

運用報告書 (全体版)

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信 / 内外 / 資産複合	
信託期間	2007年1月26日から無期限です。	
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。	
主要投資対象	マネックス資産設計 ファンド<隔月分配型>	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 (最速化法)・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。
	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。
	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。
	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている (または採用予定の) 不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場 (これに準ずるものを含みます。) されている不動産投資信託証券とします。
	世界の6資産 (国内外の株式・債券・リート) に分散投資を行います。基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。また、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。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	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日 (原則として奇数月の各11日。休業日の場合は翌営業日。) に経費控除後の利子、配当等収入および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益 (評価益を含みます。) 等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。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。	

第104期 <決算日 2024年7月11日>
第105期 <決算日 2024年9月11日>
第106期 <決算日 2024年11月11日>

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、「マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>」は、2024年11月11日に第106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。

<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。

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

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

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	投資信託(資産)組入比率	純資産額
		(分配落)	税込み	み騰落							
第32作成期	92期(2022年7月11日)	円 12,744	円 15	% 1.3	% 47.1	% 1.4	% 36.7	% -	% -	% 13.2	百万円 425
	93期(2022年9月12日)	13,207	15	3.8	48.4	0.9	35.3	-	-	13.5	442
	94期(2022年11月11日)	13,015	15	△1.3	48.6	1.5	35.7	-	-	13.1	434
第33作成期	95期(2023年1月11日)	12,480	15	△4.0	47.7	2.0	36.3	-	-	12.7	409
	96期(2023年3月13日)	12,692	15	1.8	48.7	1.1	35.7	-	-	12.2	418
	97期(2023年5月11日)	13,207	15	4.2	48.8	1.3	34.0	-	-	14.3	432
第34作成期	98期(2023年7月11日)	13,862	15	5.1	50.9	1.0	32.4	-	-	14.1	439
	99期(2023年9月11日)	14,223	15	2.7	51.9	1.2	31.3	-	-	14.0	453
	100期(2023年11月13日)	14,207	15	△0.0	52.2	1.2	31.3	-	-	13.4	464
第35作成期	101期(2024年1月11日)	14,827	15	4.5	51.6	2.1	30.3	-	-	13.7	476
	102期(2024年3月11日)	15,345	15	3.6	54.7	0.9	29.1	-	-	13.0	495
	103期(2024年5月13日)	15,937	15	4.0	50.8	1.5	33.7	-	-	12.2	518
第36作成期	104期(2024年7月11日)	16,743	15	5.2	52.7	1.3	32.3	-	-	11.8	546
	105期(2024年9月11日)	15,395	15	△8.0	49.6	1.0	34.3	-	-	12.8	501
	106期(2024年11月11日)	16,448	15	6.9	53.2	1.2	32.5	-	-	12.8	525

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含む場合があります。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注6) 当ファンドは、国内外の株式、債券および不動産投資信託証券(リート)の6資産に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。各資産の基本資産配分比率については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づいて決定しますが、原則として年1回見直すこととします。

上記コンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率							
第104期	(期 首) 2024年 5 月 13 日	15,937	—	50.8	1.5	33.7	—	—	—	12.2
	5 月 末	15,964	0.2	51.1	1.6	33.4	—	—	—	12.0
	6 月 末	16,408	3.0	51.8	1.6	33.0	—	—	—	11.9
	(期 末) 2024年 7 月 11 日	16,758	5.2	52.7	1.3	32.3	—	—	—	11.8
第105期	(期 首) 2024年 7 月 11 日	16,743	—	52.7	1.3	32.3	—	—	—	11.8
	7 月 末	16,040	△4.2	51.1	1.7	33.3	—	—	—	12.3
	8 月 末	15,849	△5.3	50.4	1.4	37.5	—	—	—	12.5
	(期 末) 2024年 9 月 11 日	15,410	△8.0	49.6	1.0	34.3	—	—	—	12.8
第106期	(期 首) 2024年 9 月 11 日	15,395	—	49.6	1.0	34.3	—	—	—	12.8
	9 月 末	15,845	2.9	50.2	1.6	33.6	—	—	—	12.5
	10 月 末	16,343	6.2	50.9	1.6	32.7	—	—	—	12.4
	(期 末) 2024年 11 月 11 日	16,463	6.9	53.2	1.2	32.5	—	—	—	12.8

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

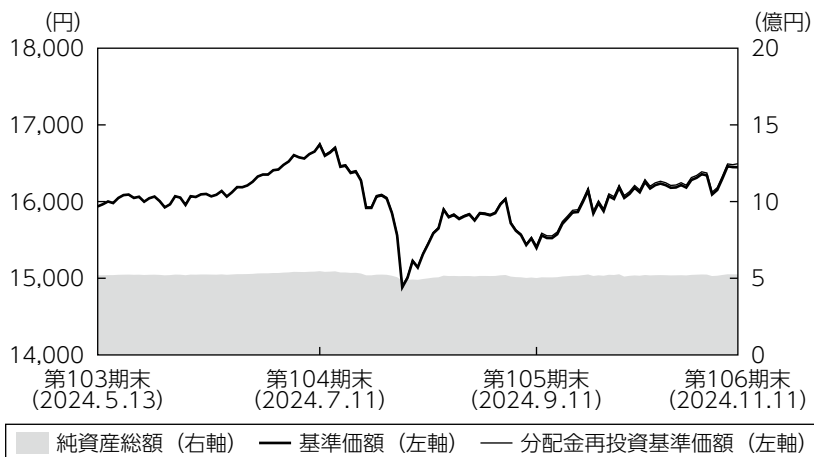
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含む場合があります。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第104期～第106期の運用経過（2024年5月14日から2024年11月11日まで）

基準価額等の推移



第104期首： 15,937円
 第106期末： 16,448円
 （既払分配金45円）
 騰落率： 3.5%
 （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。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2) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注3) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

日銀の想定以上の金融引き締め姿勢等を背景に複数の通貨が対円で下落したことや国内の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと等がマイナスに寄与しました。一方、米国を中心に企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内外の株式市場や外国リート市場が上昇したこと、FRB（米連邦準備理事会）やECB（欧州中央銀行）が利下げを開始したこと等から米欧の多くの国で長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと等がプラスに寄与し、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	1.7%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.4%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.1%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	△5.6%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.2%

投資環境

国内株式市場は、作成期初から2024年7月までは、為替動向などを材料に一進一退の展開となりました。8月上旬には、円高ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを受けて急落しました。9月には、米国経済指標の改善などを受けて金融市場全体が徐々に落ち着きを取り戻し、値を戻す展開となりました。10月以降も、石破首相就任や米国大統領選挙などを受けて市場変動が高い状況でしたが、米国株高と円安ドル高等を要因として小幅ながら上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。作成期初から米欧などの利下げ期待により長期金利が低下したことで多くの市場が上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化や米大型ハイテク株の下落などが重しとなり調整する場面も見られましたが、パウエルF R B議長が、2024年9月の利下げを示唆したことなどから反発し、利下げ後も更なる利下げ期待から高値圏で作成期末を迎えました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。作成期初から2024年7月にかけては、日銀の国債買い入れ減額や円安進行に伴う利上げ観測などから利回りは上昇しました。8月初めに米景気後退懸念を背景としたリスク回避の動きから大幅に利回りが低下した後、作成期末にかけては堅調な米雇用統計の結果や米大統領選挙などを受けた米国金利の上昇に連れて利回りは上昇しました。

外国債券市場では、米国債およびドイツ国債の利回りはともに低下しました。米国債は、米国のインフレの鈍化、米雇用者数の伸び鈍化や失業率の悪化などを受けて、F R Bが利下げを開始したことから利回りは低下しました。ドイツ国債についてもヨーロッパの景気悪化懸念などを受け、E C Bが利下げを開始し利回りは低下しました。

国内リート市場は下落しました。日米の金融政策を巡る思惑などから方向感に欠ける展開が続きました。2024年8月には急速な円高や米景気後退懸念を受けてリスク回避的な動きが強まり、急落する局面もありましたが、日銀の内田副総裁が不安定な状況下では利上げしないと述べたことなどにより値を戻しました。作成期末にかけては自民党総裁選挙の結果を受けて日銀の追加利上げペース加速への懸念が強まり、軟調な推移となりました。

外国リート市場は上昇しました。2024年6月以降、米長期金利の低下などが支えとなりリート市場は堅調に推移しました。10月以降は堅調な米雇用統計を受けて米長期金利が上昇したことや中東情勢に対する懸念などからリスク回避の動きも見られ上値の重い展開となりました。

為替市場では円は主要通貨に対して値動きの大きい展開となりました。ドル／円相場は、内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安ドル高となった後、日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気後退懸念等から急速に円高ドル安が進みました。その後、米景気後退懸念が和らいだこと等から再び円安ドル高に振れました。その他主要通貨においても、円安で推移したのち急速に円高が進みましたが、再び円安方向に振れました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととしていますが、当作成期において変更はありませんでした。組入れる6資産の保有比率が概ね基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分についてはリバランスを行いませんでした。

<基本資産配分比率>

日本株式：25% 外国株式：28% 日本債券：23% 外国債券：12% 日本リート：6% 外国リート：6%

●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。

●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。

●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。

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

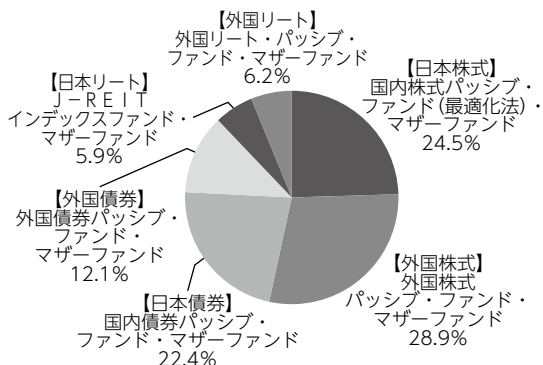
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

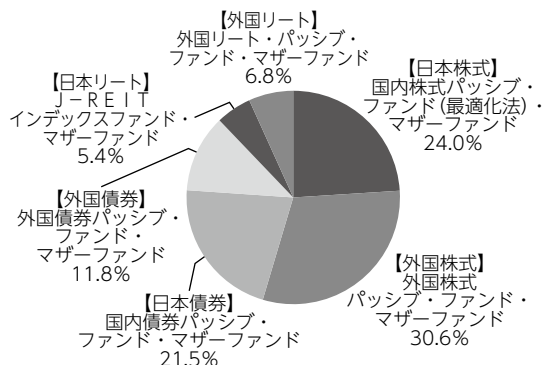
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

前作成期末



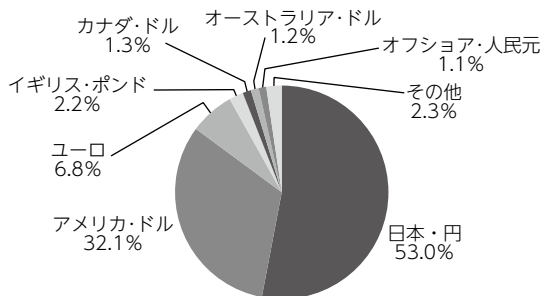
当作成期末



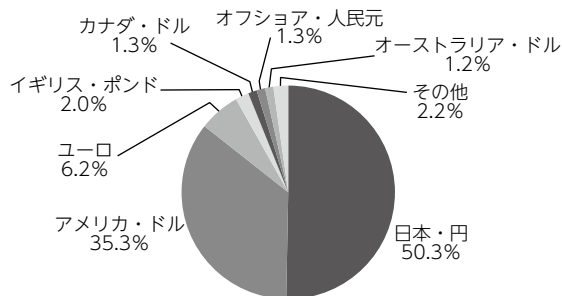
(注) 組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



(注1) 組入比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券の評価額に対する割合です。

(注2) 組入比率が1.0%未満の通貨については、合計してその他として表示しております。

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第104期	第105期	第106期
	2024年5月14日 ～2024年7月11日	2024年7月12日 ～2024年9月11日	2024年9月12日 ～2024年11月11日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.09%	0.10%	0.09%
当期の収益	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	7,443円	7,453円	7,505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

●当ファンド

マザーファンドの組入比率について、基本資産配分比率に基づき高位組入れを維持します。また、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、年1回の基本資産配分比率の見直し時を除いては原則としてリバランスを行いません。

●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。

●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。

●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。

●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。

● J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

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

● 外国リート・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	第104期～第106期 (2024年5月14日 ～2024年11月11日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	44円	
(投信会社)	(23)	(0.142)	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)	(18)	(0.110)	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)	(4)	(0.022)	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
(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)	(0.001)	
(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)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	1	0.007	(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)	(1)	(0.004)	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)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	45	0.284	

(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。

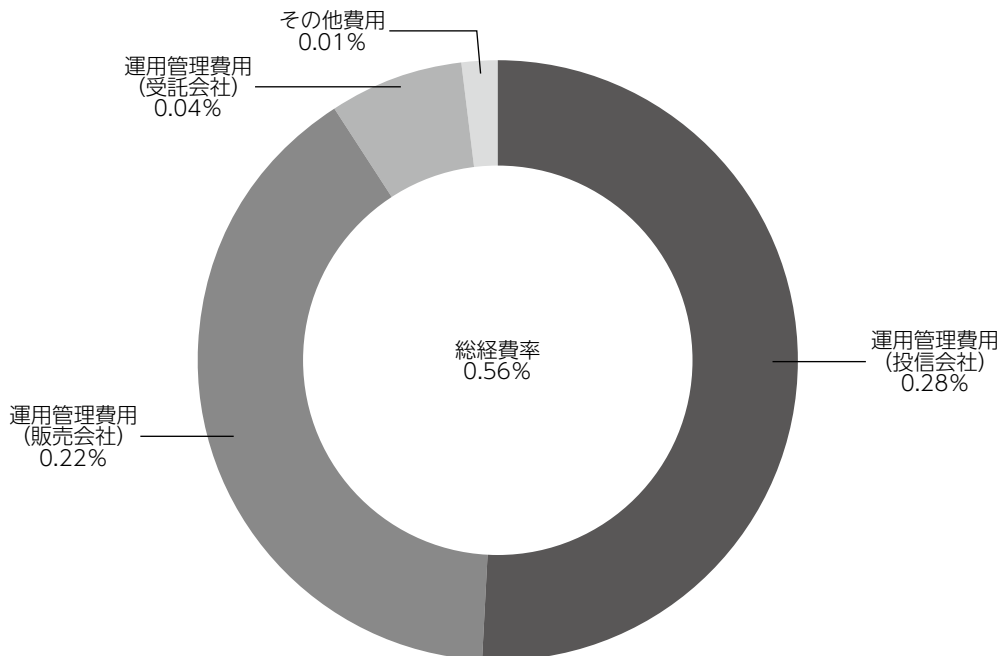
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

当作成期中の運用・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0.56%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（2024年5月14日から2024年11月11日まで）

	第 104 期 ~ 第 106 期			
	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	-	-	699	3,309
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	-	-	406	3,706
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	-	-	2,497	3,044
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	-	-	668	1,588
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	-	-	348	794
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	-	-	373	794

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 104 期 ~ 第 106 期	
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	123,412,826千円	237,483,420千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	575,683,168千円	1,530,097,633千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.21	0.15

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2024年5月14日から2024年11月11日まで）

【マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 104 期 ~ 第 106 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	6千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.181千円
(B) / (A)	2.9%

(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

決 算 期	第 104 期 ~ 第 106 期					
	区 分	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
株 式						

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 104 期 ~ 第 106 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 509	百万円 624	百万円 6,801

(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	第 104 期 ~ 第 106 期	
	買 付 額	
株 式	百万円 322	

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【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

決 算 期	第 104 期 ~			第 106 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 419,945	百万円 47,659	% 11.3	百万円 454,304	百万円 65,622	% 14.4

平均保有割合 0.0%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 104 期 ~			第 106 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 35,708	百万円 22,364	% 62.6	百万円 47,650	百万円 35,129	% 73.7
不動産投信指数先物取引	9,816	9,816	100.0	9,913	4,990	50.3

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 104 期 ~ 第 106 期	
	買	付 額
投 資 証 券		百万円 3,110

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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、当作成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

	第 35 作 成 期 末	第 36 作 成 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	26,070	25,371	123,948
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16,139	15,733	158,198
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	94,093	91,596	110,968
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25,663	24,995	60,800
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	12,646	12,297	27,778
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,876	15,502	34,974

■投資信託財産の構成

2024年11月11日現在

項 目	第 36 作 成 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	123,948	23.5
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	158,198	30.0
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	110,968	21.1
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	60,800	11.5
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	27,778	5.3
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	34,974	6.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,214	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	526,883	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、2024年11月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,724,740,450千円、97.2%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは266,333,330千円、99.4%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは99,140,115千円、92.3%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、2024年11月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=153.14円、1カナダ・ドル=110.07円、1オーストラリア・ドル=100.90円、1香港・ドル=19.70円、1シンガポール・ドル=115.38円、1ニュージーランド・ドル=91.36円、1イギリス・ポンド=197.75円、1イスラエル・シケル=40.83円、1スイス・フラン=174.76円、1デンマーク・クローネ=22.00円、1ノルウェー・クローネ=13.91円、1スウェーデン・クローナ=14.15円、1メキシコ・ペソ=7.61円、100韓国・ウォン=10.97円、1オフショア・人民元=21.271円、1マレーシア・リンギット=34.834円、1ポーランド・ズロチ=37.896円、1ユーロ=164.04円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月11日)、 (2024年9月11日)、 (2024年11月11日)現在

項 目	第 104 期 末	第 105 期 末	第 106 期 末
(A) 資 産	547,514,422円	502,077,027円	526,883,482円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,530,416	11,037,798	10,214,236
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)	134,802,987	115,547,286	123,948,807
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	162,296,157	139,363,192	158,198,145
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	113,147,911	114,179,135	110,968,871
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	64,941,529	59,230,015	60,800,826
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	28,854,656	29,238,766	27,778,193
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	33,940,766	33,480,835	34,974,404
(B) 負 債	1,160,159	974,163	1,870,093
未 払 収 益 分 配 金	489,488	488,232	478,786
未 払 解 約 金	198,828	—	912,499
未 払 信 託 報 酬	468,529	482,520	475,451
そ の 他 未 払 費 用	3,314	3,411	3,357
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	546,354,263	501,102,864	525,013,389
元 本	326,325,370	325,488,585	319,190,933
次 期 繰 越 損 益 金	220,028,893	175,614,279	205,822,456
(D) 受 益 権 総 口 数	326,325,370口	325,488,585口	319,190,933口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	16,743円	15,395円	16,448円

(注) 第103期末における元本額は325,597,063円、当作成期間(第104期~第106期)中における追加設定元本額は9,394,737円、同解約元本額は15,800,867円です。

■損益の状況

[自 2024年5月14日
至 2024年7月11日] [自 2024年7月12日
至 2024年9月11日] [自 2024年9月12日
至 2024年11月11日]

