

運用報告書 (全体版)

第16期<決算日2023年2月27日>

DIAMDC バランスインデックスファンド

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 (インデックス型)	
信託期間	2006年12月27日から無期限です。	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。	
主要投資対象	主ベビーフンド [※]	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている (または採用予定の) 銘柄を主要投資対象とします。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	マザーファンドへの投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用します。各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。	
組入制限	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額のDIAMDC バランス30インデックスファンド：40%以下、DIAMDC バランス50インデックスファンド：60%以下、DIAMDC バランス70インデックスファンド：80%以下、とします。外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額のDIAMDC バランス30インデックスファンド：35%以下、DIAMDC バランス50インデックスファンド：45%以下、DIAMDC バランス70インデックスファンド：50%以下、とします。	
分配方針	決算日 (原則として2月25日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の利子、配当収入および売買益 (評価益を含みます。) 等から基準価額水準、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ことがあります。	

※ベビーフンドとは、DIAMDC バランス30インデックスファンド、DIAMDC バランス50インデックスファンド、DIAMDC バランス70インデックスファンドです。

<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。

DIAMDC バランス30インデックスファンド

DIAMDC バランス50インデックスファンド

DIAMDC バランス70インデックスファンド

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、「DIAMDC バランスインデックスファンド」は、2023年2月27日に第16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。

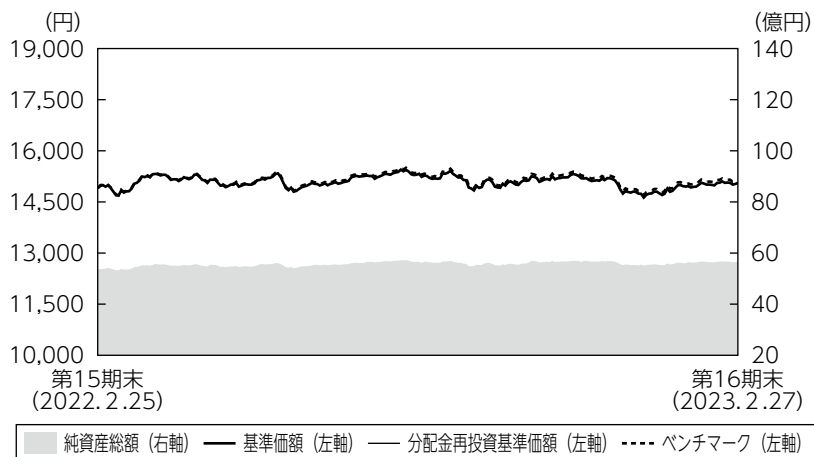
アセットマネジメントOne 株式会社

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（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

DIAMDC バランス30インデックスファンド 基準価額等の推移



第16期首： 14,905円
 第16期末： 15,060円
 (既払分配金0円)
 騰落率： 1.0%
 (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およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

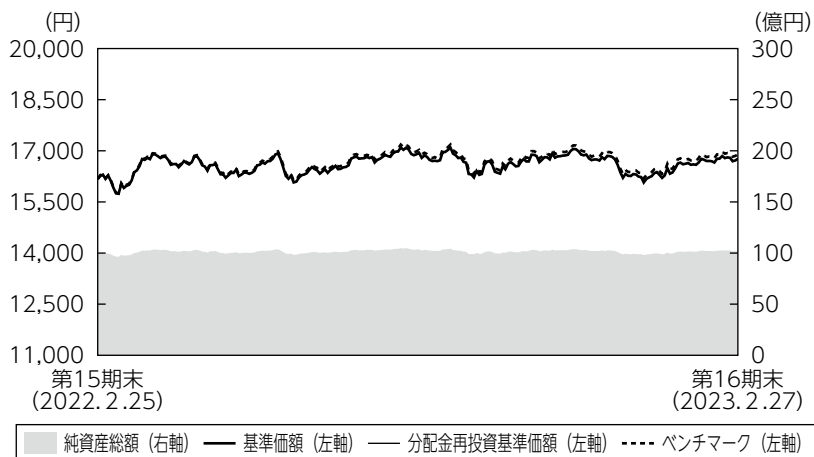
基準価額の主な変動要因

期初から2022年後半までは欧米を中心に金融引き締めが進展し海外金利が上昇、リスク性資産は下落しました。また日銀との金融政策の違いから内外金利差が拡大し外国通貨高円安の動きとなりました。期末にかけては物価上昇の鈍化期待、金融引き締めの修正織り込みから海外金利上昇が一服、リスク性資産下落の動きは縮小しました。また日銀が長期金利の許容変動幅を拡大させたことで外国通貨に対する円安の動きも縮小しました。期を通じては国内債券を除く資産がプラスに寄与したことなどから、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	9.1%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.0%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.6%

DIAM DC バランス50インデックスファンド 基準価額等の推移



- (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およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

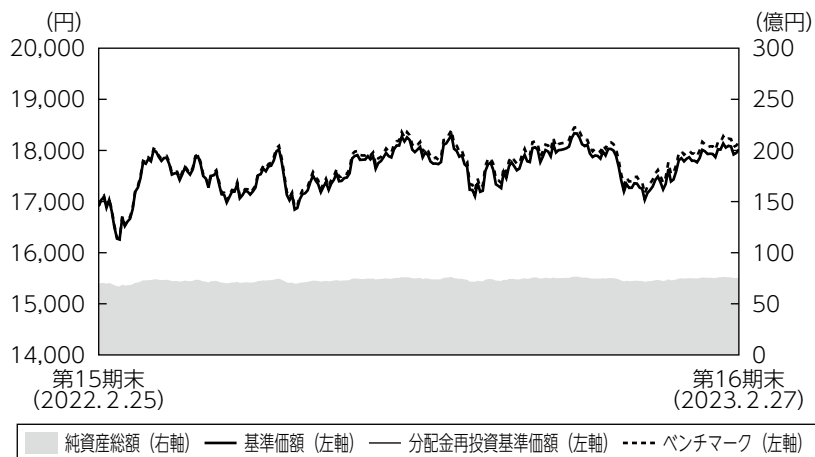
基準価額の主な変動要因

期初から2022年後半までは欧米を中心に金融引き締めが進展し海外金利が上昇、リスク性資産は下落しました。また日銀との金融政策の違いから内外金利差が拡大し外国通貨高円安の動きとなりました。期末にかけては物価上昇の鈍化期待、金融引き締めの修正織り込みから海外金利上昇が一服、リスク性資産下落の動きは縮小しました。また日銀が長期金利の許容変動幅を拡大させたことで外国通貨に対する円安の動きも縮小しました。期を通じては国内債券を除く資産がプラスに寄与したことなどから、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	9.1%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.0%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.6%

DIAMDC バランス70インデックスファンド 基準価額等の推移



第16期首： 16,913円
 第16期末： 18,019円
 (既払分配金0円)
 騰落率： 6.5%
 (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およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化していません。

基準価額の主な変動要因

期初から2022年後半までは欧米を中心に金融引き締めが進捗し海外金利が上昇、リスク性資産は下落しました。また日銀との金融政策の違いから内外金利差が拡大し外国通貨高円安の動きとなりました。期末にかけては物価上昇の鈍化期待、金融引き締めの修正織り込みから海外金利上昇が一服、リスク性資産下落の動きは縮小しました。また日銀が長期金利の許容変動幅を拡大させたことで外国通貨に対する円安の動きも縮小しました。期を通じては国内債券を除く資産がプラスに寄与したことなどから、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	9.1%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.0%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.6%

投資環境

国内株式市場は、日本や米国などの金融政策への思惑、ウクライナ情勢、為替の動き、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況など材料が多い中一進一退の展開となりました。期末にかけては、米国で金融引き締め長期化懸念が後退したことや日銀の金融緩和継続などを受けて上昇しました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2022年12月中旬にかけては、ウクライナ情勢を巡る不透明感などが意識された一方、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢が観測されたことなどを背景に、利回りは横ばいとなりました。12月下旬から期末にかけては、日銀が長期金利の変動幅を従来の $\pm 0.25\%$ から $\pm 0.5\%$ に拡大したことなどから利回りは上昇しました。

外国株式市場は上昇、下落が混在する結果となりました。米国株式市場ではF R B（米連邦準備理事会）の大幅利上げに伴う景気減速懸念から下落基調となりました。2022年10月後半以降は利上げペースの緩和観測が広がり、持ち直しの動きとなりました。欧州株式市場ではロシアによるウクライナ侵攻に伴うインフレ高進やE C B（欧州中央銀行）の利上げが嫌気され下落しましたが、中国のゼロコロナ政策緩和に伴う景気回復期待や欧州の景況感改善などが好感され反発しました。

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに上昇（価格は下落）しました。米国債は、インフレが加速する中でF O M C（米連邦公開市場委員会）の複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やE C Bの複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。期初から期後半までのドル／円相場は、米国が金融政策の正常化を進める一方で日銀は金利上昇を抑制する姿勢を継続し、日米の政策の違いから内外金利差が拡大したこと等で円安ドル高の動きとなりました。期末にかけては金融正常化の減速期待、日銀の政策修正の動きから一時円高ドル安の動きとなりましたが、期を通じては円安ドル高となりました。その他の主要通貨においても、金融政策の違い等を背景に推移し円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

各ファンドでは、以下の基本アロケーションによる合成インデックスに概ね連動した投資成果をめざし、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行いました。

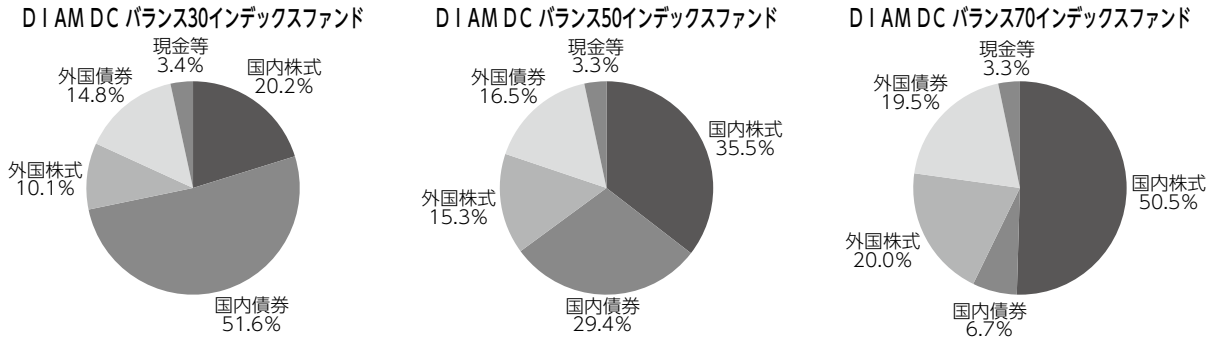
<基本アロケーション>

D I A M D C バランス30インデックスファンド：国内株式20%、国内債券52%、外国株式10%、外国債券15%、短期金融資産 3%

D I A M D C バランス50インデックスファンド：国内株式35%、国内債券30%、外国株式15%、外国債券17%、短期金融資産 3%

D I A M D C バランス70インデックスファンド：国内株式50%、国内債券 7%、外国株式20%、外国債券20%、短期金融資産 3%

決算日（2023年2月27日）現在の組入比率



(注1) 各資産の組入比率は、先物を含んだ実質組入比率です。

(注2) 株式には、不動産投信（リート）および新株予約権証券を含む場合があります。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、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。

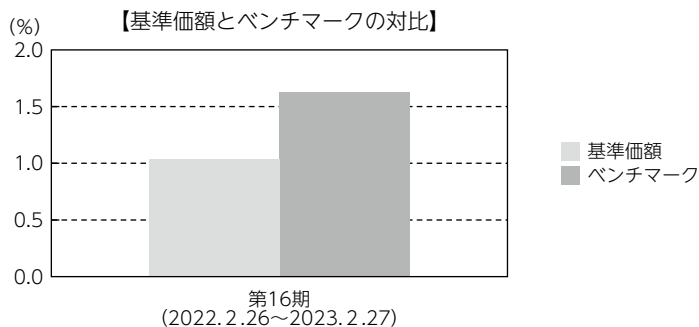
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、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。

DIAMDC バランス30インデックスファンド 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1.6%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.6%のパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金 (税引前) 込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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
	2022年2月26日 ~2023年2月27日
当期分配金 (税引前)	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	5,452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。

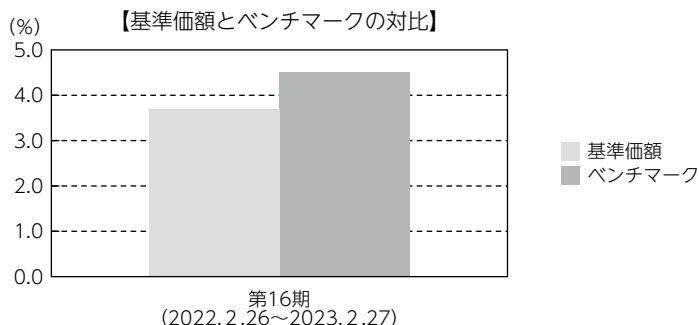
(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金 (税引前)」の期末基準価額 (分配金込み) に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(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。

DIAMDC バランス50インデックスファンド 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4.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.8%のパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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
	2022年2月26日 ～2023年2月27日
当期分配金(税引前)	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	7,711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。

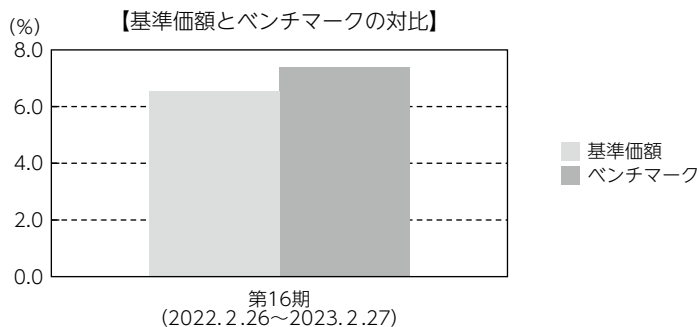
(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(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。

DIAMDC バランス70インデックスファンド 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7.4%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.8%のパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。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
	2022年2月26日 ～2023年2月27日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	9,550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

各ファンドでは、合成インデックスに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行います。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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で、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。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、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投資成果をめざ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基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」および「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

■当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4日)

* 合成インデックスについて

- (注1) 合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式については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）、外国債券については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）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて委託会社が独自に合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。
- (注2) 運用環境見直し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- (注3) 東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- (注4) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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。
- (注5) 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。
- (注6) 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。

DIAMDC バランス30インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率						
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	百万円
12期(2019年2月25日)	13,547	0	0.1	14,326.21	0.5	29.1	0.7	66.2	-	-	4,498
13期(2020年2月25日)	14,053	0	3.7	14,913.60	4.1	28.1	0.7	67.0	-	-	4,666
14期(2021年2月25日)	14,732	0	4.8	15,739.37	5.5	30.7	0.5	65.0	-	-	4,946
15期(2022年2月25日)	14,905	0	1.2	15,983.40	1.6	28.6	0.6	67.0	-	-	5,360
16期(2023年2月27日)	15,060	0	1.0	16,243.23	1.6	29.6	0.5	66.3	-	-	5,659

(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」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(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		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首) 2022年2月25日	円 14,905	% -	ポイント 15,983.40	% -	% 28.6	% 0.6	% 67.0	% -	% -
2月末	14,971	0.4	16,075.21	0.6	28.9	0.5	67.0	-	-
3月末	15,313	2.7	16,436.97	2.8	29.9	0.8	65.5	-	-
4月末	15,153	1.7	16,272.82	1.8	28.8	1.0	66.4	-	-
5月末	15,144	1.6	16,281.35	1.9	29.2	1.0	59.5	-	-
6月末	15,026	0.8	16,164.97	1.1	28.7	0.8	66.8	-	-
7月末	15,260	2.4	16,414.68	2.7	29.1	0.8	66.3	-	-
8月末	15,260	2.4	16,419.58	2.7	28.8	0.7	66.7	-	-
9月末	14,911	0.0	16,042.73	0.4	28.4	1.0	69.1	-	-
10月末	15,254	2.3	16,432.10	2.8	29.3	0.7	66.2	-	-
11月末	15,187	1.9	16,366.62	2.4	29.3	0.7	66.3	-	-
12月末	14,736	△1.1	15,886.49	△0.6	28.8	0.9	66.7	-	-
2023年1月末	14,924	0.1	16,098.17	0.7	29.5	0.7	66.1	-	-
(期末) 2023年2月27日	円 15,060	% 1.0	ポイント 16,243.23	% 1.6	% 29.6	% 0.5	% 66.3	% -	% -

(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」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 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16期		項目の概要
	(2022年2月26日 ～2023年2月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	40円	0.265%	(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15,086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)	(15)	(0.099)	
(販売会社)	(20)	(0.133)	
(受託会社)	(5)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(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)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.008	(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)	(0.004)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	42	0.276	

(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。

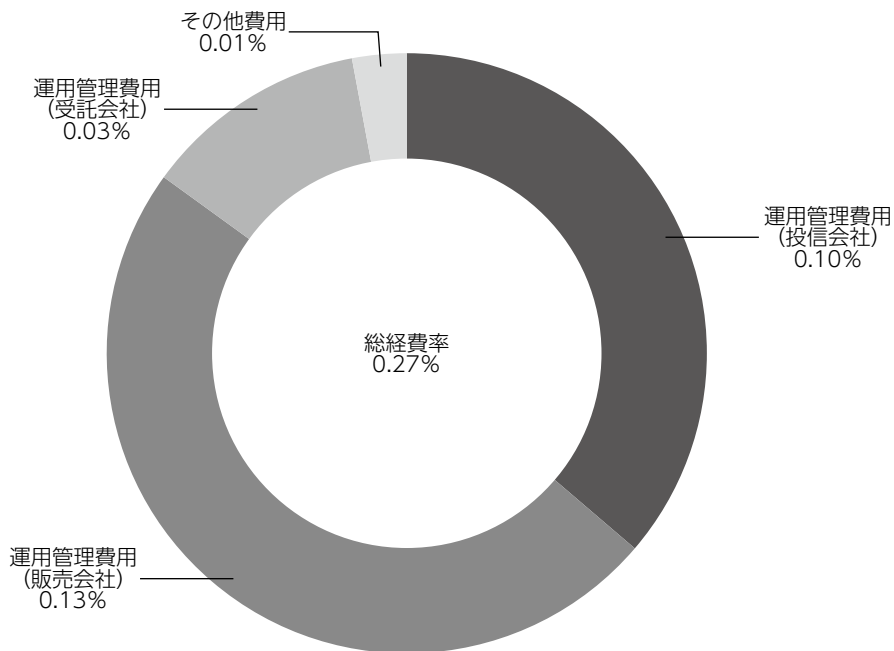
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

(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0.27%です。



(注1) 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) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	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	33,133	103,654	37,324	122,841
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	246,206	311,880	76,040	96,354
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	13,593	77,909	15,732	97,211
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	44,109	90,394	22,791	48,003

■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	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
(a) 期中の株式売買金額	614,046,936千円	397,449,124千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	377,008,289千円	716,444,920千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.62	0.55

(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（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

【D I A M D C バランス30インデックス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		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.016	百万円 0.016	% 100.0	百万円 0.016	百万円 0.016	% 100.0

(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)	28千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.380千円
(B)／(A)	1.3%

(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まず。

【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

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 307,584	百万円 175,736	% 57.1	百万円 306,462	百万円 170,517	% 55.6
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0

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) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 2,569	百万円 2,303	百万円 4,223

(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	期 末 保 有 額
株 式	百万円 3	百万円 3

【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】

期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 1,433,402	百万円 89,493	% 6.2	百万円 1,492,920	百万円 110,091	% 7.4
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

平均保有割合 0.5%

(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。

【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
金 銭 信 託	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0

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。

【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
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

平均保有割合 0.5%

(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。

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、みずほ信託銀行、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

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	340,892	336,701	1,142,157
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	2,188,884	2,359,050	2,928,524
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	94,718	92,579	570,630
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	398,655	419,973	848,892

■投資信託財産の構成

2023年2月27日現在

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	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	1,142,157	20.1
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	2,928,524	51.6
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	570,630	10.1
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	848,892	15.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	181,567	3.2
投 資 信 託 財 産 総 額	5,671,772	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、2023年2月27日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは846,398,492千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは215,626,022千円、88.7%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、2023年2月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.27円、1カナダ・ドル=100.22円、1オーストラリア・ドル=91.70円、1香港・ドル=17.36円、1シンガポール・ドル=101.01円、1ニュージーランド・ドル=84.02円、1イギリス・ポンド=162.94円、1イスラエル・シェケル=37.194円、1スイス・フラン=144.88円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.413円、1オフショア・人民元=19.532円、1マレーシア・リンギット=30.585円、1ポーランド・ズロチ=30.46円、1ユーロ=143.75円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月27日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,671,772,127円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	180,227,178
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)	1,142,157,749
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,928,524,836
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	570,630,279
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	848,892,085
未 収 入 金	1,340,000
(B) 負 債	12,293,319
未 払 解 約 金	4,627,326
未 払 信 託 報 酬	7,554,042
そ の 他 未 払 費 用	111,951
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,659,478,808
元 本	3,757,866,453
次 期 繰 越 損 益 金	1,901,612,355
(D) 受 益 権 総 口 数	3,757,866,453口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	15,060円

(注) 期首における元本額は3,596,502,602円、当期中における追加設定元本額は563,656,024円、同解約元本額は402,292,173円です。

■損益の状況

当期 自2022年2月26日 至2023年2月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△61,217円
受 取 利 息	3,800
支 払 利 息	△65,017
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	65,167,482
売 買 益	176,250,123
売 買 損	△111,082,641
(C) 信 託 報 酬 等	△15,009,775
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	50,096,490
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	881,985,789
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	969,530,076
(配 当 等 相 当 額)	(1,096,472,932)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△126,942,856)
(G) 合 計(D+E+F)	1,901,612,355
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,901,612,355
追 加 信 託 差 損 益 金	969,530,076
(配 当 等 相 当 額)	(1,096,980,415)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△127,450,339)
分 配 準 備 積 立 金	952,045,969
繰 越 損 益 金	△19,963,690

(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	59,914,823円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,096,980,415
(d) 分 配 準 備 積 立 金	892,131,146
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,049,026,384
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	5,452.63
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

DIAMDC バランス50インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率						
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	百万円
12期(2019年2月25日)	13,729	0	△1.1	14,771.42	△0.5	47.7	1.2	47.1	—	—	8,531
13期(2020年2月25日)	14,358	0	4.6	15,516.30	5.0	47.4	1.3	47.2	—	—	8,938
14期(2021年2月25日)	15,834	0	10.3	17,149.41	10.5	52.0	0.7	43.4	—	—	9,692
15期(2022年2月25日)	16,169	0	2.1	17,575.44	2.5	48.3	1.0	46.8	—	—	9,872
16期(2023年2月27日)	16,767	0	3.7	18,366.01	4.5	49.6	0.8	45.9	—	—	10,210

(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」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(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		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首) 2022年2月25日	円 16,169	% —	ポイント 17,575.44	% —	% 48.3	% 1.0	% 46.8	% —	% —
2月末	16,263	0.6	17,706.32	0.7	48.6	0.8	46.7	—	—
3月末	16,843	4.2	18,336.26	4.3	49.4	1.4	45.5	—	—
4月末	16,578	2.5	18,058.48	2.7	48.2	1.7	46.4	—	—
5月末	16,588	2.6	18,095.39	3.0	48.5	1.7	42.4	—	—
6月末	16,428	1.6	17,935.90	2.1	47.9	1.4	47.0	—	—
7月末	16,785	3.8	18,323.60	4.3	48.6	1.4	46.3	—	—
8月末	16,824	4.1	18,374.99	4.5	48.6	1.2	46.4	—	—
9月末	16,295	0.8	17,796.07	1.3	47.3	1.7	48.6	—	—
10月末	16,885	4.4	18,466.92	5.1	48.7	1.3	46.3	—	—
11月末	16,867	4.3	18,457.98	5.0	49.0	1.2	46.1	—	—
12月末	16,229	0.4	17,767.68	1.1	48.1	1.5	46.8	—	—
2023年1月末	16,588	2.6	18,172.07	3.4	49.3	1.2	45.8	—	—
(期末) 2023年2月27日	円 16,767	% 3.7	ポイント 18,366.01	% 4.5	% 49.6	% 0.8	% 45.9	% —	% —

(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」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 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16期		項目の概要
	(2022年2月26日 ～2023年2月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	50円	0.299%	(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16,596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)	(19)	(0.116)	
(販売会社)	(25)	(0.149)	
(受託会社)	(6)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(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)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.010	(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)	(0.005)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	52	0.311	

(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。

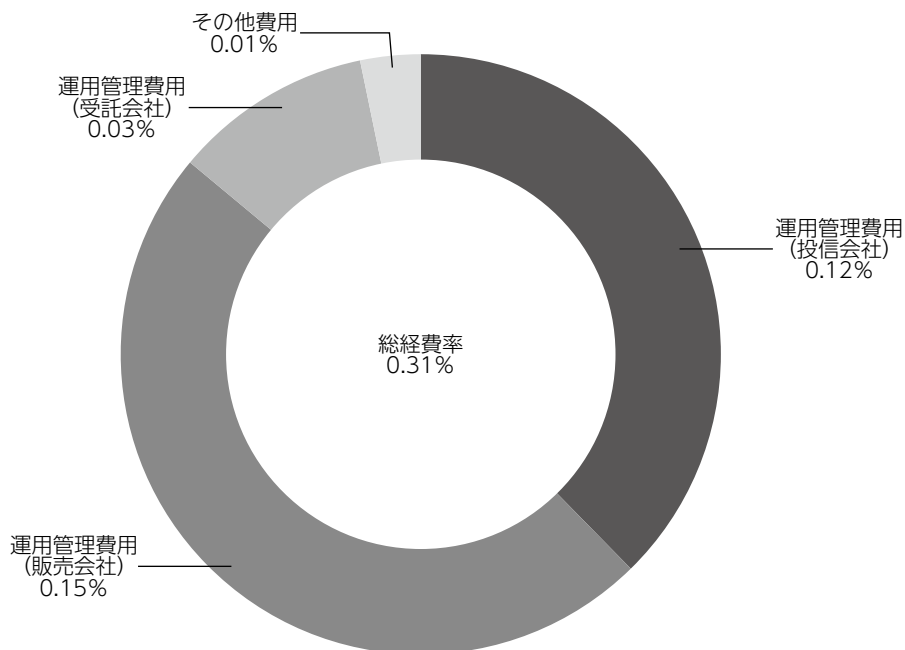
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

(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0.31%です。



(注1) 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) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	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	21,750	68,121	64,455	213,118
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	184,933	234,244	76,989	97,274
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	13,273	76,722	26,394	163,307
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	40,666	82,840	27,489	57,971

■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	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
(a) 期中の株式売買金額	614,046,936千円	397,449,124千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	377,008,289千円	716,444,920千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.62	0.55

(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（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

【D I A M D C バランス50インデックス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		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.030	百万円 0.030	% 100.0	百万円 0.030	百万円 0.030	% 100.0

(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)	84千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B)／(A)	1.5%

(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まず。

【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

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 307,584	百万円 175,736	% 57.1	百万円 306,462	百万円 170,517	% 55.6
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0

平均保有割合 0.9%

(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		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 2,569	百万円 2,303	百万円 4,223

(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	期 末 保 有 額
株 式	百万円 3	百万円 3

【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】

期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 1,433,402	百万円 89,493	% 6.2	百万円 1,492,920	百万円 110,091	% 7.4
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

平均保有割合 0.5%

(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。

【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
金 銭 信 託	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0

平均保有割合 0.2%

(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。

【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
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

平均保有割合 1.0%

(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。

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、みずほ信託銀行、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

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	1,109,141	1,066,436	3,617,567
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,323,139	2,431,084	3,017,947
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	265,893	252,772	1,558,013
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	833,078	846,255	1,710,537

■投資信託財産の構成

2023年2月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	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	3,617,567	35.3
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,017,947	29.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,558,013	15.2
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,710,537	16.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	339,482	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	10,243,547	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、2023年2月27日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは846,398,492千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは215,626,022千円、88.7%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、2023年2月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.27円、1カナダ・ドル=100.22円、1オーストラリア・ドル=91.70円、1香港・ドル=17.36円、1シンガポール・ドル=101.01円、1ニュージーランド・ドル=84.02円、1イギリス・ポンド=162.94円、1イスラエル・シェケル=37.194円、1スイス・フラン=144.88円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.413円、1オフショア・人民元=19.532円、1マレーシア・リンギット=30.585円、1ポーランド・ズロチ=30.46円、1ユーロ=143.75円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月27日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,243,547,547円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	322,232,094
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)	3,617,567,194
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	3,017,947,729
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,558,013,322
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,710,537,208
未 収 入 金	17,250,000
(B) 負 債	33,048,994
未 払 解 約 金	17,492,695
未 払 信 託 報 酬	15,353,944
そ の 他 未 払 費 用	202,355
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,210,498,553
元 本	6,089,632,029
次 期 繰 越 損 益 金	4,120,866,524
(D) 受 益 権 総 口 数	6,089,632,029口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	16,767円

(注) 期首における元本額は6,105,761,815円、当期中における追加設定元本額は503,376,782円、同解約元本額は519,506,568円です。

■損益の状況

当期 自2022年2月26日 至2023年2月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△111,635円
受 取 利 息	6,116
支 払 利 息	△117,751
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	375,421,172
売 買 益	507,247,688
売 買 損	△131,826,516
(C) 信 託 報 酬 等	△30,677,701
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	344,631,836
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,703,140,286
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,073,094,402
(配 当 等 相 当 額)	(1,647,846,158)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△574,751,756)
(G) 合 計(D+E+F)	4,120,866,524
次 期 繰 越 損 益 金(G)	4,120,866,524
追 加 信 託 差 損 益 金	1,073,094,402
(配 当 等 相 当 額)	(1,648,509,288)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△575,414,886)
分 配 準 備 積 立 金	3,047,772,122

(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	160,248,178円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	184,383,658
(c) 収 益 調 整 金	1,648,509,288
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,703,140,286
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	4,696,281,410
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	7,711.93
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

DIAMDC バランス70インデックスファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率						
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	%	%	百万円
12期(2019年2月25日)	13,629	0	△2.2	14,854.34	△1.6	67.4	1.7	26.8	—	—	5,626
13期(2020年2月25日)	14,374	0	5.5	15,740.56	6.0	66.6	1.8	27.5	—	—	5,913
14期(2021年2月25日)	16,441	0	14.4	18,192.19	15.6	70.3	1.0	24.7	—	—	6,631
15期(2022年2月25日)	16,913	0	2.9	18,800.83	3.3	67.4	1.4	27.3	—	—	6,985
16期(2023年2月27日)	18,019	0	6.5	20,188.82	7.4	68.9	1.1	26.3	—	—	7,559

(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」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(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		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首) 2022年2月25日	円 16,913	% —	ポイント 18,800.83	% —	% 67.4	% 1.4	% 27.3	% —	% —
2月末	17,035	0.7	18,973.10	0.9	67.8	1.0	27.0	—	—
3月末	17,872	5.7	19,900.67	5.8	68.2	2.0	26.0	—	—
4月末	17,503	3.5	19,496.14	3.7	67.1	2.4	26.8	—	—
5月末	17,535	3.7	19,563.53	4.1	67.5	2.3	25.6	—	—
6月末	17,341	2.5	19,362.78	3.0	66.9	2.0	27.2	—	—
7月末	17,824	5.4	19,899.44	5.8	67.7	1.9	26.7	—	—
8月末	17,907	5.9	20,001.94	6.4	67.7	1.6	26.9	—	—
9月末	17,191	1.6	19,200.12	2.1	66.4	2.3	27.8	—	—
10月末	18,048	6.7	20,189.37	7.4	67.9	1.8	26.6	—	—
11月末	18,084	6.9	20,244.69	7.7	68.3	1.6	26.3	—	—
12月末	17,250	2.0	19,317.58	2.7	67.6	2.1	26.5	—	—
2023年1月末	17,797	5.2	19,942.85	6.1	68.5	1.6	26.2	—	—
(期末) 2023年2月27日	円 18,019	% 6.5	ポイント 20,188.82	% 7.4	% 68.9	% 1.1	% 26.3	% —	% —

(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」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 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16期		項目の概要
	(2022年2月26日 ～2023年2月27日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58円	0.332%	(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17,623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)	(23)	(0.133)	
(販売会社)	(29)	(0.166)	
(受託会社)	(6)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(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)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.011	(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)	(1)	(0.004)	
(その他)	(0)	(0.002)	
合計	61	0.347	

(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。

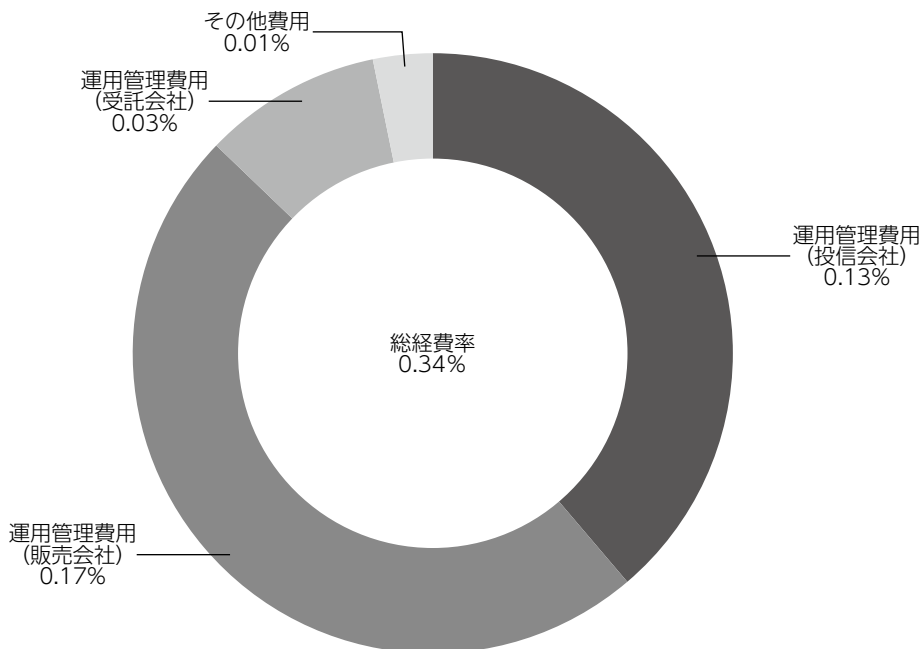
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

(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0.34%です。



(注1) 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) 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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	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	56,859	180,281	50,258	166,403
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	34,530	43,926	12,242	15,743
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	22,054	128,773	26,390	162,283
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	74,614	153,727	41,504	85,118

■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	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
(a) 期中の株式売買金額	614,046,936千円	397,449,124千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	377,008,289千円	716,444,920千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.62	0.55

(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（2022年2月26日から2023年2月27日まで）

【D I A M D C バランス70インデックス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		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.023	百万円 0.023	% 100.0	百万円 0.023	百万円 0.023	% 100.0

(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)	83千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B)／(A)	1.5%

(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まず。

【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

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 307,584	百万円 175,736	% 57.1	百万円 306,462	百万円 170,517	% 55.6
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0

平均保有割合 0.9%

(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		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 2,569	百万円 2,303	百万円 4,223

(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 3

【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】

期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 1,433,402	百万円 89,493	% 6.2	百万円 1,492,920	百万円 110,091	% 7.4
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

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。

【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
金 銭 信 託	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0

平均保有割合 0.2%

(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。

【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
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

平均保有割合 0.8%

(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。

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、みずほ信託銀行、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

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	1,117,065	1,123,667	3,811,704
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	389,968	412,257	511,775
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	249,398	245,063	1,510,497
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	708,824	741,934	1,499,672

■投資信託財産の構成

2023年2月27日現在

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	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	3,811,704	50.3
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	511,775	6.8
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,510,497	19.9
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,499,672	19.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	247,430	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	7,581,080	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、2023年2月27日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは846,398,492千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは215,626,022千円、88.7%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、2023年2月27日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.27円、1カナダ・ドル=100.22円、1オーストラリア・ドル=91.70円、1香港・ドル=17.36円、1シンガポール・ドル=101.01円、1ニュージーランド・ドル=84.02円、1イギリス・ポンド=162.94円、1イスラエル・シェケル=37.194円、1スイス・フラン=144.88円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.413円、1オフショア・人民元=19.532円、1マレーシア・リンギット=30.585円、1ポーランド・ズロチ=30.46円、1ユーロ=143.75円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月27日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	7,581,080,940円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	241,076,429
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)	3,811,704,710
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	511,775,846
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,510,497,623
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,499,672,332
未 収 入 金	6,354,000
(B) 負 債	21,549,360
未 払 解 約 金	8,902,042
未 払 信 託 報 酬	12,499,088
そ の 他 未 払 費 用	148,230
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	7,559,531,580
元 本	4,195,317,350
次 期 繰 越 損 益 金	3,364,214,230
(D) 受 益 権 総 口 数	4,195,317,350口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	18,019円

(注) 期首における元本額は4,129,903,425円、当期中における追加設定元本額は537,178,278円、同解約元本額は471,764,353円です。

■損益の状況

当期 自2022年2月26日 至2023年2月27日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△81,738円
受 取 利 息	5,177
支 払 利 息	△86,915
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	453,309,217
売 買 益	504,116,797
売 買 損	△50,807,580
(C) 信 託 報 酬 等	△24,617,822
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	428,609,657
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,903,042,399
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,032,562,174
(配 当 等 相 当 額)	(1,674,003,708)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△641,441,534)
(G) 合 計(D+E+F)	3,364,214,230
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,364,214,230
追 加 信 託 差 損 益 金	1,032,562,174
(配 当 等 相 当 額)	(1,675,017,982)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△642,455,808)
分 配 準 備 積 立 金	2,331,652,056

(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	146,584,399円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	282,025,258
(c) 収 益 調 整 金	1,675,017,982
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,903,042,399
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	4,006,670,038
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	9,550.34
(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21期（決算日 2023年2月7日）

（計算期間 2022年2月8日～2023年2月7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21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	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、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	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄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 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
20期 (2022年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
21期 (2023年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982

(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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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）。

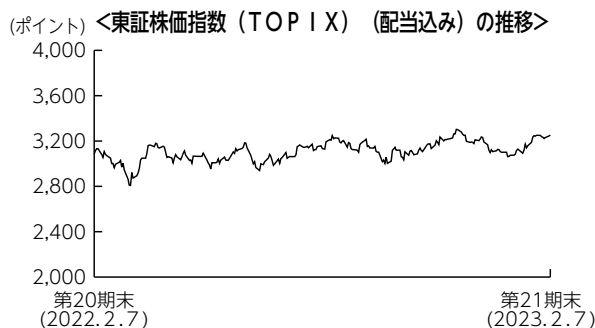
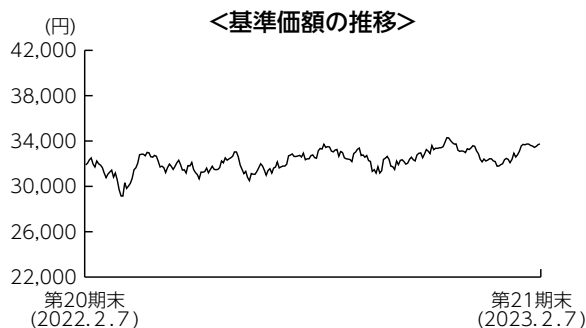
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2022年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	31,896	—	3,073.66	—	97.4	2.5
2 月 末	31,265	△2.0	3,012.57	△2.0	98.0	1.3
3 月 末	32,610	2.2	3,142.06	2.2	96.9	3.1
4 月 末	31,831	△0.2	3,066.68	△0.2	96.2	3.9
5 月 末	32,079	0.6	3,090.73	0.6	96.7	3.4
6 月 末	31,424	△1.5	3,027.34	△1.5	96.7	3.3
7 月 末	32,592	2.2	3,140.07	2.2	97.1	2.9
8 月 末	32,985	3.4	3,177.98	3.4	98.0	2.0
9 月 末	31,176	△2.3	3,003.39	△2.3	96.3	3.7
10 月 末	32,765	2.7	3,156.44	2.7	97.1	2.8
11 月 末	33,730	5.7	3,249.61	5.7	97.7	2.3
12 月 末	32,189	0.9	3,101.25	0.9	96.9	3.1
2023年 1 月 末	33,613	5.4	3,238.48	5.4	97.7	2.3
(期 末) 2023年 2月7日	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月8日から2023年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は33,751円となり、前期末比で5.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染状況、日本や米国などの金融政策、ウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、米国で金融引き締めの長期化懸念が後退したことや日銀の金融緩和継続などを受けて上昇しました。

