | | 33.669 | | 5,724,570 | | 21.333 | | 3,586,817 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | 4.539 | | 1,456,560 | | 3.111 | | 995,139 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | 15.987 | | 5,391,422 | | 10.848 | | 3,594,072 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | 1.53 | | 869,077 | | 1.068 | | 617,126 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| Oneリート投資法人 | | 1.566 | | 434,147 | | 1.093 | | 302,741 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| イオンリート投資法人 | | 10.226 | | 1,403,055 | | 7.442 | | 1,014,535 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| ヒューリックリート投資法人 | | 8.359 | | 1,337,119 | | 5.941 | | 943,979 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| 日本リート投資法人 | | 3.262 | | 1,269,238 | | 2.277 | | 885,386 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | | 64.327 | | 1,082,559 | | 45.364 | | 788,947 |
| | | (-) | | (-) | | (-) | | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-----------------------|-----------|-----------|---------|-----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 29.611 | 2,437,169 | 20.611 | 1,705,857 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| トーセイ・リート投資法人 | 2.239 | 271,609 | 1.551 | 190,597 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 4.005 | 1,002,333 | 2.747 | 684,561 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 2.14 | 283,886 | 1.493 | 196,044 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 1.937 | 214,479 | 1.388 | 151,558 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 32.49 | 5,089,564 | 22.656 | 3,535,315 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| いちごホテルリート投資法人 | 1.794 | 141,849 | 1.222 | 97,152 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ラサールロジポート投資法人 | 12.747 | 2,159,771 | 7.817 | 1,285,247 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| スターアジア不動産投資法人 | 9.881 | 523,026 | 7.20962 | 372,541 |
| | (3.57862) | (-) | (-) | (-) |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 0.949 | 113,528 | 0.687 | 80,765 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 3.731 | 1,956,437 | 2.382 | 1,226,096 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 1.63 | 123,759 | 1.178 | 88,073 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| さくら総合リート投資法人 | 0.138 | 11,229 | 0.034 | 2,784 |
| | (△1.079) | (-) | (-) | (-) |
| 投資法人みらい | 10.885 | 474,241 | 7.866 | 341,145 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 2.19 | 270,580 | 1.615 | 195,818 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 2.694 | 1,151,341 | 1.685 | 709,152 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 3.686 | 592,672 | 2.121 | 340,241 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ザイマックス・リート投資法人 | 1.569 | 162,140 | 1.068 | 110,920 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 3.093 | 316,023 | 2.106 | 217,645 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 4.567 | 640,817 | 2.58 | 346,412 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 日本ビルファンド投資法人 | 11.804 | 7,539,423 | 7.683 | 4,939,198 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 10.044 | 6,232,251 | 7.01 | 4,346,223 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 日本都市ファンド投資法人 | 35.84 | 4,369,477 | 27.908 | 3,212,119 |
| | (21.1) | (-) | (-) | (-) |
| オリックス不動産投資法人 | 20.015 | 3,524,671 | 13.971 | 2,446,975 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 6.278 | 2,323,472 | 4.545 | 1,692,549 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| N T T 都市開発リート投資法人 | 9.076 | 1,264,853 | 6.336 | 894,848 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 6.732 | 1,137,484 | 4.698 | 796,055 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 6.971 | 789,624 | 4.865 | 549,607 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------|---------------|------------------|---------------|------------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| | 千□ | 千円 | 千□ | 千円 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 21.551 (-) | 3,032,504 (-) | 15.544 (-) | 2,192,163 (-) |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 7.179 (-) | 1,037,538 (-) | 5.011 (-) | 726,138 (-) |
| インヴィンシブル投資法人 | 42.132 (-) | 1,610,132 (-) | 30.371 (-) | 1,162,356 (-) |
| フロンティア不動産投資法人 | 3.342 (-) | 1,434,764 (-) | 2.441 (-) | 1,045,298 (-) |
| 平和不動産リート投資法人 | 6.408 (-) | 905,417 (-) | 4.342 (-) | 617,749 (-) |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 6.561 (-) | 2,007,386 (-) | 4.579 (-) | 1,378,720 (-) |
| 福岡リート投資法人 | 5.193 (-) | 821,047 (-) | 3.624 (-) | 574,815 (-) |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 3.103 (-) | 2,220,907 (-) | 2.164 (-) | 1,551,811 (-) |
| いちごオフィスリート投資法人 | 8.572 (-) | 711,475 (-) | 5.884 (-) | 497,940 (-) |
| 大和証券オフィス投資法人 | 2.151 (-) | 1,498,257 (-) | 1.585 (-) | 1,099,311 (-) |
| 阪急阪神リート投資法人 | 4.538 (-) | 630,874 (-) | 3.167 (-) | 442,528 (-) |
| スターツプロシード投資法人 | 1.562 (-) | 331,889 (-) | 1.089 (-) | 231,105 (-) |
| 大和ハウスリート投資法人 | 14.329 (-) | 3,991,529 (-) | 10.001 (-) | 2,784,523 (-) |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 32.359 (-) | 1,894,989 (-) | 22.586 (-) | 1,341,805 (-) |
| 大和証券リビング投資法人 | 13.398 (-) | 1,410,087 (-) | 9.0687 (-) | 959,763 (-) |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 9.33 (-) | 1,263,813 (-) | 6.502 (-) | 878,524 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|----------------|--------------|--------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 不動産投信指数先物取引 | 百万円 6,166 | 百万円 5,456 | 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（2020年6月9日から2021年6月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決 算 期 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 |
| 投 資 証 券 | 百万円 103,649 | 百万円 748 | % 0.7 | 百万円 70,913 | 百万円 7 | % 0.0 |

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種 類 | 当 | 期 |
|---------|---|--------------|
| | 買 | 付 額 |
| 投 資 証 券 | | 百万円 3,000 |

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 | 期 |
|-----------------------------|---|-------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | | 771千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | | 1千円 |
| (B)/(A) | | 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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|-------------------------|---|---------|--------|-----|--------|-----------|-----|
| | | □ | 数 | □ | 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| 不動産ファンド | | | 千□ | | 千□ | 千円 | % |
| エスコンジャパンリート投資法人 | | | 0.548 | | 1.232 | 167,428 | 0.2 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | | | 0.653 | | 1.844 | 235,294 | 0.3 |
| S O S I L A 物流リート投資法人 | | | 1.003 | | 1.982 | 289,768 | 0.3 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | | 1.497 | | 2.598 | 1,680,906 | 1.9 |
| MCUBS MidCity投資法人 | | | 5.779 | | - | - | - |
| 森ヒルズリート投資法人 | | | 5.182 | | 8.854 | 1,439,660 | 1.6 |
| 産業ファンド投資法人 | | | 5.801 | | 10.655 | 2,109,690 | 2.4 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | | 4.272 | | 7.16 | 2,595,500 | 2.9 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | | | 2.939 | | 5.137 | 1,188,701 | 1.3 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | | | 2.257 | | 3.777 | 1,903,608 | 2.2 |
| GLP投資法人 | | | 11.218 | | 23.554 | 4,404,598 | 5.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | | 1.961 | | 3.389 | 1,192,928 | 1.3 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | | 6.778 | | 11.917 | 4,093,489 | 4.6 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | | 0.685 | | 1.147 | 754,726 | 0.9 |
| Oneリート投資法人 | | | 0.702 | | 1.175 | 371,887 | 0.4 |
| イオンリート投資法人 | | | 4.861 | | 7.645 | 1,194,913 | 1.3 |
| ヒューリックリート投資法人 | | | 3.831 | | 6.249 | 1,144,191 | 1.3 |
| 日本リート投資法人 | | | 1.463 | | 2.448 | 1,113,840 | 1.3 |
| インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 | | | 28.937 | | 47.9 | 1,082,540 | 1.2 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | | 13.17 | | 22.17 | 2,030,772 | 2.3 |
| トーセイ・リート投資法人 | | | 0.98 | | 1.668 | 230,851 | 0.3 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | | | 1.74 | | 2.998 | 877,514 | 1.0 |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | | | 0.961 | | 1.608 | 229,300 | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | | | 0.902 | | 1.451 | 178,908 | 0.2 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | | 14.541 | | 24.375 | 4,463,062 | 5.0 |
| いちごホテルリート投資法人 | | | 0.746 | | 1.318 | 124,155 | 0.1 |
| ラサールロジポート投資法人 | | | 4.188 | | 9.118 | 1,629,386 | 1.8 |
| スターアジア不動産投資法人 | | | 1.495 | | 7.745 | 470,121 | 0.5 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | | | 0.444 | | 0.706 | 97,710 | 0.1 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | | 1.282 | | 2.631 | 1,507,563 | 1.7 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | | | 0.765 | | 1.217 | 101,619 | 0.1 |
| さくら総合リート投資法人 | | | 0.975 | | - | - | - |
| 投資法人みらい | | | 5.122 | | 8.141 | 418,447 | 0.5 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | | | 1.057 | | 1.632 | 228,153 | 0.3 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | | 0.887 | | 1.896 | 892,068 | 1.0 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | | | 0.847 | | 2.412 | 440,672 | 0.5 |
| ザイマックス・リート投資法人 | | | 0.654 | | 1.155 | 142,642 | 0.2 |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------|-----------|-------------|-------------|-----------|---------|------------|
| | □ 数 | □ 数 | □ 数 | 評 価 額 | 比 率 | 率 |
| 不動産ファンド | 千□ | 千□ | 千□ | 千円 | | % |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 1.278 | 2.265 | 2.265 | 277,689 | | 0.3 |
| 伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 0.937 | 2.924 | 2.924 | 428,366 | | 0.5 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 4.362 | 8.483 | 8.483 | 5,955,066 | | 6.7 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 4.504 | 7.538 | 7.538 | 5,080,612 | | 5.7 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 8.513 | 37.545 | 37.545 | 4,317,675 | | 4.9 |
| オリックス不動産投資法人 | 8.975 | 15.019 | 15.019 | 3,152,488 | | 3.6 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 2.96 | 4.693 | 4.693 | 2,069,613 | | 2.3 |
| N T T都市開発リート投資法人 | 4.068 | 6.808 | 6.808 | 1,120,596 | | 1.3 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 3.02 | 5.054 | 5.054 | 1,007,767 | | 1.1 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 3.128 | 5.234 | 5.234 | 659,484 | | 0.7 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 10.113 | 16.12 | 16.12 | 2,603,380 | | 2.9 |
| 森トラスト総合リート投資法人 | 3.219 | 5.387 | 5.387 | 848,452 | | 1.0 |
| インヴィンシブル投資法人 | 19.757 | 31.518 | 31.518 | 1,451,403 | | 1.6 |
| フロンティア不動産投資法人 | 1.6 | 2.501 | 2.501 | 1,268,007 | | 1.4 |
| 平和不動産リート投資法人 | 2.805 | 4.871 | 4.871 | 835,863 | | 0.9 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 2.943 | 4.925 | 4.925 | 1,548,912 | | 1.7 |
| 福岡リート投資法人 | 2.329 | 3.898 | 3.898 | 712,164 | | 0.8 |
| ケネディクス・オフィス投資法人 | 1.393 | 2.332 | 2.332 | 1,900,580 | | 2.1 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 3.488 | 6.176 | 6.176 | 616,364 | | 0.7 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 1.04 | 1.606 | 1.606 | 1,270,346 | | 1.4 |
| 阪急阪神リート投資法人 | 2.034 | 3.405 | 3.405 | 535,266 | | 0.6 |
| スターツプロシード投資法人 | 0.701 | 1.174 | 1.174 | 273,776 | | 0.3 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 6.427 | 10.755 | 10.755 | 3,500,752 | | 4.0 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 14.51 | 24.283 | 24.283 | 1,660,957 | | 1.9 |
| 大和証券リビング投資法人 | 5.5137 | 9.843 | 9.843 | 1,165,411 | | 1.3 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 4.166 | 6.994 | 6.994 | 1,114,843 | | 1.3 |
| 合 計 | □ 数 | □ 数 | □ 数 | 金額 | | — |
| | 銘 柄 数<比率> | 63銘柄<97.4%> | 61銘柄<97.6%> | 264,9067 | 472,255 | 86,402,461 |
| | | | | | | — |
| | | | | | | 97.6 |

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、ラサールロジポート投資法人、森トラスト総合リート投資法人、福岡リート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、投資法人みらい、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、Oneリート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載）