項 目	第 104 期	第 105 期	第 106 期
(A) 配 当 等 収 益	911円	2,742円	4,038円
受 取 利 息	911	2,742	4,038
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	27,181,089	△42,449,043	34,358,153
売 買 益	29,862,327	3,184,842	36,997,854
売 買 損	△2,681,238	△45,633,885	△2,639,701
(C) 信 託 報 酬 等	△471,843	△485,931	△478,808
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	26,710,157	△42,932,232	33,883,383
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	180,163,286	203,001,183	154,990,259
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,644,938	16,033,560	17,427,600
(配 当 等 相 当 額)	(36,515,442)	(39,276,445)	(40,433,323)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△22,870,504)	(△23,242,885)	(△23,005,723)
(G) 合 計(D + E + F)	220,518,381	176,102,511	206,301,242
(H) 収 益 分 配 金	△489,488	△488,232	△478,786
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	220,028,893	175,614,279	205,822,456
追 加 信 託 差 損 益 金	13,644,938	16,033,560	17,427,600
(配 当 等 相 当 額)	(36,516,491)	(39,278,733)	(40,435,852)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△22,871,553)	(△23,245,173)	(△23,008,252)
分 配 準 備 積 立 金	206,383,955	203,311,251	199,144,614
繰 越 損 益 金	-	△43,730,532	△10,749,758

(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	第 104 期	第 105 期	第 106 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,487,298円	798,300円	2,160,551円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	25,222,859	0	0
(c) 収 益 調 整 金	36,516,491	39,278,733	40,435,852
(d) 分 配 準 備 積 立 金	180,163,286	203,001,183	197,462,849
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	243,389,934	243,078,216	240,059,252
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	7,458.50	7,468.10	7,520.87
(g) 分 配 金	489,488	488,232	478,786
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	15	15	15

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 104 期	第 105 期	第 106 期
1 万口当たり分配金	15円	15円	15円

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第22期（決算日 2024年2月7日）

（計算期間 2023年2月8日～2024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22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
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
22期 (2024年2月7日)	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	2.5	542,130

(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）。

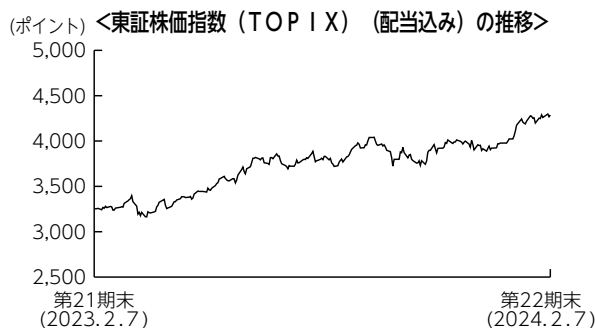
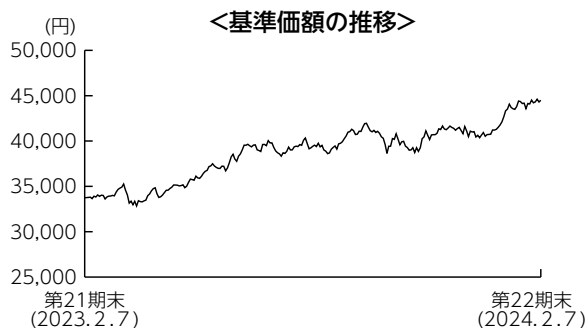
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	33,751	—	3,251.81	—	98.0	1.9
2 月 末	33,931	0.5	3,269.12	0.5	98.8	1.3
3 月 末	34,508	2.2	3,324.74	2.2	96.1	4.4
4 月 末	35,438	5.0	3,414.45	5.0	97.9	2.4
5 月 末	36,715	8.8	3,537.93	8.8	97.3	2.8
6 月 末	39,491	17.0	3,805.00	17.0	98.4	1.7
7 月 末	40,083	18.8	3,861.80	18.8	97.5	2.5
8 月 末	40,253	19.3	3,878.51	19.3	97.5	2.6
9 月 末	40,464	19.9	3,898.26	19.9	97.6	2.6
10 月 末	39,253	16.3	3,781.64	16.3	97.3	2.7
11 月 末	41,378	22.6	3,986.65	22.6	97.7	2.4
12 月 末	41,289	22.3	3,977.63	22.3	96.9	3.2
2024年 1 月 末	44,516	31.9	4,288.36	31.9	97.8	2.1
(期 末) 2024年 2月7日	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年2月8日から2024年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は44,494円となり、前期末比で31.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

日米の長期金利差などを要因として円安ドル高が進行したことや、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や海外投資家による日本株買いなどを要因として日本株が大きく上昇したことから、基準価額も上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2023年3月末までは、日米の金融政策、欧米での金融機関の破綻などを要因として一進一退の展開となりました。その後、4月から9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や欧米投資家による日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化などを要因として一時的に下落する場面もありましたが、期末にかけては円安ドル高の流れを受けて上昇しました。

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	17.3%
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

期末

No.	業種	比率
1	電気機器	16.9%
2	輸送用機器	8.9
3	情報・通信業	7.4
4	卸売業	7.1
5	銀行業	6.9
6	化学	5.8
7	機械	5.2
8	サービス業	4.5
9	医薬品	4.4
10	小売業	4.1

○組入上位10銘柄

期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.6%
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	

期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.8%
2	ソニーグループ	日本・円	2.7
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.3
4	キーエンス	日本・円	1.7
5	東京エレクトロン	日本・円	1.6
6	三菱商事	日本・円	1.6
7	日立製作所	日本・円	1.5
8	日本電信電話	日本・円	1.5
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.5
10	信越化学工業	日本・円	1.4
組入銘柄数		2,148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31.8%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		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	1	0.001	
期中の平均基準価額は38,764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 (2023年2月8日から2024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
		68,285.4 (56,521.786)	152,756,646 (-)	58,527.986	124,543,615

(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
	122,918	121,163	-	-

(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	277,300,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	438,574,353千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.63

(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（2023年2月8日から2024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 152,756	百万円 103,694	% 67.9	百万円 124,543	百万円 58,472	% 46.9

(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 1,537	百万円 1,475	百万円 5,468

(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 198

(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)	4,122千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B) / (A)	0.1%

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、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	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
トレックス・セミコンダクター	6.5	7.6	13,056	マクセル	29.9	32.6	51,182	キャノン電子	15.1	16.2	33,712	
東光高岳	8.4	8.9	21,119	古野電気	18	19.2	39,052	キャノン	749	729.3	2,980,649	
ダブル・スコープ	45.1	42.3	30,709	スミダコーポレーション	12.6	19.8	22,928	リコー	342.2	366.6	465,398	
ダイヘン	12.5	14.8	95,756	アイコム	5.4	5.7	20,491	象印マホービン	40.8	39.7	56,413	
ヤーマン	23.8	28.7	28,814	リオン	5.7	6.1	15,512	MUTOHホールディングス	1.7	0.9	1,874	
JVCケンウッド	125.5	116.6	76,606	横河電機	150.9	161.6	472,356	東京エレクトロン	96.3	309.5	8,814,560	
ミマキエンジニアリング	13.1	14	13,440	新電元工業	5.3	5.6	17,640	イノテック	9.1	9.7	18,119	
IPEX	7.6	10.2	17,911	アズビル	95.4	100.6	463,061	輸送用機器 (9.1%)				
日新電機	33	-	-	東亜ディーケーケー	5.9	3.1	2,935	トヨタ紡織	57.5	61.6	145,468	
大崎電気工業	32.5	32.3	21,899	日本光電工業	63.1	62.7	249,984	芦森工業	2.3	1.3	3,120	
オムロン	126.3	112.8	625,137	チノー	5.7	6.1	14,609	ユニプレス	24.5	26.2	29,055	
日東工業	18.6	19.9	84,973	共和電業	11.6	6.1	2,580	豊田自動織機	99.8	124.7	1,685,320	
IDEC	20.3	21.8	60,669	日本電子材料	9	9	17,208	モリタホールディングス	24	25.7	39,603	
正興電機製作所	4.6	2.2	2,457	堀場製作所	30.3	27.9	344,983	三機工業	20.9	22.3	19,824	
不二電機工業	2.5	1.3	1,492	アドバンテスト	107.5	418.9	2,561,573	デンソー	281.6	1,206.3	3,042,891	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	45.3	57.6	148,348	小野測器	4.5	2.7	1,242	東海理化電機製作所	38.6	41.2	94,677	
サクサホールディングス	2.6	1.5	4,252	エスベック	10.9	11.7	29,881	川崎重工業	102.9	119.4	418,735	
メルコホールディングス	3.7	4.6	14,950	キーエンス	136.5	146.3	9,389,534	名村造船所	31.2	36.4	49,140	
テクノメディカ	3.3	3.5	6,685	日置電機	7.1	6.9	45,126	日本車輛製造	5.3	4.8	10,972	
ダイキンエレクトリックシステムズ	4.5	5.5	3,839	シスメックス	117.7	126.2	960,760	三菱ロジスネクスト	21.8	23.3	36,441	
日本電気	195	193.9	1,835,069	日本マイクロニクス	22.5	26.3	109,934	近畿車輛	1.5	0.9	1,806	
富士通	137.4	135.9	3,125,020	メガチップス	11.2	11.6	55,100	日産自動車	1,939.1	1,973.1	1,211,680	
沖電気工業	62.3	66.8	71,876	OBARA GROUP	6.4	8	31,520	いすゞ自動車	396.9	425.1	868,904	
岩崎通信機	5.4	3.1	2,154	澤藤電機	1.4	0.8	1,047	トヨタ自動車	7,495.9	8,028.6	26,173,236	
電気興業	5.5	6.6	15,635	原田工業	5.5	2.9	2,180	日野自動車	175.8	219.9	102,473	
サンケン電気	12.8	13.7	106,860	コーセル	16.4	15.6	22,807	三菱自動車工業	532.6	570.4	259,931	
ナカヨ	2.1	1.1	1,261	イリソ電子工業	12.6	13.4	40,803	エフテック	8.3	4.5	3,091	
アイホン	8.4	8	22,936	オプテックスグループ	25.1	26.8	47,168	レッツホールディングス	4.7	2.8	1,878	
ルネサスエレクトロニクス	899.7	963.8	2,288,061	千代田インテグレ	4.7	5.7	15,600	GMB	2.4	1.3	1,635	
セイコーエプソン	183.6	189.5	448,546	レーザーテック	62.5	67	2,674,640	ファルテック	2.1	1.3	726	
ワコム	109.2	112.3	83,438	スタンレー電気	97.1	93.6	248,929	武蔵精密工業	33.3	35.7	61,368	
アルパック	32.7	32.4	244,911	岩崎電機	4.4	-	-	日産車体	24.1	14.8	14,518	
アクセル	4.5	5.9	13,440	ウシオ電機	71.3	74.3	152,835	新明和工業	42.9	42.1	49,088	
EIZO	10.1	10.8	53,460	岡谷電機産業	9.8	5	1,430	極東開発工業	24	24.2	58,007	
ジャパンドイスプレイ	528.8	636.3	12,726	ハリオス テクノ ホールディング	11.1	6.5	3,458	トビー工業	11.1	11.9	34,867	
日本信号	31.4	33.7	32,183	エノモト	3.1	1.8	2,921	ティラド	3.4	3.2	12,080	
京三製作所	29.9	30.9	14,368	日本セラミック	13.9	11.9	31,475	曙ブレーキ工業	83.3	89.1	10,157	
能美防災	18.7	20	46,040	遠藤照明	5.4	2.9	4,428	タチエス	21.6	27	53,460	
ホーチキ	10.3	11	23,386	古河電池	10.1	10.7	10,047	NOK	53	56.8	116,553	
星和電機	5.2	2.9	1,392	双信電機	5	2.6	767	フタバ産業	36.5	39.2	38,376	
エレコム	32.9	35.3	59,551	山一電機	11.9	13.1	28,767	カヤバ	13.1	14.1	71,064	
パナソニック ホールディングス	1,628.6	1,744.5	2,495,507	図研	11.9	12.7	51,752	大同メタル工業	26.6	28.6	16,330	
シャープ	166	248.9	214,576	日本電子	34.2	36.6	243,353	プレス工業	60.8	58.4	39,303	
アンリツ	97.1	104	121,108	カシオ計算機	101.6	105.6	133,108	ミクニ	14	8.2	4,108	
富士通ゼネラル	39.1	41.9	87,990	ファナック	133.9	713	2,812,785	太平洋工業	31.3	33.5	50,116	
ソニーグループ	965.7	1,034.3	14,790,490	日本シイエムケイ	29	31.1	23,387	河西工業	16.1	10.3	1,936	
TDK	218.4	233.8	1,776,646	エンプラス	4	4.3	46,827	アイシン	105.4	112.8	595,358	
帝国通信工業	6.2	6.5	12,668	大真空	16.6	21.8	19,140	マツダ	451.5	483.6	919,807	
タムラ製作所	59.1	58.8	31,810	ローム	63.1	270.3	719,538	今仙電機製作所	7.7	4.1	3,075	
アルプスアルパイン	123.1	131.9	141,133	浜松ホトニクス	109.5	117.3	661,102	本田技研工業	1,109.7	3,565.6	6,098,958	
池上通信機	4	2	1,796	三井ハイテック	14.1	12.9	95,382	スズキ	250.8	268.5	1,942,597	
日本電波工業	16.5	17.7	21,169	新光電気工業	48.3	51.7	281,765	SUBARU	432	453.4	1,403,273	
鈴木	7.4	7.9	9,875	京セラ	212.1	908.5	1,887,408	安永	5.4	2.8	1,909	
メイコー	15.1	14.7	67,326	太陽誘電	66.5	71.2	244,287	ヤマハ発動機	214.5	631.9	896,982	
日本トリム	3.1	3.3	10,923	村田製作所	414	1,330.3	3,976,931	T Y B K	11.7	7	2,961	
ロランド ディー・ジー	7.7	8.1	31,509	双葉電子工業	25.8	27.8	14,066	エクセディ	22.2	23.9	68,712	
フォスター電機	12.8	10.9	12,327	北陸電気工業	4.5	2.4	3,381	豊田合成	39.8	41.9	123,730	
SMK	3.3	3.8	9,500	ニチコン	27.9	38.4	48,384	菱三工業	22.6	24.2	35,283	
ヨコオ	10.9	13	18,564	日本ケミコン	13.5	15.6	21,871	盟和産業	1.5	0.9	931	
ティアック	18.8	10.6	1,049	KOA	20.6	22.1	32,199	日本プラスト	9.5	5.5	3,327	
ホシデン	33	33.6	60,312	市光工業	19.7	26.4	15,892	ヨロズ	12.6	13.7	13,672	
ヒロセ電機	22.8	21.8	354,032	小糸製作所	164.2	151.5	305,727	エフ・シー・シー	24.3	25.9	54,131	
日本航空電子工業	28.3	35.3	86,732	ミツバ	25.6	27.4	30,907	シマノ	55.8	59.1	1,245,532	
TOA	15.7	16.8	18,900	SCREENホールディングス	23.3	50	817,250	ティ・エス テック	62.5	52	100,568	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
精密機器 (2.3%)	6.6	7.1	10,792	共同印刷	3.8	4.1	13,940	サカイ引越センター	6.5	16.2	42,816
テルモ	426.5	408.8	2,073,842	NISSHA	26	25	39,500	近畿グループホールディングス	136.3	146	657,146
クリエイトメディック	4.2	2.1	1,871	光村印刷	0.6	0.5	779	阪急神戸ホールディングス	181.7	194.7	887,832
日機装	34.1	34.1	38,396	TAKARA & COMPANY	8.8	8.6	24,355	南海電気鉄道	65.1	65.1	193,867
日本エム・ディ・エム	8	11.6	8,444	アッシュクス	126	124.6	585,620	京都ホールディングス	56.3	80.5	288,914
島津製作所	166.2	194.3	750,386	ツツミ	2.4	2.4	5,220	神戸電鉄	3.7	4	11,508
JMS	12.8	13.4	6,994	ローランド	10	10.8	52,164	名古屋鉄道	150.6	150.6	340,657
クボテック	3.2	1.8	459	小松ウオール工業	5.1	6	19,410	山陽電気鉄道	10.3	11	24,057
長野計器	9.9	10.6	24,348	河合楽器製作所	3.7	4.4	15,422	アルプス物流	10.9	11.7	22,101
ブイ・テクノロジ	6.6	7.7	20,713	クリナップ	15.4	14.3	11,096	ヤマトホールディングス	174.5	186.9	451,550
東京計器	10.4	11.2	20,798	ピジョン	86.9	93.1	149,565	山九	34.7	37.1	199,820
愛知時計電機	5.4	6.3	16,304	兼松サステック	0.6	-	-	丸連	6.5	3.7	1,036
インタラクティブ	6.4	8.8	9,900	キングジム	12.2	13	11,323	丸全昭和運輸	8.5	9	37,350
オーバル	10.7	5.7	3,100	リントック	27.4	29.4	82,114	セブングループホールディングス	72.2	77.3	87,194
東京精密	29.9	29.9	283,631	イトーキ	27.9	30	46,920	トナミホールディングス	2.5	3.2	14,864
マニー	60.1	58.5	120,217	任天堂	861.9	923.1	7,725,423	ニッコンホールディングス	43.7	46.7	148,926
ニコン	212.3	211.4	319,108	三菱鉛筆	19.4	20.8	40,996	日本石油輸送	0.8	0.7	2,009
トプコン	71.8	71.1	122,043	タカラスタンダード	26.4	30.8	57,934	福山通運	10.4	16.7	71,309
オリンパス	853.3	900	1,930,500	コクヨ	65.7	59.9	141,573	セイノホールディングス	84.9	82.1	177,294
理研計器	8.5	10.4	82,472	ナカバヤシ	15	15.7	8,478	エスライングループ本社	3.7	1.8	1,564
タムロン	10.2	9	51,570	グローブライド	11	13.1	27,248	神奈川中央交通	3.9	4	12,440
HOYA	291.5	287.8	5,295,520	オカムラ	41.1	44.1	96,005	AZ-COM株式ホールディングス	32.9	37.3	56,770
シード	6.2	3.3	2,646	美津濃	13.5	14.5	63,945	C&Fホールディングス	13.2	14.1	24,745
ノーリツ鋼機	12.9	13.9	45,592	電気・ガス業 (1.4%)				九州旅客鉄道	96.3	103.2	348,093
A&Dホンホールディングス	19.9	21.3	45,156	東京電力ホールディングス	1,230.6	1,318	1,005,502	SGホールディングス	261.6	245.1	460,910
朝日インテック	152.5	178.2	515,176	中部電力	503.1	538.8	1,057,395	NIPPON EXPRESSホールディングス	50.9	49.5	429,066
シチズン時計	149.9	134.5	130,868	関西電力	527.1	564.6	1,080,362	海運業 (0.9%)			
リズム	3.8	1.5	5,355	中国電力	217.4	254	251,053	日本郵船	364.6	418.4	2,048,068
大研医器	9.3	5.6	3,029	北陸電力	128.7	149.5	106,279	商船三井	240.2	316.8	1,674,288
メニコン	46.9	50.3	107,013	東北電力	333.7	384.9	386,632	川崎汽船	116.1	117.2	823,330
シンシア	1.2	0.8	468	四国電力	116.5	136.2	140,830	NSユニテッド海運	7.3	7.9	40,211
松風	6.2	6.6	17,721	九州電力	315	337	389,403	明海グループ	11.8	7.1	5,530
セイコーグループ	21.2	20.4	54,835	北海道電力	131.7	141.2	89,873	飯野海運	50	53.6	72,306
ニプロ	113.8	121.9	146,462	沖縄電力	31.9	37.3	40,768	共栄タンカー	2.2	1.2	1,225
その他製品 (2.4%)				電源開発	102.8	120.1	308,596	乾汽船	17.3	17.1	18,365
KYORITSU	17.6	9.7	1,959	エフオン	8.9	10.6	4,706	空運業 (0.4%)			
中本パックス	3.8	2.1	3,645	イーレックス	24.3	26	19,994	日本航空	334.8	358.5	1,001,111
スノーピーク	23.3	20.8	17,700	レノバ	36.3	39	47,697	ANAホールディングス	370.8	397.2	1,287,722
パワマウントペドホールディングス	31.6	30.4	81,016	東京瓦斯	288.6	309.1	1,021,575	パスコ	2.5	1.3	2,442
トラザクアクション	10.5	9.6	23,654	大阪瓦斯	276.6	296.2	918,516	倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
粧美堂	3.5	1.8	1,398	東邦瓦斯	53.8	63.3	189,108	トランコム	3.9	4.2	29,232
ニホンフラッシュ	12.9	13.7	13,110	北海道瓦斯	8.2	8.7	19,992	日新	10.3	11.1	29,903
前田工業	11.6	12.4	38,750	広島ガス	28.8	30.9	12,174	三菱倉庫	29.3	35.9	158,498
永大産業	13	7.5	1,770	西部ガスホールディングス	12.8	15.3	29,024	三井倉庫ホールディングス	12.7	13.6	64,872
アートネイチャー	14.1	13.2	10,520	静岡ガス	31.2	29.2	29,784	住友倉庫	37.5	39.4	99,169
フルヤ金属	-	3.5	32,690	メタウォーター	17	17.5	37,275	濠洲倉庫	5.5	6.7	20,937
パナダイナムホールディングス	124.7	400.6	1,212,215	陸運業 (2.7%)				東陽倉庫	16.4	1.7	2,669
アイフイスジャパン	3.5	1.9	1,145	SBSホールディングス	12.2	13	32,162	日本トランスシティ	27.6	29.4	18,610
SHOEI	14.4	33.1	64,611	東武鉄道	150	160.6	628,749	ケイヒン	2.2	1.1	2,125
フランスベッドホールディングス	16.8	19	26,448	相鉄ホールディングス	45.1	52.3	148,139	中央倉庫	6.7	7.8	9,063
パイロットコーポレーション	21.4	20.6	82,523	東急	382.7	410	704,995	川西倉庫	2.1	1.3	1,463
萩原工業	9.1	9.8	14,592	京浜急行電鉄	154.8	180.9	234,265	安田倉庫	9.5	10	12,110
フジシルインターナショナル	27.7	29.6	51,504	小田急電鉄	206.9	241.8	533,289	フェイスホールディングス	2.3	0.9	1,191
タカラトミー	62.9	66.6	158,474	京王電鉄	72.2	70.3	294,416	東洋埠頭	3.5	1.9	2,644
広済堂ホールディングス	8.2	37.6	27,786	京成電鉄	88	94.3	650,670	上組	65.3	67.4	228,620
エステールホールディングス	2.9	1.7	1,113	富士急行	16.8	18	78,570	サンリツ	2.8	1.6	1,259
タカノ	4.6	2.4	2,412	東日本旅客鉄道	231.6	268.6	2,417,400	キムラユニティ	5.9	3.1	5,031
プロネクサス	11.4	15.2	19,319	西日本旅客鉄道	174.3	173.4	1,112,361	キューソー流通システム	7.3	6.6	6,039
ホクシン	9.4	4.8	552	東海旅客鉄道	105.2	563.2	2,124,390	東海運	7.5	3.8	1,113
ウッドワン	4	2.4	2,464	西武ホールディングス	165.1	176.9	375,028	エアィテイ	8.6	9.2	17,056
大建工業	8	-	-	鴻池運輸	23.3	24.9	47,484	内外トランスライン	5	5.8	14,018
TOPPANホールディングス	178.5	179.7	708,018	日本宝くじ	36.4	39.1	96,264	日本コンCEPT	4.2	5.3	9,306
大日本印刷	162	159.8	668,763	ハマキョウレックス	10.7	12.5	50,187	情報・通信業 (7.6%)			
								NECネットエスアイ	45.7	57.2	133,218