投資環境

期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの感染拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として、国内株式市場は下落しました。その後は、米国での金融引き締め、日銀の金融政策への思惑、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、日銀の金融緩和継続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	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	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	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161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5.8%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		項 目 の 概 要
	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)	(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) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は32,278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 (2022年2月8日から2023年2月7日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		152,381.9 (2,240.729)	362,922,344 (-)	156,466.829	364,983,330

(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	百万円	百万円	百万円
	116,409	119,651	-	-

(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	727,905,675千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	377,008,289千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.93

(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（2022年2月8日から2023年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 362,922	百万円 231,022	% 63.7	百万円 364,983	百万円 229,125	% 62.8
金 銭 信 託	1.380	1.380	100.0	1.380	1.380	100.0

(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 3,015	百万円 2,776	百万円 4,163

(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 3

(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)	4,537千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	231千円
(B) / (A)	5.1%

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、みずほ信託銀行、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。

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	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	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		千株	千円
日本たばこ産業	791.4	884.9	2,341,002		11	10.1	26,967							ミライアル	4.7	3.7	5,616				
ケンコーマヨネーズ	8.5	9.3	12,173											ダイキョウクス	5.6	4.4	3,000				
わさやパワートルディングス	9.6	9.9	18,810		51.4	57.6	18,950							ダイキョーニシカワ	30.7	30.1	18,150				
なとり	8.1	8.6	17,647		210.4	217.3	230,120							竹本容器	5.3	4.1	3,349				
イフジ産業	2.5	2.2	2,017		954.1	853.9	823,586							森六ホールディングス	7.9	6.9	12,240				
ピッパルスコーポレーション	7.2	-	-		9.2	7.1	3,578							恵和	3.6	8.9	14,204				
ファーマフーズ	14	20.7	28,110		124.8	132.1	291,148							日本化薬	113.4	104.3	120,570				
ユーグレナ	75	86.6	86,426		1,057.7	1,014.5	466,670							カーリットホールディングス	14.3	12.3	8,843				
紀文食品	8.6	10.5	9,985		6.4	5.8	23,606							日本精化	11.6	7.8	18,517				
ピッパルスホールディングス	-	7.9	9,511		78.4	64.9	397,188							扶桑化学工業	12.9	12.7	46,164				
ミヨシ油脂	6.2	4.2	3,880		5	5.3	10,525							トリケミカル研究所	14.9	18.3	43,718				
理研ビタミン	15.4	11.6	22,156		11.5	11.7	96,876							A D E K A	66.3	47.7	101,791				
繊維製品 (0.5%)					5.6	5.4	24,840							日油	49.2	42.3	231,804				
片倉工業	13.8	12.6	22,012		10.8	9.2	11,178							新日本理化学	23.6	16.8	3,796				
グンゼ	9.6	10.2	43,248		23.8	24.7	26,923							ハリマ化成グループ	11	8.7	7,629				
東洋紡	56.9	59	60,239		2.5	2.5	4,300							花王	325.3	333	1,722,609				
ユニチカ	39.2	41.4	9,646		18.4	14.7	63,945							第一工業製薬	5.4	5	10,290				
富士紡ホールディングス	6.4	5.4	17,010		207.7	182.6	307,681							石原ケミカル	7.5	6.3	8,051				
倉敷紡績	12.3	10.2	22,256		46	44.1	86,303							日華化学	5	5	4,135				
シキボウ	7.9	6.8	6,636		23.5	21.9	64,473							ニイタカ	3	2.2	4,391				
日本毛織	43.4	36	33,660		80.1	68.5	77,610							三洋化成工業	8.6	8.5	35,657				
ダイトウボウ	23.8	21.5	1,827		13.5	8.2	34,563							有機合成薬品工業	10.3	9.2	2,640				
トア紡コーポレーション	4.3	4.2	1,474		31.6	26.4	26,584							大日本塗料	17.8	16.9	13,351				
ダイドーリミテッド	20.5	18.6	4,724		52.4	49.7	132,301							日本ペイントホールディングス	541.2	605.1	705,546				
帝国繊維	16.3	15.4	23,931		247.4	230.7	4,442,128							関西ペイント	149.3	125.3	224,036				
帝人	135.4	131.6	173,317		5.2	4.6	5,878							神東塗料	10	10.4	1,310				
東レ	1,042.5	916.3	715,721		10	10.4	18,803							中国塗料	34	22.4	23,497				
住江織物	3.4	2.5	4,635		13.4	12.5	13,825							日本特殊塗料	10.9	7.7	6,760				
日本フェルト	5.9	6.7	2,733		136.2	129	200,079							藤倉化成	18.3	18.6	8,035				
イチカワ	1.4	1.5	2,010		138.5	132.6	299,676							太陽ホールディングス	21.2	20.7	50,052				
日東製網	1.7	1.3	2,022		4.6	4.5	8,541							D I C	60.9	53.5	129,577				
アツギ	11.5	7.1	2,726		2.6	2.6	3,013							サカタインクス	28.7	30.3	32,542				
ダイニチ	3.8	3	2,040		72.6	67.8	63,121							豊キョウキ(Sホールディングス)	30.5	26.7	49,341				
セーレン	29.6	26.4	64,125		23.1	20.1	13,266							T & K T O K A	11.7	12.2	15,408				
ソート	6.2	3.9	3,178		1.7	1.4	2,049							富士フィルムホールディングス	258.5	262.7	1,808,426				
東海染工	1.4	1.3	1,435		19	16.2	20,671							資生堂	273.9	285.8	1,892,853				
小松マテーレ	23.6	19.9	14,188		3.2	3.1	8,091							ライオン	177.6	164.3	231,663				
ワコールホールディングス	35.9	26.3	62,699		7.2	8	20,680							高砂香料工業	10.3	9.3	24,561				
ホギメディカル	19.5	18.4	59,432		4.6	3.9	12,928							マンダム	30.9	29.5	42,008				
クラヴィアホールディングス	2.5	2.7	977		24.2	20.8	113,984							ミルボン	18.3	20.3	112,056				
T S Iホールディングス	47.9	48.8	27,328		12	9.6	17,212							ファンレール	59.6	59.9	156,938				
マツオカコーポレーション	4.6	3.3	4,125		37.3	31.3	104,385							コーセー	27.7	27.9	418,500				
ワールド	18.9	17.5	23,275		133.8	102.1	192,152							コタ	9.4	11.6	20,021				
三陽商会	6.9	4.6	6,490		130.8	112.7	352,751							シーボン	1.4	1.5	2,392				
ナイガイ	4.1	4.1	1,061		134.4	127.7	396,508							ホーラルビスホールディングス	62.8	70.2	126,219				
オンワードホールディングス	86.3	88.5	30,090		23.3	23.9	155,589							ノエビアホールディングス	12.6	12.2	67,466				
リックホールディングス	4.6	3.5	8,988		12.2	10.3	21,784							アジパルホールディングス	3.5	3	2,964				
キムラタン	79.9	72.8	1,528		962.6	922.8	654,080							新日本製薬	4	7.8	11,286				
ゴールドウイン	26	24.3	240,084		23.7	22.7	61,539							エステー	9.5	10.6	16,726				
デサント	28.1	23.5	92,707		207.2	201	181,101							アグロ カネショウ	5	5.5	8,514				
キング	6.7	5.4	2,743		22.8	20.2	88,981							コニシ	24.1	22.9	39,983				
ヤマトインターナショナル	13.3	9.8	2,450		301.3	279.7	512,130							長谷川香料	25.5	28.4	90,454				
パルプ・紙 (0.2%)					129.8	82	101,024							星光PMC	8.6	6.4	3,622				
特殊東海製紙	8.9	6.1	17,805		40.1	34.5	103,465							小林製薬	41.3	39.8	361,384				
王子ホールディングス	602.3	569.8	297,435		78.7	70.4	139,532							荒川化学工業	12.3	11.7	11,442				
日本製紙	69	71.1	67,402		21.9	19.9	38,526							メック	11	11.2	28,078				
三菱製紙	21.3	15.1	4,303		31.4	30.2	14,888							日本高純度化学	4.1	3.4	7,939				
北越コーポレーション	94.7	86.4	68,688		8.1	9.1	24,451							タカラバイオ	38.5	36.9	63,541				
中越パルプ工業	5.6	4.7	4,958		8.6	8.5	15,045							J C U	16.6	15.5	50,297				
巴川製紙所	4.6	3.8	2,667		35.4	29.5	15,841							新田ゼラチン	9.3	7.5	6,450				
大王製紙	69.6	60.3	59,817		7.5	6.4	11,897							O A T アグリオ	3.2	5	7,320				
阿波製紙	4	2.9	1,957		19.6	18.7	7,293							デクセリアルズ	38.2	39.5	112,456				
レンゴウ	136.3	124.6	109,025		3.5	2.7	6,714							アース製薬	12.1	12.4	62,248				
トーモク	9	7.9	12,008		8.5	5.8	2,395							北興化学工業	13.8	13.8	11,467				
ザ・バック																					
化学 (6.2%)																					
北の達人コーポレーション					51.4	57.6	18,950														
クラレ					210.4	217.3	230,120														
旭化成					954.1	853.9	823,586														
共和レザー					9.2																

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	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
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
三協立山	18.9	16.1	10,110	ベガサスミシン製造	15	15.3	10,220	理想科学工業	12.3	12.3	27,613		12.3	12.3	27,613
アルインコ	10.9	10.8	11,232	マルマエ	6	6.7	11,771	SANKYO	31.8	27.1	140,649		31.8	27.1	140,649
東洋シャッター	2.5	2.2	1,139	タツモ	6.9	7.5	14,655	日本金銭機械	15	15.2	17,647		15	15.2	17,647
LI-X-LI	228.9	205.2	438,102	ナプテスコ	82.9	86.5	316,157	マースグループホールディングス	9.4	8.2	20,221		9.4	8.2	20,221
日本フィルコン	10.9	8.2	3,690	三井海洋開発	15.5	17.3	23,389	フクシマガリレイ	10.3	10.1	44,339		10.3	10.1	44,339
ノーリツ	28	20.7	30,718	レオン自動車	15.6	14.6	16,074	オーイズミ	5.4	4.6	2,208		5.4	4.6	2,208
長府製作所	14.9	14.1	29,243	SMC	43.1	44.7	3,031,107	ダイコク電機	6.9	7.5	15,885		6.9	7.5	15,885
リンナイ	27.4	25.5	251,940	ホンソカワミクロン	10.3	10.6	28,726	竹内製作所	22.4	25	70,950		22.4	25	70,950
ダイニチ工業	7.2	6.5	4,335	ユニオンツール	5.5	6.1	20,801	アマノ	38.5	39.1	95,325		38.5	39.1	95,325
日東精工	18.4	20.6	10,403	オイレス工業	20.5	19.3	30,687	JUKI	20.5	21.4	13,011		20.5	21.4	13,011
三洋工業	1.4	1.4	2,570	日精エー・エス・ビー機械	4.9	6.3	28,822	サンデン	20.4	18.3	4,044		20.4	18.3	4,044
岡部	27.8	22.6	16,226	サトーホールディングス	19.3	19.6	41,748	ジャノメ	12.5	14.1	8,572		12.5	14.1	8,572
ゾーテクト	18.2	15.7	21,446	技研製作所	12.8	14.3	41,169	マックス	19.7	17	35,819		19.7	17	35,819
東プレ	27.1	24.9	31,448	日本エアータック	6.8	7	7,714	グローリー	37.7	35.7	81,039		37.7	35.7	81,039
高周波熱錬	25.9	22.8	15,663	カワタ	4.7	3.6	3,074	新晃工業	13.8	13.8	21,045		13.8	13.8	21,045
東京製綱	8.9	8.4	9,307	日精樹脂工業	10.4	10.3	10,083	大和冷機工業	21.2	21.2	25,291		21.2	21.2	25,291
サンコール	12.9	11.1	7,215	オカダアイオン	4.7	3.8	6,254	セガサミーホールディングス	145.9	110.8	222,597		145.9	110.8	222,597
モリテックスチール	11.4	9.4	2,782	ワイエイシホールディングス	5.7	5.2	10,784	日本ピストンリング	5.4	4.2	5,334		5.4	4.2	5,334
パイオラックス	21.6	19.4	34,726	小松製作所	666.1	646	2,020,688	リケン	6.4	5.5	13,387		6.4	5.5	13,387
エイチワン	14.4	14.7	9,555	住友重機械工業	84.1	81.5	227,629	TPR	19.9	15.8	20,777		19.9	15.8	20,777
日本発条	133.7	124.7	112,604	日立建機	58.9	54.9	166,072	ツバキ・ナカシマ	32.2	34	39,950		32.2	34	39,950
中央発條	7.2	7.8	5,483	日工	20.4	20.6	12,875	ホシザキ	43	88.7	401,811		43	88.7	401,811
アドパネクス	2.2	1.5	1,584	巴工業	5.9	6	14,670	大豊工業	12	12.1	7,598		12	12.1	7,598
立川フラインド工業	6.7	6.4	7,692	井関農機	13.7	12.9	15,531	日本精工	276.6	253	183,931		276.6	253	183,931
三益半導体工業	11.5	10.8	27,853	TOWA	12.6	14	27,496	NTN	314.8	271.8	82,899		314.8	271.8	82,899
機械 (5.3%)				丸山製作所	3.2	2.2	3,568	ジェイテクト	140.9	122.7	120,246		140.9	122.7	120,246
日本ドライケミカル	3.8	3	4,851	北川鉄工所	6.8	5.4	6,318	不二越	12.6	10.2	39,219		12.6	10.2	39,219
日本製鋼所	44.1	38	102,372	ロウテ	7.4	7.2	75,312	日本トムソン	40.2	33.7	20,354		40.2	33.7	20,354
三浦工業	63	57.6	182,592	タカキタ	5	3.6	1,504	THK	83	79.6	214,124		83	79.6	214,124
タクマ	49.2	42.4	52,915	クボタ	712.6	729.6	1,427,097	ユーシン精機	11.7	10.8	7,776		11.7	10.8	7,776
ツガミ	31.9	30.6	43,023	荏原実業	6.9	6.6	17,503	前澤給装工業	11.4	9.8	9,074		11.4	9.8	9,074
オークマ	16.9	13.8	71,484	三菱化工機	4.7	4.4	9,702	イーグル工業	18.3	15.3	17,258		18.3	15.3	17,258
芝浦機械	16.5	13.7	38,250	月島機械	27.3	18.7	19,410	前澤工業	8.9	7.1	4,366		8.9	7.1	4,366
アマダ	229.4	220	250,580	帝國電機製作所	10.6	10	24,860	日本ピラー工業	14.9	12.8	40,640		14.9	12.8	40,640
アイダエンジニアリング	38.2	28.4	23,117	東京機械製作所	-	2.9	1,711	キッツ	49.7	50.7	40,560		49.7	50.7	40,560
TAKISAWA	4.8	3.3	3,663	新東工業	32.6	28.2	20,219	マキタ	179	171.5	604,537		179	171.5	604,537
FUJI	67	60	128,700	滋谷工業	12.8	12.9	31,863	三井E&Sホールディングス	53	63.2	25,153		53	63.2	25,153
牧野ワライス製作所	16	15.3	70,915	アイチコーポレーション	21.7	19.6	15,131	日立造船	124.3	113	99,779		124.3	113	99,779
オーエスジー	67.3	65.8	129,691	小森コーポレーション	37.5	31.9	26,413	三菱重工業	231	241.1	1,191,034		231	241.1	1,191,034
ダイジェット工業	1.1	1.3	1,060	鶴見製作所	11.5	10.5	20,800	IHI	91.8	86.9	332,392		91.8	86.9	332,392
旭ダイヤモンド工業	38.3	38.5	28,528	住友精密工業	2.4	-	-	サノヤスホールディングス	17	16.8	2,200		17	16.8	2,200
DMG森精機	86.3	83.6	164,942	日本ギア工業	6	4	1,792	スター精密	22.8	26	43,550		22.8	26	43,550
ソディック	32.2	37.9	28,387	酒井重工業	2.7	2	7,480	電気機器 (17.7%)							
ディスコ	21.5	22.1	892,840	荏原製作所	61.1	56.4	308,508	日清紡ホールディングス	89.8	112.1	107,728		89.8	112.1	107,728
日東工器	8.1	6.8	11,396	石井鐵工所	1.2	1	2,282	イビデン	77.2	79	394,605		77.2	79	394,605
日進工具	11.6	11.6	12,481	西島製作所	13.5	12	18,060	コニカミノルタ	320.9	307.8	166,827		320.9	307.8	166,827
パンチ工業	12.2	10.7	4,964	北越工業	14	13.8	19,016	ブラザー工業	179.5	184.2	367,847		179.5	184.2	367,847
富士ダイス	6.8	5.9	3,463	ダイキン工業	187.4	164.6	3,778,393	ミネベアミツミ	253.4	239.8	570,004		253.4	239.8	570,004
豊和工業	7.9	6.6	6,375	オルガン	4.2	19	61,560	日立製作所	707.2	670.5	4,704,898		707.2	670.5	4,704,898
ニデックオーケーケー	5.6	5	4,695	トーヨーカネツ	5.5	5.3	13,970	東芝	256.9	265.3	1,194,911		256.9	265.3	1,194,911
石川製作所	3.9	3.1	4,383	栗田工業	79.7	77.1	474,936	三菱電機	1,470.1	1,425	2,143,912		1,470.1	1,425	2,143,912
東洋機械金属	9.9	8.5	4,734	椿本チエイン	19.4	19.5	59,865	富士電機	88.6	83.8	434,084		88.6	83.8	434,084
津田駒工業	3.4	2.3	1,182	大同工業	6.7	5	3,665	東洋機械製造	5.9	3.9	3,424		5.9	3.9	3,424
エンシュウ	3.5	2.6	1,781	木村化工機	12.2	10.5	7,392	安川電機	158.4	163.4	833,340		158.4	163.4	833,340
島精機製作所	21.2	21.9	40,821	アナスト岩田	23	23.4	20,100	シンフォニアテクノロジー	17.7	15.2	24,912		17.7	15.2	24,912
オプトラン	18.3	20.4	51,102	ダイフク	81	71.1	512,631	明電舎	24.9	20.9	39,772		24.9	20.9	39,772
NCホールディングス	4.1	2.5	5,117	サムコ	3.6	4.5	16,650	オリジン	4	2.8	3,553		4	2.8	3,553
イワキ	9.4	9.3	11,820	加藤製作所	6.9	5.8	4,524	山洋電気	6.6	6	33,900		6.6	6	33,900
フリュー	12.8	14.4	17,236	油研工業	1.8	1.7	3,194	デンヨー	12.6	10.5	15,991		12.6	10.5	15,991
ヤマシンフィルタ	29.3	32.8	15,317	タダノ	77	72.6	68,607	PHCホールディングス	16.9	19.2	29,856		16.9	19.2	29,856
日版製作所	18.3	13.3	11,318	フジテック	54.6	50.5	157,307	ソシオネクスト	-	14.1	117,453		-	14.1	117,453
やまびこ	28.3	22.5	25,290	CKD	43.4	38.1	76,428	東芝テック	16	20.7	77,559		16	20.7	77,559
野村マイクロサイエンス	3.9	4.6	21,574	キトー	12.6	-	-	芝浦メカトロニクス	1.7	2.7	30,618		1.7	2.7	30,618
平田機工	6.9	6.6	42,570	平和	41.1	45.8	104,744	マブチモーター	34.1	34.3	128,282		34.1	34.3	128,282

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
日本電産		千株	千円		千株	千円	日本航空電子工業		千株	千円		千株	千円	ＫＯＡ		千株	千円		千株	千円
	381.1	334.9	2,469,552		33.7	28.3		33.7	28.3	64,184		28.3	28.3		22.3	20.6	38,460		20.6	38,460
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	9.9	4,959		16	15.7		16	15.7	12,183		15.7	15.7		17.7	19.7	7,683		19.7	7,683
ドレックス・セミコンダクター	7.5	6.5	17,927		29.3	29.9		29.3	29.9	42,996		29.9	29.9		80.7	164.2	363,703		164.2	363,703
東光高岳	8.2	8.4	16,783		17.4	18		17.4	18	16,740		18	18		27	25.6	13,568		25.6	13,568
ダブル・スコープ	42.3	45.1	67,424		3.3	-		3.3	-	-		-		25.6	23.3	238,825		23.3	238,825	
ダイハチ	16.1	12.5	51,750		13.9	12.6		13.9	12.6	18,711		12.6	12.6		13.7	15.1	25,790		15.1	25,790
ヤーマン	24	23.8	32,177		5.5	5.4		5.5	5.4	13,635		5.4	5.4		730.5	749	2,182,586		749	2,182,586
JVCケンウッド	119.5	125.5	51,455		5.6	5.7		5.6	5.7	10,516		5.7	5.7		408.1	342.2	344,937		342.2	344,937
ミカエンジニアリング	13.3	13.1	7,846		11.9	-		11.9	-	-		-			39.8	40.8	67,850		40.8	67,850
イーピーエフ	6.9	7.6	8,952		147.2	150.9		147.2	150.9	345,108		150.9	150.9		1.2	1.7	2,748		1.7	2,748
日新電機	34.7	33	56,100		5.6	5.3		5.6	5.3	17,940		5.3	5.3		93.3	96.3	4,498,173		96.3	4,498,173
大崎電気工業	26.8	32.5	17,095		86.2	95.4		86.2	95.4	348,210		95.4	95.4		8.7	9.1	12,212		9.1	12,212
オムロン	122.4	126.3	954,322		7.6	5.9		7.6	5.9	4,472		5.9	5.9							
日東工業	19.6	18.6	47,076		60.9	63.1		60.9	63.1	207,599		63.1	63.1		60	57.5	115,805		57.5	115,805
ＩＤＥＣ	18.3	20.3	63,133		4.8	5.7		4.8	5.7	10,869		5.7	5.7		2.5	2.3	3,286		2.3	3,286
正興電機製作所	4.6	4.6	4,650		14.9	11.6		14.9	11.6	3,920		11.6	11.6		21.9	24.5	19,159		24.5	19,159
不二電機工業	3.4	2.5	2,720		7.2	9		7.2	9	13,095		9	9		119.2	99.8	755,486		99.8	755,486
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47.9	45.3	101,517		27.3	30.3		27.3	30.3	184,830		30.3	30.3		23.6	24	27,624		24	27,624
サクサホールディングス	2.9	2.6	3,177		109.3	107.5		109.3	107.5	1,059,950		107.5	107.5		20.2	20.9	13,773		20.9	13,773
メルコホールディングス	3.3	3.7	12,265		6.9	4.5		6.9	4.5	1,881		4.5	4.5		323.7	281.6	2,070,886		281.6	2,070,886
テクノメディカ	3.5	3.3	5,633		12	10.9		12	10.9	22,345		10.9	10.9		38.8	38.6	56,394		38.6	56,394
ダイハチモーターホールディングス	4.1	4.5	6,187		133.2	136.5		133.2	136.5	8,336,055		136.5	136.5		107.3	102.9	297,072		102.9	297,072
日本電気	186.9	195	937,950		7	7.1		7	7.1	51,830		7.1	7.1		43.7	31.2	12,261		31.2	12,261
富士通	132.4	137.4	2,458,773		124.4	117.7		124.4	117.7	1,035,053		117.7	117.7		5.5	5.3	10,345		5.3	10,345
沖電気工業	59.8	62.3	45,603		25.6	22.5		25.6	22.5	31,410		22.5	22.5		19.5	21.8	17,156		21.8	17,156
岩崎通信機	6.3	5.4	4,109		13.8	11.2		13.8	11.2	32,872		11.2	11.2		1.7	1.5	1,606		1.5	1,606
電気興業	7.9	5.5	10,604		6.8	6.4		6.8	6.4	23,424		6.4	6.4		1,733.9	1,939.1	919,327		1,939.1	919,327
サンケン電気	13.8	12.8	103,936		1.8	1.4		1.8	1.4	1,601		1.4	1.4		461.4	396.9	635,833		396.9	635,833
ナカヨ	2.2	2.1	2,375		7.5	5.5		7.5	5.5	4,719		5.5	5.5		7,495.9	7,495.9	14,219,722		7,495.9	14,219,722
アイホン	8.5	8.4	16,287		16.3	16.4		16.3	16.4	18,220		16.4	16.4		183.6	175.8	98,448		175.8	98,448
ルネサエレクトロニクス	796.7	899.7	1,274,425		12.3	12.6		12.3	12.6	56,070		12.6	12.6		544.1	532.6	272,158		532.6	272,158
セイコーエプソン	182.4	183.6	343,332		24	25.1		24	25.1	50,777		25.1	25.1		10.3	8.3	4,482		8.3	4,482
ワコム	114	109.2	72,072		6.4	4.7		6.4	4.7	10,697		4.7	4.7		5.7	4.7	2,190		4.7	2,190
アルバック	29.3	32.7	197,508		5.5	-		5.5	-	-		-		2.8	2.4	1,718		2.4	1,718	
アクセル	6.3	4.5	7,366		64.5	62.5		64.5	62.5	1,415,625		62.5	62.5		2.9	2.1	1,241		2.1	1,241
ＥＩＺＯ	11.5	10.1	36,562		102.8	97.1		102.8	97.1	271,006		97.1	97.1		32.7	33.3	59,940		33.3	59,940
ジャパントディスプレイ	500	528.8	24,324		5.4	4.4		5.4	4.4	12,742		4.4	4.4		21.7	24.1	20,533		24.1	20,533
日本信号	37.5	31.4	32,404		75.3	71.3		75.3	71.3	113,010		71.3	71.3		41.7	42.9	45,345		42.9	45,345
京三製作所	31.6	29	11,832		9.3	9.8		9.3	9.8	2,518		9.8	9.8		27.3	24	34,536		24	34,536
能美防災	19.5	18.7	32,126		12.9	11.1		12.9	11.1	4,839		11.1	11.1		12.1	11.1	18,858		11.1	18,858
ホーチキ	10.9	10.3	15,398		4	3.1		4	3.1	5,809		3.1	3.1		4.2	3.4	7,633		3.4	7,633
星和電機	7.2	5.2	2,246		13.8	13.9		13.8	13.9	37,349		13.9	13.9		80.6	83.3	12,661		83.3	12,661
エレコム	33.7	32.9	44,053		6.9	5.4		6.9	5.4	3,963		5.4	5.4		25.7	21.6	26,157		21.6	26,157
パナソニック ホールディングス	1,568.1	1,628.6	1,882,661		10.7	10.1		10.7	10.1	10,817		10.1	10.1		71.2	53	62,805		53	62,805
シャープ	167.6	166	179,612		6.4	5		6.4	5	1,880		5	5		36.8	36.5	14,381		36.5	14,381
アンリツ	94.6	97.1	120,306		10.8	11.9		10.8	11.9	20,884		11.9	11.9		15.4	13.1	47,684		13.1	47,684
富士通ゼネラル	39.9	39.1	141,346		9.5	11.9		9.5	11.9	38,020		11.9	11.9		28.5	26.6	13,273		26.6	13,273
ソニーグループ	921.1	965.7	11,641,513		30.8	34.2		30.8	34.2	135,261		34.2	34.2		73	60.8	26,691		60.8	26,691
TDK	213	218.4	1,036,308		106.5	101.6		106.5	101.6	130,454		101.6	101.6		19.6	14	4,746		14	4,746
帝国通信工業	6.7	6.2	9,163		129.1	133.9		129.1	133.9	3,090,412		133.9	133.9		30.8	31.3	34,868		31.3	34,868
タムラ製作所	56.8	59.1	44,797		28.9	29		28.9	29	14,558		29	29		17.7	16.1	2,495		16.1	2,495
アルプスアルパイン	129.9	123.1	173,694		3.6	4		3.6	4	16,400		4	4		107.7	105.4	382,075		105.4	382,075
池上通信機	5	4	2,472		19.9	16.6		19.9	16.6	12,151		16.6	16.6		461.4	451.5	480,396		451.5	480,396
日本電波工業	13.3	16.5	23,859		65.8	63.1		65.8	63.1	663,181		63.1	63.1		9.6	7.7	5,205		7.7	5,205
鈴木	6.8	7.4	7,296		105.5	109.5		105.5	109.5	770,880		109.5	109.5		1,157.5	1,109.7	3,617,622		1,109.7	3,617,622
メイコー	12	15.1	44,016		14.6	14.1		14.6	14.1	100,815		14.1	14.1		336.2	250.8	1,212,116		250.8	1,212,116
日本トリム	2.9	3.1	9,008		43.2	48.3		43.2	48.3	189,577		48.3	48.3		421.2	432	932,904		432	932,904
ローランド ディー・ジー	8.7	7.7	22,607		206.9	212.1		206.9	212.1	1,380,771		212.1	212.1		7.2	5.4	3,682		5.4	3,682
フォスター電機	14.8	12.8	12,544		71.3	66.5		71.3	66.5	303,240		66.5	66.5		191.9	214.5	709,995		214.5	709,995
SMK	3.5	3.3	7,844		431.9	414		431.9	414	3,191,112		414	414		16.9	11.7	2,878		11.7	2,878
ヨコオ	10.9	10.9	24,623		25.1	25.8		25.1	25.8	14,112</										

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	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
日本プラスト		千株	千円	ホクシン		千株	千円	西日本旅客鉄道		千株	千円	西日本旅客鉄道		千株	千円
ヨロズ		11.5	4,037	ウッドワン		11	9.4	東海旅客鉄道		178.4	174.3	東海旅客鉄道		174.3	918,386
エフ・シー・シー		13.9	9,072	大建工業		4.6	4	西武ホールディングス		122.1	105.2	西武ホールディングス		105.2	1,614,294
シマノ		24	34,821	凸版印刷		8.7	8.3	湧池運輸		191.8	165.1	湧池運輸		165.1	240,220
テイ・エス テック		59.1	1,333,062	大日本印刷		223.5	178.5	西日本鉄道		23.5	23.3	西日本鉄道		23.3	35,602
ジャムコ		62.1	98,875	共同印刷		173.8	162	ハマキョウレックス		40.7	36.4	ハマキョウレックス		36.4	85,576
精密機器 (2.6%)		8.6	9,781	N I S S H A		4.6	3.8	サカイ引越センター		10.6	10.7	サカイ引越センター		10.7	34,614
テルモ		416	1,640,745	光村印刷		30.2	26	近畿グループホールディングス		6.9	6.5	近畿グループホールディングス		6.5	28,015
クリエートメディック		4.3	3,725	TAKARA & COMPANY		0.7	0.6	阪急阪神ホールディングス		139.3	136.3	阪急阪神ホールディングス		136.3	571,097
日機装		44.1	35,702	アシックス		7.4	8.8	南海電気鉄道		174.1	181.7	南海電気鉄道		181.7	700,453
日本エム・ディ・エム		8.6	8,016	アサヒ		129.9	126	京阪ホールディングス		62.3	65.1	京阪ホールディングス		65.1	179,871
島津製作所		189.3	664,800	ローランド		3.8	2.4	神戸電鉄		62.1	56.3	神戸電鉄		56.3	190,857
JMS		12.3	6,412	小松ウオール工業		10.3	10	名古屋鉄道		3.3	3.7	名古屋鉄道		3.7	11,692
クボテック		3.3	736	ヤマハ		4.3	5.1	山陽電気鉄道		114.5	150.6	山陽電気鉄道		150.6	311,591
長野計器		10.8	11,325	河合楽器製作所		85.5	86.1	アルプス物流		11	10.3	アルプス物流		10.3	22,309
ブイ・テックノロジー		6.4	18,321	クリナップ		4.1	3.7	ヤマトホールディングス		9.9	10.9	ヤマトホールディングス		10.9	14,300
東京計器		9.4	13,280	ビジョン		14	15.4	山九		195.2	174.5	山九		174.5	425,780
愛知時計電機		3.7	7,554	兼松サステック		89	86.9	丸連		36.6	34.7	丸連		34.7	173,500
インタークション		7.5	9,420	キングジム		0.6	0.6	丸倉		8.3	6.5	丸倉		6.5	1,436
オーバル		13.3	4,889	リントック		12.3	12.2	丸倉和運輸		11.5	8.5	丸倉和運輸		8.5	26,265
東京精密		24.8	137,988	イトーキ		31.6	27.4	セコグループホールディングス		69.9	72.2	セコグループホールディングス		72.2	71,694
マニー		58.6	115,091	任天堂		26.8	27.9	トナミホールディングス		3.4	2.5	トナミホールディングス		2.5	9,312
ニコン		224.5	266,861	三菱鉛筆		83	861.9	ニコンホールディングス		46.8	43.7	ニコンホールディングス		43.7	108,157
トプコン		69.1	117,823	タカラスタンダード		24.2	19.4	日本石油輸送		1.1	0.8	日本石油輸送		0.8	1,858
オリンパス		771.1	2,132,396	ココヨ		30.5	26.4	福山通運		23	10.4	福山通運		10.4	35,048
理研計器		12	39,950	ナカバヤシ		70.5	65.7	セイノーホールディングス		94.9	84.9	セイノーホールディングス		84.9	111,643
タムロン		11.5	32,946	グロープライド		14	15	エスライ		3.2	3.7	エスライ		3.7	3,019
HOYA		287	4,145,130	オカムラ		13.2	11	神奈川中央交通		3.4	3.9	神奈川中央交通		3.9	12,870
シード		6.9	3,236	美津濃		50.6	41.1	日立物流		26.9	-	日立物流		-	-
ノーリツ鋼機		13.2	30,405	電気・ガス業 (1.2%)		14.7	13.5	A2-COMEXホールディングス		29.5	32.9	A2-COMEXホールディングス		32.9	55,666
A&Dホンホールディングス		13.4	21,870	東京電力ホールディングス		1,100.2	1,230.6	C&Fホールディングス		14.3	13.2	C&Fホールディングス		13.2	15,866
朝日インテック		161.2	352,275	中部電力		449.8	503.1	九州旅客鉄道		107.8	96.3	九州旅客鉄道		96.3	274,551
シチズン時計		172.1	91,139	関西電力		557	527.1	S Gホールディングス		263.3	261.6	S Gホールディングス		261.6	552,760
リズム		4.6	6,224	中国電力		229.8	217.4	NIPPON EXPRESSホールディングス		48.2	50.9	NIPPON EXPRESSホールディングス		50.9	382,259
大研医器		12	4,287	北陸電力		134.6	128.7	海運業 (0.6%)							
メニコン		48.8	134,040	東北電力		343.8	333.7	日本郵船		116.4	364.6	日本郵船		364.6	1,164,532
シンシア		1.8	592	東国電力		132.5	116.5	商船三井		77.1	240.2	商船三井		240.2	792,660
松風		6.4	13,590	九州電力		303	315	川崎汽船		42.9	116.1	川崎汽船		116.1	362,232
セイコーグループ		20.7	62,328	北海道電力		127.8	131.7	N Sユナイテッド海運		7.7	7.3	N Sユナイテッド海運		7.3	28,433
ニプロ		109.6	117,100	沖縄電力		31.4	31.9	明治海運		16.5	11.8	明治海運		11.8	7,752
その他製品 (2.3%)				電源開発		125.2	102.8	飯野海運		64.5	50	飯野海運		50	46,100
K Y O R I T S U		-	2,164	エフオン		8.9	8.9	共栄タンカー		2.5	2.2	共栄タンカー		2.2	2,098
中本パックス		4.2	6,099	イーレックス		21.7	24.3	乾汽船		9.4	17.3	乾汽船		17.3	34,427
スノーピーク		19.3	49,675	レノバ		28.7	36.3	空運業 (0.5%)							
パワフロントベッドホールディングス		28.2	73,122	東京瓦斯		281.8	288.6	日本航空		319.2	334.8	日本航空		334.8	875,167
トランザクション		8.1	16,233	大阪瓦斯		266.1	276.6	ANAホールディングス		353.8	370.8	ANAホールディングス		370.8	1,051,218
鞋美堂		5	1,323	東邦瓦斯		67.5	53.8	パスコ		2.8	2.5	パスコ		2.5	3,650
ニホンフラッシュ		12.6	11,958	北海道瓦斯		7.6	8.2	倉庫・運輸関連業 (0.1%)							
前田工織		16.3	39,382	広島ガス		29.1	28.8	トランコム		4	3.9	トランコム		3.9	27,807
永大産業		20.5	2,899	西部ガスホールディングス		16.6	12.8	日新		11.3	10.3	日新		10.3	22,536
アートネイチャー		12.7	10,363	静岡ガス		38.4	31.2	三菱倉庫		44.1	29.3	三菱倉庫		29.3	91,269
バウダイナムコホールディングス		131.8	1,075,038	メタウオーター		15.3	17	三井倉庫ホールディングス		14.9	12.7	三井倉庫ホールディングス		12.7	47,625
アイフィスジャパン		4.3	2,128	陸運業 (2.9%)				住友倉庫		49.2	37.5	住友倉庫		37.5	75,262
共立印刷		25.1	-	SBSホールディングス		11	12.2	滋澤倉庫		8.5	5.5	滋澤倉庫		5.5	11,533
S H O E I		13.9	72,576	東武鉄道		143.6	150	東陽倉庫		22.8	16.4	東陽倉庫		16.4	4,542
フランスベッドホールディングス		19.3	16,262	相鉄ホールディングス		47	45.1	日本トランスシティ		30.8	27.6	日本トランスシティ		27.6	14,931
パイロットコーポレーション		24.9	96,300	東急		370.8	382.7	ケイヒン		2.8	2.2	ケイヒン		2.2	3,341
萩原工業		9.6	10,683	京浜急行電鉄		188.7	154.8	中央倉庫		8.8	6.7	中央倉庫		6.7	6,512
フジールインターナショナル		35.7	45,788	小田急電鉄		218.7	206.9	川西倉庫		2.9	2.1	川西倉庫		2.1	2,114
タカラトミー		61.5	79,442	京王電鉄		76.3	72.2	安田倉庫		12	9.5	安田倉庫		9.5	8,873
広済堂ホールディングス		9	16,924	京成電鉄		102.5	88	フェイスホールディングス		2.9	2.3	フェイスホールディングス		2.3	2,661
エステールホールディングス		4	1,824	富士急行		17.6	16.8	東洋埠頭		3.2	3.5	東洋埠頭		3.5	4,669
タカノ		5.4	3,086	新京成電鉄		3.4	-	上組		76.7	65.3	上組		65.3	172,914
プロネクサス		11.5	11,058	東日本旅客鉄道		258.8	231.6	サンリツ		4	2.8	サンリツ		2.8	2,086
							1,591,786	キムラユニティ		4	5.9	キムラユニティ		5.9	5,882