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当 期 | | 末 |
|-----|-------------|--------------|-------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 | 額 |
| 国内 | 東 証 R E I T | 百万円 1,985 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2021年6月7日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|------------------|---|-----------|
| | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 投 資 証 券 | 千円 86,402,461 | | % 95.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 4,014,673 | | 4.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 90,417,135 | | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 90,417,135,541円 |
| コ ー ル ・ 口 ー ン 等 | 3,405,911,232 |
| 投 資 証 券(評価額) | 86,402,461,800 |
| 未 収 入 金 | 183,819,520 |
| 未 収 配 当 金 | 490,120,359 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | △65,177,370 |
| (B) 負 債 | 1,885,627,936 |
| 未 払 金 | 1,698,686,936 |
| 未 払 解 約 金 | 186,941,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 88,531,507,605 |
| 元 本 | 35,599,014,873 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 52,932,492,732 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 35,599,014,873口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 24,869円 |

(注1) 期首元本額 21,254,723,982円
追加設定元本額 54,318,328,453円
一部解約元本額 39,974,037,562円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 265,723円 |
| M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 755,477円 |
| M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 888,298円 |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型) | 2,775,508円 |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型) | 1,719,811円 |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型) | 1,206,984円 |
| たわらノーロード 国内リート | 4,396,786,108円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ向け> | 932,624,822円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 969,244,891円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型) | 18,479,692円 |
| たわらノーロード バランス (標準型) | 328,301,241円 |
| たわらノーロード バランス (積極型) | 344,504,015円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型) | 36,161円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) | 112,884,187円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) | 298,496,743円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) | 184,755,065円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) | 240,465,240円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型) | 1,362,352円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) | 9,267,569円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型) | 3,306,792円 |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型) | 6,344,196円 |
| マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) | 12,109,534円 |
| マネックス資産設計ファンド (育成型) | 387,435,662円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 3,701,541円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) | 130,509,613円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) | 147,057,515円 |
| D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) | 282,884,029円 |
| 投資のソムリエ | 10,024,620,942円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 535,068,021円 |
| D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> | 118,464,447円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 398,097,751円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 4,120,726,367円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) | 11,396,430円 |

| | |
|---|-----------------|
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) | 5,368,611円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) | 3,754,462円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) | 25,873,028円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 2,267,692,515円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 101,490,373円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) | 8,346,602円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) | 4,119,891円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) | 3,902,574円 |
| Jリートインデックスファンド (DC) | 42,526,034円 |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定) | 82,505,379円 |
| D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定) | 742,059,473円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 933,075円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4 | 266,775,224円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) | 1,238,110円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定) | 104,218,702円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) | 765,304円 |
| 固定比率マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) | 212,081,935円 |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) | 83,568,801円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03 | 125,593,501円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 1,120,375円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定) | 5,043,105円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 | 166,112,957円 |
| D I A M J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け) | 3,849,271,455円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) | 253,271,282円 |
| 日本資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定) | 616,049,902円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) | 1,693,642円 |
| D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) | 2,597,095,834円 |
| 期末元本合計 | 35,599,014,873円 |

■損益の状況

当期 自2020年6月9日 至2021年6月7日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 2,307,938,669 | 円 |
| | 受取配当金 | 2,308,456,061 | |
| | 受取利息 | 915 | |
| | その他の収益 | 1,000 | |
| | 支払利息 | △519,307 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | 12,848,827,761 | |
| | 売却益 | 14,036,651,903 | |
| | 売却損 | △1,187,824,142 | |
| (C) | 先物取引等取引損益 | 356,830,240 | |
| | 取引益 | 367,459,860 | |
| | 取引損 | △10,629,620 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 15,513,596,670 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 20,630,700,953 | |
| (F) | 解約差損益金 | △46,304,004,438 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 63,092,199,547 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 52,932,492,732 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 52,932,492,732 | |

(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)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3) (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。

《お知らせ》

■信託金の限度額を2,000億円から5,000億円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年6月2日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第14期（決算日 2021年6月22日）

（対象期間 2020年6月23日～2021年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2007年4月11日から無期限です。 |
| 運用方針 | S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 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。 株式への直接投資は行いません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク） | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 | 純資産額 総 |
|-----------------|--------|-------|---|-------|-------------------------------|---------------|
| | 円 | 期中騰落率 | ポイント | 期中騰落率 | | |
| 10期(2017年6月22日) | 11,770 | 7.9 | 117,262.55 | 8.5 | 99.7 | 百万円 43,023 |
| 11期(2018年6月22日) | 11,979 | 1.8 | 120,101.82 | 2.4 | 99.3 | 53,148 |
| 12期(2019年6月24日) | 13,060 | 9.0 | 131,885.51 | 9.8 | 99.2 | 47,410 |
| 13期(2020年6月22日) | 10,922 | △16.4 | 111,241.50 | △15.7 | 99.7 | 34,753 |
| 14期(2021年6月22日) | 15,336 | 40.4 | 157,949.66 | 42.0 | 99.4 | 78,959 |

（注1）ベンチマークはS & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注2）S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、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、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

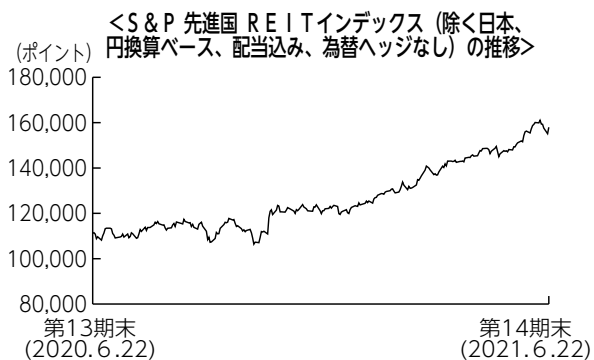
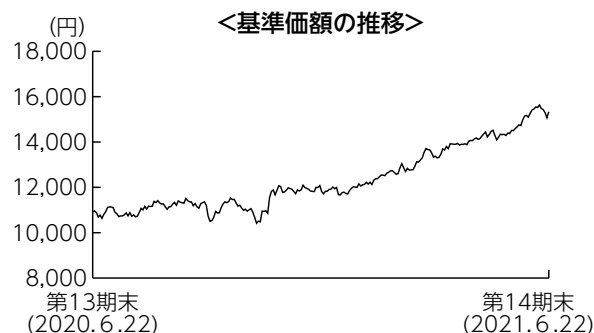
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク) | | 投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率 |
|-------------------------|-------------|--------|--|------------|-------------------------------|
| | | 騰 落 率 | 期 騰 落 | 中 騰 落 率 | |
| (期 首) 2020年 6 月 22 日 | 円 10,922 | % - | ポイント 111,241.50 | % - | % 99.7 |
| 6 月 末 | 10,809 | △1.0 | 110,069.47 | △1.1 | 99.3 |
| 7 月 末 | 11,008 | 0.8 | 112,029.46 | 0.7 | 99.7 |
| 8 月 末 | 11,349 | 3.9 | 115,692.61 | 4.0 | 99.6 |
| 9 月 末 | 10,869 | △0.5 | 110,930.39 | △0.3 | 97.4 |
| 10 月 末 | 10,511 | △3.8 | 107,293.68 | △3.5 | 98.8 |
| 11 月 末 | 11,822 | 8.2 | 120,978.81 | 8.8 | 100.4 |
| 12 月 末 | 11,940 | 9.3 | 122,315.74 | 10.0 | 99.6 |
| 2021年 1 月 末 | 12,223 | 11.9 | 125,429.06 | 12.8 | 100.1 |
| 2 月 末 | 12,864 | 17.8 | 132,415.62 | 19.0 | 99.6 |
| 3 月 末 | 13,803 | 26.4 | 141,813.22 | 27.5 | 99.4 |
| 4 月 末 | 14,442 | 32.2 | 148,529.64 | 33.5 | 99.6 |
| 5 月 末 | 14,756 | 35.1 | 151,940.99 | 36.6 | 99.7 |
| (期 末) 2021年 6 月 22 日 | 15,336 | 40.4 | 157,949.66 | 42.0 | 99.4 |

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年6月23日から2021年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は15,336円となり、前期末比で40.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は新型コロナウイルスの感染拡大や変異株の増加などから弱含む局面もありましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や経済活動正常化への期待などから、多くの市場が上昇しました。為替市場においても多くの通貨が対円で上昇し円安となったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

外国リート市場は大幅に上昇しました。米国リート市場では新型コロナウイルスのワクチン接種の進展、金融緩和政策の長期化見通し、経済活動正常化への期待などから上昇しました。欧州リート市場では感染拡大や変異株の発生などから2020年11月頃まで下落する市場もありましたが、その後は反発し上昇する展開となりました。オーストラリアリート市場ではロックダウンにより下落する局面もありましたが、その後は好調な経済指標の発表などから上昇に転じました。

為替市場では多くの通貨に対して円安となりました。米ドルは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因となり2020年は円高が進みましたが、米国の長期金利が上昇したことなどから2021年に入ると反転し、前期末比では円安水準で期末を迎えました。ユーロなど他の通貨に対しても円安となりました。新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退し、安全資産と見られた円が売られたことが主な要因です。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるS & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) のリスク特性に概ね一致させたポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で42.0%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを1.6%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|-------------------------|---|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売買委託手数料 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 4円 (0) (1) (3) | 0.033% (0.000) (0.005) (0.028) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投 資 証 券) | 12 (1) (11) | 0.096 (0.007) (0.089) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 15 (7) (8) | 0.124 (0.057) (0.067) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 31 | 0.253 | |
| 期中の平均基準価額は12,344円です。 | | | |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

| | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|----------|----------|---------|----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 110.955 | 18,619 | 83.828 | 13,836 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER'S INC. | 1.045 | 286 | 0.714 | 188 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOSTON PROPERTIES INC | 117.963 | 11,608 | 94.312 | 9,254 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 24.856 | 24 | 38.635 | 31 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 191.497 | 6,778 | 149.121 | 5,224 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 108.41 | 1,766 | 80.857 | 1,001 |
| | (△3.147) | (326) | (-) | (-) |
| AGREE REALTY CORP | 50.115 | 3,344 | 36.393 | 2,408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SL GREEN | 60.388 | 3,908 | 49.896 | 3,245 |
| | (△0.088) | (46) | (-) | (-) |
| EPR PROPERTIES | 57.934 | 2,349 | 45.759 | 1,877 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROLOGIS INC | 613.831 | 63,942 | 485.681 | 49,977 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 117.157 | 20,552 | 93.182 | 16,214 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--------------------------------|----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 215.591 | 2,408 | 167.955 | 1,858 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 81.571 | 8,559 | 64.507 | 6,739 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CBL & ASSOCIATES | 55.891 | 11 | 70.576 | 12 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MACK CALI | 62.671 | 875 | 50.446 | 732 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUINIX INC | 73.976 | 53,155 | 58.189 | 40,438 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 146.073 | 6,009 | 114.457 | 4,682 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CTO REALTY GROUTH INC | 4.656 | 218 | 1.691 | 87 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 121.376 | 4,042 | 94.397 | 3,140 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | 15.282 | 209 | 10.4 | 154 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SITE CENTERS CORP | 138.089 | 1,623 | 102.413 | 1,219 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DUKE REALTY TRUST | 312.707 | 12,758 | 246.639 | 9,938 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | - | - | 0.908 | 1 |
| | (△8.175) | (-) | (-) | (-) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 54.325 | 14,027 | 43.137 | 10,993 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 285.969 | 18,676 | 228.377 | 14,919 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 58.294 | 5,623 | 46.246 | 4,454 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 104.125 | 4,598 | 81.096 | 3,581 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 448.772 | 13,616 | 354.783 | 10,711 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 93.145 | 2,642 | 72.169 | 2,000 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 110.414 | 3,322 | 85.218 | 2,535 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 82.4 | 3,291 | 64.905 | 2,608 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 124.758 | 1,394 | 98.562 | 1,100 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WELLTOWER INC | 349.563 | 23,151 | 276.887 | 18,426 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EAST GROUP | 32.283 | 4,573 | 25.073 | 3,510 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIMCO REALTY | 358.539 | 6,004 | 280.112 | 4,800 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KILROY REALTY CORP | 88.581 | 5,505 | 69.901 | 4,334 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| LTC PROPERTIES INC | 27.592 | 1,083 | 21.613 | 860 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 135.997 | 588 | 95.837 | 416 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | 73.691 | 1,246 | 54.737 | 926 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 140.097 | 1,704 | 106.761 | 1,301 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRON MOUNTAIN INC | 240.657 | 8,102 | 190.534 | 6,576 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| THE MACERICH COMPANY | 97.397 | 1,262 | 53.439 | 612 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 143.513 | 9,220 | 117.607 | 7,408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ACADIA REALTY TRUST | 56.778 | 948 | 39.342 | 665 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 594.104 | 8,815 | 470.886 | 7,087 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MID AMERICA | 94.367 | 12,762 | 74.735 | 10,085 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 4.174 | 35 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 34.255 | 2,319 | 25.808 | 1,738 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CENTERSPACE | 7.768 | 554 | 5.267 | 369 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 7.745 | 169 | 5.072 | 112 |
| | (0.086) | (1) | (-) | (-) |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 45.612 | 96 | 24.87 | 10 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GETTY REALTY CORP | 22.569 | 646 | 15.998 | 457 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PS BUSINESS PARKS | 15.626 | 2,236 | 12.082 | 1,721 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RPT REALTY | 61.298 | 585 | 48.894 | 483 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REALTY INCOME CORP | 306.116 | 19,171 | 232.168 | 14,328 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REGENCY CENTERS CORP | 134.757 | 6,932 | 110.005 | 5,726 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UDR INC | 245.5 | 10,086 | 193.137 | 7,895 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 85.52 | 2,243 | 65.727 | 1,717 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORECIVIC INC | 27.418 | 217 | 63.211 | 421 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAUL CENTERS INC | 4.559 | 157 | 2.149 | 91 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 274.972 | 26,839 | 211.542 | 21,119 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| LIFE STORAGE INC | 52.188 (9.804) | 4,990 (-) | 40.315 (-) | 3,808 (-) |
| PUBLIC STORAGE | 127.911 (-) | 30,329 (-) | 101.076 (-) | 24,382 (-) |
| SUN COMMUNITIES INC | 93.136 (-) | 13,993 (-) | 69.88 (-) | 10,371 (-) |
| TAUBMAN CENTERS INC | 17.062 (-) | 644 (-) | 34.802 (-) | 1,427 (-) |
| TANGER FACTORY OUTLET | 71.465 (-) | 899 (-) | 52.696 (-) | 660 (-) |
| UMH PROPERTIES INC | 23.776 (-) | 406 (-) | 17.114 (-) | 312 (-) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 22.796 (-) | 439 (-) | 16.452 (-) | 313 (-) |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 8.054 (-) | 538 (-) | 5.872 (-) | 380 (-) |
| VENTAS INC | 313.759 (-) | 15,541 (-) | 248.73 (-) | 12,559 (-) |
| VORNADO REALTY TRUST | 133.257 (-) | 5,506 (-) | 106.394 (-) | 4,459 (-) |
| WASHINGTON REIT | 66.111 (-) | 1,498 (-) | 48.894 (-) | 1,080 (-) |
| GEO GROUP INC | 86.5 (-) | 763 (-) | 65.851 (-) | 530 (-) |
| WEINGARTEN REALTY INVST | 96.481 (-) | 2,364 (-) | 75.395 (-) | 1,884 (-) |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 114.558 (-) | 4,774 (-) | 90.633 (-) | 3,794 (-) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 65.403 (-) | 1,072 (-) | 50.154 (-) | 850 (-) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 110.153 (-) | 13,559 (-) | 85.731 (-) | 10,769 (-) |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 72.38 (-) | 376 (-) | 58.856 (-) | 294 (-) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 179.464 (-) | 1,988 (-) | 144.323 (-) | 1,613 (-) |
| CUBESMART | 163.684 (-) | 5,903 (-) | 127.064 (-) | 4,641 (-) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 235.042 (-) | 33,562 (-) | 182.522 (-) | 25,861 (-) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 170.504 (-) | 1,468 (-) | 128.417 (-) | 1,120 (-) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 479.782 (-) | 9,914 (-) | 358.894 (-) | 7,333 (-) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 133.386 (-) | 4,113 (-) | 104.81 (-) | 3,189 (-) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 90.984 (-) | 1,338 (-) | 68.328 (-) | 1,020 (-) |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 102.304 (-) | 1,707 (-) | 81.38 (-) | 1,352 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|-------------------------------------|------------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 76.394 | 655 | 58.833 | 509 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TERRENO REALTY CORP | 56.238 | 3,314 | 43.608 | 2,527 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 39.997 | 1,195 | 30.694 | 932 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RLJ LODGING TRUST | 138.035 | 1,851 | 109.904 | 1,480 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 205.295 | 7,536 | 145.23 | 5,273 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CORESITE REALTY CORP | 35.686 | 4,352 | 27.254 | 3,239 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VEREIT INC | 453.253 | 7,220 | 317.247 | 5,460 |
| | (△346.802) | (-) | (-) | (-) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 104.49 | 2,067 | 81.003 | 1,684 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 31.775 | 789 | 24.13 | 600 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 20.044 | 167 | 10.675 | 101 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 29.228 | 349 | 22.11 | 276 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 169.943 | 2,850 | 131.132 | 2,176 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WHITESTONE REIT | 9.906 | 66 | 5.471 | 34 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 124.175 | 3,189 | 98.7 | 2,531 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 126.984 | 4,153 | 96.854 | 3,174 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | 178.403 | 1,677 | 138.584 | 1,320 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CYRUSONE INC | 101.07 | 7,275 | 77.856 | 5,389 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WP CAREY INC | 145.942 | 10,186 | 113.024 | 7,755 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 59.301 | 923 | 26.081 | 462 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GLADSTONE LAND CORP | 11.793 | 217 | 6.505 | 129 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | 183.103 | 5,034 | 144.568 | 3,886 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 43.138 | 2,798 | 33.761 | 2,273 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | 12.639 | 141 | 28.41 | 422 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 46.296 | 511 | 18.422 | 246 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 94.57 | 3,843 | 70.283 | 2,829 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 167.642 | 3,014 | 129.284 | 2,282 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 107.612 | 5,350 | 81.852 | 4,019 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 227.14 | 7,169 | 176.07 | 5,541 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 66.782 | 945 | 45.859 | 651 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 19.924 | 3,276 | 14.251 | 2,323 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 88.795 | 2,738 | 71.487 | 2,183 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | 71.875 | 607 | 54.134 | 467 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL VALUE INC | 5.726 | 87 | 2.272 | 30 |
| | (0.336) | (5) | (-) | (-) |
| INVITATION HOMES INC | 478.21 | 14,636 | 372.084 | 11,321 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QTS REALTY TRUST INC | 53.808 | 3,434 | 39.318 | 2,443 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COREPOINT LODGING INC | 14.453 | 126 | 8.995 | 93 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 719.6 | 516 | 365.2 | 254 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 109.747 | 1,043 | 87.084 | 831 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 10.794 | 149 | 2.734 | 36 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SAFEHOLD INC | 8.948 | 612 | 6.341 | 439 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 98.973 | 2,127 | 72.351 | 1,551 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 47.62 | 1,074 | 37.302 | 841 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 93.556 | 1,369 | 72.487 | 1,078 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 183.791 | 7,736 | 143.608 | 5,952 |
| | (2.508) | (100) | (-) | (-) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 245.333 | 4,354 | 193.409 | 3,527 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 8.056 | 22 | 13.391 | 36 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | 37.354 | 589 | 36.549 | 584 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIME US REIT | 371.2 | 301 | 303.4 | 244 |
| | (-) | (△2) | (-) | (-) |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | 42.4 | 15 | 197.5 | 61 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | 12.476 | 132 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|----------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC | 2.541 | 27 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 4.82 | 53 | 3.022 | 41 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| CITY OFFICE REIT INC | 25.759 | 250 | 18.121 | 176 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NETSTREIT CORP | 10.996 | 216 | — | — |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | 40.053 | 24 | 9.926 | 18 |
| | (△79.4) | (—) | (—) | (—) |
| CARETRUST REIT INC | 77.978 | 1,699 | 59.797 | 1,283 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 81.617 | 3,533 | 70.035 | 2,970 |
| | (62.174) | (—) | (—) | (—) |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 75.559 | 1,735 | 6.983 | 140 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | 34.72 | 201 | 25.202 | 142 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| STORE CAPITAL CORP | 197.895 | 6,267 | 150.39 | 4,717 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| PARAMOUNT GROUP INC | 129.796 | 1,151 | 104.552 | 921 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 21.594 | 302 | 8.051 | 109 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 87.924 | 1,323 | 66.193 | 1,015 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 63.539 | 1,393 | 47.25 | 1,000 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 96.335 | 1,526 | 77.994 | 1,285 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 14.983 | 665 | 11.479 | 529 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 52.808 | 2,060 | 38.174 | 1,479 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 13.617 | 628 | 9.326 | 443 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 161.5 | 2,153 | 125.605 | 1,687 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| GLOBAL NET LEASE INC | 67.743 | 1,175 | 53.161 | 923 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,187.6 | 881 | 951.3 | 684 |
| | (—) | (△8) | (—) | (—) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 190.22 | 3,371 | 148.94 | 2,734 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| VICI PROPERTIES INC | 463.276 | 12,455 | 348.152 | 9,456 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 15.938 | 249 | 9.706 | 151 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 56.394 | 1,551 | 39.877 | 1,072 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|---------|----------|---------|----------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千□ | 千アメリカ・ドル | 千□ | 千アメリカ・ドル |
| COLONY CAPITAL INC | 389.126 | 2,032 | 289.658 | 1,581 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 64.667 | 1,616 | 51.366 | 1,300 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 74.876 | 3,867 | 59.233 | 3,061 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 130.933 | 1,742 | 103.689 | 1,405 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 69.508 | 1,101 | 47.408 | 781 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 132.859 | 2,410 | 106.957 | 1,968 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 54.719 | 2,192 | 43.752 | 1,743 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR | 82.534 | 724 | 63.029 | 554 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST | 20.124 | 412 | 15.885 | 316 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 6.455 | 222 | 16.452 | 591 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 16.236 | 563 | 12.456 | 430 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 40.38 | 404 | 30.455 | 304 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 36.382 | 534 | 28.574 | 427 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 63.35 | 893 | 50.078 | 694 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 81.702 | 1,033 | 61.954 | 781 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 4.712 | 70 | 2.131 | 31 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 63.315 | 814 | 42.925 | 550 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 71.588 | 1,002 | 54.582 | 772 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 26.954 | 2,080 | 20.881 | 1,596 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 36.323 | 239 | 26.718 | 171 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 137.653 | 1,838 | 109.158 | 1,462 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 7.257 | 150 | 3.429 | 73 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 37.226 | 573 | 27.11 | 425 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PLAZA RETAIL REIT | 30.759 | 112 | 10.148 | 33 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|--|------------------|---------------|------------------|---------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| カナダ | 千□ | 千カナダ・ドル | 千□ | 千カナダ・ドル |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 28.277 (-) | 529 (-) | 21.219 (-) | 395 (-) |
| SLATE GROCERY REIT | 16.175 (-) | 182 (-) | 11.141 (-) | 121 (-) |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11.824 (-) | 123 (-) | 4.736 (-) | 48 (-) |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 34.635 (-) | 630 (-) | 24.623 (-) | 449 (-) |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| BWP TRUST | 400.076 (-) | 1,645 (-) | 321.248 (-) | 1,300 (-) |
| MIRVAC GROUP | 3,340.585 (-) | 8,245 (-) | 2,675.213 (-) | 6,532 (-) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 1,351.602 (-) | 1,177 (-) | 1,056.859 (-) | 885 (-) |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 433.207 (-) | 1,586 (-) | 333.977 (-) | 1,225 (-) |
| GPT GROUP | 1,645.239 (-) | 7,294 (-) | 1,310.039 (-) | 5,830 (-) |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 478.84 (-) | 1,117 (-) | 249.712 (-) | 604 (-) |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 297.815 (-) | 861 (-) | 201.422 (-) | 563 (-) |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 221.401 (-) | 669 (-) | 142.208 (-) | 432 (-) |
| STOCKLAND | 1,992.086 (-) | 8,608 (-) | 1,590.344 (-) | 6,859 (-) |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 199.425 (-) | 1,003 (-) | 133.442 (-) | 674 (-) |
| DEXUS | 950.177 (-) | 8,958 (-) | 766.973 (-) | 7,215 (-) |
| GOODMAN GROUP | 1,420.64 (-) | 25,629 (-) | 1,109.628 (-) | 19,853 (-) |
| VICINITY CENTRES | 3,334.19 (-) | 5,243 (-) | 2,705.043 (-) | 4,206 (-) |
| CHARTER HALL GROUP | 380.505 (-) | 4,955 (-) | 296.319 (-) | 3,790 (-) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 209.892 (-) | 731 (-) | 159.678 (-) | 547 (-) |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 919.023 (-) | 2,200 (-) | 706.805 (-) | 1,682 (-) |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 430.095 (-) | 1,378 (-) | 217.121 (-) | 695 (-) |
| ARENA REIT | 198.806 (-) | 589 (-) | 133.033 (-) | 400 (-) |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 470.705 (-) | 2,230 (-) | 332.916 (-) | 1,579 (-) |
| APN INDUSTRIA REIT | 96.073 (-) | 285 (-) | 64.835 (-) | 191 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|--------------|-------------|-----------|-------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千□ | 千オーストラリア・ドル | 千□ | 千オーストラリア・ドル |
| NATIONAL STORAGE REIT | 843.968 | 1,643 | 608.162 | 1,163 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 32.489 | 105 | 9.185 | 28 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GDI PROPERTY GROUP | 236.815 | 267 | 126.789 | 135 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOME CONSORTIUM LTD | 133.803 | 549 | 47.823 | 196 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RURAL FUNDS GROUP | 231.597 | 558 | 173.393 | 408 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRONGATE GROUP | 479.341 | 657 | 223.193 | 301 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCENTRE GROUP | 4,384.993 | 11,752 | 3,491.308 | 9,302 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HOME CO DAILY NEEDS REIT | 229.327 | 308 | 46.547 | 61 |
| | (30.33) | (-) | (-) | (-) |
| CENTURIA OFFICE REIT | 298.744 | 638 | 235.378 | 491 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD | 364.512 | 983 | 188.049 | 521 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WAYPOINT REIT LTD | 671.797 | 1,730 | 497.872 | 1,263 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| 香港 | 千□ | 千香港・ドル | 千□ | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 1,715.3 | 119,146 | 1,345.6 | 92,987 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PROSPERITY REIT | 791 | 1,970 | 555 | 1,381 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,040 | 3,993 | 727 | 2,784 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CHAMPION REIT | 1,496 | 6,593 | 1,161 | 5,036 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 737 | 2,906 | 599 | 2,373 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,193 | 8,695 | 918 | 6,726 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 3,541.1 | 7,366 | 2,946.7 | 6,038 |
| | (735.249) | (1,493) | (-) | (-) |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVT | 2,855 | 8,720 | 2,191.9 | 6,566 |
| | (-) | (△52) | (-) | (-) |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 460 | 785 | 279.8 | 479 |
| | (△1,021.179) | (△1,757) | (-) | (-) |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 1,785 | 2,661 | 1,476.6 | 2,212 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 2,606.5 | 5,110 | 2,116 | 4,080 |
| | (-) | (△11) | (-) | (-) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 1,199.3 | 596 | 916.7 | 455 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASCOTT TRUST | 1,595.5 | 1,624 | 1,234 | 1,233 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|-----------|------------|---------|------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| KEPPEL REIT | 1,741 | 1,977 | 1,343.1 | 1,526 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 1,208 | 2,987 | 793.4 | 1,893 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESR REIT | 1,765.3 | 687 | 1,253.1 | 476 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 584.2 | 712 | 469.9 | 556 |
| | (-) | (△5) | (-) | (-) |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 729.9 | 963 | 512.3 | 669 |
| | (-) | (△6) | (-) | (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 554.9 | 192 | 126.2 | 53 |
| | (-) | (△11) | (-) | (-) |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 462.1 | 595 | 385.8 | 492 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| PARKWAY LIFE REIT | 339 | 1,377 | 279.3 | 1,130 |
| | (-) | (△3) | (-) | (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 3,757.7 | 277 | 1,613.6 | 108 |
| | (-) | (△4) | (-) | (-) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 1,625.5 | 4,650 | 1,168.2 | 3,260 |
| | (-) | (△0.81437) | (-) | (-) |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 1,857 | 3,797 | 1,473.4 | 2,961 |
| | (-) | (△8) | (-) | (-) |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | 1,070.7 | 740 | 793.6 | 541 |
| | (-) | (△0.60706) | (-) | (-) |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 364.1 | 133 | 337.1 | 120 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST | 1,562.4 | 1,534 | 1,157.6 | 1,125 |
| | (-) | (△20) | (-) | (-) |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 761.4 | 454 | 541.2 | 311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SPH REIT | 712.8 | 601 | 477.9 | 391 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | 659.9 | 339 | 934.9 | 489 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 169.5 | 118 | 42.1 | 29 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 325.1 | 266 | 282.2 | 235 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| QUE COMMERCIAL REIT | 1,496.3 | 568 | 1,149 | 414 |
| | (-) | (△0.35666) | (-) | (-) |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 783.9 | 570 | 565.3 | 422 |
| | (-) | (△1) | (-) | (-) |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST-RTS | - | - | 3,422.4 | - |
| | (3,422.4) | (-) | (-) | (-) |
| IREIT GLOBAL-RTS | - | - | 98.926 | 11 |
| | (98.926) | (-) | (-) | (-) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS | - | - | 596.624 | 0.59609 |
| | (596.624) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | 400.4 | 196 | 259 | 119 |
| | (-) | (△0.72217) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|------------|--------------|-----------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千□ | 千シンガポール・ドル |
| IREIT GLOBAL | 355.6 | 241 | 141.1 | 85 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KEPPEL DC REIT | 1,050.6 | 2,906 | 818.8 | 2,212 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 2,329.8 | 3,237 | 1,738 | 2,399 |
| | (-) | (△25) | (-) | (-) |
| ニュージーランド | 千□ | 千ニュージーランド・ドル | 千□ | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES | 818.851 | 1,369 | 634.984 | 1,044 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 326.559 | 997 | 253.05 | 752 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 955.298 | 2,179 | 763.949 | 1,734 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 1,275.587 | 1,541 | 980.325 | 1,174 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 480.741 | 704 | 339.798 | 492 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 809.176 | 3,771 | 648.99 | 3,069 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | - | - | 9.186 | 4 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| DERWENT LONDON PLC | 98.214 | 3,129 | 76.905 | 2,431 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 135.61 | 1,541 | 106.284 | 1,201 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| HAMMERSON PLC | 4,457.433 | 1,893 | 2,508.405 | 724 |
| | (△206.045) | (-) | (-) | (-) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 647.307 | 4,259 | 513.372 | 3,373 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 100.7 | 766 | 76.048 | 576 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| UNITE GROUP PLC | 350.775 | 3,565 | 271.617 | 2,731 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 1,083.806 | 1,627 | 821.88 | 1,213 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SHAFTESBURY PLC | 269.444 | 1,562 | 188.826 | 1,118 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SEGRO PLC | 1,030.372 | 9,810 | 793.102 | 7,430 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 196.688 | 1,322 | 151.001 | 1,011 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ASSURA PLC | 2,162.775 | 1,628 | 1,708.072 | 1,267 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD | 179.591 | 99 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | 126.599 | 43 | 59.156 | 19 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 423.894 | 337 | 336.768 | 262 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|--|------------------|----------------|------------------|----------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| イギリス | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千□ | 千イギリス・ポンド |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 499.046 (-) | 355 (-) | 405.154 (-) | 288 (-) |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 172.095 (-) | 1,406 (-) | 134.653 (-) | 1,079 (-) |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 722.168 (-) | 1,628 (-) | 567.785 (-) | 1,241 (-) |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 588.23 (-) | 433 (-) | 462.843 (-) | 334 (-) |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC | 731.393 (-) | 1,120 (-) | 580.621 (-) | 896 (-) |
| GCP STUDENT LIVING PLC | 484.173 (-) | 688 (-) | 273.977 (-) | 396 (-) |
| RDI REIT PLC | 171.611 (-) | 179 (-) | 245.662 (-) | 280 (-) |
| NEWRIVER REIT PLC | 172.393 (-) | 146 (-) | 134.927 (-) | 116 (-) |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 420.594 (-) | 467 (-) | 316.392 (-) | 343 (-) |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 285.966 (-) | 306 (-) | 218.614 (-) | 230 (-) |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 750.126 (-) | 819 (-) | 378.359 (-) | 410 (-) |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 1,443.65 (-) | 2,536 (-) | 1,145.637 (-) | 2,002 (-) |
| CUSTODIAN REIT PLC | 376.931 (-) | 350 (-) | 174.011 (-) | 156 (-) |
| HOME REIT PLC | 134.476 (-) | 154 (-) | 33.663 (-) | 38 (-) |
| HAMMERSON PLC-RTS | - (7,236.264) | - (-) | 7,236.264 (-) | 496 (-) |
| ELITE COMMERCIAL REIT | 112 (-) | 74 (-) | 112 (-) | 68 (-) |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 391.663 (-) | 287 (-) | 296.627 (-) | 210 (-) |
| AEW UK REIT PLC | 74.995 (-) | 67 (-) | 45.965 (-) | 45 (-) |
| LXI REIT PLC | 452.547 (-) | 566 (-) | 320.025 (-) | 387 (-) |
| REGIONAL REIT LTD | 234.481 (-) | 183 (-) | 157.884 (-) | 119 (-) |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 327.512 (-) | 358 (-) | 174.095 (-) | 188 (-) |
| イスラエル | 千□ | 千イスラエル・シュケル | 千□ | 千イスラエル・シュケル |
| REIT 1 LTD | 103.154 (-) | 1,603 (-) | 70.342 (-) | 1,057 (-) |
| 韓国 | 千□ | 千韓国・ウォン | 千□ | 千韓国・ウォン |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT | 82.061 (-) | 340,087 (-) | 42.218 (-) | 180,520 (-) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 31.802 (-) | 229,457 (-) | 23.061 (-) | 167,543 (-) |