銘柄	期首(前期末)			銘柄	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	
クロスキャット		千株	千円	アドソル日進	千株	千株	千円	FIG	千株	千株	千円	
システナ	7.8	9.3	10,918	ODKソリューションズ	5.8	6.2	9,901	システナサポート	14.1	7.6	2,287	
デジタルアーツ	230.2	221.9	63,907	フリービット	2.7	1.3	782	インーソル	5.3	5.7	10,847	
日鉄ソリューションズ	8.7	9.3	39,246	コムチュア	7.1	6.4	9,158	アルテリア・ネットワークス	8.8	10.6	6,190	
キューブシステム	23.4	25	124,375	サイバーコム	18.1	21.2	38,859	東海ソフト	1.9	1.1	1,283	
TI S	8.3	7.8	8,884	アステリア	2	-	-	ウイングワーク1st	14.1	15.2	43,350	
手間いらず	5.9	6.5	11,648	アイル	10.7	11.5	7,233	イー・コミュニケーションズ	3.7	3.9	4,539	
ラウンホールディングス	2.3	2.5	6,695	マークラインズ	7.6	6.8	21,964	サーバーワークス	2.8	3	12,120	
ソリトンシステムズ	11.4	10.9	7,542	メディカル・データ・ビジョン	7.4	7.9	23,700	東名	0.9	0.5	1,140	
ソフトクリエイトホールディングス	7	7.6	10,716	gumi	20.4	17.5	11,095	ヴィッツ	1.2	0.6	493	
T I S	5.7	12.1	21,634	ショーケース	21.1	23.8	9,496	トピラスシステムズ	3.1	1.9	1,654	
テクミラホールディングス	153.9	160.4	546,803	モバイルファクトリー	3	1.5	499	Sansan	44.7	48.1	67,772	
グリー	5.6	3	1,422	テラスカイ	2.6	1.4	1,016	Link-U	2.3	1.6	1,014	
GMOペパボ	36.7	49.1	28,428	デジタル・インフォメーション・テクノロジ	5.9	6.3	9,620	ギフティ	14.9	12.9	19,866	
コーエーテックモホールディングス	2	1.8	2,149	PCIホールディングス	7.9	7.6	13,512	モデル	13.7	19.7	90,915	
三菱総合研究所	85.8	91.9	165,098	アイビーシー	5.1	2.4	2,433	JMDC	4.6	5.1	16,294	
ボルテージ	6.7	7.2	35,352	ネオジャパン	1.9	1	468	フォーカスシステムズ	22.5	25	91,900	
電算	3.6	1.8	487	PR TIME S	4.5	4.9	5,169	グレスコ	10	9.8	10,280	
AGS	0.8	0.8	1,197	ラクス	3.4	2.9	6,223	フジ・メディア・ホールディングス	10.5	12	23,604	
ファンデックス	5.3	2.7	2,459	ランドコンピュータ	64.7	69.4	165,484	オービック	131.4	140.9	276,938	
ブレインパッド	10.7	11.6	11,774	ダブルスタンダード	3	3.1	2,749	ジャストシステム	45.7	49	1,099,315	
KLab	10.2	12.2	15,396	オーブントリア	5.6	4.5	7,389	TDCソフト	19.7	21.1	62,329	
ホールディングスホールディングス	27.2	26.9	9,657	マイネット	9.6	8.5	8,007	LINEヤフー	11.6	13.7	29,085	
ネクソン	23.4	25	12,125	アカツキ	4	2.1	583	トレンドマイクロ	1,948.4	2,087.7	904,600	
アイスタイル	354	328.2	948,662	ベネフィットジャパン	6.5	7	17,528	IDホールディングス	79	69.3	572,279	
エムアップホールディングス	39.8	47.8	19,550	Ubicomホールディングス	0.8	0.4	498	日本オラクル	9.3	9.9	16,780	
エイチエム	16.7	18	17,964	カナミックネットワーク	4.2	4.6	7,369	アルファシステムズ	26.2	28.1	316,827	
エニゴモ	9.9	8.7	4,863	コムラシスシステムコーポレーション	19.7	15.8	6,699	フューチャー	4.3	3.9	12,246	
テクノスジャパン	17.4	18.6	6,510	チェンジホールディングス	11.7	7.1	809	CAC Holdings	34.1	31.3	53,303	
enish	10	5.8	3,700	シンクロ・フード	33.5	31.9	43,830	S B テクノロジー	8.6	7.9	14,180	
コソブラ	9.2	6.6	1,214	オークネット	7.6	4.1	2,681	トーチ	5.8	6.2	13,615	
オルトプラス	53.2	56.9	35,676	キャピタル・アセット・プランニング	6.7	5.4	11,485	オービックビジネスコンсалタント	3.2	1.9	1,345	
ブロードリーフ	9.2	5.8	881	セグエグループ	2.4	1.3	978	伊藤テクノソリューションズ	26.9	20.6	145,477	
クロス・マナテインググループ	79.9	69.6	43,708	イトレッド	3.3	2.1	1,936	アイティフォー	73.5	-	-	
デジタルハブホールディングス	7.3	3.1	1,779	マクロミル	1.9	1	1,416	東計電算	18.2	18.8	22,729	
システム情報	8.6	9.1	9,500	ビーグリーン	26.8	28.8	22,320	エックスネット	2	4.1	15,088	
メディアドウ	12.1	-	-	ユーザローカル	2.1	1.4	1,785	サイボウズ	1.8	1.1	1,105	
じげん	5.5	6.6	8,210	テモナ	4.1	5.3	15,184	電通総研	77.6	72.7	434,964	
ブイキューブ	39.9	42.8	22,256	ニーズウェル	5	6.2	12,920	ACCESS	18.9	20.2	45,510	
エンカレッジ・テクノロジー	16.4	17.5	5,285	マネーフォワード	2.3	1.5	384	デジタルガレージ	16.6	17.8	96,654	
サイバーリンクス	2.9	1.5	958	サインポスト	3.7	3.6	2,862	イーエムシステムズ	16.2	15.2	12,768	
ディー・エル・イー	3.9	2.5	2,022	SUN ASTERISK	32.9	32.7	187,567	ウェザーニューズ	24.3	23.4	82,251	
フィックスターズ	8.8	4.6	846	プラスアルファ・コンсалティブ	4.7	2.5	1,280	C I J	22.8	24.5	16,709	
CARTA HOLDINGS	15.5	16.5	26,383	電算システムホールディングス	7.2	10.4	9,994	ビジネスエンジニアリング	4.2	4.5	22,995	
オプティム	6.4	6.9	10,736	APPPIER GROUP	-	8.7	21,228	日本エンタープライズ	11.4	24.4	16,714	
セレス	11.2	15.1	13,816	ビジョナル	6.6	6.5	19,220	WOWOW	2.6	2.8	12,474	
SHIFT	5.5	5.9	7,351	ソルクシーズ	38.9	50.1	85,671	スカラ	12.4	6.6	818	
ティーガイア	10	9.7	266,604	フェイス	-	11.2	102,816	インテリジェント ウェイ	7.6	11	12,760	
セック	14.3	15.4	31,339	プロトコムポレーション	10.2	5.3	2,141	ANY COLOR	12.7	13.5	10,260	
テクマトリックス	1.7	1.8	9,180	ハイマックス	3.4	1.8	874	WOW WORLD GROUP	6.5	3.5	3,934	
プロシップ	25	26.8	50,946	野村総合研究所	4.3	4.5	6,309	IMAGICA GROUP	-	15.5	52,390	
カホ・マルチメディア・エンターテインメント	6	7.1	9,989	サイバネットシステム	280.9	324.9	1,374,327	ネットワークシステムズ	2.2	-	-	
GMOペイメントゲートウェイ	41.9	38.2	94,984	CEホールディングス	11.5	-	-	システムソフト	11.2	14.7	10,216	
ザップパラ	31.3	29.3	258,250	日本システム技術	6.2	3.4	2,067	アルゴグラフィックス	51	59.2	160,106	
システムリサーチ	3.4	5	17,125	インテックホールディングス	5.1	5.4	17,577	マーベラス	5.8	50.8	2,946	
インタネットエンジニアティブ	4.2	70.1	198,207	東邦システムサイエンス	15.5	16.6	28,552	EIPEL	12.6	13.5	56,025	
さくらインターネット	76.4	16.5	62,452	ソースネクスト	15.5	5.5	6,897	エイベラス	22.3	23	17,635	
ヴィンクス	15.3	3.6	-	インフォコム	3.5	5.5	9,662	BI PROGY	23.2	25	35,225	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.6	-	-	シンブルクス・ホールディングス	69.6	67.1	9,662	兼松エレクトロニクス	50.4	48	215,760	
SRAホールディングス	4.2	4.5	12,370	HEROZ	17.6	18.9	41,598	都築電気	8.5	-	-	
システムインテグレイター	7	7.5	29,100	ラクスル	23	22.1	55,581	TBSホールディングス	7.2	7.7	18,641	
朝日ネット	3.7	2	868	メルカリ	4.5	5.8	9,094	日本テレビホールディングス	70.2	73.7	297,748	
eBASE	14.8	15.8	9,938	I P S	38.7	35.3	37,523	朝日放送グループホールディングス	121.3	129.8	290,946	
アバントグループ	19.3	20.7	14,717		61.8	71.4	174,037		13	13.7	9,617	
	17.3	18.5	25,326		4.4	4.2	8,513					

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
テレビ朝日ホールディングス		千株	千円	ハイパー	千株	千円	シークス	千株	千円		千株	千円			
スカパーJ SATホールディングス	33.3	35.6	78,498	あい ホールディングス	2.5	1.6	20.5	20.5	22	34,342					
日本BS放送	121.3	113.9	94,878	ディー・ブイエックス	23.1	24.8	61,032	田中商事	3.9	1.9	1,575				
ビジョン	9.8	10.6	35,139	ダイワボウホールディングス	3.5	1.9	2,036	オー・ハシテクニカ	7.2	8.1	15,106				
スマートバリュー	4.4	2.4	2,186	マツコホールディングス	59	68.5	215,364	白銅	5.3	4.5	11,092				
USEN-NEXT HOLDINGS	18.1	22.1	25,061	ラクト・ジャパン	35.4	36.6	295,179	ダイコー通産	1.4	0.7	845				
ワイヤレスゲート	3	1.9	750	グリムス	5.7	6	13,512	伊藤忠商事	890.1	1,039.9	7,004,766				
コネクショ	12.3	16.4	68,634	バイタルケアエスター・ホールディングス	6	6.5	13,351	丸紅	1,140.3	1,289.8	3,077,462				
日本通信	5.5	2.8	800	メディアスホールディングス	21.1	23.4	27,963	高島	2.1	4.7	6,363				
クロップス	8.9	-	-	ハ洲電機	11.8	12.5	16,175	長瀬産業	67.9	70.9	170,620				
日本電信電話	126.2	144.3	34,199	メスタールホールディングス	9.2	9	6,705	蝶理	7.8	9.7	28,624				
KDDI	2.1	0.9	918	レスタールホールディングス	13.8	13.2	39,930	豊田通商	126.5	135.5	1,260,150				
ソフトバンク	1,754.4	43,620.3	7,999,963	ジオリーブグループ	2.7	1.6	2,134	三共生興	20.7	21.5	16,748				
光通信	1,058	1,133.2	5,211,586	大光	5.2	3.6	2,300	兼松	56	64.7	150,492				
エムティーアイ	2,199.3	2,360	4,589,020	OCHIホールディングス	2.9	1.6	2,560	ツカモトコーポレーション	1.9	1	1,224				
GMOインターネットグループ	16.1	14.8	385,170	TOKAIホールディングス	71.3	84	84,420	三井物産	1,056.8	1,165.6	6,807,104				
ファイバーゲート	12.5	10.1	6,201	黒谷	3.7	2.2	1,344	日本紙パルプ商事	7.6	7.4	37,518				
アドリアマホールディングス	50.9	54.2	141,733	Cominix	2.4	1.4	1,188	カメイ	15.4	16.4	31,504				
KADOKAWA	7.3	7.9	7,394	三洋貿易	14.9	17.5	22,505	東都水産	0.6	0.4	2,560				
学研ホールディングス	3.1	1.8	423	ビューティガレージ	2.3	4.9	10,520	OUGホールディングス	2	1	2,435				
ゼンリン	72.3	77.5	250,945	ウイン・パートナーズ	10.5	10.1	12,726	スターゼン	11	10.7	29,157				
昭文社ホールディングス	22.8	24.4	24,644	ミタチ産業	3.3	1.9	2,133	山善	38.9	46.9	58,953				
インプレスホールディングス	23.3	25.1	21,435	シッパハルスケアホールディングス	51.9	55.6	123,320	椿本興業	2.1	3.1	21,142				
アイネット	5.6	2.9	1,078	明治電機工業	5.5	5.8	8,479	住友商事	894.6	936.3	3,143,159				
松竹	10.8	6.6	1,168	デリカフーズホールディングス	5.2	3	1,782	内田洋行	6.4	6.3	49,329				
東宝	8.4	8.9	17,132	スターティアホールディングス	2.5	1.8	2,842	三菱商事	903.1	3,065.3	8,527,664				
東映	7.8	7.6	77,558	コメダホールディングス	35.3	37.9	104,869	第一実業	5.1	14.6	27,302				
NTTデータグループ	85.7	81.6	386,294	ピーバンドコム	1.7	0.9	363	キャンノンマーケティングジャパン	33.4	35.8	155,157				
ピー・シー・エー	3.8	4.8	96,624	アセンテック	4.7	5.9	3,363	西華産業	5.7	6.1	19,581				
ビジネスブレイン太田昭宏	429.6	383.4	800,730	富士興産	2.9	1.9	4,145	佐藤商事	10.1	10.9	18,519				
DT S	7.8	8.4	13,255	協栄産業	1.1	0.7	2,093	菱洋エレフトロ	12.3	14.7	56,815				
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5.9	5.7	12,768	フルサト・マルカホールディングス	14.3	13.8	34,099	東京産業	13.3	14.1	10,560				
シーイーシー	29.1	30.9	112,630	ヤマエグループホールディングス	8.2	8.7	27,013	ユアサ商事	13	12.1	60,076				
カプコン	68.8	67	416,606	小野建	13.4	15.4	28,490	神鋼商事	3.6	3.9	26,235				
アイ・エス・ピー	19.2	18.5	30,691	南陽	2.5	1.4	3,102	トルク	6.6	3.7	1,087				
ジャストテック	136	131.1	738,617	佐島電機	8	8.6	19,986	阪和興業	25.9	27.8	149,842				
S C S K	7	7.5	11,790	エコトレーディング	2.5	1.3	1,602	正栄食品工業	9.6	10.3	47,122				
N S W	8.4	9	11,934	伯東	8.3	8.9	51,798	カナデン	11.7	11.6	17,400				
アイネス	111.7	102.6	272,043	コンドレーテック	11.1	11.9	14,399	R Y O D E N	11.6	12.5	32,900				
T K C	5.4	6.3	18,685	中山福	6.6	3.9	1,407	岩谷産業	32.9	35.2	246,118				
富士ソフト	9.5	11.4	16,917	ナガイレーベン	18.2	19.6	45,942	ナイス	3.5	2.1	3,332				
N S D	24.6	23.3	88,307	三菱食品	13.4	14.3	72,644	ニチモウ	1.4	2.2	4,952				
コナミグループ	15.5	29.5	188,800	松田産業	10.9	11.8	31,222	極東貿易	8.7	9.2	20,460				
番井コンピュータホールディングス	48.8	52.3	140,373	第一興商	27.9	59.9	120,279	アステナホールディングス	25	29	13,688				
J B C Cホールディングス	58.6	54.9	507,111	メディバルホールディングス	149.7	157.3	373,194	三菱オプリー	39.8	37.2	64,356				
ミロク情報サービス	9.5	9.1	23,241	S P K	6.4	6.9	13,882	稲畑産業	29.2	30.6	66,696				
ソフトバンクグループ	9.9	9.7	38,121	萩原電気ホールディングス	5.5	6.6	33,990	G S Iクレオス	8.5	8.3	19,812				
卸売業 (7.3%)	12.5	13.3	25,961	アズワン	21.2	24.2	133,027	明和産業	19.2	18.3	13,139				
高千穂交易	791.6	723.4	4,787,461	スズデン	5.1	5.4	12,123	クワザホールディングス	4.4	2.5	1,755				
オルパルシステムホールディングス	4.5	4.9	19,526	尾家産業	3.1	1.6	2,945	ワキタ	26.5	25.6	40,857				
伊藤忠食品	2	1.1	2,060	シモジマ	9.9	10.4	13,478	東邦ホールディングス	35.9	42.8	136,403				
エレマテック	2.7	3.5	27,405	ドウシシャ	15.3	14.3	30,358	サンゲツ	36.3	35.6	116,056				
あらた	1.3	13.9	25,117	小津産業	2.9	1.5	2,479	ミウロコグループホールディングス	18.6	19.8	32,353				
トーマンデバイス	11	23.7	73,588	高速	7.5	9.2	21,675	シナノンホールディングス	4.6	4.3	17,630				
東京エレクトロン デバイス	2.1	2.2	11,726	たげびし	5.6	5.9	11,859	伊藤忠エネクス	35.8	38.4	59,827				
円谷フーズホールディングス	5.4	15.4	100,562	リックス	2.7	2.6	9,282	サンリオ	41	43.8	274,582				
双日	12.4	26.6	47,507	丸文	12.9	13.8	21,307	サンワ テクノス	7.4	7.9	17,822				
アルフレックス ホールディングス	153.3	172.3	641,300	ハピネット	12.3	13.2	37,501	リョーサン	15.4	10.9	54,445				
横浜冷凍	144.9	155.3	371,865	機本総業ホールディングス	5.8	6.1	7,917	新光商事	19.4	20.8	25,272				
神栄	39.4	42.1	46,731	日本ライフライン	42.3	45.4	59,519	トーホー	6.2	6	17,664				
ラサ商事	1.8	1	1,712	タカショー	12.5	13.5	6,709	三信電気	5.8	6.2	14,365				
アルコニックス	5.8	6.3	10,621	I D O M	43.7	40.9	36,932	東陽テクニカ	15.9	15.7	22,780				
神戸物産	19	20.4	28,580	進和	9.6	9.5	23,132	モスフードサービス	21.3	22.8	78,432				
	111.8	119.7	443,847	エスケイジャパン	3.2	1.7	1,207	加賀電子	11.8	14.1	95,739				
				ダイトロン	5.7	6.1	18,788	ソーダニッカ	9.4	13.1	15,418				