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
キユーソー流通システム		千株	千株	千円	インターネットイニシアティブ		千株	千株	千円	東邦システムサイエンス		千株	千株	千円
近鉄エクспレス	26.3	7.3	7.3	6,978	ざくらインターネット	15.4	38.5	76.4	180.151	ゾースネクト	61.7	4.1	3.5	3,591
東海運	8.6	-	-	-	ヴィンクス	4.2	15.3	15.3	9.210	インフォコム	15.9	69.6	17.6	19,696
イーアイティー	8.8	7.5	2,122		GMOのぞみホールディングス	3.3	4.2	3.6	5,256	シンプレクス・ホールディングス	16.8	15.9	23	39,952
内外トランスライン	5.4	8.6	13,467		SRAホールディングス	7.2	4.2	7	18,564	HEROZ	4	16.8	4	5,085
日本コンセプト	4.6	5	11,040		システムインテグレータ	4.8	7	3.7	21,490	ラクソル	15.9	15.9	38.7	60,101
情報・通信業 (8.9%)		4.2	6,392		朝日ネット	13.3	4.8	14.8	1,546	メルカリ	-	61.8	61.8	182,371
NECネットワークス	47.8	13.3	73,577		eBASE	17.2	13.3	19.3	8,658	I P S	4	4.4	4	12,522
クロスキャット	3.9	15.5	10,514		アバントグループ	15.5	17.3	17.3	12,738	F I G	16	14.1	5,287	
システムナ	205.8	5.1	83,102		アドソル日進	5.1	5.8	7.824	24,271	システムサポート	4.3	5.3	8,474	
デジタルアーツ	7.9	3	48,285		ODKソリューションズ	3	2.7	1.571	7,824	イートン	8.7	8.8	6,987	
日鉄ソリューションズ	20.9	8.6	77,220		フリービット	8.6	7.1	8,094	1,571	アルテリア・ネットワークス	18.3	12.7	15,849	
キューブシステム	7.5	16.2	8,339		コムチュア	16.2	18.1	41,811	8,094	東海ソフト	2.4	1.9	1,763	
WOW WORLD	2.2	2.4	-		サイバコム	2.4	2	2,878	41,811	ウイングワーク1st	8.2	14.1	27,650	
コア	6.4	10.4	8,897		アステリア	10.4	10.7	8,003	2,878	ヒトコエソリューションズ・ホールディングス	3.4	3.7	5,742	
手間いらす	1.8	8	11,465		アイル	8	7.6	15,116	8,003	サーパワークス	2.6	2.8	6,568	
ラクーンホールディングス	10.3	7.4	13,178		マークラインズ	7.4	7.4	20,424	15,116	東名	1.5	0.9	2,031	
ソリトンシステムズ	7.3	18.3	7,966		メディカル・データ・ビジョン	18.3	20.4	19,808	20,424	ウィッツ	1.2	1.2	1,129	
ソフトクリエイティブホールディングス	6.4	20	20,064		gumi	20	21.1	17,850	19,808	トピラスシステムズ	2.9	3.1	2,551	
T I S	137.6	3.4	533,263		ショーケース	3.4	3	927	17,850	Sansan	51.3	44.7	77,375	
JNSホールディングス	6.7	3.3	1,797		モバイルファクトリー	3.3	2.6	2,488	927	Link-U	2.7	2.3	2,120	
グリ	65.7	5.2	25,910		テラスカイ	5.2	5.9	11,794	2,488	ギフティ	12.6	14.9	35,313	
GMOペパボ	1.5	6.4	3,768		デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6.4	7.9	14,844	11,794	モデル	-	13.7	60,896	
コーエーテクモホールディングス	46.1	6.6	199,399		PCLホールディングス	6.6	5.1	5,349	14,844	ベース	2.6	4.6	21,942	
三菱総合研究所	6.3	2.8	32,528		パイプドHD	2.8	-	-	5,349	JMDC	13.5	22.5	97,762	
ボルテージ	4	2.6	1,137		アイビーシー	2.6	1.9	725	-	フォーカスシステムズ	9.6	10	10,880	
電算	1.1	4	1,280		ネオジャパン	4	4.5	4,392	725	グレスコ	10.7	10.5	19,026	
AGS	7.2	3.2	3,598		PR TIME S	3.2	3.4	6,358	4,392	アジアメディア・ホールディングス	139	131.4	138,101	
ファインデックス	12.1	49.6	5,703		ラクソ	49.6	64.7	120,471	6,358	オービック	45.6	45.7	942,334	
ブレインパッド	11.3	2.5	7,354		ランドコンピュータ	2.5	3	2,820	120,471	ジャストシステム	20.5	19.7	63,138	
KLab	26.3	4.5	11,070		ダブルスタンダード	4.5	5.6	12,482	2,820	TDCソフト	12.6	11.6	18,107	
ホルトウフィンホールディングス	20.9	8.6	20,404		オープンドア	8.6	9.6	16,608	12,482	Zホールディングス	2,096.9	1,948.4	803,520	
ネクソン	325.4	5.1	1,092,090		マイネット	5.1	4	1,504	16,608	トレンドマイクロ	77.1	79	497,700	
アイスタイル	43.7	6.5	19,701		アカツキ	6.5	6.5	15,268	1,504	IDホールディングス	9.4	9.3	9,272	
エムアップホールディングス	16.4	1.1	19,923		ベネフィットジャパン	1.1	0.8	969	15,268	日本オラクル	23.4	26.2	236,324	
エイチーム	9.9	3.9	7,781		Ubicomホールディングス	3.9	4.2	8,379	969	アルファシステムズ	3.3	4.3	17,630	
エニグモ	15.5	15.4	10,631		カナミックネットワーク	15.4	19.7	11,426	8,379	フューチャー	30.5	34.1	55,855	
テクノスジャパン	11.2	7.6	5,990		ノムラシステムコムボレーション	7.6	11.7	1,345	11,426	CAC Holdings	8.6	8.6	11,945	
enish	8.8	26.5	3,330		チェンジ	26.5	33.5	77,351	1,345	S Bテクノロジー	6.4	5.8	11,698	
コロプラ	47.3	7.5	33,675		シンクロ・フード	7.5	7.6	3,663	77,351	トーセ	4.5	3.2	2,390	
オルトプラス	11.2	7.7	1,784		オークネット	7.7	6.7	12,709	3,663	オービックビジネスコンサルティング	13.9	26.9	133,020	
プロドリフ	71.5	2.9	36,514		キャピタル・アセット・プランニング	2.9	2.4	1,459	12,709	伊藤忠テクノソリューションズ	65.7	73.5	227,482	
クロス・マーケティンググループ	5.4	3.8	5,599		セグエグループ	3.8	3.3	2,795	1,459	アイティフォー	17.4	18.2	15,706	
デジタルハーツホールディングス	6.7	2.2	15,677		エイトレッド	2.2	1.9	2,781	2,795	東計電算	1.7	2	11,500	
システム情報	10.9	29.5	10,224		マクロミル	29.5	26.8	29,694	2,781	エクسسネット	2.5	1.8	1,814	
メディアアド	5.1	3.4	8,998		ビーグリー	3.4	2.1	2,490	29,694	大塚商会	78	77.6	353,856	
じげん	40.6	4.6	15,281		オロ	4.6	4.1	8,183	2,490	サイボウズ	19.4	18.9	50,292	
ブイキューブ	14.7	4.5	11,726		ユーザーローカル	4.5	5	6,965	8,183	電通国際情報サービス	20.8	16.6	69,139	
エンカレッジ・テクノロジー	3.4	3.3	1,441		テモナ	3.3	2.3	646	6,965	ACCESS	16.4	16.2	16,054	
サイバーリンクス	4.8	3.4	3,744		ニーズウェル	3.4	3.7	3,248	646	デジタルガレージ	23.8	24.3	114,088	
ディー・エル・イー	9.6	22	2,279		マネーフォワード	22	32.9	173,383	3,248	イーエムシステムズ	24	22.8	21,249	
フィックスターズ	15.4	4.6	21,173		サインポスト	4.6	4.7	2,758	173,383	ユーザーニューズ	4.5	4.2	29,316	
CARTA HOLDINGS	5.7	-	10,585		SUN A S T E R I S K	-	7.2	10,519	2,758	C I J	9.8	11.4	11,810	
オプティム	10	6	12,812		電算システムホールディングス	6	6.6	14,242	10,519	ビジネスエン지니어リング	1.7	2.6	6,432	
セレス	5.3	-	5,857		APPIER GROUP	-	38.9	73,287	14,242	日本エンタープライズ	14.9	12.4	1,661	
SHIFT	7.3	12.2	238,400		ソルクシーズ	12.2	10.2	3,723	73,287	WOWOW	7	7.6	9,568	
ティーガイア	12.7	4	23,251		フェイス	4	3.4	1,700	3,723	スカラ	12.7	12.7	9,144	
セック	2.3	15.4	5,635		プロトコムボレーション	15.4	17.1	21,340	1,700	インテリジェント ウェブ	8.7	6.5	4,725	
テクマトリックス	24.3	4	40,800		ハイマックス	4	4.3	6,170	21,340	WOW WORLD GROUP	-	2.2	3,293	
プロシップ	4.9	278.9	8,610		野村総合研究所	278.9	280.9	841,857	6,170	IMAGICA GROUP	12.2	11.2	7,358	
カホー・オンライン・エンターテインメント	37.5	10.3	90,587		サイバネットシステム	10.3	11.5	11,408	841,857	ネットワンシステムズ	55	51	164,475	
GMOペイメントゲートウェイ	28	7.6	373,448		CEホールディングス	7.6	6.2	3,155	11,408	システムソフト	30.8	46.4	4,176	
ザッパラス	5.6	2.9	1,166		日本システム技術	2.9	5.1	8,680	3,155	アルゴグラフィックス	11.4	12.6	49,203	
システムリサーチ	4	16.6	9,819		インターホールディングス	16.6	15.5	24,288	8,680	マーベラス	22.8	22.3	15,610	

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
エイバックス		千株	千円	千株	千株	千円	東電エレクトロニクス	千株	千株	千円	丸文	千株	千株	千円		千株	千株	千円		
B I P R O G Y	24.9	23.2	41,156	4.2	5.4	41,418	円谷フーズホールディングス	5.4	5.4	41,418	ハビネット	12.7	12.9	16,202		12.7	12.9	16,202		
兼松エレクトロニクス	45.1	50.4	155,232	12.6	12.4	30,938	双日	12.6	12.4	30,938	橋本製菓ホールディングス	12.1	12.3	25,202		12.1	12.3	25,202		
都築電気	8	8.5	52,615	159.9	153.3	393,214	アルフレッサホールディングス	159.9	153.3	393,214	日本ライフライン	3	5.8	6,165		3	5.8	6,165		
TBSホールディングス	7.5	7.2	9,612	160.8	144.9	231,115	横浜冷凍	160.8	144.9	231,115	タカショー	42.9	42.3	37,900		42.9	42.3	37,900		
日本テレビホールディングス	87.7	70.2	104,668	41.4	39.4	41,921	神栄	41.4	39.4	41,921	IDOM	11	12.5	8,437		11	12.5	8,437		
朝日放送グループホールディングス	120.4	121.3	124,453	2	1.8	1,519	ラサ商事	2	1.8	1,519	進和	43.9	43.7	36,620		43.9	43.7	36,620		
テレビ朝日ホールディングス	14.9	13	8,333	8.2	5.8	7,215	アルコニックス	8.2	5.8	7,215	エスケイジャパン	8.7	9.6	20,121		8.7	9.6	20,121		
スカパーJSATホールディングス	34.7	33.3	43,523	15.4	19	26,125	神戸物産	15.4	19	26,125	ダイترون	3.3	3.2	1,792		3.3	3.2	1,792		
テレビ東京ホールディングス	122	121.3	57,738	112.5	111.8	418,691	ハイパー	112.5	111.8	418,691	シークス	6.3	5.7	14,324		6.3	5.7	14,324		
日本BS放送	10.6	9.8	18,708	2.3	2.5	1,140	あいホールディングス	2.3	2.5	1,140	田中商事	20.6	20.5	29,417		20.6	20.5	29,417		
ビジョン	5.3	4.4	3,977	20.6	23.1	49,919	ディーブイエックス	20.6	23.1	49,919	オーハシテックニカ	3.3	3.9	2,269		3.3	3.9	2,269		
スマートパリュース	24.6	18.1	25,846	4.8	3.5	3,545	ダイワホールディングス	4.8	3.5	3,545	白銅	8.2	7.2	10,699		8.2	7.2	10,699		
USEN-NEXT HOLDINGS	3.6	3	1,233	70.4	59	115,817	マクニカホールディングス	70.4	59	115,817	ダイコー通産	4.7	5.3	13,583		4.7	5.3	13,583		
ワイヤレスゲート	13.8	12.3	28,228	34.5	35.4	121,953	グリムス	34.5	35.4	121,953	伊藤忠商事	1.7	1.4	1,496		1.7	1.4	1,496		
コネクシオ	5.5	5.5	1,380	5	5.7	11,793	ハイタカエスターホールディングス	5	5.7	11,793	丸紅	1,012.8	890.1	3,610,245		1,012.8	890.1	3,610,245		
日本通信	10.4	8.9	16,990	6.6	6	15,276	八洲電機	6.6	6	15,276	高島	1,428.3	1,140.3	1,981,841		1,428.3	1,140.3	1,981,841		
クロップス	119.8	126.2	27,637	25.2	21.1	17,576	メディアスホールディングス	25.2	21.1	17,576	長瀬産業	2.3	2.1	6,117		2.3	2.1	6,117		
日本電信電話	2.9	2.1	2,297	11	11.8	12,779	レスターホールディングス	11	11.8	12,779	蝶理	79.6	67.9	138,923		79.6	67.9	138,923		
KDDI	1,509.2	1,754.4	6,766,720	8.5	9.2	6,559	ジューテックホールディングス	8.5	9.2	6,559	豊田通商	8.2	7.8	19,016		8.2	7.8	19,016		
ソフトバンク	1,051.8	1,058	4,198,144	13.8	13.8	30,898	大光	13.8	13.8	30,898	三共生興	145.3	126.5	712,195		145.3	126.5	712,195		
光通信	2,185.1	2,199.3	3,366,028	3.6	2.7	3,272	OCHIホールディングス	3.6	2.7	3,272	兼松	19.6	20.7	10,577		19.6	20.7	10,577		
エムティーアイ	16.6	16.1	301,392	6.8	5.2	3,421	TOKAIホールディングス	6.8	5.2	3,421	三ツ井物産	53.9	56	88,592		53.9	56	88,592		
GMOインターネットグループ	14.2	12.5	6,337	3.6	2.9	3,726	黒谷	3.6	2.9	3,726	日本紙パルパル商事	1.8	1.9	2,637		1.8	1.9	2,637		
ファイバーゲート	51.1	50.9	132,340	70.4	71.3	61,104	Cominix	70.4	71.3	61,104	カメイ	1,124.4	1,056.8	4,134,201		1,124.4	1,056.8	4,134,201		
アドマテックシステム	4.7	7.3	6,810	4	3.7	2,205	三洋貿易	4	3.7	2,205	東都水産	7.7	7.6	39,520		7.7	7.6	39,520		
KADOKAWA	3.5	3.1	871	1.8	2.4	1,824	ビューティガレージ	1.8	2.4	1,824	スターゼン	17.1	15.4	22,638		17.1	15.4	22,638		
学研ホールディングス	78.7	72.3	181,545	14.7	14.9	17,060	ミタチ産業	14.7	14.9	17,060	山善	0.6	0.6	3,150		0.6	0.6	3,150		
ゼンリン	20.2	22.8	21,591	2.5	2.3	8,257	明治電機工業	2.5	2.3	8,257	楳木興業	2.3	2.1	8,652		2.3	2.1	8,652		
昭文社ホールディングス	23.4	23.3	20,154	10.9	10.5	10,510	デリカフーズホールディングス	10.9	10.5	10,510	住友商事	913.9	894.6	2,079,497		913.9	894.6	2,079,497		
インプレスホールディングス	4.6	5.6	1,635	4	3.3	3,953	スターフィアホールディングス	4	3.3	3,953	内田洋行	2.3	2	4,826		2.3	2	4,826		
アイネット	11.7	10.8	2,203	46.5	51.9	127,777	コマダホールディングス	46.5	51.9	127,777	三菱商事	10.9	11	23,111		10.9	11	23,111		
松竹	7.6	8.4	10,810	4.7	5.5	6,226	ピーバンドットコム	4.7	5.5	6,226	第一実業	60.9	38.9	40,883		60.9	38.9	40,883		
東宝	9.5	7.8	86,112	6	5.2	2,667	アセンテック	6	5.2	2,667	キヤノンマーケティングジャパン	2.3	2.1	8,652		2.3	2.1	8,652		
東映	85.2	85.7	406,218	3.4	2.5	2,460	富士興産	3.4	2.5	2,460	西華産業	35.9	33.4	101,870		35.9	33.4	101,870		
エヌ・ティ・ティ・データ	4.7	3.8	64,562	31.6	35.3	83,413	協栄産業	31.6	35.3	83,413	佐藤商事	6.7	5.1	24,709		6.7	5.1	24,709		
ピー・シー・エー	384.2	429.6	853,185	2.4	1.7	895	フルサト・マルカホールディングス	2.4	1.7	895	三菱商事	7.9	5.7	9,034		7.9	5.7	9,034		
ビジネスブレイン太田昭昭	8.6	7.8	9,640	4.9	4.7	2,641	ヤマエグループホールディングス	4.9	4.7	2,641	岩谷産業	12.1	10.1	13,685		12.1	10.1	13,685		
DTS	5.1	5.9	11,977	3.8	2.9	3,436	小野建	3.8	2.9	3,436	藤洋エレフトロ	1.8	1.6	6,918		1.8	1.6	6,918		
スワンフーズ・エニックスホールディングス	27.7	29.1	90,792	1.7	1.1	1,900	南陽	1.7	1.1	1,900	正和興業	8.6	12.3	28,363		8.6	12.3	28,363		
シーイーシー	67.1	68.8	422,432	14	14.3	47,118	佐島電機	14	14.3	47,118	東京産業	13.2	13.3	10,294		13.2	13.3	10,294		
カプコン	15.4	19.2	30,163	9.8	8.2	11,791	エコートレーディング	9.8	8.2	11,791	ユアサ商事	13.8	13	45,955		13.8	13	45,955		
アイ・エス・ピー	136.1	136	569,160	14.3	13.4	20,167	伯東	14.3	13.4	20,167	神鋼商事	3.4	3.6	20,160		3.4	3.6	20,160		
ジャストテック	8.6	7	8,379	2.3	2.5	5,010	コンドレーテック	2.3	2.5	5,010	トルク	6	6.6	1,379		6	6.6	1,379		
S C S K	8	8.4	10,315	9.1	8	11,360	中山福	9.1	8	11,360	阪和興業	28.9	25.9	107,226		28.9	25.9	107,226		
NSW	100	111.7	219,267	2.9	2.5	2,010	ナガイレイベン	2.9	2.5	2,010	正米食品工業	9.4	9.6	39,936		9.4	9.6	39,936		
AINES	5.4	5.4	11,296	8.7	8.3	38,470	三菱食品	8.7	8.3	38,470	カナデン	1.2	11.7	12,905		1.2	11.7	12,905		
T K C	13.2	9.5	12,521	11.6	11.1	11,155	松田産業	11.6	11.1	11,155	三菱商事	11.6	11.6	20,648		11.6	11.6	20,648		
富士ソフト	24.4	24.6	89,175	7.6	6.6	2,204	第一興商	7.6	6.6	2,204	岩谷産業	34.8	32.9	178,976		34.8	32.9	178,976		
NSD	15.4	15.5	114,545	19.3	18.2	35,271	メディカルホールディングス	19.3	18.2	35,271	ナイス	5.1	3.5	4,669		5.1	3.5	4,669		
コナミグループ	46.5	48.8	112,972	14.2	13.4	43,885	S P K	14.2	13.4	43,885	ニチモウ	2.4	1.4	4,305		2.4	1.4	4,305		
龍井コンピュータホールディングス	52.4	58.6	359,218	10.7	10.9	25,331	秋原電気ホールディングス	10.7	10.9	25,331	極東貿易	4.1	8.7	12,145		4.1	8.7	12,145		
J B C Cホールディングス	6.7	9.5	28,642	27.5	27.9	109,507	アズワン	27.5	27.9	109,507	アスタナホールディングス	20.3	25	10,525		20.3	25	10,525		
ミロク情報サービス	9.8	9.9	19,899	6	6.4	9,702	スズデン	6	6.4	9,702	稲畑産業	35.6	39.8	53,968		35.6	39.8	53,968		
ソフトバンクグループ	12.7	12.5	22,950	5.4	5.5	13,975	尾家産業	5.4	5.5	13,975	G S I クレオス	31.8	29.2	71,773		31.8	29.2	71,773		
卸売業 (6.0%)	865	791.6	4,961,748	21.1	21.2	128,260	シモジマ	21.1	21.2	128,260	明和産業	6.9	8.5	13,472		6.9	8.5	13,472		
ハウスイ	0.6	-	-	5.3	5.1	12,525	ドウシシャ	5.3	5.1	12,525	クワザールホールディングス	4.6	4.4	1,944		4.6	4.4	1,944		
高千穂交易	5.9	4.5	10,696	3.2	3.1	2,920	小津産業	3.2	3.1	2,920	ワキタ	31	26.5	30,713		31	26.5	30,713		
オルパルストアホールディングス	1.7	2	3,256	9	9.9	9,969	高速	9	9.9	9,969	東邦ホールディングス	46.5	35.9	73,846		46.5	35.9	73,846		
伊藤忠食品	3	2.7	13,351	13.8	15.3	27,524	たけびし	13.8	15.3	27,524	サンゲツ	38.4	36.3	81,239		38.4	36.3	81,239		
エレマテック	11.7	13	22,919	2.5	2.9	4,584	リックス	2.5	2.9	4,584	ミツコグループホールディングス	21.3	18.6	21,483		21.3	18.6	21,483		
J A L U X	4.1	-	-	8.8	7.5	14,392		8.8	7.5	14,392	シナホンホールディングス	5.4	4.6	16,353		5.4	4.6	16,353		

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 額	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		
サンワ テクノス	千株		千円				千株		千円				千株		千円			千株		千円			
リョーサン	8.8	7.4	14,585				11.5	11.4	17,202								14.2	12.6	5,103				
新光商事	16	15.4	45,522				4	2.9	1,792								2.7	2.8	1,778				
トーホー	22	19.4	24,987				11.2	11.9	22,467								3.5	4	2,320				
三信電気	6.8	6.2	10,812				4.8	4.1	2,824								6.9	5.3	2,316				
東陽テクニカ	6.8	5.8	14,215				17.8	19.9	23,382								23.4	47.2	61,548				
モスフードサービス	14.3	15.9	21,528				9.9	8.6	32,637								20.4	22.8	32,718				
加賀電子	19.1	21.3	65,391				85.7	96	114,720								11.2	9.7	5,422				
ソーダニッカ	13.1	11.8	52,510				89.3	88.1	103,165								166.7	186.3	257,466				
立花エレクトック	15.1	9.4	6,993				19.7	30.2	5,043								15.7	16.5	4,570				
フォーバル	11.7	10.5	19,183				183.1	204.7	416,973								14.9	13.8	12,489				
PAL TAC	6.6	5.5	5,764				4	3.1	1,503								4.8	4.7	11,355				
三谷産業	20.3	22.7	108,279				7.7	8.3	6,424								16.9	14	4,802				
太平洋興発	17.1	25.3	7,969				4.1	3.1	1,773								1.2	1.7	2,777				
西武シメッタCホールディングス	5.6	4.4	3,946				10.8	11.8	25,322								16.2	18	26,892				
ヤマタススクエアホールディングス	3.4	3.6	12,672				172.8	179.5	216,477								25.7	21.4	19,003				
コア商事ホールディングス	1.2	1	1,746				25	25.6	46,822								24.8	28	15,764				
KPPグループホールディングス	10.9	8.2	5,518				89.1	87.6	553,632								5.1	4.1	3,808				
ヤマタネ	30	33.6	29,534				8.3	7.6	18,468								20.6	19.5	64,350				
丸紅建材リース	6.9	6.4	10,681				99.8	95.5	312,285								5.4	5.4	10,103				
日鉄物産	1.1	0.8	1,500				4.3	3.9	8,392								17.6	17.4	16,912				
泉州電業	10.4	9.9	91,377				7.2	8	51,600								4	4	1,576				
トラス中山	4.1	7.2	25,236				253.3	243.1	335,964								289.5	291.5	692,895				
オートバックスセブン	30.2	30.3	61,781				3.8	5	4,025								31.7	32	49,056				
モリト	48.8	50.2	71,284				1.1	1.3	1,341								70.8	79	258,330				
加藤産業	10.9	10.4	9,869				76.6	74.9	218,932								9.2	9.5	10,260				
北恵	2	17.5	62,475				21.3	23.8	82,467								6.3	4.5	3,627				
J Kホールディングス	4	2.9	1,989				18.9	15.4	5,314								21.5	24	76,560				
日伝	25.1	25.5	44,191				3	2.4	1,488								54.6	54.8	27,783				
北沢産業	11.7	11.4	12,118				2	1.7	2,147								3.9	4.5	9,697				
杉本商事	12.1	8.6	15,953				2.2	1.9	875								4.6	3.2	444				
因幡電機産業	7.6	7.1	1,661				4.6	4	4,516								7.9	8.2	10,856				
東テック	6.6	6.2	12,065				12	10.7	11,491								15.1	15.4	26,611				
ミスミグループ本社	38.7	37.4	103,261				20.8	19.4	41,962								20.9	21.4	43,805				
アルテック	4.6	4.9	18,889				29.3	32.9	99,851								8.6	7.1	1,412				
タキヒーヨー	181.7	217.9	716,891				42.4	42.8	77,682								59.5	66.6	122,477				
蔵王産業	10.3	7.1	1,909				5.3	5.4	11,118								16.9	15.7	4,474				
ズズケン	4.1	3.1	2,954				11	11	15,554								10.3	11.5	54,222				
ジェコス	2.2	2.2	4,241				186.9	197.4	304,983								5.5	4.2	777				
グローセル	56.6	44.9	152,660				7.2	7.9	14,030								3.6	3.2	2,124				
小売業(4.5%)	10.8	9.4	7,990				11	11.4	16,062								28.9	29.1	162,960				
ローソン	17.1	15.4	6,267				2.9	2.6	5,733								7.3	8	19,688				
サンエー	32.1	35.8	182,938				42.3	47.2	53,147								19.3	17.9	1,754				
カワチ薬品	11	11	45,650				7.6	6.5	7,689								22.3	21.5	16,662				
イービーシー・マート	11.3	11.4	25,832				7.5	8.2	17,416								13.3	12.4	21,972				
ハードコアコーポレーション	22.7	21.1	145,801				12	12.1	16,431								19.3	21.9	45,902				
アスクル	6.9	5.2	6,354				8.8	9.9	11,454								20	23.8	21,586				
ゲオホールディングス	32.7	29.8	52,209				14.7	14.2	183,038								26.4	27.1	10,731				
アダストリア	19.4	15.2	27,694				6.8	5.8	4,390								12.9	9.2	717				
ジーフット	15.5	17.4	37,270				566.6	497.8	2,963,403								17.6	21.5	28,401				
シー・ヴィ・エス・バイエリア	10	6.8	2,033				77.1	108.7	106,634								26.9	23.4	20,755				
くら寿司	2.3	1.7	691				31.6	30.3	286,638								16.6	12.9	24,819				
キャンドゥ	15.1	16.9	53,826				11.5	11.7	20,264								70.4	77.4	146,595				
IKホールディングス	5.3	5.2	11,949				3.4	2.9	2,894								24.9	28	70,028				
バルグループホールディングス	4	4	1,500				35.9	35.9	99,945								0.6	0.6	450				
エディオン	12.6	14.1	40,297				13.2	14.8	6,023								18	14.1	17,963				
サトーコーポレーション	66.3	57.2	73,101				2.5	2.1	2,400								20.4	13.8	10,653				
ワッツ	29.6	30.3	21,967				9.8	12.3	22,632								13.5	12.6	34,587				
ハローズ	7.2	6.3	4,353				7.4	5.8	4,547								17.9	18.6	41,905				
フジオフードグループ本社	6.7	6.6	21,021				11.2	10.8	11,286								18.2	20.4	13,770				
あみやき亭	12.3	12.1	16,976				3.9	3.8	6,167								15.3	13.7	3,699				
ひらまつ	3.4	3.5	10,248				10.6	9.4	7,933								28	26.8	18,358				
大黒天物産	30.8	27.2	5,195				14.4	12.9	94,428								22.8	23	20,631				
	4.7	4.4	23,496				7.7	7.4	9,102								22.4	22.3	57,980				
							84.7	83	272,240								29.7	30.9	28,211				

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	
しまむら	16.8	16.9	213,278		13.1	12.8	30,208		北日本銀行	4.7	4.7	10,062		4.7	4.7	10,062		4.7	10,062	
はせがわ	8	6.2	2,089		19.5	17.4	52,287		東和銀行	25.9	24.9	14,940		25.9	24.9	14,940		25.9	14,940	
高島屋	105.3	108.9	194,713		13.4	11.4	45,144		福島銀行	16.8	12.8	3,276		16.8	12.8	3,276		16.8	3,276	
松屋	29.1	24.5	27,807		—	16.6	38,312		大東銀行	7.4	4.6	3,381		7.4	4.6	3,381		7.4	3,381	
エイト・ツー・オ ーティリング	68.5	70.3	88,437		—	18.8	42,600		トモニホールディングス	112.3	109	42,183		112.3	109	42,183		112.3	42,183	
近鉄百貨店	55.5	4.6	11,477		94.6	39.7	95,081		フィデアホールディングス	13.2	13.8	20,272		13.2	13.8	20,272		13.2	20,272	
丸井グループ	114.3	106.5	233,661		81	84.4	221,465		池田泉州ホールディングス	165.8	170.8	42,187		165.8	170.8	42,187		165.8	42,187	
アクシアル リテイリング	11.4	9.9	33,957		9,093.4	8,536.5	8,008,090		証券・商品先物取引業(0.8%)											
井筒屋	6.9	6.1	2,031		1,659.4	1,716	1,221,620		F P G	48.8	54.5	63,329		48.8	54.5	63,329		48.8	63,329	
イオン	557.2	489.7	1,285,952		274.1	244.4	1,171,898		ジャパンインベストメントアドバイザー	11.3	10.9	11,782		11.3	10.9	11,782		11.3	11,782	
イズミ	26.3	22	63,382		1,003.6	982.5	5,535,405		マーキュリアホールディングス	5.1	7.1	5,396		5.1	7.1	5,396		5.1	5,396	
平和堂	26.8	24	50,736		483.8	374.7	358,213		S B Iホールディングス	178.9	194.6	538,847		178.9	194.6	538,847		178.9	538,847	
フジ	17.6	22.2	40,159		277.9	260.6	127,433		日本アジア投資	11.5	9.6	2,150		11.5	9.6	2,150		11.5	2,150	
ヤオコー	16.5	16.3	109,210		21.6	17.1	39,586		ジャフコ グループ	55.7	44.9	96,310		55.7	44.9	96,310		55.7	96,310	
ゼビオホールディングス	19.7	19.7	18,045		34.5	28	14,252		大和証券グループ本社	1,086	961.3	591,199		1,086	961.3	591,199		1,086	591,199	
ケーズホールディングス	133.4	114.9	134,892		56.9	59.1	13,652		野村ホールディングス	2,214.1	2,476.6	1,339,097		2,214.1	2,476.6	1,339,097		2,214.1	1,339,097	
Olympicグループ	7.9	5.2	2,698		45.5	43	96,234		岡三証券グループ	113.8	118.4	49,846		113.8	118.4	49,846		113.8	49,846	
日産東京販売ホールディングス	22.8	16.4	5,084		11.3	—	—		丸三証券	42.9	44.7	18,952		42.9	44.7	18,952		42.9	18,952	
シルバークライフ	3	3.3	5,613		9.4	9	16,479		東洋証券	46.8	44.6	13,246		46.8	44.6	13,246		46.8	13,246	
Genky DrugStores	6.4	6.3	26,743		16.3	15	17,265		東興ホールディングス	165.7	146.2	54,825		165.7	146.2	54,825		165.7	54,825	
ナルミヤ・インターナショナル	3.4	2.1	1,936		9.4	9.2	21,077		光世証券	2.9	2.7	985		2.9	2.7	985		2.9	985	
フックアップホールディングス	8.8	8.4	10,600		121.4	107.2	25,513		水戸証券	38.7	36.2	10,823		38.7	36.2	10,823		38.7	10,823	
ギフトホールディングス	2.4	3.1	13,066		7.5	6	6,138		いちよし証券	27.3	24.6	15,178		27.3	24.6	15,178		27.3	15,178	
アインホールディングス	19.4	19.9	107,062		9.5	—	—		松井証券	71.2	79.5	62,010		71.2	79.5	62,010		71.2	62,010	
元気寿司	4.1	4.1	12,201		122	107.3	313,745		マネックスグループ	118	150.1	77,301		118	150.1	77,301		118	77,301	
ヤマダホールディングス	528.8	592.4	276,650		353.2	—	—		極東証券	19.5	16.8	10,096		19.5	16.8	10,096		19.5	10,096	
アークランズ	22.8	21.2	30,528		127	118.5	49,888		岩井コスモホールディングス	13.7	15.3	20,517		13.7	15.3	20,517		13.7	20,517	
ニトリホールディングス	57.6	58.4	992,800		326	275.5	153,453		アイザワ証券グループ	24	19.4	13,851		24	19.4	13,851		24	13,851	
グルメ軒屋	12	11.8	11,918		16	13.7	17,371		マネーパートナーズグループ	15.4	12.5	3,250		15.4	12.5	3,250		15.4	3,250	
愛眼	8.1	7.6	1,254		28.8	25.7	49,241		スパークス・グループ	66.7	15	25,785		66.7	15	25,785		66.7	25,785	
ケユーホールディングス	7.9	8.5	12,265		12.5	12	20,148		小林洋行	3.2	2.8	630		3.2	2.8	630		3.2	630	
吉野家ホールディングス	50.6	56.4	133,442		6.3	5.4	8,170		保険業(2.4%)											
樫屋フーズホールディングス	7	6.8	26,928		2.2	1.9	3,357		かんぽ生命保険	145.9	163.3	373,793		145.9	163.3	373,793		145.9	373,793	
サガミホールディングス	22.3	23.2	29,000		27.3	22.4	62,809		SOMPOホールディングス	238.1	230.7	1,280,615		238.1	230.7	1,280,615		238.1	1,280,615	
関西フードマーケット	11	13	16,731		22.8	20.2	52,479		アコム ホールディングス	44.4	45.7	27,008		44.4	45.7	27,008		44.4	27,008	
王将フードサービス	9.5	9.5	56,905		140	126.6	51,273		MS&Dインフラホールディングス	325.2	273.6	1,149,667		325.2	273.6	1,149,667		325.2	1,149,667	
アプレナス	16.4	—	—		51.9	42.6	259,860		第一生命ホールディングス	713.7	684.5	2,030,227		713.7	684.5	2,030,227		713.7	2,030,227	
ミニストップ	11.2	10.4	14,612		49.2	48.1	77,248		東京海上ホールディングス	477.6	1,353.8	3,691,812		477.6	1,353.8	3,691,812		477.6	3,691,812	
アークス	27.7	26.5	57,028		90.5	85.4	85,314		T&Dホールディングス	376.3	360.9	726,130		376.3	360.9	726,130		376.3	726,130	
パロホールディングス	32.1	27.6	50,728		86.3	84	67,536		アドバンスクリエイト	7	7.8	9,110		7	7.8	9,110		7	9,110	
ベルク	6.4	7.2	39,456		116	—	—		その他金融業(1.1%)											
大 庄	8	6.9	7,148		4.2	3.9	4,793		全国保証	34.7	35.2	172,480		34.7	35.2	172,480		34.7	172,480	
ファーストリテイリング	19.4	21.7	1,791,552		192.3	—	—		あんしん保証	4.9	6	1,602		4.9	6	1,602		4.9	1,602	
サンドラッグ	54.5	54.8	197,554		15.4	12.2	23,472		ジェイリース	4.9	4	10,880		4.9	4	10,880		4.9	10,880	
サックスパー ホールディングス	13.8	13.7	10,165		22.3	21.2	19,885		イントラスト	6.3	4.5	4,243		6.3	4.5	4,243		6.3	4,243	
ヤマザウ	2.9	2.3	3,155		22.3	19.9	42,227		日本モーゲージサービス	8.2	6.7	5,916		8.2	6.7	5,916		8.2	5,916	
やまや	3	2.8	7,173		8.6	8	16,824		C A S A	5.1	4.5	3,699		5.1	4.5	3,699		5.1	3,699	
ペルーナ	31.1	33.8	23,153		9.1	8.8	23,284		アルヒ	21.3	16.5	17,605		21.3	16.5	17,605		21.3	17,605	
銀行業(6.5%)									プレミアグループ	7.5	22.6	37,312		7.5	22.6	37,312		7.5	37,312	
いざぎホールディングス	—	160.1	112,710		8.6	7.8	14,297		ネットロフィクションホールディングス	33	44.4	26,551		33	44.4	26,551		33	26,551	
いざぎホールディングス	—	303.9	327,604		31.6	30.5	28,853		クレディセゾン	92.9	85.1	147,137		92.9	85.1	147,137		92.9	147,137	
ちゅうぎんホールディングス	—	113.2	105,049		430.4	481.4	126,126		芙蓉総合リース	15.3	12.4	109,740		15.3	12.4	109,740		15.3	109,740	
島根銀行	4.5	4.2	2,100		1,854.4	1,944.5	4,039,698		みずほリース	22.6	20	68,700		22.6	20	68,700		22.6	68,700	
じもとホールディングス	10.8	7.9	3,365		4.3	4.1	2,964		東京センチュリー	28.1	25.1	114,707		28.1	25.1	114,707		28.1	114,707	
めがきホールディングス	751.7	666.7	225,344		168.7	148.5	130,086		日本証券金融	57.1	54	56,106		57.1	54	56,106		57.1	56,106	
東京ちほいホールディングス	18.3	17.2	48,968		4.9	3.7	5,180		アイフル	24.3	22.6	86,814		24.3	22.6	86,814		24.3	86,814	
九州フィナンシャルグループ	296.3	236.8	112,480		10.9	8.9	31,194		リコーリース	12.8	12.7	48,768		12.8	12.7	48,768		12.8	48,768	
ゆうちょ銀行	342.8	382.9	443,398		218.8	204.1	56,535		イオンフィナンシャルサービス	78.8	77.1	100,384		78.8	77.1	100,384		78.8	100,384	
富山第一銀行	35.7	33.4	20,340		5.3	—	—		アコム	286	240.2	77,344		286	240.2	77,344		286	77,344	
コンコルド・フィナンシャルグループ	828	740.9	419,349		3.6	3.5	4,312		ジャックス	16.1	14.3	59,416		16.1	14.3	59,416		16.1	59,416	
西武ホールディングス	94.6	85	90,015		20.5	18.1	16,851		オリエンタルレゾナンス	391.5	35.1	40,540		391.5	35.1	40,540		391.5	40,540	
三十三フィナンシャルグループ	13.7	12.1	20,073		5.7	4	4,300		オリックス	880.3	899.2	2,098,283								