| | 買 付 額 | | 売 付 額 | |
|---------------------------------------|-----------|---------|---------|---------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| 韓国 | 千□ | 千韓国・ウォン | 千□ | 千韓国・ウォン |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 9.958 | 47,204 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| LOTTE REIT CO LTD | 119.571 | 626,223 | 90.462 | 470,659 |
| | (-) | (26) | (-) | (-) |
| LOTTE REIT CO LTD RTS | - | - | 20.343 | 2,443 |
| | (20.343) | (△26) | (-) | (-) |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 27.582 | 145,503 | 9.722 | 58,867 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| JR REIT XXVII | 98.87 | 519,809 | 42.648 | 220,349 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 46.423 | 354,574 | - | - |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (シンガポール) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| CROMWELL REIT EUR | 1,296.1 | 608 | 529 | 290 |
| | (△635.36) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (アイルランド) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HIBERNIA REIT PLC | 518.752 | 597 | 420.108 | 466 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 297.438 | 461 | 202.808 | 311 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (オランダ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 28.976 | 485 | 23.192 | 384 |
| | (0.958) | (-) | (-) | (-) |
| VASTNED RETAIL | 14.275 | 344 | 11.302 | 270 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WERELDHAVE NV | 23.656 | 296 | 16.76 | 224 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| NSI NV | 13.815 | 453 | 10.836 | 352 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| BEFIMMO | 20.334 | 738 | 14.982 | 530 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| COFINIMMO SA | 23.405 | 2,939 | 16.927 | 2,108 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| RETAIL ESTATES | 8.705 | 522 | 6.848 | 400 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 16.202 | 357 | 12.566 | 271 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| WAREHOUSES DE PAUW | 119.698 | 3,444 | 93.353 | 2,646 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| MONTEA SCA | 7.779 | 745 | 6.313 | 588 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEDIFICA | 26.131 | 2,595 | 18.409 | 1,811 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| CARE PROPERTY INVEST NV | 19.974 | 527 | 7.94 | 200 |
| | (-) | (-) | (-) | (-) |
| AEDIFICA SA-RTS | - | - | 10.417 | 8 |
| | (10.417) | (-) | (-) | (-) |
| XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS | - | - | 6.997 | 2 |
| | (6.997) | (-) | (-) | (-) |