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
イオン	489.7	524.4	1,878,925	りそなホールディングス	1,716	1,679.2	1,366,197	野村ホールディングス	2,476.6	2,421.5	1,955,845
イズミ	22	27.4	95,543	三井住友トラスト・ホールディングス	244.4	517.5	1,501,526	岡三証券グループ	118.4	126.5	89,182
平和堂	24	25.9	57,342	三井住友フィナンシャルグループ	982.5	1,023.9	7,870,719	丸三証券	44.7	47.9	44,163
フジ	22.2	23.7	46,333	千葉銀行	374.7	401.3	438,219	東洋証券	44.6	38.2	12,644
ヤオコー	16.3	17.5	149,677	群馬銀行	260.6	279.5	213,705	東海証券	146.2	171	97,470
ゼビオホールディングス	19.7	21	21,084	武蔵野銀行	17.1	20.1	17.1	光世証券	2.7	1.4	821
ケーズホールディングス	114.9	103.9	135,277	千葉興業銀行	28	27.2	23,147	水戸証券	36.2	42.5	19,167
Olympicグループ	5.2	3	1,644	筑波銀行	59.1	63.1	15,270	いちよし証券	24.6	27	20,196
日産東京販売ホールディングス	16.4	10.3	5,088	七十七銀行	43	41.9	153,982	松井証券	79.5	70.9	60,265
シルバーライフ	3.3	3	2,511	秋田銀行	9	9.6	19,641	マネックスグループ	150.1	141	102,930
Genky DrugStores	6.3	6.8	43,724	山形銀行	15	16	17,968	極東証券	16.8	19.7	19,660
ナルミヤ・インターナショナル	2.1	1.1	1,333	岩手銀行	9.2	9.1	22,704	岩井コスモホールディングス	15.3	16.4	34,653
ブックオフグループホールディングス	8.4	9	11,205	東邦銀行	107.2	113.7	35,247	アイザワ証券グループ	19.4	20.8	25,168
ギフトホールディングス	3.1	6.5	18,265	東北銀行	6	3.1	3,825	マネーパートナーズグループ	12.5	6.7	1,996
アインホールディングス	19.9	21.3	100,812	みくおがフィナンシャルグループ	107.3	125.4	463,729	スパークス・グループ	15	16.1	28,529
元気寿司	4.1	8.7	30,972	スルガ銀行	118.5	126.9	102,281	小林洋行	2.8	2.9	739
ヤマダホールディングス	592.4	475.7	211,591	八十二銀行	275.5	309	245,284	保険業(2.4%)			
アークランズ	21.2	46	76,728	山梨中央銀行	13.7	16.1	27,611	かんぽ生命保険	163.3	146.6	400,951
ニトリホールディングス	58.4	56.3	1,108,828	大垣共立銀行	25.7	27.4	53,594	F P パートナー	-	2.9	18,850
ブルメザン	11.8	12.6	13,595	福井銀行	12	12.9	22,355	SOMOホールディングス	230.7	216.6	1,666,737
愛眼	7.6	5	915	清水銀行	5.4	5.7	8,931	アイコムホールディングス	45.7	48.9	28,508
キューホールディングス	8.5	7.3	8,752	富山銀行	1.9	1.1	1,898	MS&ADインフラストラクチャーホールディングス	273.6	322.4	1,931,498
吉野家ホールディングス	56.4	57	187,074	滋賀銀行	22.4	24	92,040	第一生命ホールディングス	684.5	703.6	2,156,534
松屋ホールディングス	6.8	7.3	40,953	南都銀行	20.2	21.7	56,984	東京海上ホールディングス	1,353.8	1,423.4	5,519,945
サガミホールディングス	23.2	23.2	35,867	百五銀行	126.6	135.5	76,015	T&Dホールディングス	360.9	386.7	902,751
関西フードマーケット	13	10.5	16,054	京都銀行	42.6	-	-	アドバンスクリエイト	7.8	8.3	8,540
王将フードサービス	9.5	11.5	89,470	紀陽銀行	48.1	51.5	89,198	その他金融業(1.2%)			
ミニストップ	10.4	11.2	18,065	ほくほくフィナンシャルグループ	85.4	89.1	141,535	全国保証	35.2	37.7	206,633
アークス	26.5	28.4	82,757	山陰合同銀行	84	90.2	91,733	あんしん保証	6	2.9	725
パローホールディングス	27.6	29.5	74,576	鳥取銀行	3.9	2.2	3,086	ジェイリース	4	4.3	10,023
ベルク	7.2	7.7	50,358	百十四銀行	12.2	14.2	38,695	イントラスト	4.5	2.5	1,962
大 庄	6.9	7.4	9,916	四国銀行	21.2	21.2	22,450	日本モーゲージサービス	6.7	3.5	1,865
ファーストリテイリング	21.7	69.6	2,697,000	阿波銀行	19.9	20.2	48,298	C A S A	4.5	2.5	2,077
サンドラッグ	54.8	52.2	233,803	大分銀行	8	8.7	23,124	S B I アルビ	16.5	13.8	12,544
サックスパーホールディングス	13.7	13.1	11,056	宮崎銀行	8.8	8.7	23,855	プレミアグループ	22.6	24.3	40,969
ヤマザワ	2.3	1.4	1,769	佐賀銀行	7.8	8.5	16,456	ネットワッチョシヨシホールディングス	44.4	47.7	7,441
やまや	2.8	1.5	4,942	琉球銀行	30.5	30.7	35,028	クレディセゾン	85.1	91.3	248,427
ペルナナ	33.8	37.2	22,952	セブン銀行	481.4	451.4	136,819	芙蓉総合リース	12.4	13.3	179,882
銀行業(7.1%)				みずほフィナンシャルグループ	1,944.5	1,943.7	5,286,864	みずほリース	20	24.1	132,068
いざぎホールディングス	160.1	171.4	174,656	高知銀行	4.1	2.2	2,059	東京センチューリー	25.1	107.6	175,495
しずおかフィナンシャルグループ	303.9	320	449,440	山口フィナンシャルグループ	148.5	141.2	202,692	日本証券金融	54	52.9	82,629
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	113.2	121.3	130,700	長野銀行	3.7	-	-	アイフル	222.6	212	81,408
楽天銀行	-	50.1	116,883	名古屋銀行	8.9	9.3	52,545	リコーリース	12.7	13.7	69,185
京都フィナンシャルグループ	-	182.5	444,570	北洋銀行	204.1	218.2	82,261	イオンフィナンシャルサービス	77.1	82.7	110,693
島根銀行	4.2	1.9	984	大光銀行	3.5	2.1	2,931	アコム	240.2	257.1	93,275
じもとホールディングス	7.9	5.6	3,152	愛媛銀行	18.1	19.4	20,156	ジャックス	14.3	15.3	84,456
めぐみフィナンシャルグループ	666.7	714.5	309,449	トマト銀行	4	2.3	2,783	オリエンコーポレーション	35.1	47	50,055
東宝ホールディングス	17.2	18.4	76,912	京葉銀行	62.5	60.4	42,823	オリックス	899.2	877.7	2,525,142
九州フィナンシャルグループ	236.8	278.7	267,133	栃木銀行	61.6	71.9	22,001	三菱HCキャピタル	523.8	641.6	670,792
ゆうちょ銀行	382.9	1,582.4	2,379,138	北日本銀行	4.7	4.7	10,485	九州リースサービス	5.6	2.6	3,112
富山第一銀行	33.4	45.7	38,799	東和銀行	24.9	26.4	17,344	日本取引所グループ	377.7	375.7	1,249,202
コソルデリア・フィナンシャルグループ	740.9	772.7	540,658	福島銀行	12.8	6.6	15,431	イー・ギャランティ	21.7	23.4	43,266
西日本フィナンシャルホールディングス	85	81.3	138,860	大東銀行	4.6	2.7	2,014	アサックス	5.5	3	2,157
三十三フィナンシャルグループ	12.1	12.9	24,600	トモニホールディングス	109	136.3	53,293	NECキャピタルリソリューション	6.7	7.1	25,595
第四北越フィナンシャルグループ	21.2	22.6	91,417	フイデアホールディングス	13.8	14.9	23,271	不動産業(2.0%)			
ひろぎんホールディングス	175.5	205	201,515	池田泉州ホールディングス	170.8	199.7	68,896	Robot Home	32.7	39.9	6,783
おきなわフィナンシャルグループ	12.8	12.3	30,528	証券・商品先物取引業(0.9%)				大東建託	49.2	52.8	896,808
十六フィナンシャルグループ	17.4	18.7	78,072	F P G	54.5	48.7	86,491	いちご	154.8	165.9	64,037
北越フィナンシャルホールディングス	11.4	15.2	64,600	ジャポインベストメントアドバイザー	10.9	23.4	22,113	日本駐車場開発	160.1	152.4	27,279
プロレアホールディングス	16.6	16.5	30,376	マークキリアホールディングス	7.1	3.3	2,359	スター・マイカ・ホールディングス	12.2	16.7	9,101
あいちフィナンシャルグループ	18.8	22.2	57,653	S B Iホールディングス	194.6	211	796,525	S R Eホールディングス	6.6	6.2	20,584
S B I 新生銀行	39.7	-	-	日本アジア投資	9.6	4.7	1,316	ADワークスグループ	30	16.1	3,767
あおぞら銀行	84.4	103.5	225,992	ジャフコ	44.9	42.9	74,302	ヒューリック	313.4	335.9	535,424
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,536.5	8,769.7	12,312,658	大和証券グループ本社	961.3	1,115.5	1,123,866	三栄建築設計	6.5	-	-

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
バリューHR		千株	千円		千株	千円	日総工業		千株	千円		千株	千円	タナホコンサルティンググループ		千株	千円		千株	千円
M&Aキャピタルパートナーズ	13	12.2	29,206	6	6,222	18,222	キュービネットホールディングス	10.5	—	—	5	5.2	5,610	ナガワ	3.7	4.7	33,793	5	5.2	5,610
ライオンエクスプレスホールディングス	5.1	6	6,222	19	20.4	5,385	SPAホールディングス	6.6	8.6	12,728	11.8	12.6	57,708	東京都競馬	4.3	2.5	3,092	3.7	4.7	33,793
ERIホールディングス	3.2	1.9	3,562	4.3	1.9	1,508	スプリックス	7.7	6.4	18,022	25.7	23.3	67,104	カナモト	13	14	55,090	11.8	12.6	57,708
アビスト	2	1	3,115	3.3	3.5	1,242	マネジメントソリューションズ	3.6	2	622	70.2	43.4	998	アゴラ ホスピタリティグループ	17.4	18.7	55,165	4.3	2.5	3,092
シグマクシスホールディングス	21.3	20.3	34,185	2.1	2.2	3,577	テノホールディングス	1.5	0.8	414	61.2	65.6	56,940	ニシオホールディングス	6.2	6	40,200	25.7	23.3	67,104
ウィルグループ	11.7	12.5	14,900	1.8	0.9	452	フロンティア・マネジメント	4.7	3.8	5,909	8.4	9	11,763	アゴラ ホスピタリティグループ	14.8	—	—	13	13.3	28,209
エスコロー・エージェンツ・ジャパン	13.5	7.9	1,106	—	16.1	44,355	ピアラ	2	1.2	376	14.8	—	—	日本管財	12.5	13.3	28,209	1.1	1	2,736
メドピア	11	13.2	9,081	—	16.1	44,355	ゴロ・ホールディングス	2.1	2.2	3,577	15.9	153.1	1,639,701	トーカイ	1.1	1	2,736	1.1	1	2,736
レジャジョブ	2.4	1.3	1,186	—	16.1	44,355	ギークス	1.8	0.9	452	7.5	8.1	20,841	白洋舎	142.9	153.1	1,639,701	1.1	1	2,736
リクルートホールディングス	1,039	1,112.8	6,435,322	—	16.1	44,355	アンピスホールディングス	—	16.1	44,355	27	29.1	23,483	セコム	55.9	54.1	164,680	142.9	153.1	1,639,701
エラン	18.6	19.9	21,074	—	16.1	44,355	カープスホールディングス	43.1	41.1	30,866	29.1	29.1	23,483	セントラル警備保障	13.1	14	30,184	7.5	8.1	20,841
土木管理総合試験所	5.3	3.1	1,010	—	16.1	44,355	フォーラムエンジニアリング	8.3	20.5	16,338	55.9	54.1	164,680	丹靑社	13.1	14	30,184	27	29.1	23,483
日本郵政	1,839.2	1,766.2	2,500,939	—	16.1	44,355	FAST FITNESS JAPAN	4.7	5.1	5,630	13.1	14	30,184	メイテックグループホールディングス	29.5	31.3	77,373	29.1	29.1	23,483
ベルシステム24ホールディングス	18.8	16.1	28,802	—	16.1	44,355	ダイレクマーケティングミックス	16.8	15.5	6,851	29.5	31.3	77,373	船井総研ホールディングス	4.2	1.7	433	29.5	31.3	77,373
鎌倉新書	15.9	12.8	7,936	—	16.1	44,355	ロビピンズ	2.1	2.2	3,000	4.2	1.7	433	進学会ホールディングス	7.9	4.5	4,540	4.2	1.7	433
SMM	3.2	1.3	421	—	16.1	44,355	LITALICO	10.9	11.7	25,353	7.9	4.5	4,540	オオバ	2.8	1.8	3,834	7.9	4.5	4,540
一蔵	1.5	0.8	494	—	16.1	44,355	コンフィデンス・インタワークス	—	0.6	963	2.8	1.8	3,834	いであ	5.6	6	12,486	2.8	1.8	3,834
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1.2	786	—	16.1	44,355	アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	3.4	1,547	5.6	6	12,486	学究社	52.3	50.5	131,249	5.6	6	12,486
エアトリ	9.1	11	20,009	—	16.1	44,355	リロググループ	78.1	75.3	118,635	52.3	50.5	131,249	ベネッセホールディングス	15.5	16.1	60,455	52.3	50.5	131,249
アトリエ	11	8.9	5,918	—	16.1	44,355	東祥	9.8	10.5	8,158	15.5	16.1	60,455	イオンディライト	6.5	12.8	6,937	15.5	16.1	60,455
ストライク	6.9	6.4	30,976	—	16.1	44,355	ID&Eホールディングス	—	9.1	33,488	6.5	12.8	6,937	ナック	28.7	30.7	123,874	6.5	12.8	6,937
ソラスト	38.7	41.4	23,598	—	16.1	44,355	ビーウィズ	2.7	3.1	5,614	28.7	30.7	123,874	ダイセキ	5.8	5.5	11,088	28.7	30.7	123,874
セラク	5	4.6	5,147	—	16.1	44,355	TREホールディングス	29.5	28.8	36,316	5.8	5.5	11,088	ステップ	159.799.8	226.079	528,947,749	5.8	5.5	11,088
インソース	34.8	32.6	25,395	—	16.1	44,355	人・夢・技術グループ	6.3	5.7	10,807	159.799.8	226.079	528,947,749	イオンディライト	2.161	2.148	97.6%	159.799.8	226.079	528,947,749
ペイカレント・コンサルティング	111	110.5	345,754	—	16.1	44,355	NISSOホールディングス	—	13	10,647	2.161	2.148	97.6%	ナック	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
Orchestra Holdings	3	3.2	3,168	—	16.1	44,355	大栄環境	26.7	27.3	68,058	2.161	2.148	97.6%	学究社	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
アイモパイル	7.3	20.1	9,105	—	16.1	44,355	日本管財ホールディングス	—	15.8	40,416	2.161	2.148	97.6%	ベネッセホールディングス	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
キャリアインデックス	4.2	2.3	457	—	16.1	44,355	M&A総研ホールディングス	—	7.2	42,840	2.161	2.148	97.6%	イオンディライト	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
MS-Japan	4.1	5.5	6,963	—	16.1	44,355	エイチ・アイ・エス	36.7	43.7	77,523	2.161	2.148	97.6%	ナック	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
船場	1.5	1.4	1,379	—	16.1	44,355	ラックランド	4.4	6.8	17,761	2.161	2.148	97.6%	ダイセキ	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
ジャパニエレベーターサービスホールディングス	50	48.7	105,386	—	16.1	44,355	共立メンテナンス	24	23.6	145,706	2.161	2.148	97.6%	ステップ	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
フルテック	1.7	1	1,128	—	16.1	44,355	イチネンホールディングス	15	16	25,536	2.161	2.148	97.6%	学究社	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
グリーンズ	4.2	2.4	4,917	—	16.1	44,355	建設技術研究所	7.2	7.7	46,893	2.161	2.148	97.6%	ベネッセホールディングス	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
ツナググループホールディングス	3.5	1.9	1,649	—	16.1	44,355	スペース	10	9.8	9,261	2.161	2.148	97.6%	イオンディライト	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
GAMEWITH	3.7	2.8	873	—	16.1	44,355	燎ホールディングス	6	14.1	15,777	2.161	2.148	97.6%	ナック	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
MS&Consulting	1.4	1	590	—	16.1	44,355	Sバル興業	0.6	3	9,420	2.161	2.148	97.6%	ダイセキ	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
ウェルビー	10.3	7.5	6,382	—	16.1	44,355	東京アートル	4.6	2.4	2,726	2.161	2.148	97.6%	ステップ	2.161	2.148	97.6%	2.161	2.148	97.6%
エル・ティール・エス	1.9	1.7	4,867	—	16.1	44,355					2.161	2.148	97.6%					2.161	2.148	97.6%
ミダグホールディングス	8.6	9.1	15,388	—	16.1	44,355					2.161	2.148	97.6%					2.161	2.148	97.6%