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	評価額	株	数	評価額		株	数	評価額	株	数	評価額		株	数	評価額	株	数	評価額
Gunosy	千株	8.8	千円	千株	11.1	7,070	船場	千株	1.7	千円	千株	1.5	1,051	燐ホールディングス	千株	6.3	千円	千株	6	11,550
デザインワン・ジャパン	3.6	3.7	706	3.7	3.7	706	ジェロエシペーター・ビジネス・ホールディングス	44.5	50	90,600	スバル興業	0.7	0.6	5,382	スバル興業	0.7	0.6	5,382		
イー・ガーディアン	5.6	5.3	13,085	5.3	5.3	13,085	フルテック	2.2	1.7	1,849	東京テアトル	5.4	4.6	5,170	東京テアトル	5.4	4.6	5,170		
リブセンス	8.7	5.8	1,954	5.8	5.8	1,954	グリーンズ	5.3	4.2	5,006	タナバコンサルティンググループ	4.8	5	3,355	タナバコンサルティンググループ	4.8	5	3,355		
ジャパンマテリアル	43.2	42.9	101,415	42.9	42.9	101,415	ツナググループ・ホールディングス	3.4	3.5	1,834	ナガワ	4.6	3.7	28,083	ナガワ	4.6	3.7	28,083		
ベクトル	19.7	22	27,346	22	22	27,346	GAMEWITH	4.3	3.7	1,232	東京都競馬	10.7	11.8	45,607	東京都競馬	10.7	11.8	45,607		
ウチヤマホールディングス	7.4	5.6	1,495	5.6	5.6	1,495	ソウルドアウト	3.5	-	-	常磐興産	5.4	4.3	5,293	常磐興産	5.4	4.3	5,293		
チャーム・コア・コーポレーション	10.6	11.7	13,197	11.7	11.7	13,197	MS&Consulting	2.4	1.4	838	カナモト	24.8	25.7	56,437	カナモト	24.8	25.7	56,437		
キャリアリンク	5.1	5.2	13,639	5.2	5.2	13,639	ウェルビー	9.1	10.3	6,550	西尾レントオール	12.9	13	38,844	西尾レントオール	12.9	13	38,844		
IBJ	11.5	8.6	8,858	8.6	8.6	8,858	エル・ディー・エス	1.8	1.9	5,441	アゴラ ホスピタリティ グループ	75.2	70.2	1,544	アゴラ ホスピタリティ グループ	75.2	70.2	1,544		
アサンテ	6.4	7	11,585	7	7	11,585	ミダックホールディングス	6.2	8.6	25,404	トランス・コスモス	17.9	17.4	57,594	トランス・コスモス	17.9	17.4	57,594		
バリューHR	5.6	12.3	20,688	12.3	12.3	20,688	日総工産	11	10.5	6,478	乃村工務社	60.2	61.2	56,059	乃村工務社	60.2	61.2	56,059		
M&Aキャピタルパートナーズ	11.6	13	50,570	13	13	50,570	キュービネットホールディングス	6.6	6.6	9,840	藤田観光	6.2	6.2	20,925	藤田観光	6.2	6.2	20,925		
ライオンエクスプレスホールディングス	5.4	5.1	5,477	5.1	5.1	5,477	RPAホールディングス	19.7	19	6,213	KNT-CTホールディングス	8.7	8.4	14,338	KNT-CTホールディングス	8.7	8.4	14,338		
ERIホールディングス	4	3.2	4,457	3.2	3.2	4,457	スプリックス	4	4.3	3,792	日本管財	15.1	14.8	37,000	日本管財	15.1	14.8	37,000		
アビスト	2.2	2	5,992	2	2	5,992	マネジメントソリューションズ	6.9	7.7	27,373	トーカイ	12.5	12.5	23,812	トーカイ	12.5	12.5	23,812		
シグマックス・ホールディングス	8.6	21.3	24,047	21.3	21.3	24,047	プロレド・パートナーズ	3	3.3	1,709	白洋舎	1.7	1.1	1,900	白洋舎	1.7	1.1	1,900		
ウィルグループ	10.4	11.7	14,098	11.7	11.7	14,098	and factory	3.3	3.6	1,299	セコム	138.5	142.9	1,088,183	セコム	138.5	142.9	1,088,183		
エスコロ・エージェンツ・ジャパン	18.9	13.5	2,038	13.5	13.5	2,038	テノ・ホールディングス	2	1.5	1,408	セントラル警備保障	6.8	7.5	19,110	セントラル警備保障	6.8	7.5	19,110		
メドピア	10.9	11	16,929	11	11	16,929	フロンティア・マネジメント	3.6	4.7	6,913	丹青社	28.7	27	19,089	丹青社	28.7	27	19,089		
レアジョブ	2.8	2.4	2,220	2.4	2.4	2,220	ピアラ	2.3	2	1,112	メイテック	17	55.9	136,507	メイテック	17	55.9	136,507		
リクルートホールディングス	1,083.7	1,039	4,509,260	1,039	1,039	4,509,260	コプロ・ホールディングス	2.9	2.1	2,520	応用地質	16	13.1	25,715	応用地質	16	13.1	25,715		
エラン	19.4	18.6	18,451	18.6	18.6	18,451	ギークス	2.6	1.8	1,760	船井総研ホールディングス	28.8	29.5	79,709	船井総研ホールディングス	28.8	29.5	79,709		
土木管理総合試験所	6.9	5.3	1,611	5.3	5.3	1,611	カーパスホールディングス	38.7	43.1	34,480	進学会ホールディングス	5.1	4.2	1,251	進学会ホールディングス	5.1	4.2	1,251		
ネットマーケティング	6.9	-	-	-	-	-	フォーラムエンジニアリング	9.9	8.3	7,403	オオバ	10.2	7.9	5,609	オオバ	10.2	7.9	5,609		
日本郵政	1,834.3	1,839.2	2,094,848	1,839.2	1,839.2	2,094,848	FAST FITNESS JAPAN	2	4.7	5,654	いであ	3.9	2.8	4,396	いであ	3.9	2.8	4,396		
ベルシティ24ホールディングス	20.1	18.8	28,294	18.8	18.8	28,294	ダイレクトマーケティングミックス	15.2	16.8	27,367	学究社	4.7	5.6	10,746	学究社	4.7	5.6	10,746		
鎌倉新書	16	15.9	17,108	15.9	15.9	17,108	ポピンズ	3.4	2.1	4,321	ベネッセホールディングス	46.8	52.3	100,939	ベネッセホールディングス	46.8	52.3	100,939		
S MN	3.4	3.2	1,484	3.2	3.2	1,484	L I T A L I C O	11.5	10.9	29,299	イオンディライト	17.3	15.5	46,329	イオンディライト	17.3	15.5	46,329		
一蔵	2.3	1.5	693	1.5	1.5	693	アドバンテッジリス・マネジメント	7.2	5.7	2,650	ナック	7.4	6.5	6,253	ナック	7.4	6.5	6,253		
グローバルキッズCOMPANY	2.7	1.9	1,520	1.9	1.9	1,520	リロググループ	76.9	78.1	167,212	ダイセキ	26	28.7	122,118	ダイセキ	26	28.7	122,118		
エアトリ	9	9.1	23,423	9.1	9.1	23,423	東祥	10.6	9.8	11,485	ステップ	5.3	5.8	10,300	ステップ	5.3	5.8	10,300		
アトラエ	9.8	11	14,190	11	11	14,190	ビーウィズ	-	2.7	3,958	合計	株数・金額	1,161,644	159,799.8	389,230,950	株数・金額	1,161,644	159,799.8	389,230,950	
ストライク	5.3	6.9	27,841	6.9	6.9	27,841	TREホールディングス	19.4	29.5	41,860	銘柄数<比率>	2,174銘柄	2,161銘柄	<98.0%>	銘柄数<比率>	2,174銘柄	2,161銘柄	<98.0%>		
ソラスト	34.5	38.7	26,122	38.7	38.7	26,122	人・夢・技術グループ	5.6	6.3	8,782	(注1)	銘柄欄の () 内は、期末の国内株式評				価総額に対する各業種の比率です。				
セラク	4.6	5	7,690	5	5	7,690	大栄環境	-	26.7	43,627	(注2)	合計欄の< >内は、期末の純資産総額に				対する評価額の比率です。				
インソース	13.7	34.8	50,251	34.8	34.8	50,251	エイチ・アイ・エス	31.3	36.7	75,785	(注3)	評価額の単位未満は切捨ててあります。								
ベイカレント・コンサルティング	9.9	111	609,390	111	111	609,390	ラックランド	4.1	4.4	12,817										
Orchestra Holdings	2.8	3	5,925	3	3	5,925	共立メンテナンス	25	24	136,320										
アイモバイル	4	7.3	9,373	7.3	7.3	9,373	イチネンホールディングス	14.6	15	19,185										
キャリアインデックス	4.8	4.2	1,360	4.2	4.2	1,360	建設技術研究所	8.5	7.2	23,724										
MS - Japan	5.7	4.1	4,382	4.1	4.1	4,382	スペース	10.4	10	9,340										

(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 7,621		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 389,230,950		% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,041,935		2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	397,272,885		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

(2023年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	397,272,885,824円
一 般 株 式	7,105,053,675
株 式 (評 価 額)	389,230,950,760
未 収 入 当 金	279,324,650
未 収 配 当 金	620,986,739
未 収 入 委 託 証 拠 金	36,570,000
(B) 負 債	289,963,000
未 払 解 約 金	289,963,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	396,982,922,824
元 本	117,622,712,134
次 期 繰 越 損 益	279,360,210,690
(D) 受 取 益 当 利 権 総 額 (C / D)	117,622,712,134円
1 万 円 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	33,751円

(注1) 期首元本額	124,570,625,521円
追加設定元本額	128,363,975,255円
一部解約元本額	135,311,888,642円
(注2) 期末における元本の内訳	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOP1Xオープン	2,645,423,721円
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	4,020,227,881円
One DC 国内株式インデックスファンド	24,845,344,460円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,943,887,105円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,060,345円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	14,320,221円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	40,143,190円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,541,745円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	24,853,218円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,002,416円
たわらノーロード TOP1X	1,674,620,773円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,460,942,246円
たわらノーロード バランス (堅実型)	52,176,853円
たわらノーロード バランス (標準型)	349,503,344円
たわらノーロード バランス (積極型)	550,702,894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)	2,858,868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)	171,426,417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)	431,690,813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)	329,347,990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)	441,937,258円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	413,659円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,761,301円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	32,921,123円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,228,726円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,768,526円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,601,320,487円
Oneグローバルバランス	9,945,679円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,069,194,980円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,604,894,445円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,977,108,233円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	337,230,087円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,073,452,202円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,128,991,784円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	305,935,932円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	356,000,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	576,024,312円
投資のソムリエ	6,962,375,127円
フルコンポートロール	371,076,985円
投資のソムリエ<DC年金>	512,324,687円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	369,360,628円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	886,808,363円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	690,449,672円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,925,993,896円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	57,858,403円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	29,095,833円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,863,216円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	100,473,453円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	494,603,718円
リスクコントロール世界分散ファンド	556,231,620円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	276,065,472円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,963,704円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	31,180,825円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	19,176,919円
4資産分散投資・ドルクラス<DC年金>	373,583,154円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	4,139,504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]	70,190,490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]	71,566,262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]	23,234,424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]	43,811,639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]	69,167,191円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 [適格機関投資家限定]	173,752,833円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	194,219,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 [適格機関投資家限定]	62,459,767円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 22-05	198,034,533円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産投) 22-10	500,445,393円
投資のソムリエ 私募 [適格機関投資家限定]	188,318,998円
AMOneマルチアセット・インカム戦略 [適格機関投資家限定]	27,824,141円
DIAMグローバル・バランス25VA [適格機関投資家限定]	29,351,203円
日本経済発展戦略ファンド (インカム重視) (毎月リターン) [適格機関投資家限定]	230,704,117円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (毎月リターン) [適格機関投資家限定]	119,336,352円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF) [適格機関投資家専用]	3,665,294円
しあわせの一步 私募 [適格機関投資家限定]	7,940,239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]	45,113,121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]	88,905,582円
DIAM国際分散バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	3,022,472円
DIAM国際分散バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	18,327,200円
DIAM国内重視バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	4,076,223円
DIAM国内重視バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	90,458円
DIAM世界バランスファンド40VA [適格機関投資家限定]	5,854,508円
DIAM世界バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	26,240,499円
DIAMバランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	416,572,017円
DIAMバランスファンド37.5VA [適格機関投資家限定]	515,249,605円
DIAMバランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	1,525,175,305円
DIAMグローバル・セット・バランスVA [適格機関投資家限定]	15,914,184円
DIAMグローバル・セット・バランスVA2 [適格機関投資家限定]	21,162,392円
DIAM 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]	223,693,267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]	49,325,464円
DIAM世界バランスファンド55VA [適格機関投資家限定]	65,368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]	274,002,585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]	16,040,531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]	53,951,794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]	122,912,087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]	171,605,339円
DIAM世界バランス25VA [適格機関投資家限定]	31,023,888円
DIAM国内バランス30VA [適格機関投資家限定]	15,258,914円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	743,503,325円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	1,220,307,862円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
MHAMトピックスファンド	770,553,770円
MHAM TOP1XファンドVA [適格機関投資家専用]	50,331,323円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,300,674,671円
MHAM日本株式バッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,491,222,882円
期末元本合計	117,622,712,134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2022年2月8日 至2023年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,038,422,831円	
	受取配当金	10,036,451,031	
	受取利息	198,966	
	その他の収益	5,808,781	
	支払利息	△4,035,947	
(B)	有価証券売買損益	4,151,090,178	
	売買益	35,089,806,650	
	売買損	△30,938,716,472	
(C)	先物取引等取引損益	827,282,850	
	取引益	2,648,479,200	
	取引損	△1,821,196,350	
(D)	その他費用	△4	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	15,016,795,855	
(F)	前期繰越損益金	272,765,989,933	
(G)	解約差損益金	△292,592,755,843	
(H)	追加信託差損益金	284,170,180,745	
(I)	合計(E+F+G+H)	279,360,210,690	
	次期繰越損益金(I)	279,360,210,690	

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

(注2) (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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

■東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4日)

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20期（決算日 2023年2月14日）

（計算期間 2022年2月15日～2023年2月14日）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第20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	期中 騰落率				
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	ポイント 386.15	% 1.5	% 99.3	% -	% -	百万円 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
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	-	-	553,303
20期 (2023年2月14日)	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	-	-	554,514

(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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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）。

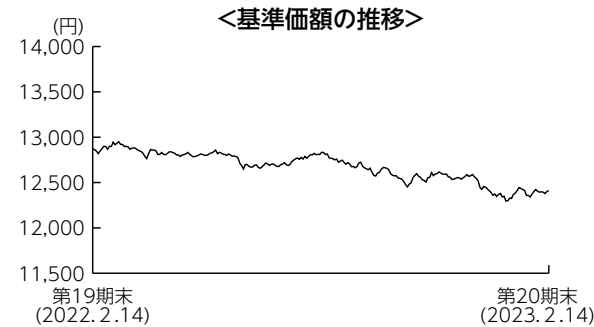
■当期中の基準価額と市況の推移

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)比	債券先物率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期 首) 2022年 2月14日	円 12,872	% -	ポイント 381.31	% -	% 99.6	% -	% -
2 月 末	12,900	0.2	382.13	0.2	99.8	-	-
3 月 末	12,864	△0.1	381.04	△0.1	99.6	-	-
4 月 末	12,832	△0.3	380.12	△0.3	99.2	-	-
5 月 末	12,812	△0.5	379.54	△0.5	86.5	-	-
6 月 末	12,694	△1.4	376.08	△1.4	99.6	-	-
7 月 末	12,777	△0.7	378.55	△0.7	99.3	-	-
8 月 末	12,747	△1.0	377.67	△1.0	99.4	-	-
9 月 末	12,612	△2.0	373.60	△2.0	103.4	-	-
10 月 末	12,598	△2.1	373.25	△2.1	99.4	-	-
11 月 末	12,538	△2.6	371.33	△2.6	99.6	-	-
12 月 末	12,374	△3.9	366.60	△3.9	99.6	-	-
2023年 1 月 末	12,341	△4.1	365.59	△4.1	99.4	-	-
(期 末) 2023年 2月14日	12,411	△3.6	367.66	△3.6	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（2022年2月15日から2023年2月14日まで）

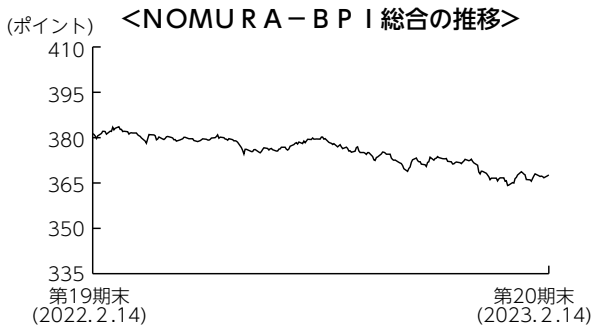


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,411円となり、前期末比で3.6%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。期初から2022年12月中旬にかけては、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢などを背景に基準価額は下落基調となりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行が長期金利の変動幅を従来の±0.25%から±0.5%に拡大したことなどから基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2022年12月中旬にかけては、ウクライナ情勢を巡る不透明感などが意識された一方、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢が観測されたことなどを背景に、利回りは横ばいとなりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行が長期金利の変動幅を従来の±0.25%から±0.5%に拡大したことなどから利回りは上昇しました。

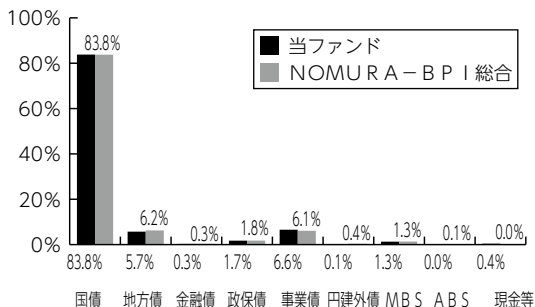
ポートフォリオについて

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。

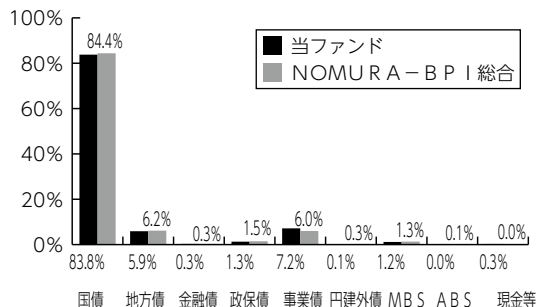
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

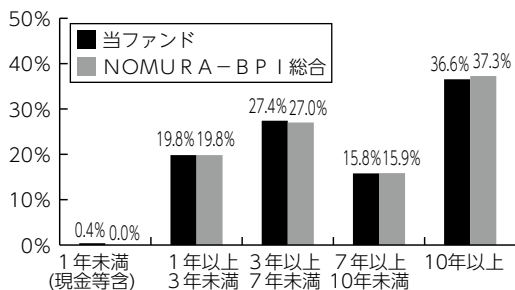


期末

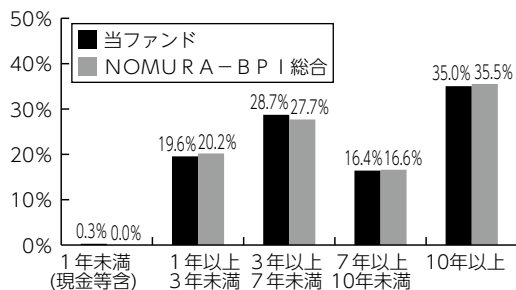


○残存年限別構成比

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3.6%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

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は12,671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 (2022年2月15日から2023年2月14日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	1,481,029,349	1,452,519,943 (-)
	地 方 債 証 券	6,447,190	4,140,237 (-)
	特 殊 債 券	7,637,720	3,833,526 (369,528)
	社 債 券	3,368,168	4,648,915 (-)

(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 (2022年2月15日から2023年2月14日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	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 1,498,482	百万円 96,387	% 6.4	百万円 1,465,142	百万円 110,127	% 7.5
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

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、みずほ信託銀行です。

■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	469,265,000	464,530,535	83.8	—	52.3	20.8	10.7
地 方 債 証 券	32,839,330	32,767,927	5.9	4.9	3.9	1.4	0.5
特 殊 債 証 券	28,478,559	28,511,051	5.1	—	3.4	1.6	0.1
金 融 債 証 券	1,700,000	1,693,591	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 証 券	26,381,000	25,503,782	4.6	0.1	2.2	2.1	0.3
合 計	558,663,889	553,006,886	99.7	5.0	61.8	26.2	11.7

(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	
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,555,406	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	50,000	51,088	2024/03/20
4 3 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,720,000	3,724,166	2024/04/01
4 3 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	6,100,000	6,107,320	2024/05/01
4 3 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,850,000	3,854,966	2024/06/01
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	6,990,000	7,007,824	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	4,420,000	4,460,973	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	50,000	51,673	2024/06/20
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	40,000	41,230	2024/06/20
4 3 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,800,000	3,804,940	2024/07/01
4 3 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,300,000	1,301,703	2024/08/01
4 4 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,700,000	1,702,363	2024/09/01
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,810,000	2,818,064	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	4,610,000	4,652,688	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	460,000	476,008	2024/09/20
4 4 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,100,000	1,101,518	2024/10/01
4 4 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,500,000	1,502,175	2024/11/01
4 4 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,500,000	2,503,800	2024/12/01
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,930,000	2,939,463	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	3,000,000	3,031,830	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,900,000	1,913,148	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	380,000	394,557	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	41,606	2024/12/20
4 4 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,100,000	3,104,650	2025/01/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,100,000	3,110,354	2025/03/20

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	
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	5,430,000	5,482,236	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	180,000	188,136	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	70,000	72,871	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	41,724	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,900,000	5,920,060	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	5,980,000	6,043,089	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	250,000	261,400	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	50,000	52,397	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	90,000	94,526	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,650,000	2,658,930	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,073,926	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	400,000	421,080	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	147,742	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,900,000	2,909,889	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	4,420,000	4,460,222	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	70,000	74,222	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	170,000	179,769	2025/12/20
1 4 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	4,250,000	4,251,275	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,520,000	4,534,644	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	590,000	628,385	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	120,000	128,548	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	120,000	128,178	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	3,310,000	3,309,437	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,690,000	4,704,070	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	590,000	635,140	2026/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
89回 利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	10,731	2026/06/20
149回 利付国庫債券(5年)	0.0050	5,010,000	5,003,687	2026/09/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,570,000	5,581,975	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	470,000	506,439	2026/09/20
91回 利付国庫債券(20年)	2.3000	110,000	118,922	2026/09/20
150回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,720,000	4,708,200	2026/12/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	6,080,000	6,086,992	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,160,000	1,250,271	2026/12/20
151回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,200,000	4,182,864	2027/03/20
152回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,030,000	1,029,783	2027/03/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,690,000	4,689,015	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	370,000	398,638	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	670,000	724,584	2027/03/20
153回 利付国庫債券(5年)	0.0050	5,310,000	5,280,157	2027/06/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,130,000	5,122,202	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	601,535	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	130,207	2027/06/20
154回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,300,000	4,287,229	2027/09/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,970,000	4,955,239	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	721,406	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	174,156	2027/09/20
155回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,300,000	1,306,851	2027/12/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,250,000	4,231,640	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	818,947	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,860,000	5,826,012	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	913,415	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	255,433	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,020,000	4,981,597	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	557,115	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	177,432	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	120,824	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,260,000	4,220,083	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	705,126	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	553,640	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,510,000	4,459,442	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	662,784	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	754,266	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,200,000	4,144,770	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	383,379	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	487,220	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,630,000	3,575,876	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	513,755	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	821,881	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,500,000	4,424,625	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	127,494	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,370,000	1,525,508	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,720,000	3,649,282	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	410,000	457,646	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	404,240	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	113,955	2030/02/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,750,000	3,676,200	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	597,214	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,070,000	1,198,303	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,952,629	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	618,336	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	516,746	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	670,000	727,084	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,200,000	5,060,744	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	640,000	708,665	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	626,965	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	236,836	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,620,000	4,482,185	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,050,000	1,179,916	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	669,696	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,360,000	5,189,230	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	680,634	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	570,368	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	599,713	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,899,698	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	370,000	411,810	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,400,000	5,211,270	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	1,007,897	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	232,188	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,330,000	4,176,198	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	830,000	914,352	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,030,000	1,143,403	2031/12/20
366回 利付国庫債券(10年)	0.2000	2,780,000	2,707,469	2032/03/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	1,000,422	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,840,000	2,028,452	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	360,000	393,746	2032/03/20
367回 利付国庫債券(10年)	0.2000	3,000,000	2,959,290	2032/06/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,880,000	2,075,783	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,020,000	1,107,577	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	900,000	985,716	2032/06/20
368回 利付国庫債券(10年)	0.2000	3,750,000	3,742,950	2032/09/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,450,000	1,601,235	2032/09/20
369回 利付国庫債券(10年)	0.5000	1,400,000	1,400,000	2032/12/20
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,060,000	1,170,547	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,530,000	1,703,808	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,730,000	1,893,692	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,450,000	1,573,409	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	276,240	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,850,000	3,149,136	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	263,446	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,340,000	2,584,810	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	170,340	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,890,000	3,161,688	2033/12/20
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	400,720	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,060,000	2,230,732	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	309,501	2034/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,640,000	2,855,925	2034/06/20
160回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	286,020	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,700,000	2,888,730	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	318,978	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,660,000	2,782,626	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	468,468	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,548,994	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	328,101	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,700,000	2,848,446	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	394,864	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,530,000	2,635,222	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	363,732	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,680,000	2,721,808	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	347,594	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,240,000	2,103,897	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	419,706	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,060,000	1,875,918	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	470,000	564,159	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,480,000	2,344,220	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	388,063	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,460,000	2,350,333	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	737,211	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	2,380,000	2,297,485	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,410,000	2,287,644	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	746,039	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,170,000	2,051,604	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,240,000	2,110,528	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	926,902	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,540,000	2,348,839	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,130,000	1,960,941	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,022,419	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,680,000	1,588,423	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,850,000	1,688,828	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,032,829	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,890,000	1,690,642	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	2,060,000	1,804,209	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	834,062	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,700,000	1,482,111	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,940,000	1,683,551	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,137,451	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,480,000	1,301,008	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,220,000	1,942,722	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,326,768	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,170,000	1,890,330	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,330,000	2,058,508	2040/12/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,385,568	2041/03/20
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	1,848,525	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,050,000	1,764,968	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,640,047	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,400,000	2,099,904	2041/09/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,150,000	1,875,466	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,540,222	2042/03/20
180回 利付国庫債券(20年)	0.8000	1,740,000	1,602,035	2042/03/20
181回 利付国庫債券(20年)	0.9000	2,000,000	1,872,000	2042/06/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,660,000	1,837,055	2042/09/20
182回 利付国庫債券(20年)	1.1000	1,980,000	1,916,659	2042/09/20
183回 利付国庫債券(20年)	1.4000	800,000	814,544	2042/12/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,685,532	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,300,000	1,435,876	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,130,000	1,227,637	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,270,000	1,356,639	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,420,000	1,515,267	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,350,000	1,440,207	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,500,000	1,598,460	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,570,000	1,612,437	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,714,071	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,560,000	1,629,732	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,480,000	1,487,651	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,490,000	1,495,170	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,460,000	1,290,245	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,390,000	1,087,508	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,430,000	1,171,599	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,460,000	1,221,713	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,269,257	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,120,000	977,580	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,360,000	1,183,635	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,430,000	1,242,083	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	132,266	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,540,000	1,333,747	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,220,000	1,027,569	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,300,000	1,147,250	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	954,145	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	730,497	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,120,000	886,692	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,410,000	1,081,399	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,030,000	786,930	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	950,000	724,356	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	626,691	2050/03/20
66回 利付国庫債券(30年)	0.4000	990,000	751,974	2050/03/20
67回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,570,000	1,257,020	2050/06/20
68回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,470,000	1,175,103	2050/09/20
69回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,530,000	1,256,283	2050/12/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	836,971	2051/03/20
70回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,410,000	1,155,100	2051/03/20
71回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,400,000	1,145,368	2051/06/20
72回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,490,000	1,222,112	2051/09/20
73回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,490,000	1,220,518	2051/12/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	710,000	798,054	2052/03/20
74回 利付国庫債券(30年)	1.0000	1,520,000	1,349,668	2052/03/20
75回 利付国庫債券(30年)	1.3000	1,620,000	1,550,809	2052/06/20

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	
76回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,520,000	1,488,840	2052/09/20
77回 利付国庫債券(30年)	1.6000	600,000	614,268	2052/12/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	1,040,000	1,139,236	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	1,210,000	1,266,676	2054/03/20
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	1,190,000	1,156,703	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	1,950,000	1,386,723	2056/03/20
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	1,970,000	1,649,421	2057/03/20
11回 利付国庫債券(40年)	0.8000	1,380,000	1,113,135	2058/03/20
12回 利付国庫債券(40年)	0.5000	1,440,000	1,034,971	2059/03/20
13回 利付国庫債券(40年)	0.5000	2,070,000	1,483,010	2060/03/20
14回 利付国庫債券(40年)	0.7000	2,050,000	1,566,979	2061/03/20
15回 利付国庫債券(40年)	1.0000	1,540,000	1,280,818	2062/03/20
小 計	-	469,265,000	464,530,535	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	302,097	2024/06/20
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	100,684	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	304,362	2024/06/26
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	100,808	2024/07/18
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	403,328	2024/07/29
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	454,014	2024/09/20
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	100,782	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	100,827	2024/09/30
26年度1回 静岡県公募公債	0.5150	100,000	100,835	2024/11/25
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	352,779	2024/12/19
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	100,755	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,545	2025/01/23
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	502,825	2025/01/24
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	100,754	2025/02/25
26年度17回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	201,636	2025/02/26
5回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	104,277	2025/03/19
213回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	100,987	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	403,400	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	606,564	2025/05/23
27年度4回 千葉県公募公債	0.6020	200,000	202,546	2025/07/25
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	505,765	2025/07/25
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	105,371	2025/09/19
1回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	105,410	2025/09/19
150回 共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	303,279	2025/09/25
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,029	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,038	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	99,922	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,827	2026/04/24
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	215,374	2026/06/19
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,564	2026/06/25
160回 共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	498,370	2026/07/24
1回 兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	210,406	2026/07/29
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	99,665	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	99,589	2026/09/18
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	323,247	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	108,373	2026/09/18

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	
413回 大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,389	2026/10/28
190回 大阪府公募公債 5年	0.0010	300,000	297,654	2026/12/25
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	499,510	2027/01/25
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	0.0010	300,000	297,540	2027/01/28
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,079	2027/02/24
169回 共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	499,270	2027/04/23
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	99,775	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	104,939	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	101,854	2027/07/07
173回 共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,836	2027/08/25
29年度4回 大阪府公募公債	0.1500	200,000	198,728	2027/09/21
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,340	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	104,808	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,547	2028/01/25
179回 共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,495	2028/02/25
29年度6回 広島市公募公債	0.2300	300,000	298,347	2028/02/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	108,536	2028/03/16
5回 兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	314,676	2028/05/26
783回 東京都公募公債	0.2200	110,000	109,105	2028/06/20
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	105,053	2028/06/23
30年度8回 北海道公募公債	0.2490	400,000	396,400	2028/08/31
30年度7回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	297,438	2028/09/20
第91回 川崎市公募公債	0.1850	200,000	197,536	2028/09/20
7回 静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	331,548	2028/09/21
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	99,144	2028/09/25
30年度3回 堺市公募公債	0.1950	100,000	98,576	2028/12/19
237回 神奈川県公募公債	0.1350	200,000	196,578	2028/12/20
20回 2号 福岡県公募公債	2.0500	100,000	109,208	2028/12/20
6回 大阪府公募公債 20年	2.2100	200,000	220,240	2028/12/20
17回 横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	109,322	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	109,031	2028/12/20
30年度6回 福岡県公募公債	0.2000	200,000	197,318	2028/12/21
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,714	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	400,000	394,280	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	110,361	2029/03/19
30年度19回 愛知県公募公債	0.1150	200,000	195,720	2029/03/28
30年度3回 岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	196,134	2029/03/29
194回 共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	293,058	2029/05/25
6回 川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	221,006	2029/05/25
令和元年度1回 福岡県公募公債	0.0290	200,000	194,264	2029/06/21
9回 兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	103,236	2029/07/13
11回 神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	109,884	2029/07/20
196回 共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	486,175	2029/07/25
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	193,754	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	193,944	2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	387,512	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	193,738	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	110,892	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	194,190	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	194,434	2030/01/30

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	
21年度2回 福岡県公債券(20年)	2.2300	100,000	111,371	2030/02/22
2030回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	96,840	2030/02/25
802回 東京都公債券	0.1300	400,000	388,276	2030/03/19
511回 名古屋市公債券 10年	0.0750	200,000	193,306	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公債券	0.1350	400,000	388,048	2030/04/12
令和2年 2回 大阪市公債券	0.1310	300,000	290,415	2030/05/22
9回 埼玉県公債券 20年	2.1500	100,000	111,028	2030/05/24
8回 静岡県公債券 15年	0.8280	200,000	203,408	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公債券	0.1350	100,000	96,268	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公債券	0.1350	100,000	96,142	2030/10/23
36回2号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	240,335	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公債券	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公債券	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27
22年度14回 愛知県公債券	2.0870	300,000	331,965	2030/12/13
9回 京都市公債券 20年	2.1430	200,000	222,170	2030/12/17
813回 東京都公債券	0.1790	300,000	288,789	2030/12/20
16回 神奈川県公債券 20年	2.0900	300,000	332,343	2031/01/24
464回 大阪府公債券 10年	0.0720	200,000	190,528	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公債券	0.1450	100,000	95,702	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公債券	0.2140	200,000	192,564	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公債券	0.2140	200,000	192,474	2031/03/19
251回 神奈川県公債券 10年	0.1990	200,000	192,242	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公債券	0.1400	200,000	191,338	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公債券 10年	0.1900	200,000	192,040	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公債券	0.1750	100,000	95,856	2031/04/25
467回 大阪府公債券 10年	0.1640	200,000	191,388	2031/04/28
469回 大阪府公債券 10年	0.1280	200,000	190,590	2031/06/27
11回 九州市公債券 20年	2.0190	300,000	331,587	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公債券	0.1050	200,000	189,864	2031/09/25
472回 大阪府公債券 10年	0.1000	200,000	189,618	2031/09/29
474回 大阪府公債券 10年	0.1190	300,000	284,616	2031/11/28
19回 神奈川県公債券 20年	1.8180	100,000	109,234	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	479,015	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	476,525	2032/03/25
258回 神奈川県公債券 10年	0.2900	300,000	286,713	2032/06/18
24年度2回 福岡県公債券(20年)	1.6350	300,000	323,976	2032/08/16
10回 大阪府公債券 20年	1.7200	200,000	218,262	2032/09/24
24年度12回 神戸市公債券	1.7110	200,000	216,916	2032/12/17
14回 千葉県公債券 20年	1.1370	100,000	102,557	2033/04/15
13回 埼玉県公債券 20年	1.5990	100,000	107,254	2033/05/20
1回 東京都公債券 30年	2.2100	200,000	226,936	2033/06/20
14回 埼玉県公債券 20年	1.5460	300,000	320,910	2034/05/08
26年度4回 愛知県公債券 20年	1.5420	200,000	213,880	2034/05/15
29回 横浜市公債券 20年	1.5280	100,000	106,759	2034/05/26
16回 名古屋市公債券 20年	1.5200	100,000	106,642	2034/06/09
5回 群馬県公債券 20年	1.5290	100,000	106,745	2034/06/16
17回 九州市公債券 20年	1.5290	100,000	106,477	2034/06/20
31回 東京都公債券 20年	1.2380	200,000	206,890	2034/09/20
15回 埼玉県公債券 20年	1.1660	100,000	102,444	2035/02/16
2回 横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	117,335	2035/03/20

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	
18回 千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	102,000	2035/04/13
17回 名古屋市公債券 20年	1.2030	100,000	102,676	2035/05/28
13回 大阪府公債券 20年	1.2030	100,000	102,213	2035/09/28
14回 大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	93,260	2036/09/29
21回 千葉県公債券 20年	0.4240	100,000	91,920	2036/10/15
3回 神奈川県公債券 30年	2.6200	100,000	119,692	2037/03/19
29年度2回 広島市公債券	0.6160	200,000	186,502	2037/08/18
29年度5回 札幌市公債券 20年	0.5970	300,000	278,595	2037/09/18
30年度2回 仙台市公債券 20年	0.7290	100,000	93,237	2038/10/18
30年度7回 福岡市公債券	0.7010	200,000	185,616	2038/10/19
2019年度5回 福岡市公債券 20年	0.2860	100,000	85,565	2039/07/29
2回 兵庫県公債券 30年	2.3600	100,000	115,928	2040/03/19
22年度8回 福岡市公債券	2.2800	100,000	114,581	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公債券	0.4640	100,000	86,483	2040/09/21
23年度7回 札幌市公債券 30年	2.0970	100,000	111,561	2041/09/20
5回 川崎市公債券 30年	2.0970	100,000	111,758	2042/03/20
24年度12回 愛知県公債券 30年	2.1200	100,000	112,081	2042/09/19
14回 東京都公債券 30年	2.0500	100,000	110,745	2043/06/19
27年度8回 愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	152,100	2045/06/20
27年度 2回 広島県公債券 30年	0.7110	100,000	84,226	2046/03/22
6回 埼玉県公債券 30年	0.9570	200,000	176,576	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公債券	0.3690	300,000	219,747	2049/06/18
令和元年3回 福岡県公債券 30年	0.4320	200,000	149,236	2049/06/18
令和元年度1回 鳥取県公債券	0.2900	200,000	179,728	2049/09/17
5回 京都市公債券 30年定時償還	0.2900	200,000	178,096	2049/09/17
12回 埼玉県公債券 30年	0.4740	300,000	225,567	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市公債券 30年	0.7130	200,000	158,462	2051/06/20
小 計	-	32,839,330	32,767,927	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	100,856	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	201,760	2024/06/28
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	302,556	2024/09/13
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	100,695	2024/09/20
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	100,810	2024/11/27
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	100,893	2025/03/17
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	504,500	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,790	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	417,968	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,197	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,001	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,780	2025/09/19
85回 中国日本高速道路債券	0.0700	300,000	298,959	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,007	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	105,523	2025/12/19
61回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	104,787	2025/12/19
F538回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	498,430	2025/12/25
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,825	2026/03/13
33回 政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	299,490	2026/03/16
87回 中国日本高速道路債券	0.0600	400,000	397,488	2026/03/18
11回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	107,368	2026/03/20

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	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	299,439	2026/03/31
187回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,731	2026/04/20
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	399,108	2026/04/28
80回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	104,878	2026/09/18
321回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165	2026/09/18
325回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165	2026/09/18
79回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	314,238	2026/11/06
91回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,753	2026/12/14
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	99,783	2027/01/29
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	208,092	2027/03/19
718回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	298,890	2027/04/13
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	797,992	2027/04/30
96回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,570	2027/05/28
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	197,442	2027/06/18
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,715	2027/07/16
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,405	2027/11/19
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	99,450	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	104,912	2027/12/20
77回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	294,948	2027/12/20
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	297,546	2028/02/18
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	99,189	2028/10/16
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	207,186	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	217,836	2028/12/20
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	103,257	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	331,575	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	332,127	2029/08/28
12回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,952	2029/09/20
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	219,880	2029/09/20
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	110,813	2029/12/28
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	101,051	2030/05/28
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,616	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	217,810	2030/10/29
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	545,880	2030/10/31
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	110,778	2031/01/28
90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	191,122	2031/05/30
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	386,540	2031/06/13
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	109,804	2031/09/19
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	110,088	2031/12/26
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	218,006	2031/12/26
156回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	381,724	2032/04/14
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	108,206	2032/07/28
115回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	109,974	2032/09/14
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	109,201	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	217,854	2032/09/28
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	105,581	2033/04/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	592,695	2033/12/20
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	106,286	2034/03/17
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	106,670	2034/04/28
39回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	524,325	2034/09/28
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	300,312	2035/01/26

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	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	308,823	2035/02/28
159回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	101,042	2035/05/18
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	102,964	2035/06/20
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	206,116	2035/06/28
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	104,095	2035/06/29
第262回 政保道路債	1.1090	500,000	509,045	2035/11/30
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,758	2036/06/20
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,470	2036/08/29
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,733	2037/04/28
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	188,402	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	237,358	2037/09/18
2回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2700	29,481	29,564	2037/11/10
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,927	2038/01/29
233回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	91,085	2038/04/20
F174回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	327,294	2038/05/28
210回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,875	2038/09/17
50回 高速道路機構債	0.5000	300,000	265,596	2039/03/18
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	250,305	2039/09/28
125回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	425,180	2040/04/24
288回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	303,009	2040/07/27
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	107,738	2040/08/31
40回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	44,416	45,090	2041/03/10
43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	10,028	10,056	2041/06/10
4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,395	48,533	2041/07/10
51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	28,716	28,785	2042/02/10
4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	9,766	9,791	2042/08/10
148回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	267,802	2043/12/18
27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	16,224	16,963	2044/08/10
9回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	101,085	106,357	2044/10/10
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	153,752	160,563	2045/05/10
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	99,702	2045/06/20
38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	21,513	22,364	2045/07/10
1回 高速道路機構債	2.9900	300,000	374,067	2045/09/20
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	197,772	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	91,630	2045/12/20
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	96,646	2046/01/31
49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	18,489	19,253	2046/06/10
52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	21,674	22,467	2046/09/10
53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	22,728	23,550	2046/10/10
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	180,889	2047/03/20
60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	27,955	28,894	2047/05/10
64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	68,544	70,293	2047/09/10
36回 高速道路機構債	2.8400	300,000	367,482	2048/03/20
76回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	31,310	32,207	2048/09/10
82回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	37,252	37,929	2049/03/10
84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	37,866	38,564	2049/05/10
86回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,647	42,347	2049/07/10
90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	43,218	43,641	2049/11/10
398回 政保道路債	0.4220	300,000	225,969	2049/12/28
93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	48,571	48,186	2050/02/10

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	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	0.5170	300,000	222,036	2050/04/28
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	54,967	54,920	2050/05/10
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	77,436	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	155,190	2050/06/20
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	56,873	57,164	2050/08/10
418回 高速道路機構債	0.6300	200,000	157,672	2051/08/31
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	159,878	2051/10/31
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	213,474	206,557	2051/11/10
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,432	70,469	2052/02/10
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	72,120	70,253	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,281	70,341	2052/04/10
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	225,873	218,581	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	226,248	218,802	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	153,450	148,271	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	230,445	222,139	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	229,833	221,568	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	397,340	384,211	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	79,465	76,755	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	81,727	78,041	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	262,260	248,724	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	102,090	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	350,088	333,234	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	269,238	256,449	2055/09/10
164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,114	263,056	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	838,701	795,759	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	149,016	2061/02/28
小 計	-	28,478,559	28,511,051	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,075	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	99,912	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,144	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	298,761	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	298,617	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	298,308	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	198,774	2026/08/27
小 計	-	1,700,000	1,693,591	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	100,870	2024/04/25
2回 BPCE SA円債社債(ソシヤルボンド)	0.3670	100,000	99,582	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	100,989	2024/07/25
29回 三菱重工社債	0.6620	100,000	100,732	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,874	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	103,370	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	100,756	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	201,138	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,729	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	200,536	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	201,488	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	201,280	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	264,048	2024/12/25