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|----------------|-----------------|----------------|--------------|
| | □ 数 | 金 額 | □ 数 | 金 額 |
| ユーロ (ベルギー) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 13.746 (-) | 670 (-) | 5.507 (-) | 257 (-) |
| ユーロ (フランス) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| GECINA SA | 45.846 (-) | 5,543 (-) | 36.902 (-) | 4,373 (-) |
| ICADE | 25.127 (-) | 1,557 (-) | 18.718 (-) | 1,146 (-) |
| ALTAREA | 2.295 (-) | 324 (△10) | 1.629 (-) | 227 (-) |
| KLEPIERRE | 165.257 (-) | 3,136 (△151) | 132.011 (-) | 2,498 (-) |
| COVIVIO | 41.233 (-) | 2,908 (-) | 32.657 (-) | 2,280 (-) |
| MERCIALYS | 26.14 (-) | 203 (-) | 14.283 (-) | 134 (-) |
| CARMILA SA | 38.138 (-) | 389 (△7) | 16.285 (-) | 221 (-) |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 115.654 (-) | 6,959 (-) | 91.353 (-) | 5,538 (-) |
| ユーロ (ドイツ) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| HAMBORNER REIT AG | 44.28 (-) | 395 (-) | 33.716 (-) | 296 (-) |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 145.224 (-) | 1,997 (△80) | 107.058 (-) | 1,450 (-) |
| ユーロ (スペイン) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 212.459 (-) | 1,719 (△3) | 165.535 (-) | 1,329 (-) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 22.988 (-) | 107 (△3) | 13.966 (-) | 68 (-) |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 271.462 (-) | 2,223 (△43) | 222.224 (-) | 1,818 (-) |
| ユーロ (イタリア) | 千□ | 千ユーロ | 千□ | 千ユーロ |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 27.255 (-) | 94 (-) | 16.303 (-) | 54 (-) |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は合併、分割等による増減分で、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 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘 | 柄 | 期 首(前期末) | | 当 期 | | 末 | |
|----------------------------------|---|----------|---------|-----------|-------------|---|-----|
| | | □ 数 | □ 数 | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 | 率 |
| | | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | % |
| 不動産ファンド | | | | | | | |
| (アメリカ) | | | | | | | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | | — | 354.4 | 269 | 29,703 | | 0.0 |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | | 72.7 | 72.7 | 0 | 0 | | 0.0 |
| PRIME US REIT | | 143.6 | 211.4 | 182 | 20,165 | | 0.0 |
| ARA US HOSPITALITY TRUST | | 155.1 | — | — | — | | — |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME | | 422.1 | 658.4 | 506 | 55,908 | | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | | 37.388 | 64.515 | 12,029 | 1,326,609 | | 1.7 |
| ALEXANDER'S INC. | | 0.658 | 0.989 | 272 | 30,066 | | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES INC | | 42.842 | 66.493 | 7,954 | 877,228 | | 1.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | | 13.779 | — | — | — | | — |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | | 67.224 | 109.6 | 4,022 | 443,581 | | 0.6 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | | 44.475 | 68.881 | 515 | 56,819 | | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | | 15.954 | 29.676 | 2,087 | 230,199 | | 0.3 |
| BRT APARTMENTS CORP | | 3.832 | 3.832 | 68 | 7,593 | | 0.0 |
| SL GREEN | | 22.676 | 33.08 | 2,646 | 291,881 | | 0.4 |
| EPR PROPERTIES | | 22.743 | 34.918 | 1,857 | 204,821 | | 0.3 |
| PROLOGIS INC | | 218.819 | 346.969 | 42,534 | 4,690,752 | | 5.9 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | | 41.682 | 65.657 | 13,925 | 1,535,742 | | 1.9 |
| LEXINGTON REALTY TRUST | | 81.846 | 129.482 | 1,615 | 178,205 | | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | | 28.877 | 45.941 | 6,222 | 686,189 | | 0.9 |
| CBL & ASSOCIATES | | 14.685 | — | — | — | | — |
| MACK CALI | | 27.227 | 39.452 | 668 | 73,701 | | 0.1 |
| EQUINIX INC | | 26.224 | 42.011 | 34,554 | 3,810,620 | | 4.8 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | | 51.259 | 82.875 | 3,971 | 437,962 | | 0.6 |
| CTO REALTY GROUTH INC | | — | 2.965 | 157 | 17,388 | | 0.0 |
| COUSINS PROPERTIES INC | | 43.872 | 70.851 | 2,696 | 297,379 | | 0.4 |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES | | 9.558 | 14.44 | 283 | 31,307 | | 0.0 |
| SITE CENTERS CORP | | 45.456 | 81.132 | 1,225 | 135,103 | | 0.2 |
| DUKE REALTY TRUST | | 109.515 | 175.583 | 8,559 | 943,960 | | 1.2 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | | 9.083 | — | — | — | | — |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | | 19.381 | 30.569 | 9,420 | 1,038,887 | | 1.3 |
| EQUITY RESIDENTIAL | | 103.634 | 161.226 | 12,794 | 1,411,021 | | 1.8 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | | 20.972 | 33.02 | 3,953 | 435,990 | | 0.6 |
| FIRST INDUSTRIAL RT | | 37.957 | 60.986 | 3,257 | 359,210 | | 0.5 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | | 159.473 | 253.462 | 8,577 | 945,888 | | 1.2 |
| EQUITY COMMONWEALTH | | 35.738 | 56.714 | 1,577 | 173,935 | | 0.2 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | | 40.136 | 65.332 | 2,015 | 222,268 | | 0.3 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | | 31.134 | 48.629 | 2,274 | 250,818 | | 0.3 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | | 49.829 | 76.025 | 1,036 | 114,274 | | 0.1 |
| WELLTOWER INC | | 123.686 | 196.362 | 15,822 | 1,744,943 | | 2.2 |
| EAST GROUP | | 11.518 | 18.728 | 3,177 | 350,361 | | 0.4 |
| KIMCO REALTY | | 126.14 | 204.567 | 4,299 | 474,203 | | 0.6 |
| KILROY REALTY CORP | | 31.365 | 50.045 | 3,615 | 398,689 | | 0.5 |
| LTC PROPERTIES INC | | 11.953 | 17.932 | 687 | 75,779 | | 0.1 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | | 72.676 | 112.836 | 454 | 50,147 | | 0.1 |
| MONMOUTH RE INVEST CP -CL A | | 29.217 | 48.171 | 919 | 101,358 | | 0.1 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | | 49.719 | 83.055 | 1,200 | 132,351 | | 0.2 |
| IRON MOUNTAIN INC | | 85.668 | 135.791 | 6,159 | 679,267 | | 0.9 |
| THE MACERICH COMPANY | | 34.714 | 78.672 | 1,398 | 154,171 | | 0.2 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | | 53.835 | 79.741 | 6,120 | 674,927 | | 0.9 |
| ACADIA REALTY TRUST | | 24.839 | 42.275 | 919 | 101,447 | | 0.1 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | | 208.857 | 332.075 | 5,854 | 645,632 | | 0.8 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 | | 期 | | 末 |
|----------------------------------|---------|---------|---|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| MID AMERICA | | 33.983 | | 53.615 | 9,167 | 1,010,946 | 1.3 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | | 12.444 | | 16.618 | 193 | 21,313 | 0.0 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | | 12.733 | | 21.18 | 1,397 | 154,111 | 0.2 |
| CENTERSPACE | | 3.559 | | 6.06 | 470 | 51,913 | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | | 5.097 | | 7.856 | 226 | 24,959 | 0.0 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | | 8.333 | | 29.075 | 72 | 8,015 | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | | 10.38 | | 16.951 | 555 | 61,296 | 0.1 |
| PS BUSINESS PARKS | | 5.805 | | 9.349 | 1,429 | 157,641 | 0.2 |
| RPT REALTY | | 25.39 | | 37.794 | 503 | 55,558 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | | 101.743 | | 175.691 | 11,957 | 1,318,676 | 1.7 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 49.99 | | 74.742 | 4,891 | 539,474 | 0.7 |
| UDR INC | | 87.344 | | 139.707 | 6,922 | 763,411 | 1.0 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | | 32.504 | | 52.297 | 1,527 | 168,405 | 0.2 |
| CORECIVIC INC | | 35.793 | | — | — | — | — |
| SAUL CENTERS INC | | 3.788 | | 6.198 | 291 | 32,125 | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 90.583 | | 154.013 | 20,252 | 2,233,468 | 2.8 |
| LIFE STORAGE INC | | 13.99 | | 35.667 | 3,867 | 426,454 | 0.5 |
| PUBLIC STORAGE | | 44.536 | | 71.371 | 21,664 | 2,389,179 | 3.0 |
| SUN COMMUNITIES INC | | 29.114 | | 52.37 | 9,227 | 1,017,561 | 1.3 |
| TAUBMAN CENTERS INC | | 17.74 | | — | — | — | — |
| TANGER FACTORY OUTLET | | 28.639 | | 47.408 | 876 | 96,616 | 0.1 |
| UMH PROPERTIES INC | | 11.534 | | 18.196 | 401 | 44,246 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | | 10.478 | | 16.822 | 381 | 42,111 | 0.1 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | | 3.813 | | 5.995 | 374 | 41,274 | 0.1 |
| VENTAS INC | | 110.685 | | 175.714 | 10,124 | 1,116,545 | 1.4 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 47.3 | | 74.163 | 3,569 | 393,640 | 0.5 |
| WASHINGTON REIT | | 24.141 | | 41.358 | 953 | 105,130 | 0.1 |
| GEO GROUP INC | | 36.455 | | 57.104 | 446 | 49,245 | 0.1 |
| WEINGARTEN REALTY INVST | | 35.001 | | 56.087 | 1,803 | 198,856 | 0.3 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | | 41.075 | | 65 | 3,172 | 349,879 | 0.4 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | | 25.625 | | 40.874 | 901 | 99,437 | 0.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | | 38.157 | | 62.579 | 10,241 | 1,129,452 | 1.4 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | | 33.124 | | 46.648 | 247 | 27,316 | 0.0 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | | 64.963 | | 100.104 | 1,307 | 144,175 | 0.2 |
| CUBESMART | | 57.831 | | 94.451 | 4,459 | 491,742 | 0.6 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | | 79.493 | | 132.013 | 20,551 | 2,266,450 | 2.9 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | | 60.643 | | 102.73 | 1,047 | 115,556 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | | 156.528 | | 277.416 | 5,623 | 620,128 | 0.8 |
| DOUGLAS EMMETT INC | | 49.264 | | 77.84 | 2,777 | 306,284 | 0.4 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | | 35.098 | | 57.754 | 1,038 | 114,580 | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | | 36.359 | | 57.283 | 1,114 | 122,932 | 0.2 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | | 31.285 | | 48.846 | 477 | 52,628 | 0.1 |
| TERRENO REALTY CORP | | 19.467 | | 32.097 | 2,134 | 235,422 | 0.3 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | | 14.433 | | 23.736 | 899 | 99,154 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | | 48.111 | | 76.242 | 1,191 | 131,416 | 0.2 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | | 59.337 | | 119.402 | 4,532 | 499,844 | 0.6 |
| CORESITE REALTY CORP | | 11.921 | | 20.353 | 2,694 | 297,153 | 0.4 |
| VEREIT INC | | 318.763 | | 107.967 | 5,090 | 561,396 | 0.7 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | | 37.688 | | 61.175 | 1,444 | 159,349 | 0.2 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | | 14.519 | | 22.164 | 656 | 72,423 | 0.1 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES | | 14.783 | | 24.152 | 252 | 27,860 | 0.0 |
| CHATHAM LODGING TRUST | | 15.244 | | 22.362 | 301 | 33,292 | 0.0 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | | 59.548 | | 98.359 | 1,751 | 193,185 | 0.2 |
| WHITESTONE REIT | | 13.415 | | 17.85 | 148 | 16,397 | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | | 45.098 | | 70.573 | 2,040 | 225,000 | 0.3 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | | |
|----------------------------------|---------|---------|----|---------|----------|-----------|-----|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | | 千口 | | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| STAG INDUSTRIAL INC | | 44.62 | | 74.75 | 2,916 | 321,658 | 0.4 |
| RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC | | 64.534 | | 104.353 | 1,241 | 136,945 | 0.2 |
| CYRUSONE INC | | 33.769 | | 56.983 | 3,979 | 438,817 | 0.6 |
| WP CAREY INC | | 50.961 | | 83.879 | 6,449 | 711,246 | 0.9 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | | — | | 33.22 | 633 | 69,826 | 0.1 |
| GLADSTONE LAND CORP | | 6.064 | | 11.352 | 281 | 31,047 | 0.0 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC | | 64.729 | | 103.264 | 2,943 | 324,556 | 0.4 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | | 16.325 | | 25.702 | 2,128 | 234,774 | 0.3 |
| FRONT YARD RESIDENTIAL CORP | | 15.771 | | — | — | — | — |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | | — | | 27.874 | 391 | 43,158 | 0.1 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | | 30.498 | | 54.785 | 2,662 | 293,626 | 0.4 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | | 60.012 | | 98.37 | 1,876 | 206,984 | 0.3 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | | 36.348 | | 62.108 | 3,656 | 403,285 | 0.5 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | | 76.081 | | 127.151 | 4,986 | 549,951 | 0.7 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | | 25.835 | | 46.758 | 863 | 95,188 | 0.1 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | | 5.514 | | 11.187 | 2,109 | 232,688 | 0.3 |
| JBG SMITH PROPERTIES | | 34.3 | | 51.608 | 1,743 | 192,253 | 0.2 |
| AMERICAN FINANCE TRUST INC | | 32.571 | | 50.312 | 424 | 46,828 | 0.1 |
| RETAIL VALUE INC | | 5.004 | | 8.794 | 189 | 20,860 | 0.0 |
| INVITATION HOMES INC | | 160.366 | | 266.492 | 10,001 | 1,102,959 | 1.4 |
| QTS REALTY TRUST INC | | 17.856 | | 32.346 | 2,497 | 275,381 | 0.3 |
| COREPOINT LODGING INC | | 13.648 | | 19.106 | 197 | 21,828 | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | | 45.046 | | 67.709 | 838 | 92,515 | 0.1 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | | 4.986 | | 13.046 | 263 | 29,004 | 0.0 |
| SAFEHOLD INC | | 4.045 | | 6.652 | 521 | 57,527 | 0.1 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | | 26.537 | | 53.159 | 1,467 | 161,801 | 0.2 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | | 19.666 | | 29.984 | 787 | 86,865 | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | | 35.108 | | 56.177 | 989 | 109,097 | 0.1 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | | 60.857 | | 103.548 | 4,826 | 532,252 | 0.7 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | | 88.264 | | 140.188 | 3,259 | 359,443 | 0.5 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | | 5.335 | | — | — | — | — |
| BROOKFIELD PROPERTY REIT INC | | 16.848 | | 17.653 | 328 | 36,190 | 0.0 |
| CIM COMMERCIAL TRUST CORP | | — | | 12.476 | 114 | 12,657 | 0.0 |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT | | 8.102 | | 10.643 | 105 | 11,643 | 0.0 |
| FARMLAND PARTNERS INC | | 9.378 | | 11.176 | 139 | 15,430 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | | 13.297 | | 20.935 | 264 | 29,159 | 0.0 |
| NETSTREIT CORP | | — | | 10.996 | 259 | 28,630 | 0.0 |
| WASHINGTON PRIME GROUP INC | | 49.273 | | — | — | — | — |
| CARETRUST REIT INC | | 28.677 | | 46.858 | 1,087 | 119,937 | 0.2 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | | — | | 73.756 | 3,571 | 393,839 | 0.5 |
| BROADSTONE NET LEASE INC | | — | | 68.576 | 1,710 | 188,610 | 0.2 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC | | 27.59 | | 37.108 | 257 | 28,441 | 0.0 |
| STORE CAPITAL CORP | | 65.92 | | 113.425 | 3,965 | 437,297 | 0.6 |
| PARAMOUNT GROUP INC | | 55.473 | | 80.717 | 874 | 96,402 | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | | 12.189 | | 25.732 | 392 | 43,303 | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | | 32.034 | | 53.765 | 1,059 | 116,805 | 0.1 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | | 21.404 | | 37.693 | 811 | 89,495 | 0.1 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | | 34.147 | | 52.488 | 1,027 | 113,278 | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | | 6.893 | | 10.397 | 582 | 64,254 | 0.1 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | | 17.791 | | 32.425 | 1,634 | 180,293 | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | | 6.19 | | 10.481 | 508 | 56,116 | 0.1 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | | 60.884 | | 96.779 | 1,546 | 170,551 | 0.2 |
| GLOBAL NET LEASE INC | | 26.964 | | 41.546 | 766 | 84,486 | 0.1 |
| CLIPPER REALTY INC | | 5.086 | | 5.086 | 38 | 4,206 | 0.0 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | | 69.339 | | 110.619 | 2,372 | 261,669 | 0.3 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|--------------|--------------|-------------|------------|----|------|
| | □数 | 金額 | □数 | 金額 | 比率 | 率 |
| (アメリカ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 | | % |
| VICI PROPERTIES INC | 137.449 | 252,573 | 8,089 | 892,155 | | 1.1 |
| SERITAGE GROWTH PROPERTIES | 9.418 | 15.65 | 294 | 32,429 | | 0.0 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 20.693 | 37.21 | 1,080 | 119,166 | | 0.2 |
| COLONY CAPITAL INC | 139.081 | 238,549 | 2,027 | 223,611 | | 0.3 |
| 小計 | 7,409.052 | 11,651.995 | 534.054 | 58,895.551 | | - |
| | 157銘柄<74.6%> | 156銘柄<74.6%> | - | - | | 74.6 |
| (カナダ) | 千口 | 千円 | 千カナダ・ドル | 千円 | | % |
| SMARTCENTRES REIT | 20.064 | 33.365 | 996 | 88,778 | | 0.1 |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 24.536 | 40.179 | 2,380 | 211,992 | | 0.3 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 39.965 | 67.209 | 1,102 | 98,213 | | 0.1 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | 30.633 | 52.733 | 942 | 83,915 | | 0.1 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 46.927 | 72.829 | 1,610 | 143,392 | | 0.2 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 18.176 | 29.143 | 1,344 | 119,741 | | 0.2 |
| COMINAR REAL ESTATE INVNT TR | 24.741 | 44.246 | 477 | 42,513 | | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 8.627 | 12.866 | 308 | 27,439 | | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REIT | 9.997 | - | - | - | | - |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 7.095 | 10.875 | 457 | 40,751 | | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 21.186 | 31.111 | 364 | 32,497 | | 0.0 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 13.784 | 21.592 | 387 | 34,513 | | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 18.272 | 31.544 | 542 | 48,286 | | 0.1 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | 24.249 | 43.997 | 568 | 50,658 | | 0.1 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | 6.002 | 8.583 | 144 | 12,871 | | 0.0 |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 22.509 | 42.899 | 650 | 57,951 | | 0.1 |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | 20.873 | 37.879 | 669 | 59,603 | | 0.1 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 8.495 | 14.568 | 1,238 | 110,268 | | 0.1 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 12.414 | 22.019 | 164 | 14,666 | | 0.0 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 46.042 | 74.537 | 1,092 | 97,306 | | 0.1 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | 4.997 | 8.825 | 211 | 18,860 | | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 14.064 | 24.18 | 410 | 36,518 | | 0.0 |
| PLAZA RETAIL REIT | - | 20.611 | 96 | 8,608 | | 0.0 |
| WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES | 12.087 | 19.145 | 438 | 39,075 | | 0.0 |
| SLATE GROCERY REIT | 5.623 | 10.657 | 137 | 12,270 | | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT | 11.634 | 11.634 | 62 | 5,584 | | 0.0 |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT | - | 7.088 | 87 | 7,807 | | 0.0 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV | 14.74 | 24.752 | 513 | 45,736 | | 0.1 |
| 小計 | 487.732 | 819.066 | 17,403 | 1,549,824 | | - |
| | 26銘柄<1.9%> | 27銘柄<2.0%> | - | - | | 2.0 |
| (オーストラリア) | 千口 | 千円 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | % |
| BWP TRUST | 145.963 | 224.791 | 973 | 80,738 | | 0.1 |
| MIRVAC GROUP | 1,181.612 | 1,846.984 | 5,393 | 447,365 | | 0.6 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 570.442 | 865.185 | 787 | 65,308 | | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 136.991 | 236.221 | 921 | 76,418 | | 0.1 |
| GPT GROUP | 575.807 | 911.007 | 4,391 | 364,237 | | 0.5 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | - | 229.128 | 607 | 50,366 | | 0.1 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 100.258 | 196.651 | 619 | 51,383 | | 0.1 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU | 75.176 | 154.369 | 534 | 44,304 | | 0.1 |
| STOCKLAND | 727.078 | 1,128.82 | 5,260 | 436,341 | | 0.6 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 68.692 | 134.675 | 816 | 67,698 | | 0.1 |
| DEXUS | 321.924 | 505.128 | 5,435 | 450,847 | | 0.6 |
| GOODMAN GROUP | 478.528 | 789.54 | 16,517 | 1,370,099 | | 1.7 |
| VICINITY CENTRES | 1,197.4 | 1,826.547 | 2,986 | 247,722 | | 0.3 |
| CHARTER HALL GROUP | 136.701 | 220.887 | 3,339 | 277,037 | | 0.4 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 86.456 | 136.67 | 552 | 45,800 | | 0.1 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | 301.574 | 513.792 | 1,310 | 108,678 | | 0.1 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | - | 212.974 | 796 | 66,071 | | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|---------|------------|----|------------|-------------|-----------|------|
| | □ | 数 | □ | 数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (オーストラリア) | | 千口 | | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % |
| ARENA REIT | | 93.469 | | 159.242 | | 45,439 | 0.1 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | | 123.086 | | 260.875 | 1,254 | 104,086 | 0.1 |
| APN INDUSTRIA REIT | | 41.907 | | 73.145 | 234 | 19,415 | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | | 280.409 | | 516.215 | 1,047 | 86,924 | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | | 50.661 | | 73.965 | 241 | 20,062 | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | | 137.85 | | 247.876 | 280 | 23,234 | 0.0 |
| HOME CONSORTIUM LTD | | - | | 85.98 | 498 | 41,365 | 0.1 |
| RURAL FUNDS GROUP | | 101.989 | | 160.193 | 397 | 32,954 | 0.0 |
| IRONGATE GROUP | | - | | 256.148 | 371 | 30,808 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | | 1,543.922 | | 2,437.607 | 6,874 | 570,202 | 0.7 |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | | - | | 213.11 | 303 | 25,190 | 0.0 |
| CENTURIA OFFICE REIT | | 115.908 | | 179.274 | 419 | 34,797 | 0.0 |
| AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD | | - | | 176.463 | 538 | 44,644 | 0.1 |
| WAYPOINT REIT LTD | | 208.852 | | 382.777 | 1,014 | 84,141 | 0.1 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | <比率> | <比率> | <比率> |
| | | 8,802.655 | | 15,356.239 | 65,264 | 5,413,690 | - |
| | | 25銘柄<6.6%> | | 31銘柄<6.9%> | - | - | 6.9 |
| (香港) | | 千口 | | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % |
| LINK REIT | | 608.02 | | 977.72 | 76,066 | 1,080,145 | 1.4 |
| PROSPERITY REIT | | 361 | | 597 | 1,779 | 25,262 | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | | 448 | | 761 | 3,135 | 44,521 | 0.1 |
| CHAMPION REIT | | 602.07 | | 937.07 | 4,216 | 59,878 | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | | 313 | | 451 | 2,056 | 29,203 | 0.0 |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T | | 405 | | 680 | 5,712 | 81,110 | 0.1 |
| 小計 | □ | 数 | □ | 数 | 金額 | 金額 | 比率 |
| | 銘 | 柄 | 銘 | 柄 | <比率> | <比率> | <比率> |
| | | 2,737.09 | | 4,403.79 | 92,966 | 1,320,122 | - |
| | | 6銘柄<1.9%> | | 6銘柄<1.7%> | - | - | 1.7 |
| (シンガポール) | | 千口 | | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | | 839.66 | | 2,169.309 | 4,555 | 373,509 | 0.5 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVNT | | 881.66 | | 1,544.76 | 4,526 | 371,098 | 0.5 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 840.979 | | - | - | - | - |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | | 698.59 | | 1,006.99 | 1,470 | 120,542 | 0.2 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 880.12 | | 1,370.62 | 2,768 | 227,001 | 0.3 |
| STARHILL GLOBAL REIT | | 374.2 | | 656.8 | 361 | 29,618 | 0.0 |
| ASCOTT TRUST | | 530.116 | | 891.616 | 891 | 73,103 | 0.1 |
| KEPPEL REIT | | 553.6 | | 951.5 | 1,094 | 89,715 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | | 208.3 | | 622.9 | 1,501 | 123,082 | 0.2 |
| ESR REIT | | 636.53 | | 1,148.73 | 470 | 38,615 | 0.0 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | | 250.9 | | 365.2 | 452 | 37,129 | 0.0 |
| CAPITALAND CHINA TRUST | | 232.58 | | 450.18 | 621 | 50,936 | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU | | 180.1 | | 608.8 | 167 | 13,726 | 0.0 |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | | 140.595 | | 216.895 | 307 | 25,252 | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REIT | | 119.3 | | 179 | 789 | 64,722 | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU | | 615 | | 2,759.1 | 176 | 14,477 | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | | 455.82 | | 913.12 | 2,556 | 209,626 | 0.3 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 644.6 | | 1,028.2 | 2,200 | 180,406 | 0.2 |
| ARA LOGOS LOGISTICS TRUST | | 310.78 | | 587.88 | 485 | 39,765 | 0.1 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | | 286.2 | | 313.2 | 134 | 11,042 | 0.0 |
| MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL | | 614.2 | | 1,019 | 1,080 | 88,560 | 0.1 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | | 271.3 | | 491.5 | 289 | 23,775 | 0.0 |
| SPH REIT | | 237 | | 471.9 | 410 | 33,661 | 0.0 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT | | 275 | | - | - | - | - |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT | | - | | 127.4 | 102 | 8,408 | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T | | 165.2 | | 208.1 | 193 | 15,867 | 0.0 |
| QUE COMMERCIAL REIT | | 773.055 | | 1,120.355 | 448 | 36,743 | 0.0 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | | 203.6 | | 422.2 | 339 | 27,866 | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | | 235.7 | | 377.1 | 197 | 16,232 | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|--------------------------|--------------------------|--------------|-----------|----------|
| | □数 | 金額 | □数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (シンガポール) | 千□ | 千円 | 千□ | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| IREIT GLOBAL | - | - | 214.5 | 140 | 11,519 | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | 359.7 | - | 591.5 | 1,520 | 124,637 | 0.2 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T | 723.164 | - | 1,314.964 | 1,814 | 148,783 | 0.2 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 13,537.549 30銘柄<4.1%> | 24,143.319 30銘柄<3.3%> | 32,070 | 2,629,427 | - 3.3 |
| (ニュージーランド) | 千□ | 千円 | 千□ | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | % |
| PRECINCT PROPERTIES | 326.171 | - | 510.038 | 790 | 60,833 | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 106.603 | - | 180.112 | 545 | 41,994 | 0.1 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 328.996 | - | 520.345 | 1,194 | 91,893 | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 447.199 | - | 742.461 | 864 | 66,559 | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 247.066 | - | 388.009 | 601 | 46,278 | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 1,456.035 5銘柄<0.4%> | 2,340.965 5銘柄<0.4%> | 3,996 | 307,559 | - 0.4 |
| (イギリス) | 千□ | 千円 | 千□ | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| BRITISH LAND CO PLC | 277.336 | - | 437.522 | 2,159 | 331,216 | 0.4 |
| CAPITAL & REGIONAL PLC | 9.186 | - | - | - | - | - |
| DERWENT LONDON PLC | 31.508 | - | 52.817 | 1,827 | 280,333 | 0.4 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 48.36 | - | 77.686 | 995 | 152,776 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | 233.838 | - | 1,976.821 | 778 | 119,478 | 0.2 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 221.691 | - | 355.626 | 2,409 | 369,651 | 0.5 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 38.577 | - | 63.229 | 543 | 83,365 | 0.1 |
| INTU PROPERTIES PLC | 231.04 | - | 231.04 | 1 | 283 | 0.0 |
| UNITE GROUP PLC | 106.992 | - | 186.15 | 2,068 | 317,250 | 0.4 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 355.593 | - | 617.519 | 959 | 147,206 | 0.2 |
| SHAFTESBURY PLC | 63.788 | - | 144.406 | 862 | 132,357 | 0.2 |
| SEGRO PLC | 327.645 | - | 564.915 | 6,174 | 947,171 | 1.2 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 73.391 | - | 119.078 | 878 | 134,715 | 0.2 |
| ASSURA PLC | 788.073 | - | 1,242.776 | 945 | 145,078 | 0.2 |
| STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERT | - | - | 179.591 | 131 | 20,110 | 0.0 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | 187.713 | - | 255.156 | 120 | 18,474 | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 170.446 | - | 257.572 | 225 | 34,533 | 0.0 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD | 254.022 | - | 347.914 | 271 | 41,681 | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 60.379 | - | 97.821 | 924 | 141,804 | 0.2 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 269.096 | - | 423.479 | 1,006 | 154,348 | 0.2 |
| BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT | 245.021 | - | 370.408 | 325 | 50,002 | 0.1 |
| CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL | 247.221 | - | 397.993 | 673 | 103,361 | 0.1 |
| GCP STUDENT LIVING PLC | - | - | 210.196 | 348 | 53,396 | 0.1 |
| RDI REIT PLC | 74.051 | - | - | - | - | - |
| NEWRIVER REIT PLC | 102.138 | - | 139.604 | 118 | 18,224 | 0.0 |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 189.831 | - | 294.033 | 345 | 53,043 | 0.1 |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT | 110.038 | - | 177.39 | 186 | 28,572 | 0.0 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | - | - | 371.767 | 438 | 67,294 | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 512.115 | - | 810.128 | 1,598 | 245,191 | 0.3 |
| CUSTODIAN REIT PLC | - | - | 202.92 | 199 | 30,629 | 0.0 |
| HOME REIT PLC | - | - | 100.813 | 114 | 17,629 | 0.0 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 186.961 | - | 281.997 | 243 | 37,288 | 0.0 |
| AEW UK REIT PLC | 54.933 | - | 83.963 | 78 | 12,081 | 0.0 |
| LXI REIT PLC | 159.926 | - | 292.448 | 414 | 63,523 | 0.1 |
| REGIONAL REIT LTD | 129.74 | - | 206.337 | 179 | 27,537 | 0.0 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | - | - | 153.417 | 169 | 25,934 | 0.0 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 5,760.649 30銘柄<5.3%> | 11,724.532 34銘柄<5.6%> | 28,719 | 4,405,550 | - 5.6 |
| (イスラエル) | 千□ | 千円 | 千□ | 千イスラエル・シェケル | 千円 | % |
| REIT 1 LTD | 52.551 | - | 85.363 | 1,515 | 51,165 | 0.1 |
| 小計 | □数・金額 銘柄数<比率> | 52.551 1銘柄<0.1%> | 85.363 1銘柄<0.1%> | 1,515 | 51,165 | - 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当期 | | | 期末 | |
|----------------------------------|------------------|---------|---------|-----------|-----------|----|-----|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 | 率 |
| (韓国) | 千口 | 千円 | 千口 | 千韓国・ウォン | 千円 | | % |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE | - | - | 39,843 | 195,230 | 19,015 | | 0.0 |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 10.894 | - | 19,635 | 162,774 | 15,854 | | 0.0 |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | - | - | 9,958 | 54,769 | 5,334 | | 0.0 |
| LOTTE REIT CO LTD | 25.4 | - | 54,509 | 332,504 | 32,385 | | 0.0 |
| KORAMCO ENERGY PLUS REIT | - | - | 17,86 | 108,053 | 10,524 | | 0.0 |
| JR REIT XXVII | - | - | 56,222 | 295,165 | 28,749 | | 0.0 |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | - | - | 46,423 | 335,174 | 32,645 | | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 36,294 | 244.45 | 1,483,671 | 144,509 | | 0.2 |
| (ユーロ…シンガポール) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| CROMWELL REIT EUR | - | - | 131.74 | 309 | 40,649 | | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | - | 131.74 | 309 | 40,649 | | 0.1 |
| (ユーロ…アイルランド) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| HIBERNIA REIT PLC | 208.204 | - | 306,848 | 382 | 50,200 | | 0.1 |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI | 119.677 | - | 214,307 | 327 | 42,995 | | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 327,881 | 521,155 | 709 | 93,195 | | 0.1 |
| (ユーロ…オランダ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 11.468 | - | 18,21 | 398 | 52,266 | | 0.1 |
| VASTNED RETAIL | 5.849 | - | 8,822 | 227 | 29,826 | | 0.0 |
| WERELDHAVE NV | 11.998 | - | 18,894 | 287 | 37,782 | | 0.0 |
| NSI NV | 5.133 | - | 8,112 | 280 | 36,852 | | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 34,448 | 54,038 | 1,193 | 156,728 | | 0.2 |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| BEFIMMO | 6.929 | - | 12,281 | 421 | 55,389 | | 0.1 |
| COFINIMMO SA | 7.256 | - | 13,734 | 1,801 | 236,589 | | 0.3 |
| RETAIL ESTATES | 3.188 | - | 5,045 | 353 | 46,368 | | 0.1 |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 6.779 | - | 10,415 | 242 | 31,794 | | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW | 38.064 | - | 64,409 | 2,111 | 277,217 | | 0.4 |
| MONTEA SCA | 3.259 | - | 4,725 | 481 | 63,280 | | 0.1 |
| AEDIFICA | 7.985 | - | 15,707 | 1,782 | 234,074 | | 0.3 |
| CARE PROPERTY INVEST NV | - | - | 12,034 | 323 | 42,424 | | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | - | - | 8,239 | 418 | 54,954 | | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 73.46 | 146,589 | 7,936 | 1,042,092 | | 1.3 |
| (ユーロ…フランス) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| GECINA SA | 16.655 | - | 25,599 | 3,403 | 446,864 | | 0.6 |
| ICADE | 8.117 | - | 14,526 | 1,077 | 141,518 | | 0.2 |
| ALTAREA | 0.977 | - | 1,643 | 298 | 39,175 | | 0.0 |
| KLEPIERRE | 60.564 | - | 93,81 | 2,133 | 280,094 | | 0.4 |
| COVIVIO | 14.277 | - | 22,853 | 1,732 | 227,445 | | 0.3 |
| MERCIALYS | 7.165 | - | 19,022 | 196 | 25,775 | | 0.0 |
| CARMILA SA | - | - | 21,853 | 274 | 36,095 | | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD | 40.645 | - | 64,946 | 5,106 | 670,510 | | 0.8 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 148.4 | 264,252 | 14,223 | 1,867,480 | | 2.4 |
| (ユーロ…ドイツ) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| HAMBORNER REIT AG | 21.542 | - | 32,106 | 290 | 38,201 | | 0.0 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 46.459 | - | 84,625 | 1,331 | 174,891 | | 0.2 |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 68,001 | 116,731 | 1,622 | 213,092 | | 0.3 |
| (ユーロ…スペイン) | 千口 | 千円 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 72.211 | - | 119,135 | 1,060 | 139,295 | | 0.2 |