(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。
(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。
(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(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 13,328		百万円 -

■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 528,947,749		% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,775,214		2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	542,722,964		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	542,722,857,274円
一 般 株 式	12,373,197,806
株 式 (評価額)	528,947,749,730
未 収 入 金	569,015,410
未 収 入 委 託 証 拠 金	703,427,711
未 収 入 委 託 証 拠 金	129,466,617
(B) 負 債	592,021,000
未 払 解 約 金	592,021,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	542,130,836,274
元 本	121,842,817,407
次 期 繰 越 損 益	420,288,018,867
(D) 受 取 金 額 (C / D)	121,842,817,407円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	44,494円

(注1) 期首元本額 117,622,712,134円
 追加設定元本額 59,907,077,380円
 一部解約元本額 55,686,972,107円

(注2) 期末における元本の内訳

MHAMスリーウェイクオープン	234,935,632円
MHAM TOP I Xオープン	2,457,094,087円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,281,412,558円
One DC 国内株式インデックスファンド	30,809,632,061円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,610,201,313円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,608,149円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	17,989,649円
たわらノーロード TOP I X	2,226,070,109円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,358,924円
たわらノーロード バランス (標準型)	360,326,830円
たわらノーロード バランス (積極型)	607,683,019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)	2,285,856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)	141,103,494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)	406,039,337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)	347,897,665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)	481,585,965円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	365,246円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,354,848円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	27,592,829円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,404,483円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,596,334円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,412,337,171円
Oneグローバルバランス	41,793,827円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	914,089,355円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,328,302,554円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,866,884,412円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	294,884,221円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	964,080,357円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,090,311,381円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	283,994,414円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	332,963,584円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	563,739,113円
投資のソムリエ	8,462,984,252円
フルーズコントロール	331,322,523円
投資のソムリエ<DC年金>	830,639,366円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	315,192,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,094,963,321円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	940,176,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,070,818,810円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	79,256,153円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,224,319円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,888,540円
リスクコントロール世界分散ファンド	1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	230,928,569円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	80,685,240円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	43,107,354円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	26,468,340円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	499,441,883円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	6,256,314円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,630,752円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	32,054,533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)	1,852,453円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	1,973,535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)	1,168,075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)	1,140,101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)	21,514,902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)	4,850,093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	179,053,363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)	1,676,651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	82,171,987円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産分配) 22-10	373,974,618円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	3,244,839円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	271,164,256円
AMIOネットアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定)	13,265,462円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	22,573,361円
日本興業証券機関投資ファンド (インカム重視) 儲蓄ツケリ (適格機関投資家限定)	42,437,517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)	3,180,848円
リスクコントロール世界8資産バランス (FOF 5割) (適格機関投資家専用)	3,641,563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)	34,738,163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)	67,464,810円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,592,055円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	10,658,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	3,391,442円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	80,001円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,346,974円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	17,271,356円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	278,577,105円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	397,261,876円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,219,167,945円
DIAMグローバル・セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	10,308,559円
DIAMグローバル・セット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	14,774,714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)	148,488,928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)	28,546,667円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	53,149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)	157,074,573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)	8,107,544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)	38,324,573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)	100,737,648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)	130,670,328円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	17,344,200円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	7,096,700円
動的パッケージファンド<DC年金>	26,832,017円
コア資産形成ファンド	13,890,277円
MHAMトピックスファンド	785,854,154円
MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	44,680,531円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,152,105,329円
MHAM日本株バッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,885,462,391円
期末元本合計	121,842,817,407円
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。

(注3)

■損益の状況

当期 自2023年2月8日 至2024年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,425,561,919	円
	受取配当金	10,381,192,543	
	受取利息	112,936	
	その他の収益	47,949,906	
	支払利息	△3,693,466	
(B)	有価証券売買損益	111,503,767,553	
	売却益	123,369,784,497	
	売却損	△11,866,016,944	
(C)	先物取引等取引損益	3,953,117,580	
	取引益	4,399,997,660	
	取引損	△446,880,080	
(D)	その他費用	△2,081,296	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	125,880,365,756	
(F)	前期繰越損益金	279,360,210,690	
(G)	解約差損益金	△154,955,776,199	
(H)	追加信託差損益金	170,003,218,620	
(I)	合計(E+F+G+H)	420,288,018,867	
	次期繰越損益金(I)	420,288,018,867	

(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》

■当投資信託において保有していた株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2023年12月に当該和解金を計上いたしました。

(2023年12月20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22期（決算日 2024年2月15日）

（計算期間 2023年2月16日～2024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22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 (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	純資産 総額
	期騰落率	騰落率	期騰落率	騰落率			
18期(2020年2月17日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
22期(2024年2月15日)	83,633	34.0	2,736,922.65	34.4	96.4	1.8	1,360,958

(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

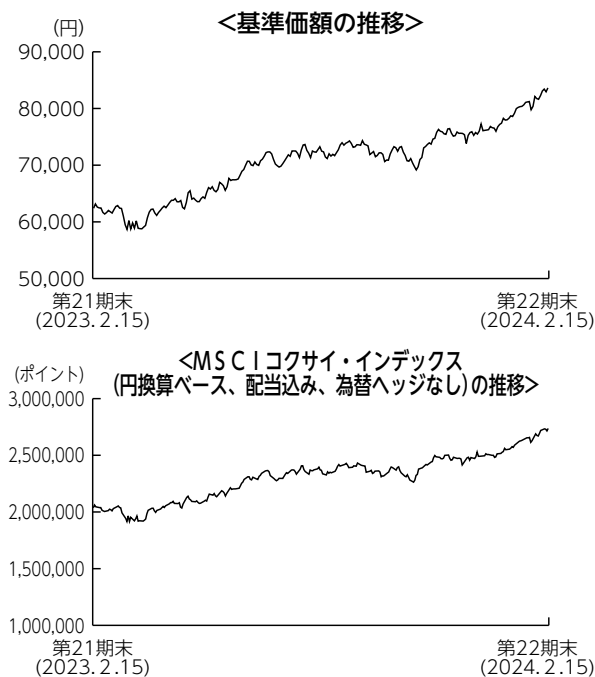
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 2 月 15 日	62,397	% -	2,036,206.59	% -	% 95.5	% 2.4
2 月 末	62,015	△0.6	2,024,295.30	△0.6	95.3	2.7
3 月 末	61,720	△1.1	2,015,006.82	△1.0	94.3	3.6
4 月 末	63,410	1.6	2,069,847.33	1.7	96.3	1.1
5 月 末	66,369	6.4	2,168,855.48	6.5	96.0	2.0
6 月 末	71,589	14.7	2,341,072.28	15.0	95.7	2.3
7 月 末	72,676	16.5	2,377,166.85	16.7	96.3	1.7
8 月 末	73,956	18.5	2,418,481.90	18.8	95.1	2.9
9 月 末	72,169	15.7	2,360,275.52	15.9	96.8	1.3
10 月 末	69,734	11.8	2,281,682.14	12.1	96.3	1.9
11 月 末	75,211	20.5	2,460,561.81	20.8	96.5	1.6
12 月 末	76,550	22.7	2,507,429.81	23.1	96.4	1.5
2024 年 1 月 末	81,230	30.2	2,657,966.51	30.5	95.7	2.7
(期 末) 2024 年 2 月 15 日	83,633	34.0	2,736,922.65	34.4	96.4	1.8

(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（2023年2月16日から2024年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は83,633円となり、前期末比で34.0%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米欧中央銀行の利上げ長期化観測が懸念されていたところに、一転して早期利下げ観測が浮上したことから多くの株式市場が上昇しました。加えて、為替市場で各国中央銀行と日銀の金融政策の方向性の違いから全ての通貨に対し円安となったことも寄与し、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は多くの市場が上昇しました。期前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となりました。2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や長期金利上昇への警戒感から下落しましたが、11月以降は米欧などで早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから米

国など多くの株式市場は上昇しました。その後は早期利下げ観測は後退したものの、大型ハイテク株などに牽引され上昇しました。

為替市場は全ての通貨に対し円安となりました。米ドルは期前半、F R Bの利上げ長期化観測や日銀の金融政策修正観測の後退などから日米の金融政策の方向性の違いが意識され円安米ドル高が進行しました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年に入ると米国の利下げ観測は後退し、改めて円安米ドル高となりました。ユーロなどに対しても各中央銀行の金融政策の方向性の違いなどから円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである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	10.6%
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

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.5%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.0
3	半導体・半導体製造装置	7.7
4	資本財	6.7
5	金融サービス	6.6
6	メディア・娯楽	6.4
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
8	銀行	5.1
9	一般消費財・サービス流通・小売り	4.8
10	エネルギー	4.4



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で34.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.4%下回りました。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)	1円 (1) (0) (0) (0)	0.002% (0.001) (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)	10 (10) (0) (0)	0.015 (0.015) (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)	17 (12) (5)	0.024 (0.016) (0.007)	(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	29	0.041	
期中の平均基準価額は70,616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 (2023年2月16日から2024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 201,199.39 (8,428.59)	千アメリカ・ドル 2,176,298 (△375)	百株 116,394.14	千アメリカ・ドル 1,154,025
	カ ナ ダ	百株 24,189.81 (387.18)	千カナダ・ドル 139,511 (-)	百株 13,131.73	千カナダ・ドル 71,369
	オーストラリア	百株 35,636.27 (△668.68)	千オーストラリア・ドル 95,709 (-)	百株 18,254.35	千オーストラリア・ドル 51,278
	香 港	百株 49,114 (-)	千香港・ドル 154,405 (-)	百株 29,493	千香港・ドル 76,166
	シンガポール	百株 60,335 (35,288.22)	千シンガポール・ドル 15,583 (△49)	百株 12,378	千シンガポール・ドル 7,120
	ニュージーランド	百株 2,918.52 (-)	千ニュージーランド・ドル 2,741 (-)	百株 -	千ニュージーランド・ドル -
	イ ギ リ ス	百株 147,852.82 (△1,691.59)	千イギリス・ポンド 111,828 (△638)	百株 80,572.83	千イギリス・ポンド 55,647
	イスラエル	百株 1,810.83 (-)	千イスラエル・シケル 9,910 (-)	百株 3,689.04	千イスラエル・シケル 7,214

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ス イ ス	百株 9,308.82 (796.67)	千スイス・フラン 79,635 (△383)	百株 9,910.6	千スイス・フラン 42,987	
	デ ン マ ー ク	百株 3,613.64 (2,397.1)	千デンマーク・クローネ 204,868 (-)	百株 2,066.9	千デンマーク・クローネ 114,086	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 3,294.23 (-)	千ノルウェー・クローネ 51,942 (△40)	百株 1,342.07	千ノルウェー・クローネ 21,391	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 16,692.57 (546.4)	千スウェーデン・クローナ 288,680 (-)	百株 15,731.31	千スウェーデン・クローナ 219,117	
	ユ ー ロ ー 圏	ア イ ル ラ ン ド	百株 1,955.04 (-)	千ユーロ 5,255 (-)	百株 1,811.3	千ユーロ 10,624
		オ ラ ン ダ	百株 11,847.24 (2,024.76)	千ユーロ 49,648 (△57)	百株 9,609.12	千ユーロ 29,076
		ベ ル ギ ー	百株 880.49 (112.17)	千ユーロ 5,791 (-)	百株 490.21	千ユーロ 2,703
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 1,091.52 (-)	千ユーロ 2,425 (-)	百株 1,827.65	千ユーロ 1,572
		フ ラ ン ス	百株 12,278.26 (129.1)	千ユーロ 91,329 (△81)	百株 7,834.61	千ユーロ 52,133
		ド イ ツ	百株 15,631.14 (-)	千ユーロ 68,716 (△464)	百株 10,234.72	千ユーロ 35,105
		ス イ ス	百株 383.65 (-)	千ユーロ 4,036 (△39)	百株 95.19	千ユーロ 737
		ポ ル ト ガ ル	百株 2,186.26 (-)	千ユーロ 1,421 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	百株 23,314.77 (17,297.92)	千ユーロ 20,669 (△4)	百株 30,997.66	千ユーロ 11,683
		イ タ リ ア	百株 33,079.8 (-)	千ユーロ 14,241 (△1)	百株 12,925.86	千ユーロ 7,258
	口	フ ィ ン ラ ン ド	百株 10,192.13 (640.8)	千ユーロ 11,591 (-)	百株 2,298.9	千ユーロ 2,543
		オ ー ス ト リ ア	百株 277.66 (-)	千ユーロ 1,178 (-)	百株 -	千ユーロ -

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	カナダ	証券	千カナダ・ドル	証券	千カナダ・ドル
		(2,968)	(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
		8.981	1,023	3.582	338
	BOSTON PROPERTIES INC	(-)	(-)	(-)	(-)
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	11.195	620	5.253	283
	PROLOGIS INC	(-)	(-)	(-)	(-)
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	38.286	711	17.066	274
	CAMDEN PROPERTY TRUST	(-)	(-)	(-)	(-)
	EQUINIX INC	50.042	5,776	25.541	2,751
	CROWN CASTLE INC	(-)	(-)	(-)	(-)
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11.994	2,086	7.408	1,265
	EQUITY RESIDENTIAL	(-)	(-)	(-)	(-)
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11.902	1,192	8.322	781
	SBA COMMUNICATIONS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	WELLTOWER INC	5.046	3,731	2.146	1,501
	KIMCO REALTY	(-)	(-)	(-)	(-)
	IRON MOUNTAIN INC	29.18	3,127	18.278	1,754
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	4.621	1,015	3.073	660
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	19.452	1,146	11.402	687
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	41.098	781	19.936	328
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	7.459	1,648	4.504	874
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	30.066	2,390	11.303	881
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	33.13	608	17.597	289
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	9.102	513	-	-
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	22.334	1,508	15.53	1,032
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	40.57	664	21.932	343
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	11.957	1,754	7.998	1,156
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	61.574	3,413	8.304	409
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)
	REGENCY CENTERS CORP	12.938	788	10.342	607
	REGENCY CENTERS CORP	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
UDR INC	18.219	625	9.286	322
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.263	1,305	3.256	342
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	9.624	2,632	5.407	1,424
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	12.875	1,666	9.06	1,158
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	30.71	1,365	18.045	750
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	39.178	1,222	14.307	429
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	21.499	3,052	3.575	386
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	13.283	1,584	3.934	461
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	-	-	72.327	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	30.077	5,546	16.904	2,911
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	24.66	1,518	15.328	825
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	47.041	794	89.412	1,345
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	18.257	637	9.439	317
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	19.821	636	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	11.157	547	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	-	2.199	26
	(2.199)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	32.109	994	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	754.156	1,632	486.626	1,108
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	130.224	498	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	110.515	470	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	83.445	1,701	42.152	851
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	656.486	1,689	478.229	1,197
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT DUMMY	87	4,495	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LINK REIT	60.6	2,397	-	-
	(-)	(1)	(-)	(-)
LINK REIT-RTS	-	-	52.503	209
	(52.503)	(△1)	(-)	(-)

	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
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△3)	(—)	(—)
CAPLAND ASCENDAS REIT	628.1	1,689	457.7	1,188
	(—)	(△13)	(—)	(—)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△17)	(—)	(—)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	—	—	24.589	25
	(24.589)	(26)	(—)	(—)
KEPPEL REIT	—	—	36.98	29
	(36.98)	(22)	(—)	(—)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	—	—	—	—
	(—)	(△3)	(—)	(—)
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	—	—	119.111	385
	(—)	(—)	(—)	(—)
LAND SECURITIES GROUP PLC	235.62	1,460	191.367	1,133
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW	29.844	808	26.007	723
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	12.488	1,202	8.836	823
	(—)	(—)	(—)	(—)
KLEPIERRE	11.128	266	—	—
	(—)	(△21)	(—)	(—)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.942	255	—	—
	(13.535)	(—)	(—)	(—)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	—	—	—	—
	(△13.535)	(—)	(—)	(—)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 255,616	百万円 257,547	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	655,018,143千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,026,729,929千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.63