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	
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,834	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,001	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,306	2025/06/11
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,249	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	312,741	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	101,459	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	208,004	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,624	2025/07/09
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	209,534	2025/09/19
27回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,188	2025/12/19
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,478	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,834	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	199,008	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,497	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,414	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	296,892	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	197,168	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,227	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,694	2026/06/03
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,250	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,038	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債(2016)	0.4000	100,000	98,180	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,437	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	297,714	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,476	2026/06/19
61回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	496,025	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,771	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	128,152	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	102,035	2026/06/25
90回 中日本高速道路債券	0.0500	200,000	198,360	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	296,802	2026/07/27
3回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	295,548	2026/09/04
91回 中日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/17
62回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,183	2026/09/18
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,106	2026/10/16
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,035	2026/10/23
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	299,208	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	199,682	2027/02/16
12回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	106,194	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	107,729	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	297,735	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	297,435	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,384	2027/05/07
3回 東レ社債	0.3750	300,000	298,701	2027/07/16
30回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	108,120	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,858	2027/09/24
25回 フランス銀行総合銀行(BF CMI)円債社債(2017)	0.5100	300,000	292,086	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,105	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	195,324	2027/10/25

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	98,587	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	297,567	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,483	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,612	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,710	2028/06/06
5 回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	98,283	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	109,267	2029/03/21
2 3 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	97,601	2029/04/12
1 4 回 プリヂストーン社債	0.3750	300,000	295,032	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,734	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	385,108	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	389,616	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	190,862	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	289,911	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	192,826	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	109,292	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	194,078	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	96,955	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	96,435	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	192,592	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	382,644	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	95,100	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	291,630	2030/07/16
3 1 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	192,492	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	192,698	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	389,456	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,766	2030/09/27
1 7 回 デイセル社債	0.5000	300,000	291,198	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	287,298	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	218,502	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	191,796	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	181,328	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	94,712	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	279,612	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	286,257	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	279,180	2031/09/19

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 3 6 回 東北電力社債	0.2900	300,000	277,605	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	470,495	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	186,218	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	188,732	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	282,738	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	189,720	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	295,416	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	94,311	2036/06/02
2 3 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	185,404	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	180,940	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	89,875	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,153	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	92,653	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	176,628	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	88,572	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	184,228	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	89,806	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,393	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,241	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	169,598	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	81,752	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	83,714	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,538	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,014	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	81,836	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	94,254	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	87,052	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	77,848	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	153,760	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	206,034	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	75,020	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	74,006	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	74,560	2060/12/17
小 計	-	26,381,000	25,503,782	-
合 計	-	558,663,889	553,006,886	-

■投資信託財産の構成

2023年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
コーポレートローン等、その他	553,006,886	99.7
投資信託財産総額	1,668,486	0.3
	554,675,373	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

(2023年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	554,675,373,305円		
コ ー ー ン 等	617,814,346		
公 社 債(評価額)	553,006,886,952		
未 収 利 息	696,325,613		
前 払 金	354,346,394		
(B) 負 債	160,658,000		
未 払 解 約 金	160,658,000		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	554,514,715,305		
元 本	446,785,885,792		
次 期 繰 越 損 益	107,728,829,513		
(D) 受 取 権 益 総 額	446,785,885,792円		
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,411円		
(注1) 期首元本額	429,840,166,151円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,242,098,929円
追加設定元本額	1,193,021,056,559円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	33,649,224円
一部解約元本額	1,176,075,336,918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)	1,918,361,466円
(注2) 期末における元本の内訳		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)	1,966,575,557円
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	25,373,106,533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)	1,522,865,115円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	57,586,017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)	1,201,586,453円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	103,700,225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)	1,897,755,847円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	66,758,277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)	4,911,402,998円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	754,422,213円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	1,872,779,890円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	180,875,125円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	1,712,179,046円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	51,325,733円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	1,920,698,394円
たわらノーロード 国内債券	17,498,683,959円	D I A M国内債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	9,123,052,184円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,806,010,006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)	2,647,924,770円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,251,955,017円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	2,161,052,848円
たわらノーロード バランス (標準型)	2,226,167,410円	AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	572,870,714円
たわらノーロード バランス (積極型)	289,053,050円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	262,362,220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)	128,198,441円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I (適格機関投資家限定)	5,397,074,453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)	1,726,237,986円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I (適格機関投資家限定)	5,408,411,752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)	1,815,055,749円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI V (適格機関投資家限定)	5,364,968,629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)	501,958,943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)	3,271,484,674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)	2,448,954円	リスクコントロール世界8資産(バランスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)	41,605,092円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	27,062,997円	AMOOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,052,664,270円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	18,479,351円	しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	74,795,895円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	155,346,253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)	146,999,752円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,911,502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)	96,492,643円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	62,284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)	19,332,957円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,797,948,481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)	72,848,637円
Oneグローバルバランス	26,722,380円	D I A M国内重視(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	27,734,823円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	9,748,438,004円	D I A M国内重視(バランスファンド)50VA (適格機関投資家限定)	327,700円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	13,721,614,185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)	23,873,600円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,826,988,427円	D I A M世界(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	107,055,264円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	2,358,619,228円	D I A M世界(バランスファンド)37.5VA (適格機関投資家限定)	3,016,439,998円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,427,324,525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)	2,100,621,220円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	411,372,305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)	4,138,221,952円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	97,387,528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)	64,082,448円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	3,564,928,239円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	143,932,786円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	13,441,521円	D I A M アクア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,815,004,927円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	4,632,204,263円	D I A M アセット(バランスファンド)4VA (適格機関投資家限定)	133,615,087円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,967,220,079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)	532,578円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	377,779,353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)	1,989,249,669円
投資のソムリエ	80,243,319,715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)	43,566,296円
グループコントロール	973,146,033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)	293,969,678円
投資のソムリエ<DC年金>	5,911,038,890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)	445,411,075円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,610,654,070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)	771,111,794円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,317,826,922円	D I A M世界(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	250,595,165円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,499,330,383円	D I A M国内(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	95,877,638円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	27,485,903,692円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	905,339,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	470,764,235円	動的パッケージファンド<DC年金>	366,377,124円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	236,380,237円	コア資産形成ファンド	245,142,281円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	45,753,552円	MH A M日本債券インデックスファンド (ファンドラップ)	46,520,562,169円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,970,386,655円	MH A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	47,766,276,797円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,435,483,967円	MH A M日本債券バッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,297,060,099円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,471,865,998円	MH A M動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,689,593,873円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,499,704,588円	期末元本合計	446,785,885,792円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	663,974,989円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	253,415,299円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	155,546,201円		

■損益の状況

当期 自2022年2月15日 至2023年2月14日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,860,461,249	円
	受取利息	3,866,858,522	
	支払利息	△6,397,273	
(B)	有価証券売買損益	△31,051,006,500	
	売却益	919,953,577	
	売却損	△31,970,960,077	
(C)	その他費用	△20	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△27,190,545,271	
(E)	前期繰越損益金	123,463,010,360	
(F)	解約差損益金	△306,962,982,017	
(G)	追加信託差損益金	318,419,346,441	
(H)	計(D+E+F+G)	107,728,829,513	
	次期繰越損益金(H)	107,728,829,513	

(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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

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21期（決算日 2023年2月15日）

（計算期間 2022年2月16日～2023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21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			
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	ポイント 1,111,144.35	% 3.8	% 95.3	% 2.0	百万円 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
20期(2022年2月15日)	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8	642,642
21期(2023年2月15日)	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4	856,221

(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

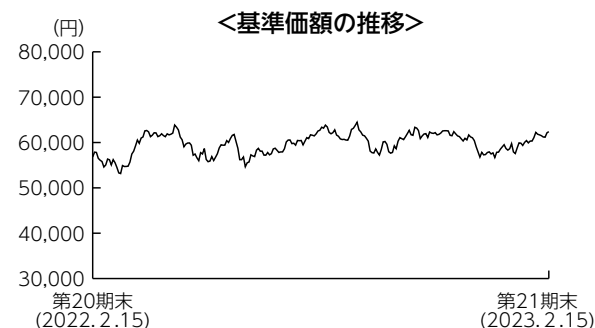
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2022年 2月 15日	56,820	% -	1,849,569.21	% -	% 93.1	% 1.8
2 月 末	56,351	△0.8	1,836,612.20	△0.7	95.5	2.0
3 月 末	62,337	9.7	2,031,374.00	9.8	95.6	2.1
4 月 末	59,665	5.0	1,943,470.47	5.1	95.3	2.2
5 月 末	59,498	4.7	1,941,169.72	5.0	94.5	3.1
6 月 末	58,103	2.3	1,895,744.26	2.5	95.7	1.9
7 月 末	60,392	6.3	1,967,771.49	6.4	95.2	2.3
8 月 末	60,806	7.0	1,982,292.26	7.2	94.6	3.1
9 月 末	57,818	1.8	1,883,547.10	1.8	95.3	2.5
10 月 末	63,361	11.5	2,066,941.46	11.8	95.8	1.8
11 月 末	61,492	8.2	2,007,747.19	8.6	95.4	2.4
12 月 末	57,722	1.6	1,884,347.09	1.9	95.2	2.6
2023年 1 月 末	59,911	5.4	1,957,032.55	5.8	95.5	2.2
(期 末) 2023年 2月 15日	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4

(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（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

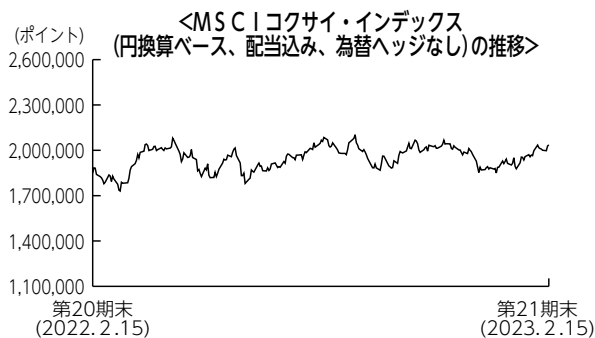


基準価額の推移

当期末の基準価額は62,397円となり、前期末比で9.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

インフレ高進に伴う大幅利上げと景気減速観測が嫌気され、米国やドイツなどの市場は下落しましたが、為替市場で円安が進んだ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

先進国株式市場は上昇、下落が混在する結果となりました。米国株式市場ではF R B（米連邦準備理事会）の大幅利上げに伴う景気減速懸念から下落基調となりました。2022年10月後半以降は利上げペースの緩和観測が広がり、持ち直しの動きとなりました。欧州株式市場ではロシアのウクライナ侵攻に伴うインフレ高進やE C B（欧州中央銀行）の利上げが嫌気され下落しましたが、中国のゼロコロナ政策緩和に伴う景気回復期待や欧州の景況感改善などが好感され反発しました。

為替市場では、円／米ドルレートは高騰する物価抑制のため金融引き締めを急ぐ米国と、金融緩和を維持する日本との政策の違いを背景に大幅に円安米ドル高が進みました。2022年10月後半以降は米国の物価上昇に鈍化傾向が見られたことから利上げペースの緩和観測が広がり、円高米ドル安方向に反転し円の下落幅を縮小しました。ユーロに対してはE C Bの利上げ継続が意識され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	10.8%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.5
3	銀行	6.4
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
5	メディア・娯楽	6.1
6	資本財	5.8
7	小売	5.1
8	各種金融	4.7
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	ヘルスケア機器・サービス	4.5

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.6%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.7
3	資本財	6.5
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.2
5	銀行	6.2
6	エネルギー	5.6
7	メディア・娯楽	5.0
8	各種金融	4.8
9	半導体・半導体製造装置	4.8
10	ヘルスケア機器・サービス	4.6



(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10.1%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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	2円 (1) (1) (0) (0)	0.003% (0.002) (0.001) (0.000) (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) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	8 (8) (0) (0)	0.014 (0.014) (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)	13 (8) (5)	0.022 (0.014) (0.008)	(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	23	0.038	
期中の平均基準価額は59,696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 (2022年2月16日から2023年2月15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 146,429.57 (28,880.34)	千アメリカ・ドル 1,573,779 (△280)	百株 60,698.13	千アメリカ・ドル 623,093
	カ ナ ダ	百株 18,266.39 (2,003.25)	千カナダ・ドル 110,136 (-)	百株 7,515.52	千カナダ・ドル 44,724
	オ ー ス ト ラ リ ア	百株 37,539.52 (3,447.3)	千オーストラリア・ドル 83,816 (-)	百株 20,631.98	千オーストラリア・ドル 32,045
	香 港	百株 27,339.16 (-)	千香港・ドル 124,405 (-)	百株 12,266	千香港・ドル 43,805
	シ ン ガ ポ ー ル	百株 8,498.47 (-)	千シンガポール・ドル 8,393 (△7)	百株 2,903	千シンガポール・ドル 2,867
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	百株 1,951.75 (-)	千ニューージーランド・ドル 1,645 (-)	百株 2,042.47	千ニューージーランド・ドル 1,342
	イ ギ リ ス	百株 106,567.17 (3,741.03)	千イギリス・ポンド 76,417 (△770)	百株 43,039.63	千イギリス・ポンド 39,087
	イ ス ラ エ ル	百株 4,723.42 (-)	千イスラエル・シケル 10,753 (-)	百株 6.29	千イスラエル・シケル 430

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ス イ ス	百株 9,648.21 (3,532.6)	千スイス・フラン 66,022 (△346)	百株 7,123.42	千スイス・フラン 27,291	
	デ ン マ ー ク	百株 2,131.07 (-)	千デンマーク・クローネ 118,134 (-)	百株 1,147.15	千デンマーク・クローネ 51,075	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 3,186.11 (-)	千ノルウェー・クローネ 58,164 (-)	百株 1,253.7	千ノルウェー・クローネ 18,394	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 17,412.61 (7,219.23)	千スウェーデン・クローナ 255,477 (-)	百株 11,724.99	千スウェーデン・クローナ 119,230	
	ユ ー ロ 圏	ア イ ル ラ ン ド	百株 3,308.28 (-)	千ユーロ 4,643 (-)	百株 140.45	千ユーロ 978
		オ ラ ン ダ	百株 8,803.64 (-)	千ユーロ 36,103 (△30)	百株 2,759.53	千ユーロ 14,396
		ベ ル ギ ー	百株 842.99 (29.18)	千ユーロ 5,404 (-)	百株 495.99	千ユーロ 1,930
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 285.39 (-)	千ユーロ 674 (-)	百株 320.77	千ユーロ 345
		フ ラ ン ス	百株 11,204.29 (1,127.33)	千ユーロ 63,276 (△54)	百株 5,503.82	千ユーロ 25,024
		ド イ ツ	百株 10,320.16 (-)	千ユーロ 50,341 (△418)	百株 4,164.74	千ユーロ 19,120
		ポ ル ト ガ ル	百株 719.53 (-)	千ユーロ 488 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	百株 18,213.25 (20,934.83)	千ユーロ 15,005 (△3)	百株 28,200.45	千ユーロ 6,356
		イ タ リ ア	百株 18,552.14 (-)	千ユーロ 10,406 (△5)	百株 8,292.23	千ユーロ 5,518
口	フ ィ ン ラ ン ド	百株 4,213.92 (-)	千ユーロ 6,141 (-)	百株 1,545.28	千ユーロ 2,284	
	オ ー ス ト リ ア	百株 322.73 (-)	千ユーロ 1,108 (-)	百株 363.32	千ユーロ 825	

(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) 投資信託受益証券、投資証券

	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
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8.155	1,306	3.108	468
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	6.545	538	2.815	209
	(-)	(-)	(-)	(-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	45.188	495	-	-
	(△136.345)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	37.979	4,878	15.018	1,932
	(20.182)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.166	1,077	1.59	318
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	9.282	1,317	6.451	918
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	4.367	2,935	1.67	1,084
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	13.615	715	6.431	318
	(△42.49)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INC	18.68	3,038	6.544	1,097
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.231	895	1.018	291
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	19.763	1,425	8.106	565
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36.911	1,054	17.886	467
	(-)	(-)	(-)	(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.09	1,283	1.057	341
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	28.536	2,232	10.336	836
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	105.12	2,406	25.129	529
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	6.074	314	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.332	611	4.419	349
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	16.161	274	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	3.977	659	2.098	323
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	38.458	2,557	15.04	960
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	4.646	286	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	17.665	844	4.438	211
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.86	1,424	2.837	335
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	5.927	1,962	1.886	654
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	9.555	1,493	5.927	932
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	12.719	576	5.035	208
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 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
VORNADO REALTY TRUST	12.068	310	27.191	687
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	24.493	908	6.784	266
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.935	1,055	3.677	682
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	10.392	1,294	1.494	199
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	31.645	592	13.398	288
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	47.312	585	91.632	1,120
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	22.373	5,285	8.587	1,995
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	12.013	968	7.795	603
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42.371	1,237	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	42.177	1,528	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	21.439	759	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30.095	1,452	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	79.168	2,383	16.448	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	0.502	25	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.957	24	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
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
MIRVAC GROUP	18.677	48	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	11.931	59	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	15.847	66	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	62.787	503	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	90.284	1,752	33.867	600
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	173.934	349	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	280.096	821	112.275	305
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	93.116	5,933	30.3	1,996
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	242.054	484	-	-
	(-)	(△1)	(-)	(-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	304.272	876	112.2	312
	(-)	(△16)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 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
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	487.1	838	497.5	896
	(-)	(△15)	(-)	(-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	-	-	6.265	7
	(6.265)	(7)	(-)	(-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	213.2	366	-	-
	(-)	(△2)	(-)	(-)
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	79.077	413	35.736	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	3.064	23	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	44.721	425	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW	27.206	846	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	0.282	30	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	8.18	172	-	-
	(-)	(△30)	(-)	(-)
COVIVIO	0.403	28	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	0.615	39	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 223,972	百万円 217,712	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	399,100,709千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	716,444,920千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.55

(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 (2022年2月16日から2023年2月15日まで)

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
金 銭 信 託	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0

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、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

(1) 外国株式

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	
AMAZON.COM INC	444.06	11,415.95	113,817	15,113,762	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,727.2	2,180.54	23,388	3,105,755	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	654.52	795.05	2,090	277,555	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	42.71	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	873.09	1,124.58	15,295	2,031,077	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,223.07	2,016.32	17,330	2,301,286	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	464.19	584.05	22,071	2,930,841	ソフトウェア
CHUBB LTD	429.3	521.17	11,117	1,476,305	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	216.51	277.73	7,817	1,038,128	化学
ALLEGHANY CORP	12.56	—	—	—	保険
ALLSTATE CORP	305.8	329.39	4,448	590,660	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	674.78	837.7	16,837	2,235,887	コンプロマリット
AMGEN INC	552.91	666.76	16,070	2,134,056	バイオテクノロジー
HESS CORP	269.32	352.71	5,219	693,131	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	655.69	795.36	14,397	1,911,858	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	484.16	626.53	5,668	752,765	電力
AFLAC INC	624.14	726.73	5,029	667,893	保険
AMERICAN INTL GROUP	830.45	938.43	5,773	766,626	保険
AMERCO	9.29	—	—	—	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	518.67	633.36	11,561	1,535,232	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	696.42	864.52	5,635	748,378	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	422.88	484.9	6,773	899,462	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	83.94	108.31	2,970	394,482	ソフトウェア
APPLE INC	16,106.99	20,001.34	306,420	40,689,582	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	881.06	1,068.03	12,649	1,679,759	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	111.8	139.61	3,779	501,845	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	544.75	694.12	5,676	753,784	食品
AMEREN CORP	254.36	316.21	2,694	357,750	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	62.95	99.36	1,253	166,468	電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	214.23	269.07	6,135	814,782	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	413.9	518.47	11,644	1,546,248	情報技術サービス
AUTOZONE INC	20.86	24.51	6,240	828,730	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	80.95	95.14	1,752	232,762	容器・包装
BALL CORP	315.98	402.23	2,289	304,075	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,292.71	1,619.51	50,332	6,683,686	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	794.62	969.68	5,014	665,837	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	484.18	631.74	2,521	334,800	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	280.24	350.61	8,534	1,133,256	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	226.36	289.58	4,180	555,150	電気設備
VERIZON COMM INC	4,048.08	5,240.12	21,133	2,806,304	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	128.04	291.91	1,957	259,942	保険
BEST BUY CO INC	212.38	254.05	2,243	297,916	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	23.24	30.21	1,397	185,543	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	286.66	353.37	4,623	613,906	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	518.27	672.13	2,699	358,525	電力
BOEING CO	542.08	702.82	15,353	2,038,738	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	112.38	144.56	1,209	160,613	専門サービス
BORGWARNER INC	209.23	278	1,381	183,433	自動車部品

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,387.96	1,753.52	8,290	1,100,914		ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	123.82	144.94	1,521	202,031		航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	107.92	195.29	2,189	290,678		娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.29	27.31	4,220	560,471		ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,157.51	2,659.49	19,214	2,551,535		医薬品
ONEOK INC	420.2	569.8	3,975	527,905		石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	74.44	97.09	1,276	169,524		保険
UNITED RENTALS INC	69.35	88.83	4,056	538,628		商社・流通業
SEMPRA ENERGY	310.48	385.67	6,049	803,277		総合公益事業
FEDEX CORP	247.48	309.91	6,590	875,199		航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	103.4	118.5	2,533	336,458		情報技術サービス
AMPHENOL CORP	581.23	743.44	6,001	796,977		電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	297.33	384.05	2,508	333,067		飲料
QUANTA SERVICES INC	-	175.6	2,707	359,562		建設・土木
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	1,017.65	473	62,837		メディア
CSX CORP	2,203.61	2,635.36	8,285	1,100,241		陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	785.16	999.16	2,552	338,993		石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	203.34	269.78	1,376	182,774		食品
CONSTELLATION BRANDS INC	164.21	193.43	4,366	579,851		飲料
CARDINAL HEALTH INC	290.05	344.21	2,710	359,947		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARLISLE COS INC	-	61.19	1,572	208,847		建設関連製品
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	763.02	1,322.91	1,571	208,695		ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	532.89	658.5	16,091	2,136,737		機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	102.58	126.31	1,591	211,285		ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	115.3	-	-	-		ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	921.88	970.73	381	50,658		各種電気通信サービス
CERNER CORP	285.28	-	-	-		ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,913.79	3,650.43	52,274	6,941,485		銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	245.63	302.36	2,503	332,405		家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	144.65	198.78	2,500	332,008		保険
CINTAS CORP	89.31	111.73	4,950	657,366		商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	4,107.04	5,161.36	24,619	3,269,248		通信機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	-	693.71	1,415	188,012		金属・鉱業
CLOROX COMPANY	114.55	157.94	2,411	320,192		家庭用品
COCA-COLA CO/THE	4,005.62	5,108.54	30,441	4,042,365		飲料
COPART INC	203.22	540.11	3,741	496,884		商業サービス・用品
COGNEX CORP	162.62	204.32	1,130	150,119		電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	784.14	988.65	7,234	960,727		家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	265.14	345.46	6,262	831,551		ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	55.04	74.34	2,214	294,085		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	227.63	283.64	995	132,202		電力
COMCAST CORP-CL A	4,460.29	5,492.1	21,452	2,848,630		メディア
CONAGRA BRANDS INC	454.72	619.81	2,235	296,790		食品
CONSOLIDATED EDISON INC	340.89	438.55	3,995	530,521		総合公益事業
CMS ENERGY CORP	272.38	366.03	2,238	297,268		総合公益事業
COOPER COS INC	47.32	63.42	2,140	284,294		ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	169.84	252.81	1,305	173,392		飲料
CORNING INC	838.66	957.58	3,388	450,008		電子装置・機器・部品
WOLFSPEED INC	-	156.84	1,269	168,530		半導体・半導体製造装置
SEALED AIR CORP	133.82	176.1	895	118,862		容器・包装
HEICO CORP-CL A	74.77	94.63	1,295	172,014		航空宇宙・防衛

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CUMMINS INC	139.26	178.03	4,422	587,256		機械
DARLING INTERNATIONAL INC	-	200.32	1,369	181,867		食品
DR HORTON INC	327.87	406.02	4,026	534,678		家庭用耐久財
DANAHER CORP	625.65	861.23	22,068	2,930,430		ライフサイエンス・ツール/サービス
MOODY'S CORP	163.35	206.82	6,392	848,818		資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	512.62	629.06	4,240	563,095		情報技術サービス
TARGET CORP	474.94	577.14	9,878	1,311,819		複合小売り
DEERE & CO	286.89	362.03	14,818	1,967,715		機械
MORGAN STANLEY	1,330.94	1,604.05	16,130	2,141,946		資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	215.52	270.24	3,374	448,062		商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	412.01	500.52	3,842	510,310		専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,767.79	2,274.04	24,482	3,251,006		娯楽
DOLLAR TREE INC	231.67	281.49	4,136	549,247		複合小売り
DOVER CORP	141.72	178.42	2,777	368,890		機械
OMNICOM GROUP	203.13	265.7	2,475	328,760		メディア
DTE ENERGY CO	184.19	237.92	2,705	359,216		総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	753.03	964.73	9,596	1,274,275		電力
DARDEN RESTAURANTS INC	133.37	156.76	2,293	304,561		ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	628.16	676.67	3,302	438,492		インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	7,384.33	9,008.68	32,088	4,261,087		銀行
CITIGROUP INC	1,979.43	2,418.65	12,482	1,657,571		銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	133.26	167.9	1,483	197,002		化学
EATON CORP PLC	390.25	496.76	8,592	1,140,992		電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	268.13	343.37	6,836	907,772		ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	226.45	244.16	342	45,455		メディア
ECOLAB INC	252.97	325.5	5,155	684,654		化学
PERKINELMER INC	118.35	156.49	2,159	286,705		ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	275.61	348.38	3,910	519,283		娯楽
SALESFORCE INC	953.48	1,248.76	21,223	2,818,324		ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	33.72	803	106,640		保険
EMERSON ELECTRIC CO	583.88	738.89	6,353	843,709		電気設備
ATMOS ENERGY CORP	124.29	175.67	2,033	270,059		ガス
ENTERGY CORP	188.13	260.97	2,768	367,646		電力
EOG RESOURCES INC	567.51	734.98	9,784	1,299,322		石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	116.63	151.56	3,244	430,809		専門サービス
EQT CORP	-	409.96	1,274	169,195		石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	226.64	289.95	7,408	983,814		パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	163.66	199.74	2,259	300,007		航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	4,127.07	5,193.82	60,466	8,029,340		石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	121.83	155.34	1,998	265,353		化学
NEXTERA ENERGY INC	1,911.83	2,449.25	18,621	2,472,768		電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	38.74	47.16	2,027	269,169		資本市場
FAIR ISAAC CORP	28.1	29.62	2,067	274,563		ソフトウェア
ASSURANT INC	55.23	58.23	758	100,714		保険
FASTENAL CO	549.13	729.41	3,846	510,830		商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	666.81	843.62	3,137	416,618		銀行
M&T BANK CORP	121.75	207.66	3,335	442,912		銀行
FIRST HORIZON CORP	-	696.34	1,719	228,393		銀行
FISERV INC	576.52	760.76	8,825	1,171,948		情報技術サービス
FORD MOTOR CO	3,805.63	4,943.79	6,412	851,462		自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	276.05	379.16	1,202	159,655		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			
			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		
FREPORT-MCMORAN INC	1,425.79	1,801.8	7,744	1,028,343		金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	11.92	15.87	1,219	161,930		銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	200.01	262.69	4,945	656,665		保険
DENTSPLY SIRONA INC	202.22	255.99	946	125,739		ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	231.98	287.25	6,666	885,206		航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	588.18	749.19	5,645	749,619		食品
GENUINE PARTS CO	136.11	173.74	3,068	407,455		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,218.49	1,563.88	13,399	1,779,296		バイオテクノロジー
GARTNER INC	88.55	95.64	3,272	434,607		情報技術サービス
MCKESSON CORP	150.01	179.8	6,577	873,490		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	2,433.72	3,102.42	71,265	9,463,370		半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	1,070.26	1,369.1	11,437	1,518,780		コングロマリット
WW GRAINGER INC	41.48	54.66	3,643	483,794		商社・流通業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	309.23	-	-	-		ソフトウェア
HALLIBURTON CO	838.43	1,115.7	4,346	577,207		エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	386.22	497.39	5,185	688,554		飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	329.9	424.3	15,774	2,094,712		資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	193.75	243.2	5,176	687,453		航空宇宙・防衛
HASBRO INC	121.84	154.37	897	119,118		レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	143.58	174.31	1,551	205,958		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	35.96	51.85	907	120,455		航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	152.45	186.95	4,466	593,071		食品
HP INC	1,162.73	1,259.55	3,829	508,457		コンピュータ・周辺機器
F5 INC	55.57	69.24	1,019	135,368		通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	123.36	153.22	1,313	174,365		容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	352.9	437.15	1,370	182,042		通信機器
HOLOGIC INC	243.1	306.95	2,552	338,918		ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	1,028.3	1,275.83	40,626	5,394,760		専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	198.15	228.8	2,487	330,377		バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	290.21	388.51	1,747	232,104		食品
CENTERPOINT ENERGY INC	611.05	787.91	2,307	306,346		総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	34.21	36.02	952	126,450		建設関連製品
HUBBELL INC	-	69.03	1,694	224,964		電気設備
HUMANA INC	125.74	158.44	7,948	1,055,496		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	87.52	103.48	2,011	267,058		陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,419.2	1,814.91	2,785	369,937		銀行
BIOPEN INC	143.44	176.03	5,088	675,725		バイオテクノロジー
IDEX CORP	73.32	90.65	2,042	271,263		機械
ILLINOIS TOOL WORKS	307.86	387.9	9,233	1,226,177		機械
INTUIT INC	266.2	335.01	14,136	1,877,174		ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	82.25	101.62	5,118	679,631		ヘルスケア機器・用品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	230.51	292.93	5,439	722,261		建設関連製品
INTEL CORP	3,947.83	5,124.32	14,676	1,948,833		半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	239.91	319.79	3,070	407,790		化学
INTERNATIONAL PAPER CO	343.88	441.53	1,728	229,539		容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	369.48	456.79	1,716	227,949		メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	131.48	-	-	-		専門サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	77.48	95.06	1,583	210,248		情報技術サービス
INCYTE CORP	179.58	244.49	1,940	257,648		バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,569.27	3,270.95	53,002	7,038,198		医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	328	394.02	3,056	405,913		保険

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
KLA CORPORATION	147.87	177.34	7,134	947,446		半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	624.62	783.84	5,011	665,526		石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	265.78	329.41	2,213	293,948		食品
KEYCORP	916.12	1,189.55	2,293	304,547		銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	326.7	421.73	5,422	720,067		家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	147.89	188.14	13,718	1,821,643		資本市場
KROGER CO	684.81	827.75	3,611	479,567		食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	138.76	172.6	8,909	1,183,130		半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	44.17	58.9	2,600	345,272		電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	105.55	110.29	1,573	208,887		容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	152.64	200.36	1,758	233,572		情報技術サービス
PLUG POWER INC	526.24	561.49	887	117,879		電気設備
LENNAR CORP	264.83	323.61	3,367	447,211		家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	791.98	1,006.41	34,978	4,644,832		医薬品
BATH & BODY WORKS INC	269.67	281.56	1,265	167,985		専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	170.02	179.37	622	82,602		保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	709.53	911.89	17,031	2,261,595		航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	292.04	371.89	5,691	755,761		ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	244.24	296.95	14,300	1,898,965		航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	223.94	235.3	1,453	193,034		保険
LOWE'S COS INC	674.34	774.78	16,561	2,199,227		専門小売り
DOMINION ENERGY INC	787.03	1,018.28	5,912	785,072		総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	387	404.01	1,783	236,804		ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	249.05	320.31	2,399	318,621		食品
MCDONALD'S CORPORATION	727.78	914.13	24,371	3,236,307		ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	233.63	425.05	15,508	2,059,357		資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	42.82	53.53	2,032	269,871		保険
MARKEL CORPORATION	14.47	16.74	2,256	299,616		保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	605.91	776.95	5,950	790,188		ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	495.58	621.47	10,378	1,378,167		保険
MASCO CORP	232.33	289.37	1,603	212,992		建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	58.93	77.36	2,755	365,911		建設資材
METLIFE INC	714.43	847.99	6,109	811,316		保険
MEDTRONIC PLC	1,313.85	1,660.79	13,850	1,839,272		ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	756.57	974.96	7,485	994,031		娯楽
CVS HEALTH CORP	1,287.35	1,636.16	14,483	1,923,235		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	2,465.91	3,156.72	34,326	4,558,172		医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	413.6	543.62	4,722	627,163		半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	92.82	114.55	2,793	370,952		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	6,957.86	8,819.04	240,027	31,873,293		ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,090.85	1,356.54	8,420	1,118,097		半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	533.22	695.97	5,907	784,442		半導体・半導体製造装置
3M CO	566.66	693.96	7,925	1,052,455		コンプロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	59.63	63.11	739	98,176		家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	136.39	177.09	1,507	200,213		半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	54.58	64.45	1,622	215,447		ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	163.01	205.78	5,564	738,936		通信機器
ILLUMINA INC	142.46	198.33	4,221	560,514		ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	516.15	693.25	4,712	625,801		電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	97.13	117.16	1,205	160,119		バイオテクノロジー
NETAPP INC	212.2	282.65	1,914	254,174		コンピュータ・周辺機器

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	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		
NEWELL BRANDS INC	404.89	419.84	625	83,068		家庭用耐久財
NEWMONT CORP	774.43	992.87	4,667	619,794		金属・鉱業
NOVAVAX INC	78.86	-	-	-		バイオテクノロジー
NVR INC	3.38	4.05	2,073	275,348		家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,245.17	1,574.85	19,874	2,639,149		繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	47.87	64.47	1,565	207,834		機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	242.35	289.97	6,822	905,948		陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	328.72	430.42	3,395	450,899		電力
NISOURCE INC	420.35	532.7	1,434	190,495		総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	200.11	248.36	2,417	320,991		資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	148.6	183.61	8,583	1,139,862		航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	4,001.7	4,724.91	22,915	3,042,990		銀行
NUCOR CORP	282.85	316.6	5,422	719,999		金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	231.2	285.54	4,248	564,164		石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	430.6	466.54	5,381	714,614		消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	902.66	1,147.44	7,612	1,010,813		石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	95.78	116.3	4,171	553,942		陸運・鉄道
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	66.72	77.57	6,678	886,874		専門小売り
ORACLE CORP	1,632.21	1,992.12	17,747	2,356,729		ソフトウェア
PACCAR INC	359.38	648.01	4,743	629,880		機械
PTC INC	110.92	136.65	1,836	243,806		ソフトウェア
EXELON CORP	956.45	1,216.64	5,113	679,026		電力
PARKER HANNIFIN CORP	125.93	161.01	5,673	753,342		機械
PAYCHEX INC	313.87	405.19	4,616	613,056		情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	73.03	96.51	3,199	424,861		ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	734.82	887.37	2,532	336,297		電力
PEPSICO INC	1,349.24	1,714.95	30,143	4,002,778		飲料
PENTAIR PLC	163.39	198.04	1,116	148,319		機械
PFIZER INC	5,460.72	6,989.45	30,557	4,057,780		医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	215.43	327.96	1,504	199,806		水道
CONOCOPHILLIPS	1,306.12	1,591.69	18,073	2,399,998		石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,524.96	1,782.57	2,777	368,790		電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	222.38	284.45	6,648	882,809		石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,796.13	2,244.42	10,640	1,412,991		タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	415.17	510.1	8,219	1,091,433		銀行
BROWN & BROWN INC	217.93	306.5	1,755	233,048		保険
GARMIN LTD	145.29	199.11	1,937	257,285		家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	230.64	283.41	3,678	488,414		化学
IPG PHOTONICS CORP	33.53	-	-	-		電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	429.9	551.82	27,768	3,687,403		食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	218.51	277.07	3,349	444,816		資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	124.93	145.36	2,101	279,092		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,369.3	2,967.79	41,335	5,488,924		家庭用品
PROGRESSIVE CORP	569.36	731.78	10,191	1,353,329		保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	490.59	601	3,675	488,098		総合公益事業
PULTE GROUP INC	238.14	290.5	1,640	217,874		家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	283.31	336.53	3,909	519,183		情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,096.16	1,401.58	18,548	2,463,056		半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	197.29	234.37	2,677	355,537		資本市場
EXACT SCIENCES CORP	179.82	233.86	1,532	203,467		バイオテクノロジー
REGENERON PHARMACEUTICALS	101.93	133.97	10,104	1,341,730		バイオテクノロジー

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
REPLIGN CORP	—	67.3	1,267	168,332		ライフサイエンス・ツール/サービス
RESMED INC	140.92	186.28	3,984	529,155		ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,379.88	1,766	8,676	1,152,133		銀行
SEAGEN INC	128.63	168.6	2,374	315,262		バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	370.32	458.51	3,039	403,549		保険
ROSS STORES INC	342.98	441.71	5,159	685,086		専門小売り
ROLLINS INC	191.56	259.2	923	122,669		商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	103.18	131.2	5,599	743,503		ソフトウェア
ROCKWELL AUTOMATION INC	111.67	146.33	4,289	569,663		電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	212.92	274.77	2,070	275,000		ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	128.97	164.67	1,467	194,830		化学
ACCENTURE PLC-CL A	618.55	788.43	22,452	2,981,417		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,364.94	1,686.45	11,073	1,470,414		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	124.53	132.32	3,195	424,299		保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	241.52	295.95	5,449	723,616		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	599.27	750.43	5,088	675,723		情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	39.84	49.56	12,246	1,626,215		ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,365.54	1,774.1	10,080	1,338,581		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,406.74	1,813.79	14,649	1,945,371		資本市場
POOL CORP	43.36	46.6	1,749	232,254		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	200.7	261.44	3,312	439,894		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	135.81	186.42	1,863	247,448		食品
SEI INVESTMENTS CO	102.94	144.77	904	120,111		資本市場
ELEVANCE HEALTH INC	238.09	299.28	14,709	1,953,209		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	149.22	191.04	3,006	399,194		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	257.42	319.21	2,936	389,883		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	243.75	304.76	7,068	938,680		化学
CENTENE CORP	563.86	700.8	5,142	682,868		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	56.17	73.3	2,277	302,488		銀行
SMITH (A.O.) CORP	140.37	148.56	1,002	133,119		建設関連製品
SNAP-ON INC	57.83	70.68	1,782	236,704		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	375.64	467.76	4,830	641,449		保険
ADVANCE AUTO PARTS	56.94	71.65	1,080	143,439		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	362.4	485.33	3,277	435,274		電力
SOUTHERN CO	1,035.27	1,360.27	9,066	1,203,900		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,291.44	1,653.26	8,071	1,071,776		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	132.2	197	699	92,892		旅客航空輸送業
AT&T INC	6,960.38	8,882.01	17,009	2,258,631		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,886.45	2,316.39	39,916	5,300,449		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	153.85	192.7	1,718	228,148		機械
STATE STREET CORP	351.58	461.98	4,323	574,078		資本市場
STARBUCKS CORP	1,144.57	1,428.19	15,421	2,047,833		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	219.29	229.37	2,901	385,294		金属・鋳業
STRYKER CORP	331.3	426.35	11,283	1,498,373		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	430.24	554.71	19,967	2,651,463		娯楽
GEN DIGITAL INC	552.31	730.86	1,549	205,747		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	158.87	203.18	1,236	164,147		陸運・鉄道
SYNOPSYS INC	147.52	187.79	7,059	937,467		ソフトウェア
SYSCO CORP	496.62	625.21	4,862	645,742		食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	346.96	446.32	10,760	1,428,864		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	44.66	55.32	1,356	180,166		ヘルスケア機器・用品