| 銘柄 | 柄 | 期 首(前期末) | | | | 当 期 | | | | 末 | |
|----------------------------------|------------|--------------|--|--------------|--|-----------|-------------|-----|--|------|--|
| | | □ 数 | | □ 数 | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | 比 率 | | | |
| (ユーロ…スペイン) | | 千口 | | 千口 | | 千ユーロ | 千円 | | | % | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | 18.634 | | 27.656 | | 141 | 18,519 | | | 0.0 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 109.392 | | 158.63 | | 1,451 | 190,618 | | | 0.2 | |
| 小 計 | □ 数 | 200.237 | | 305.421 | | 2,653 | 348,434 | | | - | |
| | 銘 柄 数<比 率> | 3銘柄<0.5%> | | 3銘柄<0.4%> | | - | - | | | 0.4 | |
| (ユーロ…イタリア) | | 千口 | | 千口 | | 千ユーロ | 千円 | | | % | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | | 14.335 | | 25.287 | | 112 | 14,725 | | | 0.0 | |
| 小 計 | □ 数 | 14.335 | | 25.287 | | 112 | 14,725 | | | - | |
| | 銘 柄 数<比 率> | 1銘柄<0.0%> | | 1銘柄<0.0%> | | - | - | | | 0.0 | |
| 合 計 | □ 数 | 41,146.369 | | 72,334.932 | | - | 78,493,798 | | | - | |
| | 銘 柄 数<比 率> | 308銘柄<99.7%> | | 327銘柄<99.4%> | | - | - | | | 99.4 | |