(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 (2023年2月16日から2024年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		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	11,415.95	14,153.69	241,999	36,418,548	大規模小売り
ABBOTT LABORATORIES	2,180.54	2,650.14	29,697	4,469,172	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	795.05	1,091.22	1,761	265,047	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,124.58	1,390.28	25,521	3,840,710	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	2,016.32	2,466.44	44,075	6,632,889	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	584.05	694.37	41,985	6,318,439	ソフトウェア
CHUBB LTD	521.17	628.23	15,587	2,345,784	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	277.73	342.61	7,434	1,118,890	化学
ALLSTATE CORP	329.39	396.52	6,399	963,051	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	837.7	1,013.35	19,747	2,971,748	コンゴロマリット
AMGEN INC	666.76	815.06	23,642	3,557,951	バイオテクノロジー
HESS CORP	352.71	414.96	5,922	891,310	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	795.36	954.49	20,130	3,029,392	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	626.53	773.42	6,094	917,168	電力
AFLAC INC	726.73	847.3	6,686	1,006,310	保険
AMERICAN INTL GROUP	938.43	1,081.5	7,480	1,125,775	保険
ANALOG DEVICES	633.36	762.33	14,203	2,137,519	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	864.52	1,024.32	5,845	879,733	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	484.9	540.42	7,622	1,147,047	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	108.31	132.52	4,373	658,116	ソフトウェア
APPLE INC	20,001.34	23,826.92	438,772	66,030,908	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	1,068.03	1,280.53	23,842	3,588,010	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	139.61	169.36	1,937	291,545	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	694.12	815.04	4,341	653,385	食品
AMEREN CORP	316.21	406.44	2,788	419,654	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	99.36	-	-	-	電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	269.07	320.74	8,408	1,265,446	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	518.47	629.63	15,797	2,377,353	専門サービス
AUTOZONE INC	24.51	27.16	7,406	1,114,555	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	95.14	115.42	2,382	358,490	容器・包装
BALL CORP	402.23	462.88	2,869	431,884	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,619.51	1,993.18	79,464	11,958,552	金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	969.68	1,163.87	6,340	954,221	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	631.74	802.19	3,179	478,540	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	350.61	439.38	10,484	1,577,744	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	289.58	344.76	5,978	899,701	電気設備
VERIZON COMM INC	5,240.12	6,415.22	25,757	3,876,187	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	291.91	316.07	2,589	389,655	保険
BEST BUY CO INC	254.05	305.68	2,280	343,173	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	30.21	30.21	990	149,077	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	353.37	420.53	5,635	848,089	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	672.13	836.97	3,090	465,154	電力
BOEING CO	702.82	866.01	17,612	2,650,567	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INC	144.56	144.56	1,165	175,343	専門サービス
BORGWARNER INC	278	370.1	1,152	173,438	自動車用部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,753.52	2,219.59	14,638	2,202,902	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	144.94	172.33	1,272	191,496	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	195.29	260.64	4,058	610,791	娯楽

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	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	27.31	34.11	4,029	606,324	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,659.49	3,197.71	15,633	2,352,701	医薬品
ONEOK INC	569.8	867.02	5,991	901,732	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	97.09	97.09	1,194	179,701	保険
UNITED RENTALS INC	88.83	107.88	7,055	1,061,824	商社・流通業
SEMPRA	385.67	983.72	6,832	1,028,285	総合公益事業
FEDEX CORP	309.91	367.46	8,702	1,309,647	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	118.5	133.02	2,598	391,015	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	743.44	915.2	9,528	1,433,890	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	384.05	483.08	2,770	416,927	飲料
QUANTA SERVICES INC	175.6	232.71	4,948	744,676	建設・土木
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,017.65	1,017.65	489	73,663	メディア
CSX CORP	2,635.36	3,042.11	11,255	1,693,886	陸上運輸
COTERRA ENERGY INC	999.16	1,147.11	2,742	412,754	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	269.78	269.78	1,103	166,131	食品
CONSTELLATION BRANDS INC	193.43	246.29	5,999	902,883	飲料
CARDINAL HEALTH INC	344.21	382.98	3,965	596,806	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	75.2	2,612	393,169	建設関連製品
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	1,322.91	1,484.08	2,266	341,038	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	658.5	779.69	24,693	3,716,134	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	126.31	146.08	2,414	363,366	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	970.73	-	-	-	各種電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	3,650.43	4,423.91	77,874	11,719,271	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	302.36	389.11	3,774	568,004	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	198.78	228.76	2,537	381,923	保険
CINTAS CORP	111.73	141.69	8,680	1,306,391	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	5,161.36	6,184.56	31,095	4,679,632	通信機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	693.71	835.13	1,631	245,450	金属・鉱業
CLOROX COMPANY	157.94	183.05	2,786	419,295	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	5,108.54	6,273.48	37,195	5,597,545	飲料
COPART INC	540.11	1,283.73	6,318	950,873	商業サービス・用品
COGNEX CORP	204.32	-	-	-	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	988.65	1,213.09	10,154	1,528,192	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	345.46	383.76	9,033	1,359,425	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	74.34	89.28	3,570	537,376	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	283.64	348.74	1,815	273,220	電力
COMCAST CORP-CL A	5,492.1	6,281.71	26,395	3,972,295	メディア
CONAGRA BRANDS INC	619.81	736.39	1,968	296,220	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	438.55	517.36	4,492	676,114	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	366.03	441.28	2,489	374,675	総合公益事業
COOPER COS INC	63.42	79.71	2,969	446,822	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	252.81	304.36	1,869	281,414	飲料
CORNING INC	957.58	1,265.61	4,018	604,715	電子装置・機器・部品
WOLFSPEED INC	156.84	-	-	-	半導体・半導体製造装置
SEALED AIR CORP	176.1	-	-	-	容器・包装
HEICO CORP-CL A	94.63	116.14	1,798	270,662	航空宇宙・防衛
MANHATTAN ASSOCIATES INC	-	94.42	2,349	353,526	ソフトウェア
CUMMINS INC	178.03	212.5	5,534	832,960	機械
DARLING INTERNATIONAL INC	200.32	238.06	995	149,822	食品
DR HORTON INC	406.02	457.84	6,661	1,002,499	家庭用耐久財
DANAHER CORP	861.23	1,070.45	26,546	3,994,921	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOODY'S CORP	206.82	245.21	8,986	1,352,371	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	629.06	759.97	5,832	877,659	情報技術サービス
TARGET CORP	577.14	711.89	10,324	1,553,740	生活必需品流通・小売り
DEERE & CO	362.03	413.61	15,914	2,395,031	機械
MORGAN STANLEY	1,604.05	1,898.13	15,944	2,399,456	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	270.24	335.74	6,001	903,093	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	500.52	619.75	5,101	767,767	不動産管理・開発
DECKERS OUTDOOR CORP	-	41.74	3,539	532,729	繊維・アパレル・贅沢品
THE WALT DISNEY CO	2,274.04	2,794.06	31,170	4,690,853	娯楽
DOLLAR TREE INC	281.49	317.56	4,442	668,480	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	178.42	225.99	3,635	547,174	機械
OMNICOM GROUP	265.7	305.86	2,623	394,881	メディア
DTE ENERGY CO	237.92	337	3,549	534,182	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	964.73	1,181.23	10,789	1,623,690	電力
DARDEN RESTAURANTS INC	156.76	177.01	2,852	429,275	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	676.67	842.27	3,552	534,645	大規模小売り
BANK OF AMERICA CORP	9,008.68	10,908.1	36,138	5,438,488	銀行
CITIGROUP INC	2,418.65	2,941.7	15,879	2,389,675	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	167.9	167.9	1,378	207,494	化学
EATON CORP PLC	496.76	611.13	16,843	2,534,848	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	343.37	417.15	12,545	1,887,952	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	244.16	-	-	-	メディア
ECOLAB INC	325.5	381.51	8,277	1,245,699	化学
REVVITY INC	156.49	179.72	1,861	280,089	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	348.38	388.01	5,551	835,467	娯楽
SALESFORCE INC	1,248.76	1,483.57	42,897	6,455,633	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	33.72	33.72	1,186	178,531	保険
EMERSON ELECTRIC CO	738.89	879.6	9,344	1,406,309	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	175.67	245.32	2,771	417,101	ガス
ENTERGY CORP	260.97	307.36	3,014	453,665	電力
EOG RESOURCES INC	734.98	903.94	10,034	1,510,112	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	151.56	187.3	4,688	705,627	専門サービス
EQT CORP	409.96	597.29	1,968	296,264	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	289.95	358.46	5,113	769,520	パーソナルケア用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	199.74	224.15	2,818	424,150	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	5,193.82	6,116.07	61,674	9,281,387	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	155.34	177.11	905	136,278	化学
NEXTERA ENERGY INC	2,449.25	3,099.21	17,358	2,612,307	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	47.16	60.19	2,779	418,280	資本市場
FAIR ISAAC CORP	29.62	37.75	4,884	735,030	ソフトウェア
ASSURANT INC	58.23	87.66	1,505	226,611	保険
FASTENAL CO	729.41	856.03	6,003	903,442	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	843.62	1,054.1	3,532	531,574	銀行
M&T BANK CORP	207.66	249.58	3,398	511,407	銀行
FIRST HORIZON CORP	696.34	-	-	-	銀行
FISERV INC	760.76	917.18	13,297	2,001,107	金融サービス
FORD MOTOR CO	4,943.79	5,859.08	7,359	1,107,456	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	379.16	474.77	1,270	191,266	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,801.8	2,146.28	7,984	1,201,536	金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	15.87	15.84	2,364	355,881	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	262.69	333.44	7,958	1,197,681	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		
DENTSPLY SIRONA INC	255.99	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	287.25	346.34	9,320	1,402,568		航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	749.19	885.17	5,520	830,825		食品
GENUINE PARTS CO	173.74	207.69	2,991	450,200		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,563.88	1,900.11	13,878	2,088,560		バイオテクノロジー
GARTNER INC	95.64	119.88	5,392	811,580		情報技術サービス
MCKESSON CORP	179.8	208.54	10,452	1,572,925		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	3,102.42	3,764.94	278,229	41,870,692		半導体・半導体製造装置
GRACO INC	—	239.85	2,118	318,863		機械
GENERAL ELECTRIC CO	1,369.1	1,646.58	24,122	3,630,179		コンプロマリット
WW GRAINGER INC	54.66	67.77	6,400	963,165		商社・流通業
HALLIBURTON CO	1,115.7	1,392.51	4,762	716,691		エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	497.39	1,176.37	6,572	989,077		飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	424.3	503	19,015	2,861,629		資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	243.2	287.28	6,038	908,666		航空宇宙・防衛
HASBRO INC	154.37	163.59	861	129,715		レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	174.31	174.31	1,284	193,276		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	51.85	68.78	1,329	200,151		航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	186.95	225	4,303	647,577		食品
HP INC	1,259.55	1,341.36	3,833	576,919		コンピュータ・周辺機器
F5 INC	69.24	89.81	1,654	249,036		通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	153.22	181.25	1,331	200,399		容器・包装
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	76.15	1,632	245,732		バイオテクノロジー
JUNIPER NETWORKS INC	437.15	578.81	2,143	322,550		通信機器
HOLOGIC INC	306.95	383.99	2,808	422,709		ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	1,275.83	1,527.31	54,712	8,233,733		専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	228.8	296.68	2,551	384,012		バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	388.51	490.54	1,412	212,605		食品
CENTERPOINT ENERGY INC	787.91	977.76	2,674	402,436		総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	36.02	49.17	2,197	330,717		建設関連製品
HUBBELL INC	69.03	78.2	2,812	423,294		電気設備
HUMANA INC	158.44	186.41	6,753	1,016,326		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	103.48	122.76	2,670	401,923		陸上運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,814.91	2,153.85	2,739	412,297		銀行
BIOGEN INC	176.03	219.1	4,836	727,831		バイオテクノロジー
IDEX CORP	90.65	110.45	2,507	377,344		機械
ILLINOIS TOOL WORKS	387.9	464.63	11,807	1,776,862		機械
INTUIT INC	335.01	427.34	28,081	4,226,029		ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	101.62	125	7,007	1,054,483		ヘルスケア機器・用品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	292.93	351.54	9,590	1,443,253		建設関連製品
INTEL CORP	5,124.32	6,392.05	28,246	4,250,811		半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	319.79	409.93	3,254	489,698		化学
INTERNATIONAL PAPER CO	441.53	534.19	1,844	277,587		容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	456.79	540.63	1,714	258,072		メディア
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	95.06	118.57	2,078	312,726		金融サービス
JABIL CIRCUIT INC	—	195.86	2,767	416,540		電子装置・機器・部品
INCYTE CORP	244.49	316.54	1,832	275,765		バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	3,270.95	3,669.56	57,149	8,600,462		医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	394.02	456.59	4,175	628,442		保険
KLA CORPORATION	177.34	204.32	13,359	2,010,434		半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	783.84	969.85	4,057	610,666		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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
KELLANOVA	329.41	424.51	2,291	344,912	食品
KEYCORP	1,189.55	1,440.72	1,996	300,504	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	421.73	529.32	6,267	943,143	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	188.14	227.27	17,849	2,686,214	資本市場
KROGER CO	827.75	1,033.85	4,723	710,863	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	172.6	200.26	18,337	2,759,656	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	58.9	74.46	3,183	479,068	電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	110.29	134.51	2,224	334,809	容器・包装
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	-	202.6	1,545	232,511	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES	200.36	233.13	2,676	402,761	情報技術サービス
PLUG POWER INC	561.49	-	-	-	電気設備
LENNAR CORP	323.61	376.67	5,795	872,213	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	1,006.41	1,230.21	93,165	14,020,405	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	281.56	346.38	1,519	228,732	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	179.37	-	-	-	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	911.89	1,108.84	15,991	2,406,589	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	371.89	448.25	5,927	892,053	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	296.95	338.42	14,152	2,129,792	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	235.3	302.89	2,226	335,118	保険
LOWE'S COS INC	774.78	884.86	20,080	3,021,858	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	1,018.28	1,265.01	5,674	854,005	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	404.01	404.01	1,729	260,221	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	320.31	402.79	2,617	393,942	食品
MCDONALD'S CORPORATION	914.13	1,110.35	31,996	4,815,221	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	425.05	495.71	20,879	3,142,201	資本市場
EVEREST GROUP LTD	53.53	66.7	2,474	372,438	保険
MARKEL GROUP INC	16.74	20.13	2,957	445,004	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	776.95	915.1	7,873	1,184,886	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	621.47	756.06	14,948	2,249,647	保険
MASCO CORP	289.37	345.61	2,539	382,123	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	77.36	93.65	5,052	760,281	建設資材
METLIFE INC	847.99	974.05	6,657	1,001,907	保険
MEDTRONIC PLC	1,660.79	2,021.17	16,913	2,545,260	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	974.96	-	-	-	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,636.16	1,973.56	15,079	2,269,384	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	3,156.72	3,864.48	48,622	7,317,258	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	543.62	652.5	5,328	801,956	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	114.55	128.76	2,937	442,010	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	8,819.04	10,756.09	440,451	66,283,490	ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,356.54	1,680.37	13,750	2,069,307	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	695.97	816.68	6,580	990,345	半導体・半導体製造装置
3M CO	693.96	825.77	7,631	1,148,504	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	63.11	-	-	-	家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	177.09	236.75	3,105	467,339	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	64.45	76.74	1,881	283,079	ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	205.78	248.47	7,935	1,194,271	通信機器
ILLUMINA INC	198.33	243.79	3,431	516,346	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	693.25	827.77	4,857	730,983	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	117.16	146.13	1,925	289,776	バイオテクノロジー
NETAPP INC	282.65	327.85	2,877	432,991	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	419.84	-	-	-	家庭用耐久財

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	
NEWMONT CORP	992.87	1,736.08	5,576	839,175	金属・鉱業
NVR INC	4.05	4.83	3,623	545,275	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,574.85	1,877.2	19,960	3,003,820	繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	64.47	75.48	1,990	299,559	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	289.97	341.4	8,612	1,296,043	陸上運輸
EVERSOURCE ENERGY	430.42	518.61	2,959	445,328	電力
NISOURCE INC	532.7	645.43	1,638	246,517	総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	248.36	328.68	2,597	390,955	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	183.61	220.98	9,863	1,484,415	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	4,724.91	5,582.86	27,093	4,077,318	銀行
NUCOR CORP	316.6	374.96	6,789	1,021,680	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	285.54	364.22	5,666	852,811	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	466.54	576.3	7,786	1,171,773	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,147.44	997.74	5,717	860,358	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	116.3	148.54	6,404	963,738	陸上運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	77.57	90.84	9,531	1,434,446	専門小売り
ORACLE CORP	1,992.12	2,507.07	28,645	4,310,903	ソフトウェア
PACCAR INC	648.01	777.44	8,292	1,248,006	機械
PTC INC	136.65	180.85	3,268	491,931	ソフトウェア
EXELON CORP	1,216.64	1,571.97	5,363	807,162	電力
PARKER HANNIFIN CORP	161.01	192.11	10,026	1,508,874	機械
PAYCHEX INC	405.19	491.52	6,007	904,047	専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	96.51	114.52	3,467	521,762	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	887.37	1,136.87	2,961	445,683	電力
PEPSICO INC	1,714.95	2,105.84	35,277	5,308,840	飲料
PENTAIR PLC	198.04	255.45	1,915	288,243	機械
PFIZER INC	6,989.45	8,623.81	23,379	3,518,328	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	327.96	403.19	1,428	214,975	水道
CONOCOPHILLIPS	1,591.69	1,839.94	20,261	3,049,140	石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,782.57	3,061.39	5,005	753,258	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	284.45	362.19	8,161	1,228,292	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	2,244.42	2,710.33	10,949	1,647,825	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	510.1	598.05	8,843	1,330,838	銀行
BROWN & BROWN INC	306.5	369.07	3,033	456,549	保険
GARMIN LTD	199.11	232.81	2,859	430,341	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	283.41	357.48	5,008	753,698	化学
COSTCO WHOLESALE CORP	551.82	676.03	48,821	7,347,152	生活必需品流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	277.07	342.93	3,647	548,897	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	145.36	165.74	2,116	318,561	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,967.79	3,594.41	55,939	8,418,380	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	731.78	898.08	16,879	2,540,182	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	601	742.43	4,363	656,627	総合公益事業
PULTE GROUP INC	290.5	339.5	3,524	530,430	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	336.53	400.68	5,568	838,026	金融サービス
QUALCOMM INC	1,401.58	1,702.86	26,213	3,944,918	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	234.37	291.41	3,400	511,735	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	233.86	260.45	1,617	243,362	バイオテクノロジー
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	-	87.47	2,577	387,858	金属・鉱業
REGENERON PHARMACEUTICALS	133.97	160.52	15,214	2,289,616	バイオテクノロジー
REPLIGEN CORP	67.3	85.76	1,766	265,915	ライフサイエンス・ツール/サービス
RESMED INC	186.28	228.99	4,134	622,188	ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			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	
US BANCORP	1,766	2,292.27	9,283	1,397,103	銀行
SEAGEN INC	168.6	—	—	—	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	458.51	563.09	4,778	719,183	保険
ROSS STORES INC	441.71	508.78	7,351	1,106,306	専門小売り
ROLLINS INC	259.2	457.08	2,022	304,377	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	131.2	163.44	8,853	1,332,394	ソフトウェア
ROCKWELL AUTOMATION INC	146.33	173.27	4,850	729,928	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	274.77	374.64	4,369	657,554	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	164.67	192.58	2,082	313,404	化学
ACCENTURE PLC-CL A	788.43	956.12	35,470	5,337,901	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,686.45	2,088.47	14,913	2,244,372	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	132.32	162.17	4,462	671,526	保険
AXON ENTERPRISE INC	—	110.39	2,989	449,935	航空宇宙・防衛
THE TRAVELERS COMPANIES INC	295.95	348.35	7,545	1,135,591	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	750.43	893.54	5,597	842,312	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	49.56	54.52	20,381	3,067,176	ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,774.1	2,179.9	10,409	1,566,453	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,813.79	2,301.45	14,506	2,183,013	資本市場
POOL CORP	46.6	63.05	2,413	363,196	販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	261.44	321.14	3,912	588,832	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	186.42	—	—	—	食品
SEI INVESTMENTS CO	144.77	144.77	953	143,485	資本市場
ELEVANCE HEALTH INC	299.28	361.39	18,290	2,752,508	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENCORA INC	191.04	257.01	5,951	895,692	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	319.21	355.91	2,800	421,470	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	304.76	375	11,663	1,755,258	化学
CENTENE CORP	700.8	824.87	6,391	961,919	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	73.3	—	—	—	銀行
SMITH (A.O.) CORP	148.56	195.63	1,587	238,967	建設関連製品
SNAP-ON INC	70.68	82.04	2,158	324,877	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	467.76	543.92	5,787	870,932	保険
ADVANCE AUTO PARTS	71.65	—	—	—	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	485.33	576.12	3,746	563,812	電力
SOUTHERN CO	1,360.27	1,667.22	11,305	1,701,352	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,653.26	1,987.29	7,036	1,058,997	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	197	197	664	100,057	旅客航空輸送
AT&T INC	8,882.01	10,942.28	18,503	2,784,575	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	2,316.39	2,770.81	41,842	6,296,802	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	192.7	225.92	2,002	301,398	機械
STATE STREET CORP	461.98	504.16	3,604	542,477	資本市場
STARBUCKS CORP	1,428.19	1,751.61	16,477	2,479,683	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	229.37	229.37	2,746	413,317	金属・鋳業
STRYKER CORP	426.35	518.49	18,117	2,726,439	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	554.71	676.48	39,190	5,897,780	娯楽
GEN DIGITAL INC	730.86	925.83	1,973	297,047	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	203.18	274	1,619	243,735	陸上運輸
SYNOPSIS INC	187.79	233.14	13,119	1,974,351	ソフトウェア
SYSCO CORP	625.21	764.19	6,037	908,523	生活必需品流通・小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	446.32	534.63	20,410	3,071,506	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	55.32	69.85	1,739	261,815	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,347.81	1,692.5	2,229	335,445	医薬品