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,057.57	1,347.81	1,381	183,450		医薬品
TERADYNE INC	154.54	185.12	1,999	265,511		半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	895.92	1,137.01	20,050	2,662,444		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	206.83	258.24	1,926	255,781		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	382.78	487.95	27,885	3,702,897		ライフサイエンス・ツール/サービス
GLOBE LIFE INC	91.68	121.53	1,466	194,769		保険
DAVITA INC	64.97	68.13	564	74,990		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	109.61	136.9	3,258	432,640		専門小売り
BIO-TECHNE CORP	42.2	206.52	1,590	211,163		ライフサイエンス・ツール/サービス
TRIMBLE INC	260.37	286.76	1,594	211,756		電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	39.35	53	1,728	229,568		ソフトウェア
TYSON FOODS INC	277.88	356.84	2,172	288,525		食品
UGI CORP	184.69	241.6	953	126,563		ガス
MARATHON OIL CORP	-	840.59	2,283	303,165		石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	637.38	777.69	15,867	2,107,006		陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,472.36	1,830.61	18,556	2,464,169		航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	920.02	1,165.09	57,419	7,624,686		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	77.37	80.96	1,200	159,475		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VF CORP	356.87	378.87	1,046	138,956		繊維・アパレル・贅沢品
PARAMOUNT GLOBAL	570.34	786.63	1,765	234,505		メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	250.92	321.4	9,650	1,281,428		バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	126.76	164.52	3,053	405,429		建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	704.44	917.06	3,370	447,528		食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,502.63	1,878.96	27,336	3,630,078		食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	406.53	505.78	7,654	1,016,437		商業サービス・用品
WATERS CORP	57.5	75.11	2,548	338,432		ライフサイエンス・ツール/サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	204.18	222.85	1,228	163,142		銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	71.03	96.41	2,661	353,394		ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	99.44	126.79	1,864	247,563		食品
VAIL RESORTS INC	41.8	52.35	1,338	177,799		ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	293.01	407.23	1,777	235,987		コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	170.97	202.73	2,097	278,492		機械
WHIRLPOOL CORP	57.37	68.32	1,028	136,600		家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	159.24	188.33	2,293	304,526		半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	120.04	127.57	1,391	184,781		ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	110.34	415.96	2,438	323,789		資本市場
CME GROUP INC	348.92	443.42	8,264	1,097,496		資本市場
WILLIAMS COS INC	1,163.01	1,518.9	4,848	643,809		石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	287.85	315.04	1,808	240,211		販売
ALLIANT ENERGY CORP	238.72	339.66	1,810	240,356		電力
WEC ENERGY GROUP INC	305.23	383.18	3,513	466,592		総合公益事業
CARMAX INC	152.87	186.73	1,417	188,225		専門小売り
XILINX INC	253.18	-	-	-		半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,168.23	1,452.28	11,722	1,556,671		専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	56.09	67.3	2,145	284,868		電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,560.49	749	99,464		不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	204	173.28	891	118,385		コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	108.82	150.92	3,394	450,734		バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	56.1	79.96	1,040	138,191		銀行
CBRE GROUP INC	323.38	410.89	3,652	485,056		不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	145.97	157.79	331	44,043		各種電気通信サービス

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
REGIONS FINANCIAL CORP	974.23	1,172.22	2,795	371,246		銀行
DOMINO'S PIZZA INC	38.08	41.15	1,430	189,928		ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	40.44	53.87	2,804	372,377		半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	-	41.87	519	69,048		化学
T-MOBILE US INC	607.01	784.34	11,568	1,536,145		無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	367.69	429.72	2,473	328,451		ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	385.15	425.61	2,126	282,414		化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	39.59	48.71	1,734	230,319		資本市場
CELANESE CORP	109.17	138.41	1,689	224,376		化学
DEXCOM INC	93.5	487.1	5,774	766,805		ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	130.68	-	-	-		メディア
EXPEDIA GROUP INC	136.45	191.86	2,205	292,859		ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	202.05	240.27	2,055	272,887		化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	108.96	131.23	4,629	614,685		資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	360.34	783	103,977		各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	551.66	698.96	7,576	1,006,113		資本市場
LIVE NATION	153.12	204.44	1,596	211,968		娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	27.13	34.74	5,713	758,637		ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	50.93	61.48	4,645	616,931		航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	858.46	1,074.66	39,758	5,279,480		情報技術サービス
WESTERN UNION CO	448.68	467.12	658	87,460		情報技術サービス
OWENS CORNING	97.4	132.27	1,367	181,630		建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	123.03	151.08	1,439	191,089		専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	-	178.61	1,125	149,444		商社・流通業
FIRST SOLAR INC	-	119.03	1,964	260,862		半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	-	-	-		ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	117.8	153	2,211	293,680		情報技術サービス
DELTA AIR LINES INC	147.23	215.92	844	112,107		旅客航空輸送業
INSULET CORP	64.81	88.34	2,590	343,943		ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	286.45	332.36	3,833	509,086		消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	318.46	387.62	5,143	683,034		電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	54.04	56.88	939	124,762		ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	114.58	145.47	4,653	617,910		繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	213.2	266.9	3,128	415,482		ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	43.13	57.15	6,471	859,304		インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	52.74	60.73	3,186	423,095		専門小売り
INVESCO LTD	369.04	385.3	732	97,211		資本市場
MSCI INC	79.74	98.07	5,509	731,642		資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,520.6	1,930.16	19,631	2,606,887		タバコ
VISA INC	1,644.41	2,035.26	46,686	6,199,544		情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	709.52	928.16	3,284	436,183		飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	173.37	228.09	3,405	452,231		水道
DISCOVERY INC-C	303.88	-	-	-		メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	618.96	631.37	8,121	1,078,512		石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	127.87	161.82	1,052	139,736		建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,960.57	2,578.77	4,721	626,998		石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	170.83	228.48	2,452	325,668		機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	261.91	333.42	3,338	443,323		化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.82	47.13	1,018	135,300		航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	156.99	208.98	2,227	295,764		ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	53.99	70.9	2,563	340,345		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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ZILLOW GROUP INC	76.58	—	—	—	—	不動産管理・開発
HCA HEALTHCARE INC	250.49	287.52	7,443	988,474	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	146.24	189.74	3,354	445,508	—	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	61.52	77.92	1,174	155,918	—	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	73.99	88.44	1,857	246,622	—	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	169.47	224.34	3,036	403,238	—	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	258.51	321.09	6,093	809,217	—	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	136.87	163.43	1,550	205,885	—	専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	—	258.3	1,994	264,861	—	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	52.16	69.11	981	130,397	—	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	105.27	127.09	1,608	213,569	—	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	215.54	310.59	1,939	257,605	—	情報技術サービス
DOLLAR GENERAL CORP	225.66	278.99	6,455	857,195	—	複合小売り
FORTINET INC	134.08	811.66	4,966	659,507	—	ソフトウェア
HORIZON PHARMA PLC	204.15	276.13	3,025	401,690	—	バイオテクノロジー
TESLA INC	819.66	3,319.53	69,461	9,223,748	—	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	59.93	69.14	865	114,956	—	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	122.17	170.46	3,551	471,608	—	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,267.27	1,712.1	7,264	964,645	—	自動車
ALLY FINANCIAL INC	374.66	392.3	1,279	169,876	—	消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	96.61	2,367	314,332	—	資本市場
APTIV PLC	260.18	343.1	4,154	551,734	—	自動車部品
PHILLIPS 66	424.28	594.04	6,412	851,537	—	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	86.28	—	—	—	—	ソフトウェア
META PLATFORMS INC	2,321.43	2,845.33	51,067	6,781,317	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	185.72	225.14	5,112	678,856	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	157.27	200.87	3,010	399,756	—	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	192.63	253.33	11,687	1,551,967	—	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	94.41	369.42	6,285	834,626	—	ソフトウェア
WORKDAY INC	186.02	255.47	4,842	642,992	—	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,721.56	2,201.98	33,600	4,461,745	—	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	460.53	587.56	10,100	1,341,199	—	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	383.72	542.11	1,020	135,479	—	メディア
CDW CORP	129.43	164.65	3,426	454,965	—	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	404.34	475.9	2,047	271,863	—	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	158.35	210.9	1,309	173,913	—	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	77.32	—	—	—	—	ソフトウェア
SNAP INC	1,027.74	1,273.18	1,381	183,436	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	418.52	532.3	2,657	352,855	—	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	221.57	224.66	1,597	212,169	—	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	88.45	310	41,225	—	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	143.46	198.71	695	92,406	—	メディア
OKTA INC	116.92	178.28	1,377	182,951	—	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	167.75	176.53	1,122	149,087	—	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	779.09	1,262.92	4,099	544,364	—	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	181.67	1,803	239,478	—	食品
BROADCOM INC	398.94	502.59	30,271	4,019,752	—	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	73.05	—	—	—	—	ソフトウェア
ARES MANAGEMENT CORP	—	195.34	1,639	217,707	—	資本市場
MONGODB INC	61.01	90.21	2,064	274,091	—	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	68.61	84.53	1,944	258,157	—	専門小売り

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	404.49	613.21	790	104,960		医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	132.96	168.56	2,898	384,832		ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	829.81	—	—	—		インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	159.85	242.12	1,267	168,375		電気設備
EVERGY INC	223.98	282.26	1,711	227,324		電力
ALLEGION PLC	89.24	101.4	1,215	161,390		建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	133.6	183.14	1,420	188,595		ソフトウェア
STERIS PLC	96.49	125.24	2,440	324,030		ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	185.2	263.62	1,677	222,778		ソフトウェア
WIX.COM LTD	55.67	58.55	508	67,586		情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	304.79	731	97,135		ソフトウェア
KKR & CO INC	503.37	674.3	3,951	524,706		資本市場
FUTU HOLDINGS LTD ADR	47.58	50.5	241	32,107		資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	209	279.21	2,175	288,824		ソフトウェア
MODERNA INC	334.13	416.26	7,310	970,742		バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	266.16	344.09	5,208	691,635		ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	213.87	311.33	1,214	161,273		ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	571.24	—	—	—		娯楽
CIGNA CORP	331.11	382.14	11,439	1,519,083		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	277.83	327.7	1,410	187,246		コンピュータ・周辺機器
DOW INC	722.56	876.67	5,238	695,684		化学
OVINTIV INC	—	316.03	1,540	204,540		石油・ガス・消耗燃料
AMCOR PLC	1,618.22	1,887.89	2,152	285,789		容器・包装
PINTEREST INC	521.77	697.46	1,721	228,575		インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	254.18	—	—	—		レジャー用品
FOX CORP-A	346.81	365.01	1,305	173,327		メディア
FOX CORP-B	150.8	155.11	513	68,238		メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	408.46	425.86	462	61,413		専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	182.31	257.23	2,991	397,286		ソフトウェア
CHEWY INC	90.68	96.48	462	61,354		インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	486.39	782.14	1,899	252,172		ライフサイエンス・ツール/サービス
LYFT INC	245.89	—	—	—		陸運・鉄道
DYNATRACE INC	194.17	254.29	1,128	149,824		ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	225.54	297.7	2,035	270,316		情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	98.86	138	1,027	136,466		資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	798.71	1,018.98	4,598	610,655		建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	422.26	528.55	4,457	591,879		機械
INMODE LTD	55.11	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	1,191.09	1,815.6	6,396	849,372		陸運・鉄道
CORTEVA INC	717.05	905.9	5,632	747,990		化学
MATCH GROUP INC	253.22	352.59	1,588	210,879		インタラクティブ・メディアおよびサービス
FERGUSON PLC	—	257.02	3,789	503,173		商社・流通業
BILL.COM HOLDINGS INC	78.3	119.88	1,163	154,508		ソフトウェア
BLACKSTONE INC	665.78	880.26	8,518	1,131,141		資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	32.02	—	—	—		専門サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	53.22	1,155	153,398		ソフトウェア
CARLYLE GROUP INC	170.2	245.3	866	115,081		資本市場
10X GENOMICS INC	76.67	—	—	—		ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	183.67	291.79	2,494	331,207		ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	209.24	256.89	1,861	247,178		コンピュータ・周辺機器
UPSTART HOLDINGS INC	20.8	—	—	—		消費者金融

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
INGERSOLL RAND INC	405.29	514.79	2,956	392,585		機械
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	—	441.35	3,204	425,544		ヘルスケア機器・用品
PAYCOM SOFTWARE INC	52.5	63.41	2,058	273,395		ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	177.12	383.42	747	99,232		自動車
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	—	92.67	196	26,087		海運業
ASANA INC	71.34	—	—	—		ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	53.67	308.39	1,224	162,657		ソフトウェア
AON PLC	220.29	263.41	8,229	1,092,859		保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	547.34	—	—	—		消費者金融
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	2,917.78	4,297	570,716		娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	7.36	1,419	188,484		石油・ガス・消耗燃料
BENTLEY SYSTEMS INC	160.02	225.66	924	122,708		ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	39.76	130.94	772	102,638		資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	92.04	185.28	242	32,230		情報技術サービス
IAC INC	72.5	—	—	—		インタラクティブ・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	227.11	471.77	5,702	757,206		ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	119.15	—	—	—		ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	318.81	412.24	3,547	471,104		電力
ROYALTY PHARMA PLC	355.64	417.75	1,587	210,797		医薬品
ROBLOX CORP	—	450.19	1,605	213,237		娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	235.77	296.56	796	105,814		インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,248.58	1,508.26	1,781	236,532		医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	218.14	264.44	1,409	187,127		ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	334.59	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	126.87	1,064	141,296		石油・ガス・消耗燃料
HF SINCLAIR CORP	—	202.99	1,123	149,223		石油・ガス・消耗燃料
SNOWFLAKE INC	203.94	285.82	4,888	649,089		情報技術サービス
DOORDASH INC	109.22	295.75	1,822	241,958		インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	91.44	—	—	—		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	218.59	293.67	4,154	551,643		通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	371.77	504.82	3,617	480,373		各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	1,532.71	2,028.24	1,870	248,322		ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	367.14	—	—	—		専門サービス
FNF GROUP	254.51	310.04	1,351	179,460		保険
JACOBS SOLUTIONS INC	—	166.15	2,035	270,316		専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	794.17	1,079.89	5,098	676,984		半導体・半導体製造装置
APA CORP	—	409.46	1,738	230,918		石油・ガス・消耗燃料
ROBINHOOD MARKETS INC	198.72	—	—	—		資本市場
LUCID GROUP INC	421.36	449.1	463	61,603		自動車
U-HAUL HOLDING CO	—	119.81	689	91,559		陸運・鉄道
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	37.21	799	106,174		ソフトウェア
TOAST INC	—	326.2	819	108,766		情報技術サービス
GRAB HOLDINGS LTD	—	1,683.28	585	77,785		陸運・鉄道
CATALENT INC	174.39	205.64	1,446	192,104		医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	599.85	611.18	2,219	294,768		消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	435.54	633.78	2,748	364,916		銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	52.37	782	103,972		ソフトウェア
WAYFAIR INC	69.59	—	—	—		インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.12	222.09	4,113	546,297		電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	43.07	58.02	2,111	280,381		ソフトウェア
QORVO INC	111.07	141.44	1,505	199,894		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		
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	24.25	—	—	—	メディア	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	145.2	153.35	1,422	188,829	メディア	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	49.59	67.28	2,122	281,808	半導体・半導体製造装置	
GODADDY INC	165.74	197.13	1,597	212,137	情報技術サービス	
KORNIT DIGITAL LTD	49.78	—	—	—	機械	
ETSY INC	117.13	156.14	2,088	277,314	インターネット販売・通信販売	
TRANSUNION	189.9	257.08	1,753	232,784	専門サービス	
ALCOA CORP	—	239.41	1,171	155,554	金属・鉱業	
BLOCK INC	489.39	669.1	5,272	700,136	情報技術サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	506.8	602.66	4,607	611,888	化学	
CARVANA CO	77.35	—	—	—	専門小売り	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	215.37	262.21	1,467	194,811	飲料	
TELADOC HEALTH INC	147.9	—	—	—	ヘルスケア・テクノロジー	
WESTROCK CO	262.97	342.86	1,131	150,243	容器・包装	
KRAFT HEINZ CO	640.01	921.06	3,673	487,762	食品	
NOVOCURE LTD	97.72	123.17	1,064	141,329	ヘルスケア機器・用品	
FORTIVE CORP	329.64	426.08	2,940	390,509	機械	
WASTE CONNECTIONS INC	261.86	310.39	4,180	555,106	商業サービス・用品	
ALPHABET INC-CL A	293.14	7,443.29	70,473	9,358,118	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,231.01	1,563.84	2,586	343,473	コンピュータ・周辺機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,086.55	1,375.33	10,625	1,410,969	情報技術サービス	
SEA LTD ADR	132.32	439.08	2,820	374,495	娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	343.46	449.24	1,477	196,144	各種金融サービス	
SUNRUN INC	162.13	—	—	—	電気設備	
ZILLOW GROUP INC-C	156.65	163.21	743	98,697	不動産管理・開発	
ALPHABET INC-CL C	280.94	6,916.6	65,673	8,720,733	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
ZSCALER INC	77.59	103.1	1,404	186,452	ソフトウェア	
CABLE ONE INC	5.42	—	—	—	メディア	
LINDE PLC	503.98	620.82	20,735	2,753,452	化学	
ROKU INC	119.01	156.6	886	117,782	娯楽	
AVALARA INC	78.24	—	—	—	ソフトウェア	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	124.76	140.85	5,635	748,382	メディア	
VISTRA CORP	397.58	496.33	1,142	151,653	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>	309,096.71 608銘柄	423,708.49 601銘柄	4,451,014 —	591,050,171 <69.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES LTD	455.67	570.3	3,886	386,737	金属・鉱業	
BARRICK GOLD CORP	1,736.87	2,148.35	5,108	508,425	金属・鉱業	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	212.72	—	—	—	電気設備	
BANK OF MONTREAL	630.76	825.85	11,166	1,111,271	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,191.19	1,494.35	11,050	1,099,767	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	326	409.67	4,133	411,413	銀行	
BCE INC	72.75	76.97	470	46,841	各種電気通信サービス	
BROOKFIELD CORP	1,379.3	1,771.31	8,638	859,721	資本市場	
BAUSCH HEALTH COS INC	281.92	—	—	—	医薬品	
SAPUTO INC	253.95	345.82	1,269	126,306	食品	
BLACKBERRY LTD	466.71	—	—	—	ソフトウェア	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	622.22	923.11	910	90,581	総合公益事業	
DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	—	115.08	1,160	115,478	ソフトウェア	
CGI INC	229.85	279.18	3,456	343,965	情報技術サービス	
CCL INDUSTRIES INC	153.58	210.58	1,314	130,813	容器・包装	

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		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
CAE INC	304.43	408.08	1,295	128,902		航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	346.76	542.64	2,110	210,019		石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	373.08	456.07	2,986	297,246		無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	436.21	1,145.14	7,152	711,821		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,152.17	1,407.03	11,305	1,125,121		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	58.89	61.24	1,003	99,890		複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	97.93	163.3	597	59,497		総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	691.09	732.33	11,682	1,162,605		陸運・鉄道
GILDAN ACTIVEWEAR INC	208.15	217.13	856	85,268		繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	258.68	332.17	1,583	157,585		ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	294.33	1,078	107,324		食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,185.75	2,199.14	1,216	121,028		金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	94.52	132.86	1,134	112,878		商業サービス・用品
FORTIS INC	452	604.84	3,334	331,847		電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	569.14	742.03	2,019	200,937		金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	873	86,895		各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	252.5	342.08	1,228	122,251		保険
IMPERIAL OIL LTD	220.66	272.46	1,925	191,596		石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,964.79	2,517.28	13,356	1,329,257		石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	53.66	124.78	527	52,516		資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,892.5	2,338.61	6,106	607,680		保険
LOBLAW CO LTD	154.86	216	2,535	252,345		食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	788.73	1,012.1	6,476	644,534		食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	302.02	358.44	2,670	265,720		自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	570.83	758.84	5,172	514,742		保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23.2	27.99	2,441	242,970		保険
METRO INC	227.64	286.29	2,036	202,717		食品・生活必需品小売り
EMERA INC	238.36	369.98	2,004	199,529		電力
ONEX CORP	64.89	101.57	679	67,624		資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	187.66	193.23	425	42,325		金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	564.39	655	2,335	232,451		保険
QUEBECOR INC-B	160.42	171.95	548	54,605		メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,394.86	1,719.47	23,874	2,376,024		銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	906.81	1,163.63	12,375	1,231,580		陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	426.01	598.77	2,357	234,663		メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,431.08	1,718.98	7,972	793,436		石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	643.1	687.62	616	61,383		金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	438.24	573.26	3,230	321,538		金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	167.4	199.79	3,309	329,343		専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	93.88	96.65	1,038	103,303		商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) CS	1,778.19	2,251.61	20,973	2,087,307		銀行
TC ENERGY CORP	949.79	1,237.53	6,982	694,862		石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	92.98	81.02	895	89,081		紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	78.86	98.39	1,655	164,756		食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	179.01	215.66	4,295	427,468		保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	470.07	585.39	3,372	335,624		金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	19.31	25.3	6,086	605,773		ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	186.23	231.63	4,204	418,390		金属・鉱業
TOURMALINE OIL CORP	323.64	392.98	2,467	245,567		石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	237.72	245.71	767	76,415		石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	144.97	156.65	473	47,127		石油・ガス・消耗燃料

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALTAGAS LTD	240.53	338.33	843	83,907	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	564.42	681.79	3,209	319,445	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	264.38	362.04	2,857	284,422	複合小売り
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,344.22	1,677.15	4,454	443,312	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	-	749.61	1,209	120,406	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	234.9	341.52	1,134	112,942	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	-	512.43	978	97,404	各種金融サービス
TMX GROUP LTD	47.97	70.4	962	95,760	資本市場
BRP INC	-	43.07	515	51,264	レジャー用品
IVANHOE MINES LTD	619.3	640.27	773	76,973	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	555.64	661.77	6,795	676,243	化学
TFI INTERNATIONAL INC	89.99	93.99	1,602	159,511	陸運・鉄道
LIGHTSPEED COMMERCE INC	113.46	-	-	-	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC	129.91	156.81	2,695	268,262	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	116.6	120.11	1,008	100,348	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	164.85	275.77	1,157	115,157	商業サービス・用品
NUVEI CORP	49.6	79.29	347	34,562	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	108.45	161.03	641	63,798	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	-	425.01	2,012	200,318	資本市場
AIR CANADA	179.4	188.14	427	42,540	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	264.43	353.84	3,141	312,666	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	109.46	1,468.23	9,810	976,362	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	32.93	52.37	1,019	101,433	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	-	-	-	医薬品
HYDRO ONE LTD	357.38	462.25	1,672	166,439	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	86銘柄	309,487	30,800,200	
		86銘柄	-	<3.6%>	
(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	171.34	217.54	1,388	128,725	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	2,757.53	-	-	-	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,565.97	4,377.12	10,443	968,036	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,622.22	2,101.04	4,660	431,945	金属・鉱業
TELSTRA GROUP LTD	3,896.81	4,828.55	1,999	185,289	各種電気通信サービス
ASX LTD	189.26	236.64	1,638	151,894	資本市場
BHP GROUP LTD	3,064.96	6,313	30,125	2,792,345	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	318.28	993	92,044	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	516.04	720.81	1,772	164,290	情報技術サービス
CSL LIMITED	464.24	601.03	18,496	1,714,458	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	58.28	61.34	749	69,461	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,937.86	3,796.33	5,295	490,875	運送インフラ
COCHLEAR LTD	58.75	78.36	1,638	151,858	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,463.6	2,132.29	1,505	139,535	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,728.88	2,112.29	23,076	2,138,985	銀行
RIO TINTO LIMITED	359.15	459.36	5,581	517,323	金属・鉱業
APA GROUP	1,182.05	1,643	1,758	162,949	ガス
ARISTOCRAT LEISU	620.13	766.75	2,763	256,136	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,694.3	2,816.64	1,357	125,837	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	462.46	607.67	1,847	171,227	建設資材
IGO LTD	-	919.47	1,324	122,810	金属・鉱業
ORICA LTD	413.11	638.62	1,010	93,703	化学
LEND LEASE CORP LTD	621.16	1,071.81	841	77,986	不動産管理・開発

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BLUESCOPE STEEL LTD	469.46	503.25	962	89,234	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	1,422.58	—	—	—	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	337.36	466.42	8,939	828,593	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,202.9	1,541.62	1,950	180,759	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,188.61	3,928.66	12,418	1,151,070	銀行
NEWCREST MINING LTD	868.79	1,128.15	2,792	258,806	金属・鉱業
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,074.83	1,126.59	726	67,353	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,336.24	1,724.87	2,292	212,478	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	966.92	1,355.78	1,629	151,052	金属・鉱業
REECE LTD	303.19	315.58	520	48,205	商社・流通業
SANTOS LTD	3,333.93	4,173.58	2,967	275,049	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	406.13	527.74	1,513	140,291	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	247.11	259.85	742	68,788	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	2,145.97	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	1,094.81	1,397.2	6,804	630,696	複合小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	906.41	2,354.31	8,529	790,614	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,204.4	1,543.2	5,598	518,946	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	155.53	—	—	—	資本市場
SEEK LTD	361.4	384.05	935	86,751	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	60.86	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	—	—	—	電力
MINERAL RESOURCES LTD	—	211.79	1,843	170,846	金属・鉱業
BRAMBLES LTD	1,300.28	1,709.29	2,034	188,536	商業サービス・用品
PILBARA MINERALS LTD	—	3,279.47	1,590	147,427	金属・鉱業
CROWN RESORTS LTD	328.61	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	1,502.3	—	—	—	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,381.66	2,228.49	744	68,990	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	759.03	792.33	1,135	105,241	飲料
XERO LTD	140.63	188.6	1,481	137,298	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD	228.52	237.81	746	69,147	各種消費者サービス
LOTTERY CORP LTD	—	2,912.7	1,453	134,719	ホテル・レストラン・レジャー
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,195.74	1,604.7	1,137	105,456	食品・生活必需品小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	3,743.53	9,639	893,493	銀行
MEDIBANK PVT LTD	2,831.54	2,985.76	913	84,685	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,093.17	5,966.94	2,768	256,627	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,227.26	1,716.84	3,095	286,918	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	136.04	148.23	837	77,600	ソフトウェア
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	66,920.43 55銘柄	87,275.27 52銘柄	209,012 —	19,373,402 <2.3%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	2,570	4,060	68,705	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS LTD	1,620	1,972.96	11,383	192,616	電力
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	535	933.14	4,105	69,470	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,164.4	1,518.91	51,217	866,602	資本市場
MTR CORP	1,375	1,924.41	7,986	135,128	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD	758	950.96	11,934	201,932	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,204.5	1,709.72	4,829	81,722	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,460	1,513.2	6,605	111,758	電力
HONG KONG & CHINA GAS	11,754.56	15,364.06	11,861	200,689	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,000	2,609.04	13,984	236,616	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,535	4,199.95	11,129	188,317	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	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,630.66	1,730.66	3,868	65,446	不動産管理・開発
SINO LAND CO	5,054	4,112	4,301	72,775	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,385	1,805.65	20,169	341,261	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	495	530.2	3,528	59,701	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,320	1,801.56	19,312	326,771	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,660	1,780	2,837	48,007	建設関連製品
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	2,172	-	-	-	専門小売り
AIA GROUP LTD	11,750.27	14,933.16	128,873	2,180,534	保険
HKT TRUST / HKT LTD	4,450	4,631.36	4,955	83,847	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	2,520	3,358	9,771	165,338	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	1,330	1,400	2,405	40,695	海運業
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	2,016	4,324	73,167	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,517.5	1,961.35	8,551	144,691	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD	2,038	2,164	3,280	55,508	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,465	1,281	21,688	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,506	2,650	6,280	106,266	飲料
WH GROUP LTD	8,970	9,315	4,387	74,234	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,563.32	3,104.45	15,289	258,696	コンプロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,863.32	2,661.95	13,669	231,281	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	82,613.53 30銘柄	97,686.69 29銘柄	396,186 -	6,703,475 <0.8%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE TECH ENG	1,095	1,442	524	52,483	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,766	2,248.1	7,881	788,105	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	394	320	32,028	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	-	155	441	44,186	コンプロマリット
SINGAPORE EXCHANGE LTD	674	998	916	91,607	資本市場
GENTING SINGAPORE LTD	7,242	7,611.93	776	77,633	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,849	1,307	130,711	コンプロマリット
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,209.53	3,981.98	5,164	516,411	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,084.22	9,433.3	2,358	235,808	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,580.5	1,627	955	95,495	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,113	1,399.66	4,235	423,494	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	436	301	30,124	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	421	438	811	81,109	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,814	2,585	1,028	102,872	食品
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	2,952.15	3,065.9	1,180	118,025	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	32,069.4 14銘柄	37,664.87 15銘柄	28,203 -	2,820,098 <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	1,102.26	1,643.41	1,401	117,837	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	494.49	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FISHER & PAYKEL	573.88	784.6	2,008	168,840	ヘルスケア機器・用品
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,629.43	2,190.38	1,160	97,585	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	628.34	397	33,433	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	1,241.62	1,321.57	708	59,544	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 >	6,659.02 6銘柄	6,568.3 5銘柄	5,677 -	477,242 <0.1%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	352.61	459.63	782	126,580	金属・鉱業
ASHTED GROUP	430.03	543.04	3,034	490,861	商社・流通業

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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
SEVERN TRENT PLC	294.58	293.97	821	132,861		水道
BARCLAYS PLC	16,512.19	20,224.17	3,787	612,744		銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	922.35	1,241.96	571	92,393		家庭用耐久財
BT GROUP PLC	8,502.62	9,041.98	1,250	202,281		各種電気通信サービス
BHP GROUP LTD	2,059.88	—	—	—		金属・鉱業
BUNZL PLC	355.08	385.93	1,168	189,094		商社・流通業
AVIVA PLC	3,815.43	3,486.83	1,544	249,865		保険
CRODA INTERNATIONAL	136.93	167.82	1,148	185,736		化学
DIAGEO PLC	2,277.84	2,829.74	9,960	1,611,240		飲料
SCHRODERS PLC	113.54	1,103.66	548	88,728		資本市場
DCC PLC	106.84	111.35	515	83,413		コンゴロマリット
NATIONAL GRID PLC	3,522.37	4,605.69	4,856	785,619		総合公益事業
KINGFISHER PLC	2,114.6	2,253.92	624	101,029		専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	3,096.99	3,796.23	3,285	531,423		航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,127.07	2,628.77	8,178	1,322,890		タバコ
HALMA PLC	342.01	510.66	1,133	183,381		電子装置・機器・部品
NEXT PLC	131.97	187.51	1,258	203,585		複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	896.52	1,078.89	2,181	352,881		タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	191.07	199.76	445	72,123		化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,255.2	1,574.26	5,058	818,197		金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,721.99	2,209.35	4,190	677,779		ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	19,905.53	24,887.38	15,161	2,452,506		銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,733.2	7,381.79	1,880	304,131		保険
UNILEVER PLC	2,528.12	3,166.86	13,511	2,185,605		パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	677.14	905.69	954	154,342		水道
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	322.09	423.51	808	130,848		食品
PEARSON PLC	637.46	841.59	768	124,319		各種消費者サービス
PERSIMMON PLC	336.88	352.52	496	80,374		家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,544.6	3,339.71	4,286	693,387		保険
RIO TINTO PLC	1,091.55	1,408.39	8,475	1,371,027		金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	27,067.74	32,204.82	3,130	506,358		無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	692.96	886.53	5,088	823,145		家庭用品
RELX PLC	1,892.62	2,404.03	5,820	941,468		専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,934.06	3,121.14	1,561	252,538		商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	7,958.64	11,219.24	1,215	196,545		航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	5,723.46	6,704.64	2,044	330,785		銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	483.93	674.48	842	136,216		資本市場
SSE PLC	999.67	1,315.74	2,275	368,096		電力
BP PLC	19,568.09	23,470.86	13,146	2,126,501		石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	924.78	1,288.93	980	158,666		ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	354	516.95	916	148,177		コンゴロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	76.48	89.36	1,064	172,157		機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,427.25	3,198.02	2,307	373,292		銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	69,189.54	84,778.63	4,552	736,430		銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	3,467.94	5,698.63	679	109,971		家庭用耐久財
TESCO PLC	8,098.05	9,342.47	2,296	371,462		食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	1,019.75	1,247.51	2,047	331,250		資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	880.29	1,076.79	1,239	200,570		ヘルスケア機器・用品
GSK PLC	4,896.01	4,995.5	7,343	1,187,865		医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	317.95	414.94	3,177	514,010		資本市場
WPP PLC	1,134.03	1,427.85	1,406	227,458		メディア

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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	1,508.4	1,930.29	22,233	3,596,423	医薬品
WHITBREAD PLC	187.44	254.7	778	125,990	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	161.39	233.09	1,030	166,767	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	387.64	522.29	1,256	203,187	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	162.86	217.52	1,210	195,775	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,828.62	1,920.97	507	82,158	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	200.87	213.25	474	76,683	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	105.59	164.89	696	112,611	家庭用耐久財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	180.34	184.55	323	52,287	医薬品
AVEVA GROUP PLC	104.08	-	-	-	ソフトウェア
ABRDN PLC	2,063.13	2,858.31	611	98,945	資本市場
EXPERIAN PLC	893.61	1,127.09	3,346	541,302	専門サービス
MONDI PLC	458.75	588.87	870	140,883	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	353.12	369.42	350	56,638	資本市場
OCADO GROUP PLC	449.09	697.66	432	69,991	食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC	1,515.66	1,861.95	1,235	199,929	メディア
GLENCORE PLC	9,681.28	12,257.76	6,323	1,022,934	金属・鉱業
ENTAIN PLC	581.26	744.51	982	158,970	ホテル・レストラン・レジャー
COCA-COLA HBC AG	202.33	213.38	434	70,344	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	565.61	862.23	544	88,147	保険
FERGUSON PLC	216.07	-	-	-	商社・流通業
M&G PLC	2,591.17	2,704.01	541	87,611	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,354.9	2,521.8	449	72,733	専門小売り
HALEON PLC	-	6,227.66	2,043	330,523	パーソナル用品
SHELL PLC	7,503.11	9,059.72	23,197	3,752,413	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	1,046.24	1,108.33	670	108,466	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,701.29	4,872.07	689	111,517	コングロメリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	284,167.37 79銘柄	351,435.94 77銘柄	237,063 -	38,347,464 <4.5%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,077.44	1,467.03	4,442	167,607	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,436.45	1,803.43	5,345	201,686	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	-	2,877.73	1,576	59,501	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	21.98	36.62	2,123	80,125	航空宇宙・防衛
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	-	125.74	1,805	68,128	半導体・半導体製造装置
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,061.43	1,629.44	2,916	110,050	銀行
ICL GROUP LTD	680.48	1,030.67	2,754	103,948	化学
NICE LTD	61.29	76.4	5,898	222,541	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	167.84	174.4	1,993	75,212	銀行
AZRIELI GROUP	44.14	46.72	1,000	37,759	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,551.05 8銘柄	9,268.18 10銘柄	29,857 -	1,126,561 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,530.13	4,515.99	1,256	181,054	資本市場
LOGITECH INTL-REG	180.08	237.34	1,270	183,059	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	2,745.36	3,418.82	38,051	5,481,694	食品
CIE FINANCIERE RICHEMONT	508.16	644.58	9,185	1,323,229	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	680.16	872.21	24,282	3,498,111	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	41.22	52.36	1,049	151,236	機械
SIKA INHABER	138.38	177.93	4,562	657,219	化学
SGS SA-REG	6.13	7.48	1,629	234,694	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		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
NOVARTIS AG-REG SHS	2,138.86	2,693.94	21,664	3,121,011	医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	42.59	56.75	862	124,184	保険	
BARRY CALLEBAUT AG	3.29	4.6	885	127,631	食品	
CLARIANT AG-REG	199.79	210.72	332	47,932	化学	
SWISSCOM AG-REG	24.19	34.31	1,954	281,536	各種電気通信サービス	
ABB LTD	1,605.91	1,945.38	6,052	871,862	電気設備	
ADECCO GROUP AG-REG	140.95	198.42	685	98,816	専門サービス	
GEBERIT AG	35.39	43.77	2,263	326,120	建設関連製品	
LONZA GROUP AG-REG	71.69	90.27	4,935	711,074	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDT & SPRUENGLI PART	1.1	1.37	1,397	201,309	食品	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.1	0.13	1,340	193,083	食品	
GIVAUDAN-REG	9.01	11.73	3,374	486,162	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	147.34	187.71	8,225	1,184,958	保険	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	36.04	36.12	1,091	157,248	医薬品	
HOLCIM LTD	511.47	666.07	3,714	535,039	建設資材	
TEMENOS GROUP	67.53	70.82	495	71,355	ソフトウェア	
BACHEM HOLDING AG	5	46.73	417	60,217	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SONOVA HOLDING AG	52.1	69.84	1,601	230,702	ヘルスケア機器・用品	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	49.34	68.87	1,683	242,479	海運業	
STRAUMANN HOLDING AG	11.25	145.31	1,870	269,412	ヘルスケア機器・用品	
THE SWATCH GROUP AG-B	29.91	31.3	1,017	146,545	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	92.59	550	79,364	繊維・アパレル・贅沢品	
SCHINDLER NAMEN	14.94	27.2	521	75,155	機械	
SWISS LIFE HOLDING AG	30.53	39.78	2,183	314,501	保険	
BANQUE CANTONALE VAUD	-	49.03	412	59,366	銀行	
VIFOR PHARMA AG	52.56	-	-	-	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING	6.16	8.1	575	82,907	化学	
SWISS PRIME SITE AG	80.4	83.72	680	98,053	不動産管理・開発	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	21.76	28.52	2,655	382,509	資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	210.08	260.31	1,588	228,826	資本市場	
SWISS RE LTD	292.13	381.39	3,632	523,277	保険	
BKW AG	-	31.94	419	60,368	電力	
SIG GROUP AG	-	383.22	844	121,675	容器・包装	
ALCON INC	485.73	612.85	4,243	611,300	ヘルスケア機器・用品	
UBS GROUP AG	3,427.79	4,189.21	8,483	1,222,082	資本市場	
VAT GROUP AG	24.12	33.25	956	137,760	機械	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	16,704.59 41銘柄	22,761.98 43銘柄	174,900 -	25,196,133 <2.9%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	104.57	125.49	12,408	237,497	飲料	
A P MOLLER A/S	5.27	6.63	10,226	195,740	海運業	
AP MOLLER MAERSK A	3.41	3.59	5,463	104,580	海運業	
DANSKE BANK A/S	687.25	853.71	12,626	241,668	銀行	
GENMAB A/S	62.51	79.26	21,685	415,061	バイオテクノロジー	
NOVOZYMES-B SHS	191.32	238.59	8,259	158,096	化学	
ROCKWOOL AS	8.13	8.73	1,495	28,614	建設関連製品	
NOVO NORDISK A/S-B	1,640.82	2,063.49	205,110	3,925,822	医薬品	
GN STORE NORD A/S	104.48	-	-	-	ヘルスケア機器・用品	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	979.91	1,254.36	26,115	499,855	電気設備	
COLOPLAST-B	119.22	153.43	12,378	236,928	ヘルスケア機器・用品	
DSV A/S	198.61	238.42	30,505	583,881	航空貨物・物流サービス	

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		
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円		
DEMANT A/S	107.39	113.67	2,441	46,732	ヘルスケア機器・用品	
TRYG A/S	357.84	448.87	7,085	135,614	保険	
PANDORA A/S	92.65	124.73	7,902	151,261	繊維・アパレル・贅沢品	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	89.84	125.38	6,200	118,668	化学	
AMBU A/S B	141.56	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
ORSTED A/S	192.05	232.4	14,545	278,408	電力	
小 計	株 数 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,086.83	6,070.75	384,453	7,358,435	
		18銘柄	16銘柄	—	<0.9%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円		
MOWI ASA	432.02	563.75	9,995	131,038	食品	
NORSK HYDRO ASA	1,290.36	1,629.71	12,516	164,087	金属・鉱業	
TELENOR ASA	674.35	859.54	9,897	129,757	各種電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA	75.37	—	—	—	メディア	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	111.85	4,637	60,795	航空宇宙・防衛	
ORKLA ASA	694.4	1,160.68	8,059	105,663	食品	
EQUINOR ASA	943.06	1,156.17	37,939	497,389	石油・ガス・消耗燃料	
YARA INTERNATIONAL ASA	151.93	198.34	9,153	120,000	化学	
AKER BP ASA	152.17	387.23	11,407	149,556	石油・ガス・消耗燃料	
SALMAR ASA	—	72.48	3,254	42,664	食品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	294.84	257.21	4,740	62,146	保険	
ADEVINTA ASA	222.65	243.82	2,156	28,272	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
DNB BANK ASA	895.96	1,193.19	23,088	302,686	銀行	
SCHIBSTED ASA	74.45	—	—	—	メディア	
小 計	株 数 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,901.56	7,833.97	136,846	1,794,058	
		12銘柄	12銘柄	—	<0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円		
ATLAS COPCO AB-A SHS	636.97	3,341.22	42,132	540,563	機械	
ATLAS COPCO AB-B SHS	401.9	1,942.04	21,568	276,721	機械	
ERICSSON LM-B SHS	2,794.5	3,665.51	21,978	281,982	通信機器	
GETINGE AB-B SHS	244.21	257.55	6,145	78,842	ヘルスケア機器・用品	
INVESTOR AB-A SHS	557.33	584.37	12,184	156,322	各種金融サービス	
LUNDBERGS B	73.82	78.59	3,887	49,870	各種金融サービス	
SKF AB-B SHS	322.28	465.94	9,290	119,201	機械	
SANDVIK AB	1,143.71	1,333.5	28,736	368,694	機械	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,664.38	1,958.37	24,469	313,947	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	319.68	439.37	8,424	108,091	建設・土木	
SWEDBANK AB	893.78	1,122.96	22,863	293,338	銀行	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	543.82	702.11	10,675	136,967	紙製品・林産品	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,340.2	1,844.99	19,510	250,323	銀行	
VOLVO AB-A SHS	236.91	241.98	5,192	66,624	機械	
VOLVO AB-B SHS	1,342.82	1,916.25	39,350	504,862	機械	
HOLMEN AB-B SHS	—	101.42	4,404	56,511	紙製品・林産品	
SWEDISH MATCH AB	1,583.29	—	—	—	タバコ	
TELE2 AB-B SHS	460.83	644.16	6,022	77,273	無線通信サービス	
INDUSTRIVARDEN A	142.73	152.92	4,388	56,308	各種金融サービス	
INDUSTRIVARDEN C	119.4	213.25	6,096	78,222	各種金融サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	252.19	269.07	3,426	43,959	家庭用耐久財	
SECURITAS AB-B SHS	483.54	760.85	7,048	90,432	商業サービス・用品	
INVESTOR AB-B SHS	1,694.19	2,263.92	46,150	592,104	各種金融サービス	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	662.7	822.87	10,511	134,860	専門小売り	
ASSA ABLOY AB-B	1,010.25	1,246.12	31,738	407,207	建設関連製品	