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2021年6月22日現在

| 項 目 | 当 期 | | 末 | |
|---------------|------------|-------|-------|-----|
| | 評 価 額 | 比 率 | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 千円 | % | | |
| | 78,493,798 | 98.9 | | |
| コール・ローン等、その他 | 899,846 | 1.1 | | |
| 投資信託財産総額 | 79,393,645 | 100.0 | | |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、78,945,132千円、99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.28円、1カナダ・ドル=89.05円、1オーストラリア・ドル=82.95円、1香港・ドル=14.20円、1シンガポール・ドル=81.99円、1ニュージーランド・ドル=76.95円、1イギリス・ポンド=153.40円、1イスラエル・シェケル=33.768円、100韓国・ウォン=9.74円、1ユーロ=131.30円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 79,603,209,961円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 287,731,720 |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額) | 8,270,655,187 |
| 投 資 証 券(評価額) | 70,223,143,733 |
| 未 収 入 金 | 695,464,237 |
| 未 収 配 当 金 | 126,215,084 |
| (B) 負 債 | 643,996,315 |
| 未 払 金 | 639,224,315 |
| 未 払 解 約 金 | 4,772,000 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 78,959,213,646 |
| 元 本 | 51,487,595,373 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 27,471,618,273 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 51,487,595,373口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 15,336円 |