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TERADYNE INC	185.12	220.66	2,241	337,284	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,137.01	1,389.08	21,929	3,300,156	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	258.24	298.41	2,575	387,643	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	487.95	588.51	32,266	4,855,746	ライフサイエンス・ツール/サービス
GLOBE LIFE INC	121.53	149.73	1,876	282,449	保険
TORO CO	-	146.44	1,394	209,931	機械
DAVITA INC	68.13	68.13	840	126,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	136.9	168.08	3,958	595,656	専門小売り
BIO-TECHNE CORP	206.52	259.34	1,818	273,664	ライフサイエンス・ツール/サービス
TRIMBLE INC	286.76	375.04	2,183	328,535	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	53	61.75	2,717	409,002	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	356.84	413.16	2,147	323,193	食品
UGI CORP	241.6	-	-	-	ガス
MARATHON OIL CORP	840.59	929.52	2,081	313,199	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	777.69	931.33	23,293	3,505,438	陸上運輸
RTX CORP	1,830.61	2,234.86	20,424	3,073,665	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,165.09	1,413.9	73,090	10,999,336	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	80.96	99.03	1,601	240,996	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VF CORP	378.87	517.62	890	133,982	繊維・アパレル・贅沢品
PARAMOUNT GLOBAL	786.63	813.26	1,072	161,429	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	321.4	394.11	16,469	2,478,430	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	164.52	200.95	4,844	729,109	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	917.06	1,071.24	2,307	347,248	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	1,878.96	2,261.8	38,133	5,738,777	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	505.78	621.22	12,372	1,861,895	商業サービス・用品
WATERS CORP	75.11	87.86	2,789	419,826	ライフサイエンス・ツール/サービス
WATSCO INC	-	48.89	1,895	285,292	商社・流通業
WEBSTER FINANCIAL CORP	222.85	-	-	-	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	96.41	114.64	4,679	704,216	ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	126.79	156.04	1,954	294,117	食品
VAIL RESORTS INC	52.35	65.23	1,462	220,085	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	407.23	494.51	2,773	417,340	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	202.73	284	3,836	577,363	機械
WHIRLPOOL CORP	68.32	-	-	-	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	188.33	253.19	2,679	403,239	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	127.57	153.79	1,618	243,496	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	115.96	529.69	2,956	444,878	資本市場
CME GROUP INC	443.42	541.32	11,648	1,752,926	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,518.9	1,807.81	5,974	899,149	石油・ガス・消耗燃料
DICK'S SPORTING GOODS INC	-	85.51	1,427	214,812	専門小売り
LKQ CORP	315.04	438.82	2,143	322,595	販売
ALLIANT ENERGY CORP	339.66	405.24	1,930	290,469	電力
WEC ENERGY GROUP INC	383.18	478.82	3,670	552,321	総合公益事業
CARMAX INC	186.73	224.14	1,630	245,425	専門小売り
TJX COMPANIES INC	1,452.28	1,724.69	16,758	2,522,033	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	67.3	77.85	1,969	296,358	電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,560.49	1,560.49	497	74,913	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	173.28	235.28	989	148,852	コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	150.92	192.71	3,163	476,050	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	79.96	-	-	-	銀行
CBRE GROUP INC	410.89	485.77	4,220	635,196	不動産管理・開発

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY GLOBAL PLC	157.79	—	—	—	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,172.22	1,525.88	2,790	419,992	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	41.15	51.37	2,180	328,151	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	53.87	71.27	5,310	799,237	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	41.87	60.3	851	128,123	化学
T-MOBILE US INC	784.34	806.97	13,026	1,960,299	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	429.72	594.74	3,240	487,609	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	425.61	485.02	1,433	215,687	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	48.71	61.26	1,324	199,324	資本市場
CELANESE CORP	138.41	162.73	2,410	362,808	化学
DEXCOM INC	487.1	585.53	6,836	1,028,759	ヘルスケア機器・用品
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	195.54	3,651	549,486	建設関連製品
EXPEDIA GROUP INC	191.86	219.78	2,963	445,913	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	240.27	309.69	2,402	361,563	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	131.23	155.36	6,080	915,004	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	360.34	—	—	—	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	698.96	873.85	11,942	1,797,156	資本市場
LIVE NATION	204.44	235.97	2,109	317,469	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	34.74	42.26	11,072	1,666,364	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	61.48	84.96	9,746	1,466,678	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	1,074.66	1,282.61	59,665	8,979,096	金融サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	—	236.23	1,477	222,402	飲料
WESTERN UNION CO	467.12	—	—	—	金融サービス
OWENS CORNING	132.27	132.27	1,891	284,705	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	151.08	206.79	2,512	378,105	専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	178.61	300.64	2,316	348,644	商社・流通業
FIRST SOLAR INC	119.03	155.79	2,465	370,991	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	153	183.98	3,614	543,969	専門サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	72.63	6,395	962,448	コンピュータ・周辺機器
AECOM TECHNOLOGY CORP	—	210.94	1,895	285,191	建設・土木
DELTA AIR LINES INC	215.92	215.92	881	132,704	旅客航空輸送
INSULET CORP	88.34	101.58	1,917	288,599	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	332.36	391.88	4,275	643,465	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	387.62	470.54	6,719	1,011,189	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	56.88	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	145.47	172.55	7,949	1,196,327	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	266.9	—	—	—	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	57.15	69.13	12,072	1,816,813	大規模小売り
ULTA BEAUTY INC	60.73	72.63	3,824	575,567	専門小売り
INVESCO LTD	385.3	—	—	—	資本市場
MSCI INC	98.07	119.48	6,843	1,029,925	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,930.16	2,367.46	21,122	3,178,721	タバコ
VISA INC	2,035.26	2,448.21	67,952	10,226,174	金融サービス
KEURIG DR PEPPER INC	928.16	1,607.6	4,999	752,395	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	228.09	317.51	3,825	575,678	水道
MARATHON PETROLEUM CORP	631.37	615.28	10,452	1,572,978	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	161.82	214.3	1,704	256,516	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	2,578.77	2,983.12	4,943	743,876	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	228.48	368.91	4,580	689,302	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	333.42	404.21	3,825	575,690	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	47.13	64.81	1,816	273,393	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SPLUNK INC	208.98	247.88	3,829	576,338	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	70.9	81.62	2,270	341,639	情報技術サービス
HCA HEALTHCARE INC	287.52	307.02	9,377	1,411,191	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	189.74	216.63	5,332	802,432	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	77.92	107.06	1,308	196,946	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88.44	102.95	2,804	421,996	金融サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	224.34	—	—	—	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	321.09	389.38	9,109	1,370,954	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	163.43	192.42	2,792	420,257	専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	258.3	332.63	2,938	442,207	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	69.11	93.98	1,267	190,775	自動車用部品
BOE GLOBAL MARKETS INC	127.09	156.08	2,883	433,973	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	310.59	342.95	2,162	325,507	専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	278.99	334.44	4,414	664,354	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	811.66	1,005.99	7,130	1,073,062	ソフトウェア
HYATT HOTELS CORP	—	66.47	857	129,109	ホテル・レストラン・レジャー
HORIZON PHARMA PLC	276.13	—	—	—	バイオテクノロジー
TESLA INC	3,319.53	4,357.58	82,231	12,375,077	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	69.14	—	—	—	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	170.46	215.39	2,834	426,633	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,712.1	2,080.56	7,983	1,201,378	自動車
ALLY FINANCIAL INC	392.3	392.3	1,413	212,770	消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	96.61	118.95	3,033	456,470	資本市場
APTIV PLC	343.1	430.97	3,410	513,275	自動車用部品
PHILLIPS 66	594.04	683.58	9,926	1,493,803	石油・ガス・消耗燃料
META PLATFORMS INC	2,845.33	3,387.66	160,331	24,128,238	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	225.14	278.48	6,780	1,020,345	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	200.87	248.5	4,221	635,221	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	253.33	311.78	24,692	3,716,045	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	369.42	468.54	17,257	2,597,116	ソフトウェア
WORKDAY INC	255.47	310.6	9,387	1,412,736	ソフトウェア
ABBVIE INC	2,201.98	2,688.95	46,900	7,058,081	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	587.56	702.24	12,926	1,945,359	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	542.11	542.11	1,410	212,195	メディア
CDW CORP	164.65	202.62	4,852	730,229	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	475.9	631.1	3,999	601,946	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	210.9	257.1	1,858	279,619	情報技術サービス
SNAP INC	1,273.18	1,522.5	1,735	261,197	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	532.3	668.55	4,967	747,633	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	224.66	—	—	—	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	88.45	—	—	—	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	198.71	—	—	—	メディア
OKTA INC	178.28	218.31	1,912	287,796	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	176.53	—	—	—	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	1,262.92	1,521.6	4,389	660,623	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	181.67	217.85	2,240	337,185	食品
CNH INDUSTRIAL NV	—	1,619.62	2,032	305,889	機械
BROADCOM INC	502.59	676.79	85,425	12,855,726	半導体・半導体製造装置
ARES MANAGEMENT CORP	195.34	231.61	3,166	476,502	資本市場
MONGODB INC	90.21	109.06	5,305	798,481	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	84.53	105.65	2,062	310,369	専門小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	613.21	—	—	—	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	168.56	232.73	5,135	772,864	ヘルスケア・テクノロジー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	242.12	—	—	—	電気設備
EVERGY INC	282.26	331.92	1,632	245,707	電力
ALLEGION PLC	101.4	134.23	1,760	264,987	建設関連製品
DAYFORCE INC	183.14	220.02	1,590	239,391	専門サービス
STERIS PLC	125.24	155.4	3,537	532,292	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	263.62	319.74	1,633	245,833	ソフトウェア
WIX.COM LTD	58.55	89.97	1,166	175,473	情報技術サービス
DROPBOX INC	304.79	418.01	1,354	203,879	ソフトウェア
KKR & CO INC	674.3	903.73	8,671	1,304,942	資本市場
FUTU HOLDINGS LTD ADR	50.5	50.5	252	37,975	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	279.21	338.57	2,171	326,802	ソフトウェア
MODERNA INC	416.26	500.06	4,298	646,808	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	344.09	402.32	7,752	1,166,704	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	311.33	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA GROUP	382.14	451.63	15,292	2,301,389	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	327.7	386.69	3,327	500,692	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	876.67	1,060.37	5,681	855,003	化学
OVINTIV INC	316.03	391.6	1,660	249,871	石油・ガス・消耗燃料
AMCOR PLC	1,887.89	2,233.48	1,998	300,824	容器・包装
PINTEREST INC	697.46	909.36	3,257	490,195	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FOX CORP-A	365.01	365.01	1,104	166,164	メディア
FOX CORP-B	155.11	275.07	763	114,830	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	425.86	—	—	—	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	257.23	338.13	11,312	1,702,363	ソフトウェア
CHEWY INC	96.48	—	—	—	専門小売り
AVANTOR INC	782.14	971.57	2,370	356,756	ライフサイエンス・ツール/サービス
DYNATRACE INC	254.29	393.62	2,076	312,528	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	297.7	432.84	4,517	679,846	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	138	169.18	1,734	261,091	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	1,018.98	1,243.79	6,840	1,029,478	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	528.55	626	5,685	855,679	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	1,815.6	2,811.19	22,250	3,348,488	陸上運輸
CORTEVA INC	905.9	1,080.01	5,840	878,966	化学
MATCH GROUP INC	352.59	447.64	1,627	244,873	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FERGUSON PLC	257.02	308.68	5,974	899,102	商社・流通業
BILL HOLDINGS INC	119.88	162.43	1,051	158,299	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	880.26	1,085.46	13,888	2,090,074	資本市場
PAYLOCITY HOLDING CORP	53.22	58.09	999	150,361	専門サービス
CARLYLE GROUP INC	245.3	348.47	1,534	230,898	資本市場
DATADOG INC	291.79	386.35	5,260	791,600	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	256.89	308.9	2,681	403,548	コンピュータ・周辺機器
VERTIV HOLDINGS CO	—	532.34	3,458	520,486	電気設備
INGERSOLL RAND INC	514.79	619.76	5,360	806,672	機械
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	441.35	623.73	5,187	780,676	ヘルスケア機器・用品
PAYCOM SOFTWARE INC	63.41	89.41	1,692	254,641	専門サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	383.42	934.26	1,451	218,487	自動車
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	92.67	—	—	—	海上運輸
DRAFTKINGS INC	—	639	2,803	421,963	ホテル・レストラン・レジャー
UNITY SOFTWARE INC	308.39	409.67	1,430	215,224	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AON PLC	263.41	313.09	9,657	1,453,415	保険
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,917.78	3,514.21	3,419	514,574	娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	7.36	9.06	1,301	195,882	石油・ガス・消耗燃料
BENTLEY SYSTEMS INC	225.66	336.34	1,734	260,975	ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	130.94	263.05	4,218	634,886	資本市場
UIPATH INC	-	534.39	1,389	209,173	ソフトウェア
AFFIRM HOLDINGS INC	185.28	-	-	-	金融サービス
AIRBNB INC	471.77	644.56	9,552	1,437,537	ホテル・レストラン・レジャー
CONSTELLATION ENERGY CORP	412.24	482.14	6,203	933,594	電力
MONDAY.COM LTD	-	43.08	947	142,595	ソフトウェア
ROYALTY PHARMA PLC	417.75	621.73	1,821	274,142	医薬品
ROBLOX CORP	450.19	664.77	2,934	441,582	娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	296.56	-	-	-	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,508.26	1,841.48	2,222	334,489	医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	264.44	346.04	1,478	222,518	ホテル・レストラン・レジャー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	126.87	158.46	1,201	180,876	石油・ガス・消耗燃料
HF SINCLAIR CORP	202.99	255.6	1,521	228,945	石油・ガス・消耗燃料
SNOWFLAKE INC	285.82	426.08	10,055	1,513,250	情報技術サービス
DOORDASH INC	295.75	393.76	4,725	711,142	ホテル・レストラン・レジャー
ARISTA NETWORKS INC	293.67	392.38	10,424	1,568,761	通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	504.82	595.48	6,703	1,008,782	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	-	158.93	650	97,893	大規模小売り
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	2,028.24	2,731.08	6,879	1,035,309	ソフトウェア
FNF GROUP	310.04	389.07	2,023	304,524	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	166.15	187.23	2,701	406,555	専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,079.89	1,291.01	8,902	1,339,783	半導体・半導体製造装置
APA CORP	409.46	491.46	1,464	220,400	石油・ガス・消耗燃料
CONFLUENT INC	-	275.24	932	140,375	ソフトウェア
LINDE PLC	-	744.54	31,151	4,687,997	化学
ROBINHOOD MARKETS INC	-	735.66	984	148,129	資本市場
LUCID GROUP INC	449.1	1,439.27	496	74,725	自動車
U-HAUL HOLDING CO	119.81	119.81	762	114,816	陸上運輸
ASPEN TECHNOLOGY INC	37.21	37.21	671	101,002	ソフトウェア
TOAST INC	326.2	453.99	914	137,666	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD	1,683.28	2,795.15	953	143,438	陸上運輸
CATALENT INC	205.64	273.57	1,557	234,419	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	611.18	687.01	2,702	406,625	消費者金融
VERALTO CORP	-	370.86	3,123	470,037	商業サービス・用品
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	-	198.71	596	89,711	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	-	281.91	1,882	283,354	娯楽
BUNGE GLOBAL SA	-	217.15	1,943	292,541	食品
KENVUE INC	-	2,640.38	5,040	758,542	パーソナルケア用品
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	633.78	730.13	2,286	344,025	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	52.37	67.99	1,792	269,823	ソフトウェア
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	222.09	277.13	4,292	645,973	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	58.02	73.6	4,634	697,393	ソフトウェア
QORVO INC	141.44	141.44	1,606	241,779	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	153.35	184.44	1,099	165,483	メディア
LIBERTY GLOBAL LTD	-	360.34	707	106,502	各種電気通信サービス
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	67.28	-	-	-	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	197.13	197.13	2,199	330,984	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ETSY INC	156.14	185.58	1,413	212,782	大規模小売り
TRANSUNION	257.08	312.62	2,423	364,749	専門サービス
ALCOA CORP	239.41	—	—	—	金属・鉱業
ALBERTSONS COS INC	—	540.86	1,147	172,636	生活必需品流通・小売り
BLOCK INC	669.1	843.06	5,683	855,244	金融サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	602.66	682.35	4,616	694,676	化学
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	262.21	310.12	2,052	308,815	飲料
WESTROCK CO	342.86	342.86	1,461	219,906	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	921.06	1,294.47	4,421	665,453	食品
NOVOCURE LTD	123.17	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	426.08	553.7	4,627	696,441	機械
WASTE CONNECTIONS INC	310.39	388.48	6,375	959,484	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	7,443.29	9,072.3	132,401	19,925,048	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,563.84	1,867.11	2,843	427,934	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	1,375.3	1,585.07	9,331	1,404,268	金融サービス
SEA LTD ADR	439.08	580.7	2,479	373,065	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	449.24	563.29	1,903	286,436	金融サービス
ZILLOW GROUP INC-C	163.21	223.74	1,299	195,491	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	6,916.6	7,929.18	116,669	17,557,661	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	103.1	140.51	3,558	535,548	ソフトウェア
ATLASSIAN CORP PLC	—	237.13	5,119	770,418	ソフトウェア
LINDE PLC	620.82	—	—	—	化学
ROKU INC	156.6	193.31	1,763	265,428	娯楽
CHARTER COMMUNICATIONS INC	140.85	150.49	4,323	650,609	メディア
VISTRA CORP	496.33	496.33	2,197	330,664	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>	423,708.49 601銘柄	516,942.33 588銘柄	6,597,442 —	992,849,171 <73.0%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	570.3	752.91	4,618	513,283	金属・鉱業
BARRICK GOLD CORP	2,148.35	2,674.95	5,093	566,047	金属・鉱業
BANK OF MONTREAL	825.85	1,097.27	13,755	1,528,772	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,494.35	1,836.39	11,639	1,293,562	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	409.67	517.06	5,290	587,935	銀行
BCE INC	76.97	141.97	711	79,113	各種電気通信サービス
BROOKFIELD CORP	1,771.31	2,110.45	11,335	1,259,797	資本市場
SAPUTO INC	345.82	345.82	961	106,886	食品
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	923.11	923.11	734	81,665	総合公益事業
DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	115.08	115.08	1,367	151,983	ソフトウェア
CGI INC	279.18	310.91	4,781	531,448	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	210.58	210.58	1,212	134,712	容器・包装
CAE INC	408.08	408.08	1,044	116,106	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	542.64	660.84	3,782	420,403	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	456.07	533.75	3,255	361,857	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,145.14	1,430.11	8,699	966,846	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,407.03	1,643.44	13,377	1,486,786	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	61.24	89.11	1,255	139,523	大規模小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	163.3	163.3	488	54,247	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	732.33	836.93	14,606	1,623,415	陸上運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	217.13	301.42	1,402	155,841	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	332.17	404.59	2,207	245,335	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	294.33	206.08	693	77,093	生活必需品流通・小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
KINROSS GOLD CORP	2,199.14	1,927.37	1,302	144,804	金属・鉱業
RB GLOBAL INC	132.86	266.41	2,478	275,509	商業サービス・用品
FORTIS INC	604.84	720.78	3,792	421,525	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	742.03	854.21	1,000	111,171	金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	746	82,935	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	342.08	435.51	1,809	201,112	保険
IMPERIAL OIL LTD	272.46	274.34	2,191	243,555	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	2,517.28	3,261.9	14,724	1,636,449	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	124.78	124.78	447	49,703	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,338.61	2,713.63	8,322	924,985	保険
LOBLAW CO LTD	216	248.03	3,371	374,732	生活必需品流通・小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,012.1	1,162.51	9,798	1,089,038	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	358.44	422.79	3,100	344,569	自動車用部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	758.84	903.24	6,433	715,050	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	27.99	31.33	4,242	471,565	保険
METRO INC	286.29	350.59	2,454	272,829	生活必需品流通・小売り
EMERA INC	369.98	446.43	2,090	232,303	電力
ONEX CORP	101.57	101.57	1,045	116,248	資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	193.23	553.73	929	103,266	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	655	898.64	3,413	379,324	保険
QUEBECOR INC-B	171.95	305.98	963	107,052	各種電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,719.47	2,135.23	27,982	3,109,940	銀行
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	1,163.63	1,440.17	16,527	1,836,854	陸上運輸
SHAW COMM INC-B	598.77	—	—	—	メディア
STANTEC INC	—	183.58	2,048	227,677	建設・土木
SUNCOR ENERGY INC	1,718.98	1,984.39	8,473	941,727	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	687.62	1,196.6	1,315	146,156	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	573.26	658.96	3,362	373,654	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	199.79	248.37	5,279	586,747	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	96.65	130.97	1,620	180,057	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) CS	2,251.61	2,795.45	22,215	2,469,024	銀行
TC ENERGY CORP	1,237.53	1,571.54	7,989	887,976	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	81.02	81.02	863	95,943	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	98.39	98.39	1,685	187,361	生活必需品流通・小売り
INTACT FINANCIAL CORP	215.66	267.58	5,979	664,544	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	585.39	738.65	4,324	480,657	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	25.3	30.41	11,310	1,257,070	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	231.63	294.2	4,236	470,842	金属・鉱業
TOURMALINE OIL CORP	392.98	490.85	2,650	294,532	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	245.71	399.97	1,275	141,759	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	156.65	241.29	1,094	121,668	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	338.33	472.49	1,289	143,306	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	681.79	821.64	3,725	414,031	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	362.04	415.08	4,268	474,375	大規模小売り
MEG ENERGY CORP	—	471.81	1,165	129,519	石油・ガス・消耗燃料
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,677.15	2,267.67	4,982	553,707	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	749.61	963.01	2,058	228,827	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	341.52	341.52	813	90,450	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	512.43	512.43	1,154	128,311	商業サービス・用品
TMX GROUP LTD	70.4	468.84	1,622	180,341	資本市場
BRP INC	43.07	43.07	382	42,516	レジャー用品