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	千ユーロ	千円	
TELIA CO AB	2,699.54	3,448.1	9,092	116,658	各種電気通信サービス
ORRON ENERGY AB	207.62	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BOLIDEN AB	240.47	362.6	15,936	204,462	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	279.3	353.13	12,197	156,488	機械
KINNEVIK AB-B	214.49	362.78	5,918	75,937	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	114.01	729.42	4,212	54,045	不動産管理・開発
INDUTRADE AB	—	391.78	9,242	118,576	機械
HUSQVARNA AB-B SHS	451.58	477.69	4,326	55,514	機械
NIBE INDUSTRIER AB	1,340.88	1,858.45	21,400	274,562	建設関連製品
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	—	183.8	4,466	57,303	バイオテクノロジー
HEXAGON AB-B SHS	1,852.43	2,481.63	29,531	378,887	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	183.48	280.22	7,577	97,214	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	593.63	845.63	17,301	221,979	機械
EPIROC AB-B	389.43	412.05	7,293	93,572	機械
ESSITY AB-B	576.54	751.8	20,907	268,243	家庭用品
EQT AB	300.03	407.16	10,007	128,402	資本市場
EMBRACER GROUP AB	491.42	797.91	4,016	51,533	娯楽
VOLVO CAR AB	—	637.1	3,147	40,379	自動車
LIFCO AB	257.38	268.35	5,825	74,746	コンプロマリット
EVOLUTION AB	161.47	223.26	29,648	380,395	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	3,102.72	4,203.56	52,779	677,166	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	149.45	155.39	3,653	46,870	コンプロマリット
SINCH AB	562.99	—	—	—	ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	674,682	8,656,179	
			45銘柄	<1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	755.8	907.48	3,966	565,715	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	175.84	199.53	2,893	412,626	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	149.68	207.61	1,766	251,975	食品
KINGSPAN GROUP PLC	143.07	174.51	1,044	148,933	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	242.28	324.22	1,192	170,025	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	1,345.37	1,329	189,650	銀行
AIB GROUP PLC	—	1,475.78	580	82,843	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	12,773	1,821,770	
			7銘柄	<0.2%>	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	575.35	733.77	8,510	1,213,733	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	168.59	222.01	2,630	375,207	化学
ING GROEP NV-CVA	3,804.32	4,707.18	6,145	876,498	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	42.71	59.78	1,940	276,705	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	112.39	155.84	921	131,488	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,063.9	1,258.84	3,459	493,364	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	245.94	320.26	2,921	416,651	飲料
AKZO NOBEL	187.17	226.27	1,565	223,248	化学
ASML HOLDING NV	403.14	506.05	31,430	4,482,655	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,893.23	2,324.33	1,195	170,521	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	886.59	1,155.12	1,829	260,986	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	266.29	320.47	3,280	467,795	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	650.99	869.19	3,963	565,337	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	204.27	274.12	1,240	176,865	ライフサイエンス・ツール/サービス
KONINKLIJKE KPN NV	3,414.47	4,757.39	1,500	213,930	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)		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…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HEINEKEN HOLDING NV-A	106.67	108.53	831	118,565	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	553.04	577.75	593	84,664	飲料
OCI NV	-	123.29	360	51,344	化学
FERRARI NV	120.5	154.35	3,792	540,869	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	1,061.55	1,246.04	1,885	268,875	機械
PROSUS NV	906.79	1,025.26	7,618	1,086,580	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV	73.08	143.85	395	56,336	食品
EXOR NV	-	141.42	1,072	153,004	各種金融サービス
EURONEXT NV	96.19	100.81	776	110,706	資本市場
IMCD NV	53.59	68.23	1,031	147,132	商社・流通業
NN GROUP NV	281.24	362.89	1,449	206,762	保険
ARGENX SE	42.55	67.53	2,358	336,319	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	679.41	925.02	2,096	298,945	娯楽
STELLANTIS NV	1,962.48	2,806.95	4,372	623,549	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	160.29	226.7	476	67,994	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV	343.82	528.35	853	121,733	銀行
EXOR NV	99.66	-	-	-	各種金融サービス
ADYEN NV	19.2	25.93	3,550	506,348	情報技術サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,479.41 31銘柄	26,523.52 32銘柄	106,049 -	15,124,722 <1.8%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	177.49	242.9	781	111,409	化学
DIETEREN TRDG	-	27.36	498	71,056	販売
KBC GROUPE	265.87	322.13	2,279	325,086	銀行
SOFINA	13.82	22.81	531	75,733	各種金融サービス
SOLVAY SA	69.31	90.7	979	139,704	化学
AGEAS	170.55	181.36	792	113,058	保険
UCB SA	127.78	167.32	1,299	185,321	医薬品
COLRUYT NV	46.73	-	-	-	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	107.14	113.18	896	127,874	各種金融サービス
PROXIMUS	137.39	-	-	-	各種電気通信サービス
ELIA GROUP	28.62	40.78	530	75,666	電力
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	740.93	1,053.27	5,762	821,839	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,885.63 11銘柄	2,261.81 10銘柄	14,351 -	2,046,752 <0.2%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	639.79	668.78	1,862	265,589	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	139.43	178.24	1,203	171,588	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	529.85	558.55	904	129,010	エネルギー設備・サービス
AROUNDTOWN SA	1,060.18	1,132.25	292	41,662	不動産管理・開発
INPOST SA	203.95	-	-	-	航空貨物・物流サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,573.2 5銘柄	2,537.82 4銘柄	4,262 -	607,850 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	465.78	653.17	9,434	1,345,532	化学
AXA SA	1,895.06	2,280.92	6,436	918,010	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	674.38	837.2	2,349	335,040	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	29.5	31.2	498	71,062	航空宇宙・防衛
DANONE	632.31	791.5	4,010	571,981	食品
SAFRAN SA	333.08	425.57	5,522	787,575	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	173.8	183.05	551	78,659	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BOUYGUES	202.22	291.23	898	128,177	建設・土木
BNP PARIBAS	1,099.14	1,390.23	8,950	1,276,491	銀行
THALES SA	104.48	128.86	1,642	234,227	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	155.19	198.39	3,669	523,304	情報技術サービス
EIFFAGE	84.77	117.84	1,213	173,021	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	253.45	294.05	2,203	314,278	メディア
FAURECIA	107.74	—	—	—	自動車部品
L'OREAL	245.54	301.22	11,679	1,665,773	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	270.69	344.54	27,924	3,982,658	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	708.07	1,148.08	586	83,588	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	162.26	869.08	2,559	364,965	自動車部品
PERNOD-RICARD	204.47	248.88	4,657	664,293	飲料
RENAULT SA	190.19	279.02	1,174	167,532	自動車
REMY COINTREAU	18.47	28.66	473	67,484	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	491.74	614.6	3,243	462,639	建設関連製品
SEB SA	24.39	25.96	252	35,987	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	788.64	1,004.09	2,661	379,631	銀行
VINCI S.A.	523.44	667.67	7,185	1,024,790	建設・土木
SODEXO	93.25	98.22	846	120,666	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	528.92	678.65	10,280	1,466,160	電気設備
VIVENDI SE	687.46	989.44	965	137,698	メディア
TOTALENERGIES SE	2,445.35	3,100.9	18,599	2,652,617	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	253.93	265.7	548	78,251	自動車部品
ORANGE	1,917.27	2,554.81	2,535	361,634	各種電気通信サービス
HERMES INTL	30.76	39.16	6,706	956,431	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	645.96	819	3,100	442,226	ソフトウェア
KERING	72.93	93.82	5,267	751,187	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	—	—	—	保険
CARREFOUR SA	611.89	755.72	1,240	176,976	食品・生活必需品小売り
SANOFI	1,108.56	1,424.61	12,552	1,790,200	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	71.51	110.32	219	31,310	娯楽
TELEPERFORMANCE	59.18	78.45	2,020	288,216	専門サービス
EURAZEO	30.08	56.73	366	52,226	各種金融サービス
ESSILORLUXOTTICA	278.64	356.82	6,115	872,248	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,149.26	1,437.2	1,661	237,031	銀行
ORPEA	49.32	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	54.49	546	77,946	各種金融サービス
BIOMERIEUX	46.12	48.7	470	67,080	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	24.56	31.09	1,065	151,955	ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,774.63	2,217.51	2,935	418,729	総合公益事業
ALSTOM	285.33	370.07	995	141,976	機械
ELECTRICITE DE FRANCE	415.49	—	—	—	電力
IPSEN SA	36.46	38.73	408	58,219	医薬品
ARKEMA SA	60.09	63.92	583	83,231	化学
LEGRAND SA	259.78	327.83	2,858	407,611	電気設備
ADP	23.13	39.75	571	81,493	運送インフラ
BUREAU VERITAS SA	298.1	397.29	1,030	146,923	専門サービス
GETLINK	415.25	635.09	1,055	150,538	運送インフラ
EDENRED	248.65	310.91	1,593	227,208	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	80.92	172.93	665	94,904	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	235.7	299.16	1,210	172,584	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AMUNDI SA	59.24	104.36	661	94,363	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,298.59 59銘柄	31,126.39 55銘柄	199,457 -	28,446,562 <3.3%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	184.33	219.74	3,050	435,052	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	329.21	415.77	4,063	579,570	自動車
COMMERZBANK AG	1,062.15	1,410.36	1,420	202,654	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	388.3	489.48	1,385	197,561	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	98.82	100.1	196	28,074	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	-	-	-	化学
HANNOVER RUECK SE	53.21	71.05	1,273	181,687	保険
GEA GROUP AG	164.92	174.9	720	102,795	機械
CONTINENTAL AG	97.95	129.21	883	125,973	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	959.37	1,247.72	5,118	729,950	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	159.12	168.54	931	132,829	自動車
MERCK KGAA	123.64	162.3	3,051	435,167	医薬品
RWE AG	644.26	778.53	3,070	437,917	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SAP SE	1,015.97	1,300.68	14,294	2,038,677	ソフトウェア
E.ON SE	2,086.41	2,802.87	2,812	401,144	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	103.66	133.76	851	121,424	家庭用品
SIEMENS AG-REG	746.31	953.29	13,824	1,971,666	コングロマリット
PUMA AG	104.48	162.1	988	141,024	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	948.61	1,213.29	7,335	1,046,196	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	175	196.44	1,315	187,652	家庭用品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	827.56	995.29	7,114	1,014,646	自動車
BASF SE	895.92	1,164.08	5,943	847,703	化学
BEIERSDORF AG	103.42	129.4	1,461	208,449	パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	140.32	208.09	1,308	186,554	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	188.36	238.55	890	127,072	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	401.57	509.4	11,214	1,599,403	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	702.48	723.42	697	99,439	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	135.09	176.12	5,722	816,091	保険
RHEINMETALL STAMM	-	55.96	1,324	188,910	航空宇宙・防衛
VOLKSWAGEN AG	31.53	33.15	556	79,404	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	179.03	222.69	2,899	413,515	自動車
NEMETSCHKE SE	48.41	98.78	507	72,355	ソフトウェア
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,132.85	2,537.16	2,930	418,008	資本市場
BMW VORZUG	69.57	78.21	703	100,277	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,241.17	4,033.92	8,273	1,179,976	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	26.86	28.47	1,251	178,535	ライフサイエンス・ツール/サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,266.18	1,590.23	5,699	812,846	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4.79	5.16	318	45,369	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG	35.01	48.66	649	92,612	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	75.33	81.39	328	46,907	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	196.7	238.84	4,088	583,164	資本市場
LANXESS AG	71.94	-	-	-	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	48.07	72.94	1,590	226,778	航空宇宙・防衛
SYMRISE AG	121.06	172.65	1,647	234,955	化学
BRENNTAG SE	163.1	179.34	1,267	180,781	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	233.4	246.87	496	70,769	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	983.85	1,054.74	292	41,713	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LEG IMMOBILIEN SE	61.13	82.09	588	83,920	不動産管理・開発
KION GROUP AG	75.08	—	—	—	機械
VONOVIA SE	700.86	859.37	2,226	317,561	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	68.6	103.42	650	92,716	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	284.75	343.18	1,756	250,497	ヘルスケア機器・用品
DR ING HC F PORSCHE AG	—	151.74	1,732	247,142	自動車
SIEMENS ENERGY AG	357.61	590.14	1,121	159,914	電気設備
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	378.31	566.93	1,760	251,016	機械
ZALANDO SE	208.57	313.21	1,241	177,027	インターネット販売・通信販売
SCOUT24 SE	96.7	100.48	525	75,005	インタラクティブ・メディアおよびサービス
COVESTRO AG	191.58	275.58	1,147	163,658	化学
HELLOFRESH SE	169.9	178.56	387	55,287	食品・生活必需品小売り
UNIPER SE	104.27	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	166.45	225.64	947	135,159	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	149,853	21,372,171	
	<比率>	<比率>	—	<2.5%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	331.35	346.44	671	95,705	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,686.36	3,179.56	1,469	209,547	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	382.82	594.06	683	97,433	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	2,823	402,687	
	<比率>	<比率>	—	<0.0%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	5,945.92	7,795.92	8,380	1,195,243	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	212.06	—	—	—	電気設備
REPSOL SA	1,502.89	1,787.13	2,756	393,153	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	5,375.23	6,649.75	2,435	347,299	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	286.39	377.01	697	99,446	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	228.77	235.71	645	92,043	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	6,440.62	7,351.18	5,053	720,792	銀行
ACCIONA S.A.	—	26.42	490	69,896	電力
NATURGY ENERGY GROUP SA	162.89	176.77	464	66,279	ガス
BANCO SANTANDER SA	16,741.54	20,668.57	7,233	1,031,713	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	462.37	490.11	794	113,272	電力
INDITEX	1,042.55	1,363.21	3,856	550,017	専門小売り
ENAGAS	234.77	382.7	645	92,050	ガス
GRIFOLS SA	306.87	319.82	433	61,805	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	464.37	635.13	1,743	248,648	建設・土木
CAIXABANK	4,097.23	5,660.59	2,263	322,844	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	279.72	396.88	765	109,243	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMADEUS IT GROUP SA	467.67	547.12	3,228	460,378	情報技術サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	—	98.22	365	52,194	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AENA SME SA	70.76	99.89	1,405	200,516	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	487.6	695.72	2,678	382,010	各種電気通信サービス
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	46,338	6,608,848	
	<比率>	<比率>	—	<0.8%>	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,117.77	1,446.13	2,639	376,400	保険
INTESA SANPAOLO	15,981.58	20,509.73	5,131	731,859	銀行
UNICREDIT SPA	2,056.36	2,411.49	4,563	650,915	銀行
ENI SPA	2,418.13	3,151.96	4,673	666,476	石油・ガス・消耗燃料

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MEDIOBANCA SPA	574.42	867.92	903	128,857	銀行
ENEL SPA	7,880.51	10,193.43	5,484	782,137	電力
SNAM SPA	1,989.63	2,564.15	1,230	175,498	ガス
TELECOM ITALIA SPA	8,325.8	9,082.86	268	38,343	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	457.18	—	—	—	運送インフラ
TERNA SPA	1,671.4	1,660.64	1,225	174,740	電力
RECORDATI SPA	103.03	109.08	447	63,861	医薬品
AMPLIFON SPA	113.72	123	336	47,960	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	218.22	307.28	1,139	162,456	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	22.23	24.29	286	40,912	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	228.55	250.14	1,418	202,277	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	435.86	835.76	651	92,972	情報技術サービス
FINECOBANK SPA	652.74	751.8	1,250	178,309	銀行
POSTE ITALIANE SPA	557.49	588.89	600	85,583	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	232.81	418.79	440	62,833	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	45,037.43 19銘柄	55,297.34 18銘柄	32,691 4,662,399 <0.5%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	238.04	352.52	717	102,262	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	486.12	509.56	480	68,531	機械
UPM-KYMMENE OYJ	559.82	677.58	2,362	336,971	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	555.48	749.6	1,040	148,334	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	499.85	583.96	2,647	377,528	保険
FORTUM OYJ	408.2	541.94	783	111,686	電力
NOKIA OYJ	5,106.9	6,795.69	2,964	422,862	通信機器
ELISA OYJ	136.42	202.42	1,074	153,237	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	432.9	505.99	2,342	334,120	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	319.56	438.14	2,149	306,501	機械
ORION OYJ	81.06	135.59	632	90,269	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,824.35 11銘柄	11,492.99 11銘柄	17,194 2,452,304 <0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	170.07	172.58	811	115,682	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	69.16	73.2	570	81,325	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	105.93	351	50,157	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	315.46	456.86	1,634	233,133	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	195.72	—	—	—	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	849.16 5銘柄	808.57 4銘柄	3,367 480,299 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,063,294.07 1,228銘柄	1,372,550.07 1,212銘柄	— 817,729,794 <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	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率	
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13.788	18.835	3,109	412,881		0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	14.801	18.531	1,340	178,009		0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	150.15	58.993	1,280	170,069		0.0	
PROLOGIS INC	72.03	115.173	14,711	1,953,479		0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13.356	16.932	3,049	404,891		0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	10.44	13.271	1,622	215,435		0.0	
EQUINIX INC	8.702	11.399	8,303	1,102,589		0.1	
DUKE REALTY TRUST	35.306	—	—	—		—	
CROWN CASTLE INC	42.028	54.164	7,530	1,000,036		0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6.132	8.345	1,993	264,655		0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	34.397	46.054	3,053	405,458		0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49.946	68.971	1,789	237,575		0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	10.551	13.584	3,901	518,092		0.1	
WELLTOWER INC	40.744	58.944	4,465	592,908		0.1	
KIMCO REALTY	—	79.991	1,713	227,523		0.0	
IRON MOUNTAIN INC	28.44	34.514	1,835	243,775		0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16.573	20.486	1,468	195,048		0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	75.616	91.777	1,700	225,826		0.0	
MID AMERICA	11.699	13.578	2,320	308,082		0.0	
REALTY INCOME CORP	53.267	76.685	5,038	669,125		0.1	
REGENCY CENTERS CORP	14.665	19.311	1,269	168,603		0.0	
UDR INC	28.289	41.516	1,853	246,151		0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	31.871	40.894	5,128	681,015		0.1	
PUBLIC STORAGE	15.276	19.317	5,812	771,788		0.1	
SUN COMMUNITIES INC	11.066	14.694	2,335	310,087		0.0	
VENTAS INC	40.408	48.092	2,444	324,671		0.0	
VORNADO REALTY TRUST	15.123	—	—	—		—	
WEYERHAEUSER CO	72.184	89.893	2,945	391,171		0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	13.998	16.256	2,600	345,295		0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	27.36	36.258	4,090	543,242		0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	54.08	72.327	875	116,212		0.0	
AGNC INVESTMENT CORP	44.32	—	—	—		—	
AMERICAN TOWER CORP	44.301	58.087	12,497	1,659,532		0.2	
WP CAREY INC	19.446	23.664	1,982	263,296		0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	42.371	870	115,623		0.0	
AMERICAN HOMES 4 RENT	—	42.177	1,443	191,711		0.0	
INVITATION HOMES INC	55.207	76.646	2,533	336,478		0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	—	30.095	1,600	212,563		0.0	
VICI PROPERTIES INC	57.882	120.602	4,122	547,383		0.1	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	金額 1,233.442	金額 1,612.427	金額 124,635	金額 16,550,295	比率 —
(カナダ)			千カナダ・ドル	千円		%	
CANADIAN APT PPTYS REIT	8.22	8.722	431	42,984		0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13.467	14.424	320	31,881		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	金額 21.687	金額 23.146	金額 752	金額 74,865	比率 —
			2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	比率	
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%	
MIRVAC GROUP	414.125	432.802	960	89,058		0.0	
GPT GROUP	207.292	219.223	1,008	93,470		0.0	
STOCKLAND	243.481	259.328	1,011	93,744		0.0	
DEXUS	101.202	163.989	1,393	129,201		0.0	
GOODMAN GROUP	158.185	214.602	4,268	395,641		0.0	
VICINITY CENTRES	371.711	545.645	1,096	101,657		0.0	
SCENTRE GROUP	479.376	647.197	1,922	178,166		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	1,975.372 7銘柄<0.1%>	2,482.786 7銘柄<0.1%>	11,661	1,080,940	-	0.1	
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	199.7	262.516	14,175	239,855		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	199.7 1銘柄<0.0%>	262.516 1銘柄<0.0%>	14,175	239,855	-	0.0	
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	545.177	787.231	1,542	154,281		0.0	
CAPLAND ASCENDAS REIT	248.606	440.678	1,225	122,496		0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	484.5	474.1	787	78,692		0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	192.3	405.5	701	70,144		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	1,470.583 4銘柄<0.0%>	2,107.509 4銘柄<0.0%>	4,256	425,615	-	0.0	
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%	
BRITISH LAND CO PLC	75.77	119.111	533	86,260		0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	74.028	77.092	541	87,641		0.0	
SEGRO PLC	120.36	165.081	1,370	221,692		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	270.158 3銘柄<0.1%>	361.284 3銘柄<0.0%>	2,445	395,594	-	0.0	
(ベルギー)	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
WAREHOUSES DE PAUW	-	27.206	806	115,006		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	- 1銘柄<-%>	27.206 1銘柄<0.0%>	806	115,006	-	0.0	
(フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
GECINA SA	4.763	5.045	556	79,362		0.0	
KLEPIERRE	17.099	25.279	607	86,707		0.0	
COVIVIO	4.663	5.066	323	46,168		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12.92	13.535	822	117,269		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	39.445 4銘柄<0.0%>	48.925 4銘柄<0.0%>	2,310	329,508	-	0.0	
合計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
	5,210.387 56銘柄<2.1%>	6,925.799 58銘柄<2.2%>	-	19,211,682	-	2.2	

(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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期		末	
			買	建 額	売	建 額
外 国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T			百万円 14,918		百万円 -
	S & P / T S E 6 0 I X F U T			770		-
	S P I 2 0 0 F U T U R E S			767		-
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E			949		-
	D J E U R O S T O X X 5 0			3,157		-

(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

2023年2月15日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
株 式	千円	%		
株 式	817,729,794	95.5		
投資信託受益証券、投資証券	19,211,682	2.2		
コール・ローン等、その他	19,565,080	2.3		
投資信託財産総額	856,506,557	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、856,083,494千円、100.0%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、2023年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=132.79円、1カナダ・ドル=99.52円、1オーストラリア・ドル=92.69円、1香港・ドル=16.92円、1シンガポール・ドル=99.99円、1ニュージーランド・ドル=84.06円、1イギリス・ポンド=161.76円、1イスラエル・シケル=37.731円、1スイス・フラン=144.06円、1デンマーク・クローネ=19.14円、1ノルウェー・クローネ=13.11円、1スウェーデン・クローナ=12.83円、1ユーロ=142.62円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月15日)現在

項目	当期末
(A) 資産	858,116,339,350円
株	12,369,982,821
信託受益証券(評価額)	817,729,794,487
投資信託	1,506,555,624
資産	17,705,126,582
取配	2,253,291,522
入委	828,275,858
配託	5,723,312,456
(B) 負債	1,894,762,474
未払	1,620,859,674
純資産	273,902,800
(C) 元本	856,221,576,876
次元	137,221,085,885
受1	719,000,490,991
1万口当たり基準価額(C/D)	137,221,085,885円 62,397円

(注1) 期首元本額 113,101,593,550円
追加設定元本額 64,603,879,550円
一部解約元本額 40,484,387,215円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,359,545,916円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,537,466円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,392,849円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	27,472,521円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,134,515円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,285,405円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,312,714円
たわらノーロード先進国株式<ラップ向け>	43,143,503,610円
たわらノーロード先進国株式<為替ヘッジあり>	371,248,659円
たわらノーロードバランス(8資産均等型)	3,124,755,370円
たわらノーロードバランス(堅実型)	812,932,249円
たわらノーロードバランス(標準型)	86,757,879円
たわらノーロードバランス(積極型)	734,327,287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)	932,352,496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)	1,133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)	72,512,085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)	283,171,883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)	250,978,945円
たわらノーロード最適化バランス(保守型)	420,410,827円
たわらノーロード最適化バランス(安定型)	9,144円
たわらノーロード最適化バランス(安定成長型)	661,599円
たわらノーロード最適化バランス(成長型)	3,497,348円
たわらノーロード最適化バランス(積極型)	20,654,116円
たわらノーロード全世界株式	17,996,669円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	612,427,800円
One DC 先進国株式インデックスファンド	55,311,292,707円
One グローバルバランス	2,776,530,848円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	5,702,978円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	154,579,488円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	796,155,072円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,045,740,545円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	93,160,102円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	255,168,934円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	248,526,364円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	629,832,963円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	123,209,099円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	166,603,009円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	197,017,429円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	318,946,273円
投資のソムリエ	5,236,697,696円
クルーズコントロール	101,484,005円
投資のソムリエ<DC年金>	385,311,092円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	204,497,778円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	236,289,352円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	318,178,644円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,347,351,737円
ワールドアセットバランス(基本コース)	144,201,865円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	187,755,370円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	21,116,295円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,603,461円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,240,319円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,119,092円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,118,314円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	279,203,327円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,235,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	22,279,679円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,365,527円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,977,782円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	103,657,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,508,385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)	39,207,354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)	39,983,263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)	24,499,490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)	38,551,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド11/2021-04(適格機関投資家限定)	98,803,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド11/2021-09(適格機関投資家限定)	34,816,455円
MSCI ココア/インドネシア<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	381,034,312円
DIAM外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	40,471,840円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,108,533,199円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,337,819円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,060,739,404円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	140,711,864円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付)(適格機関投資家限定)	1,328,457円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,043,021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)	66,464,123円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOF:5用)(適格機関投資家専用)	2,713,784円
しあわせの歩一・私募(適格機関投資家限定)	3,660,019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)	25,277,114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)	49,829,008円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,710,694円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	15,007,497円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,142,119円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,882円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,280,399円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	22,060,605円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	154,952,415円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	252,239,956円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	852,113,757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)	43,996,613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)	35,704,735円
DIAM アジア グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	248,901,994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)	9,152,563円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	164,151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)	102,331,680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)	8,974,317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)	30,241,885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)	45,713,631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)	95,203,048円
動的パッケージファンド<DC年金>	9,995,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,688,753,509円
MHAM外国株式インデックスファンド	140,194,506円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	6,728,106円
MHAM動的パッケージファンド【適格機関投資家限定】	1,261,770,351円
MHAM外国株式パッシブファンド【適格機関投資家限定】	1,390,845,054円
期末元本合計	137,221,085,885円

■損益の状況

当期 自2022年2月16日 至2023年2月15日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	13,816,691,400円	
	受取配当金	13,694,195,113	
	受取利息	30,845,985	
	その他の収益	92,260,263	
	支払利息	△609,961	
(B)	有価証券売買損益	54,267,691,472	
	売買益	136,086,810,742	
	売買損	△81,819,119,270	
(C)	先物取引等取引損益	102,052,001	
	取引益	5,493,726,731	
	取引損	△5,391,674,730	
(D)	その他費用	△165,932,544	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	68,020,502,329	
(F)	前期繰越損益金	529,540,902,616	
(G)	解約差損益金	△195,178,469,975	
(H)	追加信託差損益金	316,617,556,021	
(I)	計(E+F+G+H)	719,000,490,991	
	次期繰越損益金(I)	719,000,490,991	

(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20期（決算日 2023年2月21日）

（計算期間 2022年2月22日～2023年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第20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	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円ベース、為替ヘッジなし（ベンチマーク）	騰落率			
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
20期（2023年2月21日）	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822

（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いません。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）。

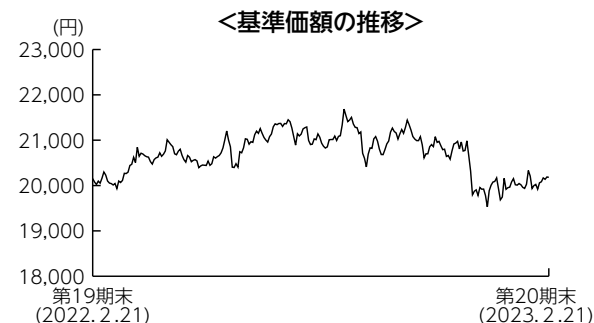
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2022 年 2 月 21 日	円 20,152	% -	ポイント 126,280.23	% -	% 98.9	% -
2 月 末	20,052	△0.5	125,907.80	△0.3	98.8	-
3 月 末	20,713	2.8	129,775.21	2.8	98.3	-
4 月 末	20,758	3.0	129,955.37	2.9	99.0	-
5 月 末	20,634	2.4	129,451.47	2.5	98.7	-
6 月 末	21,122	4.8	132,579.22	5.0	99.0	-
7 月 末	21,267	5.5	133,117.57	5.4	98.9	-
8 月 末	21,015	4.3	131,430.25	4.1	98.7	-
9 月 末	20,830	3.4	130,076.63	3.0	99.0	-
10 月 末	21,443	6.4	134,355.57	6.4	99.0	-
11 月 末	20,802	3.2	130,450.40	3.3	98.7	-
12 月 末	19,782	△1.8	123,946.23	△1.8	98.6	-
2023 年 1 月 末	20,018	△0.7	125,559.33	△0.6	98.8	-
(期 末) 2023 年 2 月 21 日	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-

(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（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

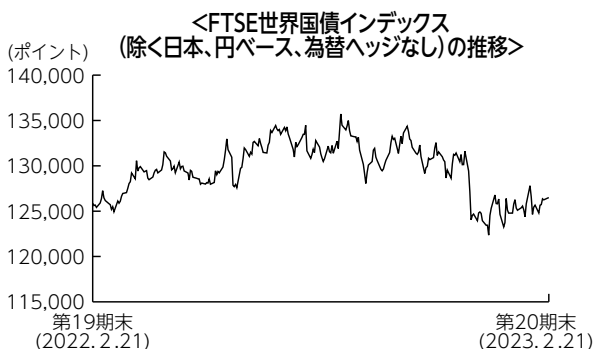


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,182円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

FOMC（米連邦公開市場委員会）による複数回の利上げやインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもFOMCによる複数回の利上げと日銀の金融緩和策を堅持する姿勢から、日米金利差拡大が意識されて円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも大きく為替が円安に動いたことから、基準価額は若干上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、インフレ率が加速する中でFOMCの複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やECB（欧州中央銀行）の複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、FOMCにおいて複数回の利上げを実施しましたが、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

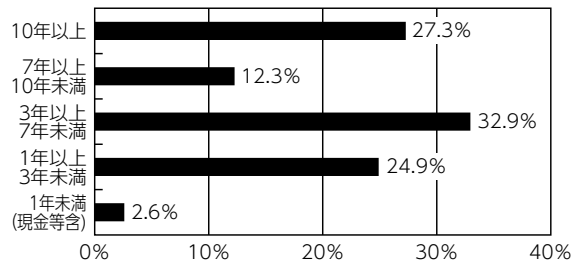
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

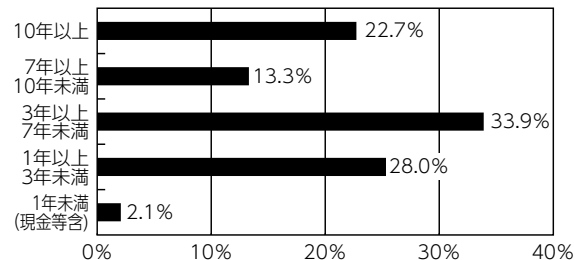
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	47.3%	48.0%	△0.7%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	49.3%	50.0%	△0.7%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.7%	△0.0%
計	0.7%	0.7%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	△0.0%
ベルギー	2.2%	2.2%	△0.0%
フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
フランス	9.7%	9.8%	△0.1%
ドイツ	7.2%	7.2%	△0.0%
アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
イタリア	8.5%	8.7%	△0.2%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.0%
スペイン	5.7%	5.7%	0.0%
ユーロ計	37.8%	38.2%	△0.4%
デンマーク	0.4%	0.4%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	△0.0%
英国	5.8%	5.5%	0.3%
ポーランド	0.5%	0.5%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	△0.0%
計	45.0%	45.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.5%	1.6%	△0.0%
中国	0.9%	1.2%	△0.3%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.4%	3.7%	△0.3%
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	1.1%	—	—
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	49.5%	50.0%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
計	51.6%	52.0%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.9%	1.9%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.4%	8.4%	0.0%
ドイツ	6.5%	6.4%	0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.5%	7.6%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	5.0%	5.0%	△0.0%
ユーロ計	33.1%	33.2%	△0.1%
デンマーク	0.3%	0.3%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	4.8%	4.7%	0.1%
ポーランド	0.4%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	39.0%	39.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.6%	1.6%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	4.4%	4.8%	△0.4%
シンガポール	0.5%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.6%	△0.0%
計	7.2%	7.6%	△0.4%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.0%	—	—
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0.2%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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.016%	(a) 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
(保 管 費 用)	(3)	(0.015)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は20,688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 (2022年2月22日から2023年2月21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 536,386	千アメリカ・ドル 350,573	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 26,736	千カナダ・ドル 16,227	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,961	千オーストラリア・ドル 11,123	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 4,947	千シンガポール・ドル 3,149	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 4,867	千ニュージーランド・ドル -	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 42,306	千イギリス・ポンド 23,277	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 9,417	千イスラエル・シケル 7,354	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 15,932	千デンマーク・クローネ 12,094	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 16,915	千ノルウェー・クローネ 14,888	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 13,712	千スウェーデン・クローナ 12,914	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 111,333	千メキシコ・ペソ 63,692	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 369,093	千オフショア・人民元 18,682	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,418	千マレーシア・リンギット 8,762	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,489	千ポーランド・ズロチ 7,291	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 5,238	千ユーロ 3,823
		オランダ	国債証券	15,082	10,731
		ベルギー	国債証券	17,985	11,988
		フランス	国債証券	79,108	52,916
		ドイツ	国債証券	67,768	45,631
		スペイン	国債証券	46,170	31,229
		イタリア	国債証券	74,616	52,932
		フィンランド	国債証券	4,741	3,163
	オーストラリア	国債証券	12,167	8,398	

(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（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

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
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

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 774,590	千アメリカ・ドル 689,046	千円 92,552,791	% 49.5	% -	% 21.4	% 18.2	% 9.9	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 41,990	千カナダ・ドル 38,354	千円 3,827,785	2.0	-	1.1	0.6	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 35,405	千オーストラリア・ドル 31,922	千円 2,963,084	1.6	-	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,895	千シンガポール・ドル 8,486	千円 853,411	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 5,560	千ニュージーランド・ドル 4,858	千円 408,149	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 65,284	千イギリス・ポンド 55,908	千円 9,037,014	4.8	-	3.4	0.9	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 17,540	千イスラエル・シケル 16,376	千円 614,774	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 33,220	千デンマーク・クローネ 31,156	千円 600,381	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 29,010	千ノルウェー・クローネ 27,010	千円 354,646	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,770	千スウェーデン・クローナ 28,193	千円 366,227	0.2	-	0.1	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 234,607	千メキシコ・ペソ 217,394	千円 1,589,526	0.9	-	0.4	0.3	0.1	
中 国	千オフショア・人民元 419,720	千オフショア・人民元 419,249	千円 8,205,585	4.4	-	1.9	2.0	0.4	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,550	千マレーシア・リンギット 34,072	千円 1,032,254	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 32,170	千ポーランド・ズロチ 27,310	千円 826,099	0.4	-	0.1	0.2	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	9,450	8,192	1,175,166	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オランダ	21,490	19,601	2,811,844	1.5	-	0.9	0.5	0.1	
ベルギー	26,630	24,128	3,461,253	1.9	-	1.3	0.4	0.1	
フランス	120,130	109,930	15,769,556	8.4	-	5.2	2.6	0.7	
ドイツ	91,020	84,475	12,118,072	6.5	-	3.4	2.0	1.1	
スペイン	69,860	64,753	9,288,912	5.0	-	2.8	1.5	0.7	
イタリア	106,807	97,750	14,022,270	7.5	-	4.2	2.3	1.0	
フィンランド	7,640	6,508	933,600	0.5	-	0.3	0.2	0.1	
オーストリア	17,370	15,259	2,188,922	1.2	-	0.6	0.4	0.1	
合 計	-	-	千円 185,001,333	99.0	-	50.1	33.3	15.7	

(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。

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当	期	末	評 価 額		償還年月日			
				種 類	利 率		額 面 金 額	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	2,460	2,346	315,144	2026/01/31			
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	500	480	64,520	2025/01/31			
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	710	691	92,923	2024/01/31			
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	2,550	2,490	334,501	2024/01/31			
US T N/B 0.875 01/31/24	国債証券	0.8750	200	192	25,837	2024/01/31			
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	4,940	4,463	599,597	2027/01/31			
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	3,969	533,182	2029/01/31			
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	705	94,711	2025/01/31			
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,739	502,279	2028/01/31			
US T N/B 1.125 01/15/25	国債証券	1.1250	4,880	4,570	613,950	2025/01/15			
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	3,700	3,302	443,558	2026/01/31			
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	800	790	106,129	2026/01/15			
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	400	418	56,275	2026/02/15			
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,860	1,635	219,679	2042/02/15			
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,740	1,516	203,634	2043/02/15			
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,358	182,433	2046/02/15			
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	500	476	64,069	2039/02/15			
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	860	947	127,274	2031/02/15			
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	400	431	57,917	2036/02/15			
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	830	918	123,374	2041/02/15			
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,527	205,189	2044/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,310	2,790	374,852	2049/02/15			
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	4,300	3,071	412,560	2052/02/15			
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	636	85,440	2038/02/15			
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	890	969	130,285	2040/02/15			
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,807	377,043	2042/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,920	3,221	432,653	2051/02/15			
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,890	2,674	359,252	2026/02/15			
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,310	1,781	239,230	2045/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,960	1,644	220,856	2047/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,223	298,606	2048/02/15			
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	2,090	2,043	274,533	2024/02/15			
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,939	260,547	2025/02/15			
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,330	4,011	538,848	2029/02/15			
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	3,370	3,174	426,418	2028/02/15			
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,518	472,624	2027/02/15			
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,650	1,602	215,212	2024/02/29			
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,164	290,721	2026/02/28			
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,891	254,052	2025/02/28			
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	7,890	6,465	868,443	2031/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,700	3,401	456,856	2041/02/15			
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,720	2,528	339,658	2050/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	7,280	6,208	833,960	2032/02/15			
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	979	131,533	2027/02/28			
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,730	3,194	429,149	2030/02/15			
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	3,610	3,306	444,114	2027/02/28			
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,800	4,574	614,488	2024/02/15			
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,782	373,724	2025/02/28			