(注1) 期首元本額 31,818,365,833円
 追加設定元本額 95,515,055,545円
 一部解約元本額 75,845,826,005円

(注2) 期末における元本の内訳

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし>(ファンドラップ) | 77,345,015円 |
| 先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) | 47,730,002円 |
| MITOラップ型ファンド(安定型) | 4,079,406円 |
| MITOラップ型ファンド(中立型) | 12,324,186円 |
| MITOラップ型ファンド(積極型) | 15,806,473円 |
| グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 44,427,031円 |
| グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 26,820,444円 |
| グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 21,242,218円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 9,199,470,870円 |
| たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> | 1,456,488,233円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 343,415,664円 |
| たわらノーロード バランス(8資産均等型) | 1,594,089,364円 |
| たわらノーロード バランス(堅実型) | 15,021,163円 |
| たわらノーロード バランス(標準型) | 269,589,574円 |
| たわらノーロード バランス(積極型) | 517,947,206円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型) | 2,849,915円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) | 50,517,227円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型) | 103,606,640円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型) | 217,909,913円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定型) | 126,975円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) | 3,199,102円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(成長型) | 2,537,823円 |
| たわらノーロード 最適化バランス(積極型) | 7,804,829円 |
| One DC先進国リートインデックスファンド | 668,657,524円 |
| マネックス資産設計ファンド(隔月分配型) | 18,528,218円 |
| マネックス資産設計ファンド(育成型) | 584,044,636円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 49,505,985円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国10) | 214,771,724円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国20) | 257,640,235円 |
| DIAMDC 8資産バランスファンド(新興国30) | 473,479,123円 |
| 投資のソムリエ | 14,503,667,660円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 770,759,716円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 208,590,169円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 506,580,878円 |

| | |
|--|-----------------|
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | 5,243,003,250円 |
| ワールドアセットバランス(基本コース) | 631,670,857円 |
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース) | 2,025,831,537円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045) | 18,688,512円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055) | 8,934,114円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC) | 4,780,454円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035) | 47,479,777円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 2,857,665,588円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 160,502,360円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040) | 13,778,837円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050) | 6,843,270円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060) | 6,456,862円 |
| DIAMパッシブ資産分散ファンド | 477,053,365円 |
| DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> | 157,404,304円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定) | 152,689,863円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型) 20-4 | 136,134,551円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定) | 186,993,439円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定) | 136,201,588円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定) | 94,419,783円 |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型) 21-03 | 14,584,701円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定) | 149,262,841円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04(適格機関投資家限定) | 551,341,810円 |
| 投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定) | 365,019,674円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定) | 249,192,963円 |
| DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け) | 128,259,992円 |
| DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定) | 300,203,577円 |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 4,176,747,403円 |
| P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定) | 340,995,307円 |
| DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定) | 554,879,654円 |
| 期末元本合計 | 51,487,595,373円 |

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| (A) | 配当等収益 | 1,789,006,467 | 円 |
| | 受取配当金 | 1,788,122,236 | |
| | 受取利息 | 24,391 | |
| | その他の収益 | 1,015,455 | |
| | 支払利息 | △155,615 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | 18,149,662,918 | |
| | 売買益 | 20,186,684,133 | |
| | 売買損 | △2,037,021,215 | |
| (C) | その他の費用 | △58,742,592 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 19,879,926,793 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | 2,935,062,020 | |
| (F) | 解約差損益金 | △20,082,050,995 | |
| (G) | 追加信託差損益金 | 24,738,680,455 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | 27,471,618,273 | |
| | 次期繰越損益金(H) | 27,471,618,273 | |

(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)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3) (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。

コモディティインデックス・マザーファンド 運用報告書

第14期（決算日 2021年1月20日）

（計算期間 2020年1月21日～2021年1月20日）

コモディティインデックス・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|---|
| 信託期間 | 2007年2月28日から無期限です。 |
| 運用方針 | 主としてS & P G S C I商品指数（以下「G S C I」ということがあります。）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | G S C Iに連動するユーロドル債（証券を含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資は行いません。 外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。 |

■最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P G S C I商品指数 | | 債券組入率 | 債券先物率 | 純資産額 |
|-----------------|-------|-------|----------------------|-------|-------|-------|--------------|
| | 円 | 騰落率 | (円換算ベース) (ベンチマーク) | 騰落率 | | | |
| 10期(2017年1月20日) | 4,140 | 22.4 | 26,413.65 | 22.0 | 99.2 | — | 百万円 2,736 |
| 11期(2018年1月22日) | 4,335 | 4.7 | 27,581.43 | 4.4 | 99.7 | — | 3,857 |
| 12期(2019年1月21日) | 3,984 | △8.1 | 24,954.09 | △9.5 | 99.1 | — | 3,551 |
| 13期(2020年1月20日) | 4,155 | 4.3 | 25,627.44 | 2.7 | 99.3 | — | 4,253 |
| 14期(2021年1月20日) | 3,202 | △22.9 | 19,768.83 | △22.9 | 99.7 | — | 4,838 |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) S & P G S C I商品指数（「当インデックス」）は、S & P Globalの一部門であるS & P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S & P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「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S P D J Iに付与されています。S & P®、S & P G S C I®およびS & P G S C I商品指数はS & Pの商標であり、これらを利用するライセンスがS P D J Iとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。S & P G S C I商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、S P D J I、Dow Jones、S & P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンサーのいずれも、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いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

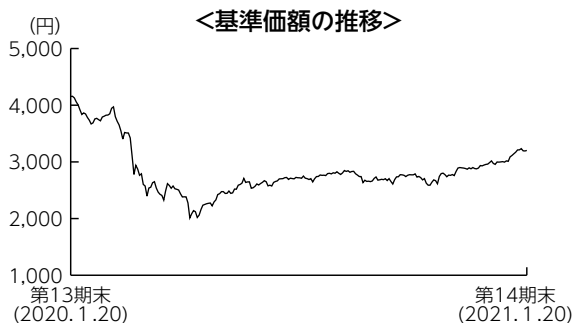
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P G S C I 商品指数 | | 債券組入率 比 | 債券先物率 比 |
|--------------------------|---------|--------|----------------------|--------|------------|------------|
| | 円 | 騰 落 率 | (円換算ベース) (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2020 年 1 月 20 日 | 4,155 | % - | ポイント 25,627.44 | % - | % 99.3 | % - |
| 1 月 末 | 3,784 | △8.9 | 23,291.51 | △9.1 | 99.4 | - |
| 2 月 末 | 3,545 | △14.7 | 21,768.15 | △15.1 | 99.4 | - |
| 3 月 末 | 2,427 | △41.6 | 14,826.16 | △42.1 | 99.0 | - |
| 4 月 末 | 2,060 | △50.4 | 12,630.38 | △50.7 | 99.5 | - |
| 5 月 末 | 2,454 | △40.9 | 15,069.26 | △41.2 | 99.5 | - |
| 6 月 末 | 2,637 | △36.5 | 16,217.26 | △36.7 | 99.0 | - |
| 7 月 末 | 2,647 | △36.3 | 16,290.03 | △36.4 | 99.5 | - |
| 8 月 末 | 2,817 | △32.2 | 17,347.48 | △32.3 | 99.3 | - |
| 9 月 末 | 2,671 | △35.7 | 16,450.78 | △35.8 | 99.4 | - |
| 10 月 末 | 2,588 | △37.7 | 15,940.33 | △37.8 | 99.0 | - |
| 11 月 末 | 2,891 | △30.4 | 17,830.36 | △30.4 | 99.5 | - |
| 12 月 末 | 2,995 | △27.9 | 18,484.84 | △27.9 | 99.6 | - |
| (期 末) 2021 年 1 月 20 日 | 3,202 | △22.9 | 19,768.83 | △22.9 | 99.7 | - |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年1月21日から2021年1月20日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は3,202円となり、前期末比で22.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

原油価格が下落したことや、為替が円高米ドル安に推移したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

投資環境

原油価格は下落しました。期初から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気減速懸念などから、原油価格は下落基調で推移しました。4月には、主要産油国による会合で合意された減産量が不十分との見方や、在庫急増による貯蔵先不足などへの懸念が広がる中、一時急落する場面もありました。その後は、世界的な経済活動再開による景気回復期待やワクチン開発への期待などを背景に、期末にかけて下落幅は縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で下落しました。



2020年3月上旬、F R B（米連邦準備理事会）による緊急利下げや新型コロナウイルスの感染拡大などを受けて、米ドルは一時急落しました。3月中旬には世界的な米ドル資金需要の高まりなどから下落幅は縮小しましたが、その後も新型コロナウイルスや米中対立、米国の経済対策や金融政策などの動向を睨みながら、期末にかけて下落基調で推移しました。

ポートフォリオについて

S & P G S C I 商品指数に連動するユーロドル債（証券を含みます。）の高位組入れを維持しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で22.9%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、S & P G S C I 商品指数に連動するユーロドル債（証券を含みます。）の高位組入れを維持します。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------|-----|---------|
| | 金 額 | 比 率 |
| (a) そ の 他 費 用 | 0円 | 0.014% |
| （保 管 費 用） | (0) | (0.014) |
| （そ の 他） | (0) | (0.000) |
| 合 計 | 0 | 0.014 |

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(2,833円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については10ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2020年1月21日から2021年1月20日まで)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|----|---------|-------|--------------------|-----------------|
| 外国 | ア メ リ カ | 社 債 券 | 千アメリカ・ドル 11,611 | 千アメリカ・ドル 421 |

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年1月21日から2021年1月20日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 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

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 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 | 千アメリカ・ドル 56,560 | 千アメリカ・ドル 46,401 | 千円 4,822,541 | % 99.7 | % 99.7 | % - | % 99.7 | % - |
| 合 計 | - | - | 千円 4,822,541 | 99.7 | 99.7 | - | 99.7 | - |

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注3) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘 柄 | 当 期 末 | | | | | | 償還年月日 |
|---------------------------|-------|--------|--------------------|--------------------|-----------------|------------|-------|
| | 種 類 | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | | |
| | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| (アメリカ) STAR HELIOS PLC | 社 債 券 | % - | 千アメリカ・ドル 56,560 | 千アメリカ・ドル 46,401 | 千円 4,822,541 | 2024/03/19 | |
| 合 計 | - | - | 56,560 | 46,401 | 4,822,541 | - | |

■投資信託財産の構成

2021年1月20日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公 社 債 | 千円 4,822,541 | % 99.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 15,935 | 0.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 4,838,476 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、4,826,843千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

なお、2021年1月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.93円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月20日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 4,838,476,918円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 15,935,350 |
| 公 社 債(評価額) | 4,822,541,568 |
| (B) 負 債 | - |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 4,838,476,918 |
| 元 本 | 15,110,318,090 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | △10,271,841,172 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 15,110,318,090口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) | 3,202円 |

(注1) 期首元本額 10,236,227,414円
追加設定元本額 5,789,041,033円
一部解約元本額 914,950,357円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M コ モ デ ィ テ ィ パ ッ シ ョ ン ・ フ ァ ン ド 14,828,606,600円
M I T O ラ ッ プ 型 フ ァ ン ド (安 定 型) 10,195,174円
M I T O ラ ッ プ 型 フ ァ ン ド (中 立 型) 29,953,476円
M I T O ラ ッ プ 型 フ ァ ン ド (積 極 型) 29,851,246円
グ ロー バ ル 8 資 産 ラ ッ プ フ ァ ン ド (安 定 型) 85,690,189円
グ ロー バ ル 8 資 産 ラ ッ プ フ ァ ン ド (中 立 型) 82,792,696円
グ ロー バ ル 8 資 産 ラ ッ プ フ ァ ン ド (積 極 型) 43,228,709円
期末元本合計 15,110,318,090円

■損益の状況

当期 自2020年1月21日 至2021年1月20日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 132,435,217円 |
| 受 取 利 息 | 132,446,750 |
| 支 払 利 息 | △11,533 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △736,036,026 |
| 売 買 益 | 270,796,216 |
| 売 買 損 | △1,006,832,242 |
| (C) そ の 他 費 用 | △567,387 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △604,168,196 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | △5,983,179,300 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | 656,890,357 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △4,341,384,033 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | △10,271,841,172 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | △10,271,841,172 |

(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)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3) (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。