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.5 02/29/24	国債証券	1.5000	4,000	3,860	518,517	2024/02/29
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,860	3,351	450,202	2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,000	3,551	477,024	2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,618	620,325	2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,282	575,202	2025/02/15
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	3,340	3,241	435,345	2024/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,721	231,172	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	1,300	1,224	164,418	2026/03/31
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	2,200	1,912	256,880	2027/03/31
US T N/B 2.125 03/15/24	国債証券	0.2500	3,910	3,720	499,752	2024/03/15
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,630	353,302	2025/03/31
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	3,610	3,148	422,881	2028/03/31
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	3,220	2,894	388,853	2026/03/31
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	3,000	2,736	367,590	2029/03/31
US T N/B 2.25 03/31/24	国債証券	2.2500	4,750	4,609	619,178	2024/03/31
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	2,650	2,486	333,923	2027/03/31
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,777	507,456	2025/03/15
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,931	259,405	2025/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	4,720	4,567	613,484	2024/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,260	1,190	159,855	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,194	429,092	2024/04/30
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	4,010	3,491	468,917	2028/04/30
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	4,140	3,935	528,671	2024/04/15
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,043	274,492	2027/04/30
US T N/B 2.5 04/30/24	国債証券	2.5000	4,010	3,895	523,179	2024/04/30
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,000	2,815	378,184	2029/04/30
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	3,700	3,314	445,169	2026/04/30
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,341	314,469	2025/04/30
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	3,000	2,840	381,552	2027/04/30
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,882	387,156	2025/04/15
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	869	116,791	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	910	960	128,992	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	230	243	32,641	2041/05/15
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	928	124,733	2042/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	990	133,106	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,914	257,152	2043/05/15
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	4,092	549,728	2051/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,287	172,974	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	400	337	45,270	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,358	182,510	2047/05/15
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,701	497,215	2052/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	2,230	1,713	230,090	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,430	326,521	2048/05/15
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,117	284,480	2040/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,300	2,715	364,751	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	644	86,516	2038/05/15
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	3,420	2,627	352,892	2041/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	5,100	4,950	664,909	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,751	503,911	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,593	617,044	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,470	3,161	424,615	2029/05/15

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	額	期		末					
										評		額	償	還	年	月	日
										外	貨	建					
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド					
US T N/B 2.375 05/15/27	国	債	証	券	2.3750	4,430	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 5.0 05/15/37	国	債	証	券	5.0000	555	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.625 05/15/26	国	債	証	券	1.6250	3,670	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.0 05/31/24	国	債	証	券	2.0000	800	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.25 05/15/50	国	債	証	券	1.2500	3,870	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.125 05/31/26	国	債	証	券	2.1250	1,550	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.625 05/15/31	国	債	証	券	1.6250	9,240	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.875 05/31/25	国	債	証	券	2.8750	1,570	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.25 05/15/42	国	債	証	券	3.2500	3,760	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.875 05/15/32	国	債	証	券	2.8750	6,650	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.5 05/31/27	国	債	証	券	0.5000	1,980	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.25 05/31/28	国	債	証	券	1.2500	3,300	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.25 05/15/24	国	債	証	券	0.2500	7,500	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.625 05/15/30	国	債	証	券	0.6250	5,650	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.5 05/31/24	国	債	証	券	2.5000	4,180	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.625 05/31/27	国	債	証	券	2.6250	3,410	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.75 05/31/29	国	債	証	券	2.7500	3,300	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.75 05/31/26	国	債	証	券	0.7500	3,630	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.25 05/31/25	国	債	証	券	0.2500	3,890	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.75 05/15/25	国	債	証	券	2.7500	4,000	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.0 06/30/24	国	債	証	券	2.0000	290	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.75 06/30/25	国	債	証	券	2.7500	1,040	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.875 06/30/26	国	債	証	券	1.8750	1,880	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.75 06/30/24	国	債	証	券	1.7500	1,340	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.5 06/30/27	国	債	証	券	0.5000	2,780	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.25 06/30/28	国	債	証	券	1.2500	3,710	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.25 06/30/25	国	債	証	券	0.2500	3,500	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.25 06/30/27	国	債	証	券	3.2500	3,500	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.25 06/15/24	国	債	証	券	0.2500	3,780	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.875 06/30/26	国	債	証	券	0.8750	3,310	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.25 06/30/29	国	債	証	券	3.2500	3,000	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.875 06/15/25	国	債	証	券	2.8750	4,920	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.125 07/31/24	国	債	証	券	2.1250	380	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.875 07/31/25	国	債	証	券	2.8750	2,200	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.875 07/31/26	国	債	証	券	1.8750	2,000	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.75 07/31/24	国	債	証	券	1.7500	1,990	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 1.0 07/31/28	国	債	証	券	1.0000	3,770	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.375 07/31/27	国	債	証	券	0.3750	3,780	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.25 07/31/25	国	債	証	券	0.2500	3,800	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.625 07/31/29	国	債	証	券	2.6250	2,570	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.625 07/31/26	国	債	証	券	0.6250	3,900	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.75 07/31/27	国	債	証	券	2.7500	3,820	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 0.375 07/15/24	国	債	証	券	0.3750	4,000	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.0 07/31/24	国	債	証	券	3.0000	3,820	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.0 07/15/25	国	債	証	券	3.0000	3,200	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.75 08/15/41	国	債	証	券	3.7500	820	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.875 08/15/40	国	債	証	券	3.8750	1,290	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 2.75 08/15/42	国	債	証	券	2.7500	1,540	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.125 08/15/44	国	債	証	券	3.1250	2,090	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 4.5 08/15/39	国	債	証	券	4.5000	980	千	ア	メ	リ	カ	・					
US T N/B 3.625 08/15/43	国	債	証	券	3.6250	1,470	千	ア	メ	リ	カ	・					

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,110	3,439	462,016	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,457	195,769	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	4,050	3,831	514,671	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,784	239,650	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	3,040	2,193	294,573	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	3,640	3,067	411,995	2052/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	4,610	4,444	596,962	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,070	1,506	202,297	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,810	2,360	317,078	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,922	526,825	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,730	3,404	457,331	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,530	4,273	573,981	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,759	236,357	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,960	3,448	463,216	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	783	105,289	2024/08/31
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,658	357,068	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	4,930	3,452	463,693	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,160	2,013	270,388	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,870	2,799	375,976	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	5,840	5,341	717,415	2032/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,130	6,636	891,362	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,340	5,024	674,950	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	998	134,165	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,870	2,719	365,229	2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,242	435,570	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	4,100	3,835	515,216	2024/08/15
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,200	429,932	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,611	350,731	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	2,950	2,616	351,465	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,938	394,652	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,957	397,289	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,784	508,341	2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,689	226,869	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	590	565	75,973	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,310	2,801	376,311	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,417	190,418	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,980	3,432	461,003	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,349	449,937	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	4,310	4,091	549,611	2024/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	2,000	2,002	268,986	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	3,110	2,764	371,360	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,934	394,200	2025/09/15
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,866	250,758	2024/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	3,250	3,230	433,930	2029/09/30
US T N/B 4.25 09/30/24	国債証券	4.2500	2,200	2,181	292,958	2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,350	2,254	302,779	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,270	1,223	164,362	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,710	1,562	209,840	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,082	548,376	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,760	2,614	351,231	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,108	417,485	2027/10/31

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		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	3,390	3,034	407,622	2026/10/31	
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	4,000	3,739	502,314	2024/10/15	
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,000	2,003	269,059	2029/10/31	
US T N/B 4.375 10/31/24	国債証券	4.3750	2,070	2,056	276,239	2024/10/31	
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,940	3,947	530,223	2027/10/31	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,587	481,831	2025/10/31	
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	2,800	2,789	374,678	2025/10/15	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	903	121,383	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	200	217	29,227	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,560	1,317	177,027	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	600	623	83,803	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,277	171,593	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	899	120,822	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,396	187,573	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,801	241,941	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,780	2,935	394,308	2050/11/15	
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	4,670	3,041	408,512	2051/11/15	
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	2,460	2,519	338,378	2052/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	860	724	97,267	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	886	119,135	2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	3,080	2,954	396,785	2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	1,057	142,106	2039/11/15	
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,200	2,883	387,345	2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,290	2,438	327,498	2049/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	3,620	3,423	459,875	2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,380	4,180	561,571	2028/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,830	2,616	351,452	2026/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,015	405,100	2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	1,780	1,702	228,629	2024/11/30	
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	1,360	1,307	175,567	2025/11/30	
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	1,200	1,196	160,705	2042/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	3,190	2,120	284,839	2040/11/15	
US T N/B 1.5 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	3,102	416,683	2041/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,651	221,798	2026/11/30	
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	4,500	4,605	618,606	2032/11/15	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,050	1,797	241,409	2029/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	7,990	6,549	879,702	2031/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	8,280	6,665	895,296	2030/11/15	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,324	446,539	2027/11/30	
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	3,700	3,322	446,256	2026/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	4,000	3,484	468,084	2028/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	3,190	2,862	384,544	2025/11/30	
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,300	2,286	307,149	2029/11/30	
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	2,610	2,438	327,486	2024/11/15	
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,000	2,978	400,016	2027/11/30	
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,581	481,011	2025/11/15	
US T N/B 4.5 11/30/24	国債証券	4.5000	4,200	4,183	561,929	2024/11/30	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	1,000	955	128,317	2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	2,871	385,645	2024/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,931	259,380	2026/12/31	
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,488	468,519	2026/12/31	

銘柄	当	期				末	
		種	利	額	価		
					額		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 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,887	253,493	2024/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,500	3,888	522,344	2028/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,688	361,168	2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	3,320	2,823	379,294	2027/12/31	
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	4,610	4,314	579,498	2024/12/15	
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,104	551,371	2025/12/15	
小計	—	—	774,590	689,046	92,552,791	—	
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	193	19,261	2024/02/01	
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,151	114,920	2025/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	420	410	40,980	2024/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	662	66,097	2025/03/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,271	126,871	2026/03/01	
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	1,210	1,108	110,592	2027/03/01	
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	480	482	48,142	2028/03/01	
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,432	142,914	2024/04/01	
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,043	104,188	2025/04/01	
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	940	907	90,610	2024/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	655	65,387	2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	842	84,063	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	737	73,611	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	280	332	33,171	2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	970	947	94,560	2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	570	621	62,003	2041/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	850	797	79,553	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,273	127,124	2025/06/01	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	498	49,729	2027/06/01	
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	430	405	40,463	2029/06/01	
CANADA 1.5 06/01/30	国債証券	1.2500	1,850	1,608	160,516	2030/06/01	
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	214,768	2031/06/01	
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,940	1,741	173,827	2032/06/01	
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	590	576	57,579	2024/08/01	
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	422	42,143	2024/09/01	
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,910	1,755	175,177	2025/09/01	
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	850	825	82,361	2027/09/01	
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,270	1,161	115,930	2026/09/01	
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	810	766	76,518	2024/10/01	
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	500	489	48,838	2025/10/01	
CANADA 3.0 11/01/24	国債証券	3.0000	860	842	84,120	2024/11/01	
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	700	719	71,803	2045/12/01	
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	630	571	57,018	2048/12/01	
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,820	2,152	214,810	2051/12/01	
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,200	1,560	155,691	2053/12/01	
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	345	34,442	2064/12/01	
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,800	1,458	145,555	2030/12/01	
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,020	1,746	174,312	2031/12/01	
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,300	1,215	121,266	2032/12/01	
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	500	469	46,853	2029/12/01	
小計	—	—	41,990	38,354	3,827,785	—	
(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	880	719	66,774	2047/03/21	

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	
(オーストラリア)													
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国	債	証	券	%	千オーストラリア・ドル	1,380	千オーストラリア・ドル	1,372	千円	127,357	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国	債	証	券	4.7500	840	877	81,455	2027/04/21				
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国	債	証	券	2.7500	970	959	89,073	2024/04/21				
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国	債	証	券	4.2500	1,200	1,225	113,742	2026/04/21				
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国	債	証	券	3.2500	1,500	1,466	136,143	2029/04/21				
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国	債	証	券	4.5000	1,230	1,301	120,771	2033/04/21				
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国	債	証	券	3.7500	830	804	74,696	2037/04/21				
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国	債	証	券	2.2500	880	822	76,347	2028/05/21				
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国	債	証	券	2.5000	1,810	1,671	155,113	2030/05/21				
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国	債	証	券	2.7500	900	736	68,400	2041/05/21				
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国	債	証	券	1.2500	1,890	1,517	140,866	2032/05/21				
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国	債	証	券	3.7500	1,200	1,187	110,260	2034/05/21				
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国	債	証	券	3.2500	820	735	68,266	2039/06/21				
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国	債	証	券	1.5000	1,610	1,350	125,353	2031/06/21				
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国	債	証	券	2.7500	650	574	53,337	2035/06/21				
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国	債	証	券	1.7500	1,200	716	66,507	2051/06/21				
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国	債	証	券	0.5000	1,815	1,629	151,265	2026/09/21				
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国	債	証	券	2.7500	960	916	85,049	2028/11/21				
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国	債	証	券	2.7500	1,230	1,183	109,875	2027/11/21				
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国	債	証	券	2.7500	1,400	1,320	122,592	2029/11/21				
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国	債	証	券	3.0000	1,170	1,084	100,627	2033/11/21				
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国	債	証	券	1.7500	1,850	1,542	143,147	2032/11/21				
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国	債	証	券	1.0000	2,170	1,722	159,897	2031/11/21				
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国	債	証	券	0.2500	1,360	1,244	115,518	2025/11/21				
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国	債	証	券	0.2500	1,990	1,878	174,356	2024/11/21				
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国	債	証	券	1.0000	1,670	1,360	126,286	2030/12/21				
小 計	-	-	-	-	-	35,405	31,922	2,963,084	-				
(シンガポール)													
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国	債	証	券	%	千シンガポール・ドル	280	千シンガポール・ドル	276	千円	27,762	2024/02/01	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国	債	証	券	3.5000	800	810	81,493	2027/03/01				
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国	債	証	券	2.7500	500	482	48,469	2046/03/01				
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国	債	証	券	1.8750	490	402	40,454	2050/03/01				
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国	債	証	券	2.7500	340	325	32,749	2042/04/01				
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国	債	証	券	2.6250	420	410	41,263	2028/05/01				
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国	債	証	券	2.3750	780	764	76,828	2025/06/01				
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国	債	証	券	2.1250	370	357	35,923	2026/06/01				
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国	債	証	券	2.8750	590	580	58,381	2029/07/01				
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国	債	証	券	2.3750	190	169	17,081	2039/07/01				
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国	債	証	券	1.6250	350	310	31,180	2031/07/01				
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国	債	証	券	3.0000	125	133	13,468	2072/08/01				
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国	債	証	券	2.2500	590	528	53,119	2036/08/01				
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国	債	証	券	3.0000	720	717	72,120	2024/09/01				
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国	債	証	券	2.8750	620	606	61,025	2030/09/01				
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国	債	証	券	3.3750	330	335	33,709	2033/09/01				
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国	債	証	券	2.8750	200	198	19,950	2027/09/01				
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国	債	証	券	1.8750	410	342	34,462	2051/10/01				
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国	債	証	券	1.2500	410	382	38,467	2026/11/01				
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国	債	証	券	0.5000	380	353	35,499	2025/11/01				
小 計	-	-	-	-	-	8,895	8,486	853,411	-				
(ニュージーランド)													
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国	債	証	券	%	千ニュージーランド・ドル	700	千ニュージーランド・ドル	704	千円	59,147	2027/04/15	

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	
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	350	326	27,388	2033/04/14	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	330	269	22,671	2037/04/15	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	570	548	46,062	2025/04/15	
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	350	325	27,343	2029/04/20	
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	440	320	26,955	2051/05/15	
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	261	21,933	2041/05/15	
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	580	467	39,248	2031/05/15	
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	128	10,762	2034/05/15	
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	350	288	24,274	2032/05/15	
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	350	284	23,880	2028/05/15	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	国債証券	0.5000	650	616	51,759	2024/05/15	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国債証券	0.5000	360	318	26,719	2026/05/15	
小計	—	—	5,560	4,858	408,149	—	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,140	1,024	165,561	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,450	1,349	218,056	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	900	935	151,164	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	630	407	65,817	2049/01/22	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	国債証券	3.7500	400	393	63,654	2038/01/29	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	1,670	895	144,822	2046/01/31	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	760	511	82,633	2039/01/31	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	2,370	1,911	308,921	2032/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,739	281,174	2024/01/31	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	680	571	92,378	2029/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,040	886	143,227	2028/01/31	
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	2,400	2,245	362,991	2025/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,150	1,048	169,427	2026/01/30	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	国債証券	4.1250	800	815	131,800	2027/01/29	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,095	1,127	182,246	2025/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,700	1,782	288,153	2036/03/07	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	950	920	148,822	2024/04/22	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,440	1,527	246,876	2032/06/07	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,060	996	161,098	2025/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,000	616	99,579	2047/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,630	889	143,790	2051/07/31	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	970	940	152,076	2052/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	1,110	638	103,220	2053/07/31	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,130	685	110,865	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,250	922	149,098	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	930	882	142,612	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	1,100	1,033	167,081	2026/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,600	1,461	236,203	2027/07/22	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	900	686	111,006	2033/07/31	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,770	1,352	218,668	2031/07/31	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	1,350	936	151,303	2035/07/31	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,260	1,311	211,965	2039/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	810	798	129,072	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,190	1,150	185,901	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	900	971	157,087	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,390	1,066	172,392	2037/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	870	515	83,279	2054/10/22	

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	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5	10/22/61	国債証券	0.5000	1,460	511	82,741	2061/10/22
UK TREASURY 1.625	10/22/71	国債証券	1.6250	830	451	72,904	2071/10/22
UK TREASURY 1.125	10/22/73	国債証券	1.1250	740	317	51,393	2073/10/22
UK TREASURY 1.25	10/22/41	国債証券	1.2500	1,600	1,036	167,567	2041/10/22
UK TREASURY 0.625	10/22/50	国債証券	0.6250	450	202	32,747	2050/10/22
UK TREASURY 1.625	10/22/28	国債証券	1.6250	1,130	1,028	166,269	2028/10/22
UK TREASURY 0.875	10/22/29	国債証券	0.8750	2,260	1,922	310,711	2029/10/22
UK TREASURY 0.375	10/22/30	国債証券	0.3750	1,220	969	156,774	2030/10/22
UK TREASURY 0.375	10/22/26	国債証券	0.3750	1,390	1,244	201,133	2026/10/22
UK TREASURY 6.0	12/07/28	国債証券	6.0000	680	770	124,599	2028/12/07
UK TREASURY 4.75	12/07/38	国債証券	4.7500	980	1,080	174,681	2038/12/07
UK TREASURY 4.5	12/07/42	国債証券	4.5000	1,265	1,362	220,223	2042/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/46	国債証券	4.2500	1,080	1,122	181,458	2046/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/55	国債証券	4.2500	1,212	1,294	209,168	2055/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/27	国債証券	4.2500	910	944	152,599	2027/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/40	国債証券	4.2500	1,070	1,113	179,988	2040/12/07
UK TREASURY 4.75	12/07/30	国債証券	4.7500	1,395	1,521	245,866	2030/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/49	国債証券	4.2500	1,017	1,065	172,151	2049/12/07
小	計	—	—	65,284	55,908	9,037,014	—
(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	1,090	1,342	50,386	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5	02/27/26	国債証券	0.5000	310	280	10,514	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75	03/31/47	国債証券	3.7500	2,090	2,078	78,013	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0	03/31/27	国債証券	2.0000	2,230	2,076	77,940	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75	03/31/24	国債証券	3.7500	1,320	1,311	49,247	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0	03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,380	89,364	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5	04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,749	65,680	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5	05/31/37	国債証券	1.5000	1,450	1,096	41,155	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75	08/31/25	国債証券	1.7500	2,300	2,176	81,698	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25	09/28/28	国債証券	2.2500	1,460	1,347	50,569	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25	10/30/26	国債証券	6.2500	220	237	8,917	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 0.4	10/31/24	国債証券	0.4000	320	300	11,286	2024/10/31
小	計	—	—	17,540	16,376	614,774	—
(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	3,760	2,037	39,256	2052/11/15
DENMARK 4.5	11/15/39	国債証券	4.5000	7,860	9,812	189,081	2039/11/15
DENMARK 1.75	11/15/25	国債証券	1.7500	4,040	3,926	75,669	2025/11/15
DENMARK 0.5	11/15/27	国債証券	0.5000	6,350	5,749	110,795	2027/11/15
DENMARK 0.5	11/15/29	国債証券	0.5000	4,830	4,202	80,975	2029/11/15
DENMARK 0.0	11/15/31	国債証券	0.0000	4,180	3,337	64,317	2031/11/15
DENMARK 0.0	11/15/24	国債証券	0.0000	2,200	2,090	40,284	2024/11/15
小	計	—	—	33,220	31,156	600,381	—
(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	4,480	4,252	55,831	2026/02/19
NORWAY 1.75	02/17/27	国債証券	1.7500	2,400	2,266	29,760	2027/02/17
NORWAY 3.0	03/14/24	国債証券	3.0000	2,370	2,358	30,962	2024/03/14
NORWAY 1.75	03/13/25	国債証券	1.7500	6,130	5,931	77,883	2025/03/13
NORWAY 2.0	04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,950	25,605	2028/04/26
NORWAY 2.125	05/18/32	国債証券	2.1250	1,980	1,805	23,710	2032/05/18
NORWAY 1.375	08/19/30	国債証券	1.3750	4,310	3,788	49,745	2030/08/19
NORWAY 1.75	09/06/29	国債証券	1.7500	2,620	2,396	31,459	2029/09/06

銘柄	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		
				当	期	
(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 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,650	2,260	29,686	2031/09/17
小計	—	—	29,010	27,010	354,646	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,420	3,860	50,146	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	2,890	2,632	34,192	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,120	6,057	78,681	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	5,420	4,469	58,060	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	2,654	34,482	2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	6,210	5,833	75,777	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,010	2,685	34,885	2029/11/12
小計	—	—	29,770	28,193	366,227	—
(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	29,842	26,541	194,062	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	10,580	9,121	66,691	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	9,180	8,225	60,143	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	20,159	19,594	143,272	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,648	28,407	207,710	2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	5,790	5,244	38,343	2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,746	23,052	168,555	2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	6,290	5,645	41,276	2053/07/31
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	22,070	21,098	154,263	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	17,277	15,096	110,380	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	16,161	14,508	106,083	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,807	108,271	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,931	43,367	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	4,835	4,411	32,257	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	15,902	15,707	114,846	2024/12/05
小計	—	—	234,607	217,394	1,589,526	—
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	20,000	19,779	387,117	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	34,500	34,380	672,902	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	5,100	5,167	101,145	2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	10,997	215,235	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	12,000	12,005	234,970	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	14,320	14,442	282,676	2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	2,100	2,255	44,148	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	30,100	29,875	584,732	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	1,000	1,013	19,830	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	3,000	2,969	58,114	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,600	6,522	127,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,452	165,436	2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	7,500	7,549	147,767	2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	20,000	19,904	389,565	2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	450	460	9,015	2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	国債証券	2.1800	4,200	4,193	82,076	2024/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,256	396,471	2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	13,000	12,764	249,819	2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	30,000	29,770	582,671	2025/08/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	26,600	26,675	522,102	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	国債証券	3.5900	5,000	5,236	102,489	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	7,300	7,120	139,358	2032/09/01

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	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	15,300	15,328	300,017	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	国債証券	2.6200	17,500	17,269	338,002	2029/09/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	国債証券	1.9900	10,000	9,952	194,784	2024/09/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	18,950	19,723	386,034	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,600	15,727	307,828	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	国債証券	2.4400	11,000	10,892	213,183	2027/10/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	国債証券	2.8000	17,300	17,178	336,224	2032/11/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	4,100	4,107	80,384	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	国債証券	2.2800	14,800	14,705	287,825	2025/11/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	国債証券	2.7900	9,000	8,959	175,359	2029/12/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,500	3,608	70,632	2027/12/03	
小計	—	—	419,720	419,249	8,205,585	—	
(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	600	606	18,376	2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	300	316	9,589	2046/03/15	
MALAYSIA 3.882 03/14/25	国債証券	3.8820	300	302	9,173	2025/03/14	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,050	1,077	32,645	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,200	1,253	37,974	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,660	1,632	49,455	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,700	1,806	54,730	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	913	27,676	2031/04/15	
MALAYSIA 4.504 04/30/29	国債証券	4.5040	300	312	9,471	2029/04/30	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	650	646	19,599	2027/05/31	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	1,500	1,413	42,811	2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	600	608	18,440	2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,004	60,726	2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	670	683	20,720	2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	620	672	20,372	2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,003	30,395	2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	400	377	11,430	2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,030	1,041	31,556	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	1,990	2,145	65,000	2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	920	931	28,222	2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,820	1,778	53,865	2034/07/05	
MALAYSIA 3.582 07/15/32	国債証券	3.5820	1,400	1,366	41,392	2032/07/15	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	700	702	21,286	2029/08/15	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,400	2,429	73,614	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,600	1,725	52,286	2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	900	909	27,561	2024/09/30	
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	1,200	1,272	38,537	2042/10/15	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,660	1,683	51,001	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	1,430	1,447	43,851	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	950	1,006	30,484	2033/11/07	
小計	—	—	33,550	34,072	1,032,254	—	
(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 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,391	42,100	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,480	2,923	88,426	2028/04/25	
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,370	1,609	48,679	2032/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	780	748	22,634	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	3,370	2,995	90,600	2025/04/25	
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	1,450	1,303	39,438	2027/05/25	

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	
(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 07/25/26	国債証券	2.5000	2,790	2,456	74,295	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,830	3,562	107,763	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,007	60,709	2027/07/25	
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	1,710	1,571	47,534	2024/07/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	630	504	15,259	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	2,150	2,015	60,979	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	3,930	2,716	82,172	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,504	45,504	2026/10/25	
小 計	—	—	32,170	27,310	826,099	—	
(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	840	678	97,320	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	360	321	46,147	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	240	241	34,614	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	850	893	128,106	2025/03/13	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	159	22,810	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	580	402	57,806	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	390	331	47,564	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	590	574	82,454	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	610	555	79,654	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	659	94,564	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	950	899	129,077	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	350	292	41,922	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	270	38,782	2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	520	467	67,011	2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	870	679	97,428	2031/10/18	
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	400	314	45,125	2032/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	550	451	64,775	2030/10/18	
小 計	—	—	9,450	8,192	1,175,166	—	
(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	1,320	1,510	216,714	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,540	1,567	224,837	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,000	488	70,076	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	780	881	126,470	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,280	1,454	208,697	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,110	1,087	156,000	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	550	364	52,258	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,110	775	111,308	2040/01/15	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	360	313	44,992	2054/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,110	948	136,123	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,080	972	139,514	2027/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	640	590	84,697	2026/01/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,420	1,317	189,022	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,140	1,124	161,327	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,490	1,402	201,127	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,240	1,121	160,908	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,160	1,068	153,227	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,060	911	130,746	2029/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	575	82,581	2030/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,200	960	137,748	2031/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	200	163	23,462	2032/07/15	
小 計	—	—	21,490	19,601	2,811,844	—	

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	
(ユーロ…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,570	1,769	253,826	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,440	206,696	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,122	161,070	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	630	678	97,342	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,220	1,440	206,598	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	810	684	98,207	2033/04/22	
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	220	205	29,452	2039/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	740	787	112,920	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	780	556	79,875	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	980	697	100,014	2050/06/22	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	710	453	65,042	2053/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	307	44,168	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	342	49,111	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	670	275	39,451	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,030	971	139,373	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	840	834	119,770	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,348	193,449	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	1,010	909	130,468	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	450	278	40,016	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,430	1,272	182,594	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	680	670	96,134	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	510	73,245	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,980	1,888	270,861	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	960	881	126,503	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	380	302	43,460	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,300	1,066	153,048	2030/06/22	
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	600	471	67,607	2032/06/22	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	750	720	103,373	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	940	728	104,517	2031/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	580	509	73,051	2027/10/22	
小計	—	—	26,630	24,128	3,461,253	—	
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,450	2,192	314,456	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	2,910	2,672	383,300	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	1,220	1,183	169,796	2024/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000	1,990	1,876	269,117	2025/02/25	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	1,980	1,789	256,749	2028/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	3,020	2,923	419,317	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	3,320	3,122	447,954	2025/03/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,000	3,058	438,763	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,640	3,099	444,621	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,756	252,027	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,170	1,372	196,903	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,880	4,463	640,344	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,930	2,252	323,055	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,470	2,486	356,634	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,548	222,122	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,470	1,719	246,634	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	2,040	1,112	159,652	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,950	1,038	148,975	2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	990	678	97,377	2066/05/25	

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 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	303	43,504	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	2,500	2,475	355,131	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,550	4,467	640,891	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,110	4,602	660,267	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,480	3,152	452,258	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	4,230	4,008	574,961	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,123	448,037	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,860	2,380	341,450	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	3,460	3,210	460,508	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,360	2,191	314,327	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,650	1,065	152,893	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	3,190	2,551	365,992	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	500	384	55,135	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	250	222	31,949	2043/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,290	1,757	252,091	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,070	1,706	244,852	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,150	680	97,578	2044/06/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,340	335,802	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,890	3,882	556,952	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,940	2,134	306,132	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,510	3,108	445,887	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,330	334,287	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,606	373,927	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,620	2,382	341,795	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	3,400	3,033	435,169	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,270	2,556	366,670	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	3,780	3,048	437,298	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	1,600	1,476	211,757	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,890	2,399	344,241	2029/11/25
小計	-	-	120,130	109,930	15,769,556	-
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,493	214,254	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	780	965	138,430	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,520	1,847	265,041	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,830	2,144	307,667	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,900	1,815	260,429	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	2,660	2,496	358,117	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	2,080	1,828	262,241	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,940	1,761	252,687	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,430	1,413	202,749	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,120	1,937	277,926	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,840	1,521	218,263	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,900	2,340	335,782	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	2,620	2,215	317,775	2030/02/15
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,500	1,455	208,741	2024/03/15
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,260	1,220	175,013	2024/04/05
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,498	214,963	2025/04/11
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	2,110	1,943	278,846	2026/04/10
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,360	1,224	175,662	2027/04/16
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,520	1,493	214,299	2024/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,660	1,223	175,440	2035/05/15

銘柄	柄	当期				未	
		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 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	350	282	40,482	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,580	1,133	162,637	2036/05/15	
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	国債証券	0.2000	1,250	1,206	173,032	2024/06/14	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	850	985	141,339	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	560	622	89,277	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,700	2,093	300,283	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,480	212,336	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,070	2,084	298,951	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,410	1,847	265,047	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,820	2,227	319,477	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,170	2,205	316,314	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	1,040	525	75,360	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	500	434	62,328	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,430	1,914	274,671	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,317	332,464	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,910	1,749	250,924	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,980	1,810	259,750	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,770	1,570	225,347	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,820	1,770	253,925	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,990	1,702	244,286	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	2,230	1,182	169,652	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	1,430	1,342	192,628	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,190	1,789	256,743	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	710	376	54,038	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,430	2,032	291,544	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	590	494	70,887	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	800	654	93,934	2031/08/15	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	国債証券	0.4000	900	865	124,202	2024/09/13	
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,590	1,516	217,554	2024/10/18	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,360	1,238	177,641	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,750	1,630	233,851	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,880	1,780	255,344	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	450	419	60,243	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,440	206,670	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,060	1,792	257,198	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	800	781	112,076	2029/11/15	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	国債証券	2.2000	1,350	1,333	191,285	2024/12/12	
小計	—	—	91,020	84,475	12,118,072	—	
(ユーロ…スペイン)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,460	1,682	241,329	2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,200	1,219	174,885	2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,400	1,480	212,407	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	2,050	1,932	277,228	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,610	1,426	204,579	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	996	142,881	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,960	1,789	256,768	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,580	226,690	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,470	1,483	212,736	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,210	2,073	297,511	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,330	1,284	184,311	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,170	1,073	153,970	2028/04/30	

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 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,400	1,266	181,616	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,550	1,226	176,010	2032/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,500	1,242	178,240	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,380	1,066	153,023	2031/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	1,110	1,068	153,206	2024/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	670	624	89,589	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,630	1,778	255,064	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,290	1,477	211,882	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,630	1,834	263,149	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,020	146,328	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,135	1,176	168,776	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,620	232,436	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,815	2,167	310,970	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,470	1,325	190,206	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	250	236	33,860	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,510	1,380	198,013	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,840	1,521	218,249	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,080	1,037	148,864	2024/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	408	58,668	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	336	48,220	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,750	1,580	226,787	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	700	603	86,557	2029/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,190	2,180	312,749	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,830	2,014	288,987	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,458	209,176	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,026	147,252	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,190	983	141,024	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	670	439	63,062	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	410	196	28,229	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,590	846	121,393	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,010	1,964	281,833	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,560	1,448	207,740	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,730	1,625	233,239	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,530	1,295	185,780	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,640	1,294	185,709	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,597	229,206	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,260	845	121,305	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,750	1,514	217,197	2030/10/31
小計	-	-	69,860	64,753	9,288,912	-
(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	1,310	1,181	169,475	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	300	300	43,125	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,460	1,635	234,590	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	2,170	2,094	300,422	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,350	1,249	179,236	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,800	1,697	243,575	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,475	211,666	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,500	1,231	176,723	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,090	825	118,364	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,190	1,025	147,101	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,710	1,729	248,084	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	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	700	485	69,607	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	209	30,091	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	560	577	82,809	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,910	1,963	281,716	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,790	1,466	210,341	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	2,350	1,981	284,218	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,020	922	132,392	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,870	1,828	262,352	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,120	805	115,517	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	785	112,672	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,080	705	101,182	2037/03/01
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	522	74,992	2038/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,229	176,429	2028/03/15
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	660	637	91,495	2035/04/30
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	810	486	69,716	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,306	187,389	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,610	1,268	181,937	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,400	1,348	193,479	2024/04/15
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	550	540	77,564	2028/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	1,520	1,363	195,585	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,100	996	142,922	2027/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,480	2,836	406,842	2031/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	990	972	139,517	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,280	1,228	176,239	2025/05/15
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	200	201	28,948	2033/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,350	1,271	182,328	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,400	200,836	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,290	1,219	175,002	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,380	1,048	150,371	2032/06/01
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,129	162,052	2029/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,290	1,231	176,614	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,174	168,428	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	927	133,115	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,196	171,670	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,660	1,757	252,057	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,170	1,246	178,813	2039/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,500	1,404	201,465	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,610	1,535	220,254	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,520	1,150	165,069	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,090	156,378	2030/08/01
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国債証券	0.0000	1,460	1,389	199,277	2024/08/15
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,287	184,674	2025/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,250	1,108	159,050	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,810	1,525	218,828	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,110	1,156	165,911	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,180	986	141,559	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	1,765	253,286	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,250	1,337	191,918	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,150	806	115,658	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,020	595	85,400	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,126	161,584	2033/09/01

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
(ユーロ…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	510	326	46,792	2052/09/01		
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,620	1,628	233,638	2024/09/01		
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	850	776	111,363	2049/09/01		
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	860	680	97,558	2036/09/01		
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,493	214,269	2027/09/15		
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	350	395	56,749	2026/11/01		
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,510	1,698	243,685	2027/11/01		
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,140	2,329	334,212	2029/11/01		
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	680	658	94,459	2024/11/15		
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,350	1,317	188,940	2025/11/15		
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	1,660	1,596	228,985	2025/12/01		
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,530	1,406	201,823	2026/12/01		
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,637	1,613	231,494	2024/12/01		
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,740	1,656	237,564	2028/12/01		
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,700	1,312	188,276	2031/12/01		
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,740	1,470	210,955	2030/12/01		
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,340	1,161	166,670	2032/12/01		
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500	800	795	114,082	2029/12/15		
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券	0.0000	1,360	1,279	183,569	2024/12/15		
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500	1,220	1,165	167,238	2027/12/01		
小計	—	—	106,807	97,750	14,022,270	—		
(ユーロ…フィンランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	320	148	21,335	2052/04/15		
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	370	366	52,545	2024/04/15		
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	200	168	24,206	2031/04/15		
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	390	286	41,101	2047/04/15		
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	460	429	61,648	2026/04/15		
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	480	392	56,370	2034/04/15		
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	380	235	33,842	2043/04/15		
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	290	197	28,384	2036/04/15		
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750	110	103	14,905	2027/04/15		
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	410	422	60,548	2025/07/04		
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	490	488	70,016	2028/07/04		
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	430	404	57,984	2042/07/04		
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	300	257	36,986	2029/09/15		
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	350	333	47,855	2025/09/15		
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	550	483	69,295	2028/09/15		
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	420	379	54,371	2027/09/15		
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	290	178	25,651	2040/09/15		
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000	50	43	6,298	2032/09/15		
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	300	236	33,990	2031/09/15		
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	210	168	24,221	2030/09/15		
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	410	392	56,286	2024/09/15		
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000	430	388	55,752	2026/09/15		
小計	—	—	7,640	6,508	933,600	—		
(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	240	279	40,061	2062/01/26		
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	640	471	67,598	2047/02/20		
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	920	799	114,719	2029/02/20		
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	835	754	108,210	2028/02/20		
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	710	561	80,597	2031/02/20		

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	
(ユーロ・オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	900	751	107,806	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	930	759	108,894	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	710	753	108,052	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	990	1,106	158,759	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	590	340	48,873	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	210	94	13,571	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,070	974	139,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	580	544	78,164	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	770	720	103,422	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	290	228	32,749	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	127	18,336	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	540	545	78,195	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	415	472	67,713	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	520	499	71,615	2024/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	160	155	22,342	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	285	40,901	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	930	910	130,642	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,190	1,104	158,454	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	940	902	129,412	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	380	259	37,176	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	258	37,104	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	570	484	69,568	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	16,225	2086/11/02
小 計	—	—	17,370	15,259	2,188,922	—
合 計	—	—	—	—	185,001,333	—

■投資信託財産の構成

2023年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 185,001,333	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,186,068	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	188,187,402	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、186,640,391千円、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、2023年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.32円、1カナダ・ドル=99.80円、1オーストラリア・ドル=92.82円、1シンガポール・ドル=100.56円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=161.64円、1イスラエル・シェケル=37.54円、1デンマーク・クローネ=19.27円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.311円、1オフショア・人民元=19.572円、1マレーシア・リンギット=30.295円、1ポーランド・ズロチ=30.248円、1ユーロ=143.45円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産 等	188,187,402,199円
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,927,378,048
公 社	185,001,333,837
未 収 利 息	1,090,149,276
前 払 費 用	168,541,038
(B) 負 債	1,365,031,536
未 払 金	1,352,244,536
未 払 解 約 金	12,787,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	186,822,370,663
元 本	92,568,430,085
次 期 繰 越 損 益	94,253,940,578
(D) 受 益 権 総 口 数	92,568,430,085口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,182円

(注1) 期首元本額	70,448,298,510円
追加設定元本額	63,457,547,851円
一部解約元本額	41,337,416,276円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,063,618,127円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,664,534円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,013,145円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	61,798,332円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	61,093,331円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,637,226円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	48,023,427円
たわらノーロード 先進国債券	17,008,425,615円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	245,317,778円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,489,017,308円
たわらノーロード バランス (堅実型)	65,360,184円
たわらノーロード バランス (標準型)	335,170,560円
たわらノーロード バランス (積極型)	71,793,070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)	16,208,215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)	982,389,497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)	1,586,938,015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)	725,563,344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)	429,869,427円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	2,046,942円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,848,744円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	179,191,650円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	14,908,588円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	24,576,579円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,613,575,783円
One DC 先進国債券インデックスファンド	837,273,305円
Oneグローバルバランス	18,428,191円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	743,440,279円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,368,236,637円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,625,122,028円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	419,973,327円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	846,255,978円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	741,934,563円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	512,673,651円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	36,330,259円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	146,595,885円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	150,866,647円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	231,293,861円
グループコントロール	895,480,870円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	600,448,211円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	610,839,468円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,820,147円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	318,874,880円

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220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)	259,574,682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)	265,741,005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)	128,786,227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)	162,358,218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)	256,453,982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)	618,270,983円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	198,620,020円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	231,445,712円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	208,546,866円
D I A M海替フルレンジ外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,554,465,372円
D I A M外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,585,064,790円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,555,775,823円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,282,640,293円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,242,436円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	49,166,703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)	442,107,851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)	362,944,405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)	238,451,787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)	11,931,845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)	29,911,489円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,822,125円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	49,876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)	14,713,798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)	43,966,666円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,620,938,828円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,399,685,001円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,546,932,927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)	65,747,358円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	124,222,256円
D I A Mアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,489,912,024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)	300,752,649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)	163,842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)	305,817,896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)	273,773,162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)	379,947,236円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	46,662,175円
動的パッケージファンド<DC年金>	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
M H A M外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	756,300,586円
M H A M外国債券インデックスファンド<海替ヘッジあり> (ファンドラップ)	514,130,947円
M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	7,052,612,220円
M H A M外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,364,933,377円
期末元本合計	92,568,430,085円

■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,630,658,528	円
	受取利息	3,630,482,398	
	その他の収益	573,045	
	支払利息	△396,915	
(B)	有価証券売買損益	△4,048,984,550	
	売却益	22,763,661,538	
	売却損	△26,812,646,088	
(C)	その他の費用	△27,916,414	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△446,242,436	
(E)	前期繰越損益金	71,516,620,489	
(F)	解約差損益金	△44,647,207,624	
(G)	追加信託差損益金	67,830,770,149	
(H)	計(D+E+F+G)	94,253,940,578	
	次期繰越損益金(H)	94,253,940,578	

(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。