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IVANHOE MINES LTD	640.27	988.2	1,401	155,736	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	661.77	773.39	5,116	568,675	化学
TFI INTERNATIONAL INC	93.99	115.91	2,275	252,942	陸上運輸
WSP GLOBAL INC	156.81	203.94	4,147	460,956	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	120.11	164.48	1,515	168,471	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	275.77	356.67	1,735	192,929	商業サービス・用品
NUVEI CORP	79.29	-	-	-	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	161.03	161.03	549	61,046	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	425.01	522.49	2,844	316,130	資本市場
AIR CANADA	188.14	418.58	794	88,296	旅客航空輸送
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	353.84	451.13	4,676	519,786	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	1,468.23	1,842.48	20,132	2,237,557	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	52.37	52.37	1,172	130,359	不動産管理・開発
HYDRO ONE LTD	462.25	462.25	1,856	206,319	電力
小計	株数 : 50,869.66 銘柄数 <比率> : 86	株数 : 62,314.92 銘柄数 : 86	386,892	42,999,195	<3.2%>
(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	217.54	283.06	1,456	142,126	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPAC BANKING CORPORATION	4,377.12	5,201.9	12,546	1,224,710	銀行
FORTESCUE LTD	2,101.04	2,530.9	7,008	684,056	金属・鉱業
TELSTRA GROUP LTD	4,828.55	5,998.53	2,393	233,621	各種電気通信サービス
ASX LTD	236.64	312.15	2,084	203,471	資本市場
BHP GROUP LTD	6,313	7,757.07	35,643	3,479,185	金属・鉱業
AMPOL LTD	318.28	318.28	1,167	113,985	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	720.81	916.24	2,408	235,122	専門サービス
CSL LIMITED	601.03	736.93	20,648	2,015,455	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	61.34	93.17	1,693	165,334	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	3,796.33	4,762.58	6,077	593,181	運送インフラ
COCHLEAR LTD	78.36	104.46	3,437	335,530	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,132.29	2,576.92	2,208	215,563	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,112.29	2,556.04	29,156	2,845,990	銀行
RIO TINTO LIMITED	459.36	569.91	7,309	713,496	金属・鉱業
APA GROUP	1,643	2,228.29	1,793	175,090	ガス
ARISTOCRAT LEISU	766.75	868.29	3,794	370,374	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,816.64	3,600.82	2,279	222,484	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	607.67	693.36	3,842	375,076	建設資材
IGO LTD	919.47	919.47	639	62,375	金属・鉱業
ORICA LTD	638.62	638.62	1,037	101,233	化学
LEND LEASE CORP LTD	1,071.81	-	-	-	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	503.25	765.87	1,659	161,997	金属・鉱業
MACQUARIE GROUP LTD	466.42	567.01	10,541	1,028,989	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,541.62	1,996.28	2,882	281,373	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,928.66	4,650.95	15,120	1,475,886	銀行
NEWCREST MINING LTD	1,128.15	-	-	-	金属・鉱業
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,126.59	1,126.59	643	62,790	旅客航空輸送
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,724.87	2,198.07	3,618	353,155	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,355.78	1,626.29	2,093	204,301	金属・鉱業
REECE LTD	315.58	315.58	728	71,125	商社・流通業
SANTOS LTD	4,173.58	4,788.09	3,538	345,383	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	527.74	648.97	2,086	203,657	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	259.85	394.2	1,323	129,170	金融サービス

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		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
WESFARMERS LTD	1,397.2	1,728.24	10,186	994,279	大規模小売り	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	2,354.31	2,821.53	8,797	858,726	石油・ガス・消耗燃料	
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,543.2	1,838.4	6,522	636,675	生活必需品流通・小売り	
SEEK LTD	384.05	585.13	1,420	138,674	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
MINERAL RESOURCES LTD	211.79	288.65	1,640	160,147	金属・鉱業	
BRAMBLES LTD	1,709.29	2,207.67	3,311	323,236	商業サービス・用品	
PILBARA MINERALS LTD	3,279.47	4,044.96	1,415	138,189	金属・鉱業	
CAR GROUP LTD	-	583.1	1,945	189,929	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
AURIZON HOLDINGS LTD	2,228.49	2,228.49	878	85,704	陸上運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	792.33	1,349.1	1,493	145,776	飲料	
XERO LTD	188.6	231.49	2,582	252,123	ソフトウェア	
IDP EDUCATION LTD	237.81	449.23	984	96,117	各種消費者サービス	
LOTTERY CORP LTD	2,912.7	2,912.7	1,433	139,879	ホテル・レストラン・レジャー	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,604.7	2,336.4	1,259	122,922	生活必需品流通・小売り	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	3,743.53	4,434.5	12,332	1,203,760	銀行	
MEDIBANK PVT LTD	2,985.76	4,127.51	1,560	152,291	保険	
SOUTH32 LTD(AUD)	5,966.94	6,827.38	2,102	205,257	金属・鉱業	
COLES GROUP LTD	1,716.84	1,975.89	3,161	308,586	生活必需品流通・小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	148.23	273.25	2,049	200,012	ソフトウェア	
小計	株数 銘柄数<比率>	87,275.27 52銘柄	103,988.51 51銘柄	257,940 -	25,177,588 <1.8%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,570	2,570	2,109	40,616	不動産管理・開発	
CLP HOLDINGS LTD	1,972.96	2,417.96	15,583	299,987	電力	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	933.14	933.14	4,185	80,563	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,518.91	1,834.91	44,698	860,444	資本市場	
MTR CORP	1,924.41	2,074.41	5,217	100,429	陸上運輸	
HANG SENG BANK LTD	950.96	1,220.96	9,889	190,378	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,709.72	2,979.72	6,227	119,881	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,513.2	2,128.2	9,683	186,403	電力	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	-	2,020	5,181	99,740	不動産管理・開発	
HONG KONG & CHINA GAS	15,364.06	15,364.06	8,742	168,286	ガス	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,609.04	3,369.04	14,941	287,627	ホテル・レストラン・レジャー	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,199.95	6,804.95	12,997	250,200	銀行	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,730.66	1,730.66	1,623	31,249	不動産管理・開発	
SINO LAND CO	4,112	6,592	5,247	101,009	不動産管理・開発	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,805.65	2,045.65	14,605	281,164	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC LTD A	530.2	530.2	3,234	62,258	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,801.56	2,151.56	18,202	350,392	機械	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,780	1,780	1,178	22,683	建設関連製品	
AIA GROUP LTD	14,933.16	17,785.16	111,512	2,146,624	保険	
HKT TRUST / HKT LTD	4,631.36	7,971.36	7,413	142,707	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	3,358	3,358	7,790	149,968	ホテル・レストラン・レジャー	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	1,400	1,400	1,867	35,951	海上運輸	
SWIRE PROPERTIES LTD	2,016	2,016	3,003	57,823	不動産管理・開発	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,961.35	2,561.35	6,262	120,553	不動産管理・開発	
ESR GROUP LTD	2,164	4,652	4,377	84,267	不動産管理・開発	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,465	-	-	-	電力	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	2,650	2,650	3,418	65,806	飲料	
WH GROUP LTD	9,315	10,010	4,594	88,445	食品	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,104.45	3,694.45	15,202	292,651	コンプロマリット	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,661.95	2,661.95	9,396	180,886	不動産管理・開発	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	97,686.69	117,307.69	358,389	6,899,003	
		29銘柄	29銘柄	-	<0.5%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE TECH ENG	1,442	1,718	657	73,465	航空宇宙・防衛	
SEMBCORP INDUSTRIES	-	1,622	901	100,689	総合公益事業	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,248.1	2,687.1	8,751	977,147	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	394	1,010	594	66,419	不動産管理・開発	
SEATRIM LTD	-	72,352.22	622	69,471	機械	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	155	155	414	46,327	コングロマリット	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	998	1,399	1,280	142,921	資本市場	
GENTING SINGAPORE LTD	7,611.93	7,611.93	776	86,686	ホテル・レストラン・レジャー	
KEPPEL LTD	1,849	2,496	1,789	199,812	コングロマリット	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,981.98	5,020.98	6,502	725,967	銀行	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	9,433.3	13,408.3	3,150	351,803	各種電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,627	2,440	1,742	194,512	旅客航空輸送	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,399.66	1,915.66	5,425	605,717	銀行	
UOL GROUP LIMITED	436	436	257	28,720	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	438	-	-	-	電子装置・機器・部品	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,585	2,585	814	90,913	食品	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	3,065.9	4,052.9	1,146	128,059	不動産管理・開発	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37,664.87	120,910.09	34,828	3,888,636	
		15銘柄	16銘柄	-	<0.3%>	
(ニューージーランド)	百株	百株	千ニューージーランド・ドル	千円		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,643.41	2,297.26	1,872	171,593	運送インフラ	
EBOS GROUP LTD	-	256.31	946	86,704	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FISHER & PAYKEL	784.6	784.6	1,867	171,142	ヘルスケア機器・用品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,190.38	3,127.23	1,601	146,744	各種電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER LTD	628.34	628.34	425	38,986	電力	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,321.57	2,393.08	1,354	124,138	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>	6,568.3	9,486.82	8,066	739,309	
		5銘柄	6銘柄	-	<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
ANTOFAGASTA PLC	459.63	612.95	1,027	194,393	金属・鉱業	
ASHTAD GROUP	543.04	668.51	3,456	653,808	商社・流通業	
SEVERN TRENT PLC	293.97	455.48	1,137	215,149	水道	
BARCLAYS PLC	20,224.17	22,290.23	3,165	598,763	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,241.96	1,241.96	588	111,268	家庭用耐久財	
BT GROUP PLC	9,041.98	9,041.98	947	179,257	各種電気通信サービス	
BUNZL PLC	385.93	539.79	1,720	325,533	商社・流通業	
CRH PLC	-	1,085.93	6,387	1,208,312	建設資材	
AVIVA PLC	3,486.83	4,292.05	1,826	345,474	保険	
CRODA INTERNATIONAL	167.82	205.73	1,000	189,335	化学	
DIAGEO PLC	2,829.74	3,468.58	9,949	1,882,169	飲料	
SCHRODERS PLC	1,103.66	1,103.66	439	83,198	資本市場	
DCC PLC	111.35	174.71	981	185,740	コングロマリット	
NATIONAL GRID PLC	4,605.69	5,474.62	5,485	1,037,705	総合公益事業	
KINGFISHER PLC	2,253.92	3,360.26	734	138,891	専門小売り	
BAE SYSTEMS PLC	3,796.23	4,573.88	5,625	1,064,246	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,628.77	3,256.71	7,812	1,477,956	タバコ	
HALMA PLC	510.66	622.08	1,362	257,716	電子装置・機器・部品	

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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
NEXT PLC	187.51	185.88	1,542	291,711	大規模小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	1,078.89	1,261.79	2,387	451,606	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	199.76	—	—	—	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,574.26	1,931.17	3,374	638,286	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	2,209.35	2,590.74	5,663	1,071,337	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	24,887.38	29,731	18,454	3,490,949	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	7,381.79	8,563.99	2,014	381,035	保険
CENTRICA PLC	—	7,937.76	1,066	201,813	総合公益事業
UNILEVER PLC	3,166.86	3,824.37	15,243	2,883,695	パーソナルケア用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	905.69	1,151.34	1,177	222,808	水道
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	423.51	550.43	1,247	235,946	食品
PEARSON PLC	841.59	841.59	796	150,606	各種消費者サービス
PERSIMMON PLC	352.52	569.89	799	151,305	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	3,339.71	4,181.46	3,305	625,211	保険
RIO TINTO PLC	1,408.39	1,730.77	9,188	1,738,218	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	32,204.82	35,829.03	2,339	442,588	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	886.53	1,070.96	6,095	1,153,162	家庭用品
RELX PLC	2,404.03	2,891.43	9,645	1,824,697	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	3,121.14	3,748.45	1,527	288,955	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	11,219.24	13,032.32	4,068	769,674	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	6,704.64	8,963.55	1,873	354,387	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	674.48	890.82	554	104,850	資本市場
SSE PLC	1,315.74	1,689.22	2,652	501,693	電力
BP PLC	23,470.86	25,715.29	12,253	2,317,963	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	1,288.93	1,521.96	1,776	335,990	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	516.95	516.95	826	156,368	コングロメリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	89.36	107.51	1,092	206,630	機械
STANDARD CHARTERED PLC	3,198.02	3,625.28	2,088	395,017	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	84,778.63	98,680.76	4,085	772,831	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	5,698.63	5,698.63	819	155,017	家庭用耐久財
TESCO PLC	9,342.47	10,307.35	2,857	540,496	生活必需品流通・小売り
3I GROUP PLC	1,247.51	1,494.86	3,569	675,285	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	1,076.79	1,259.3	1,382	261,448	ヘルスケア機器・用品
GSK PLC	4,995.5	6,260.67	10,442	1,975,464	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	414.94	633.56	5,614	1,062,115	資本市場
WPP PLC	1,427.85	1,760.61	1,347	254,919	メディア
ASTRAZENECA PLC	1,930.29	2,365.72	23,004	4,351,716	医薬品
WHITBREAD PLC	254.7	314.75	1,084	205,119	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	233.09	233.09	1,020	193,086	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	522.29	522.29	677	128,096	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	217.52	268.74	2,053	388,398	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,920.97	2,658.07	666	126,109	生活必需品流通・小売り
ADMIRAL GROUP PLC	213.25	400.84	1,021	193,206	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	164.89	164.89	763	144,482	家庭用耐久財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	184.55	184.55	362	68,600	医薬品
ABRDN PLC	2,858.31	2,858.31	460	87,107	資本市場
EXPERIAN PLC	1,127.09	1,401.33	4,707	890,435	専門サービス
MONDI PLC	588.87	675.54	913	172,838	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	369.42	369.42	306	58,058	資本市場
OCADO GROUP PLC	697.66	697.66	371	70,316	生活必需品流通・小売り
INFORMA PLC	1,861.95	2,239.61	1,788	338,340	メディア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	末額	
			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	
GLENORE PLC	12,257.76	15,701.88	6,145	1,162,585	金属・鉱業
ENTAIN PLC	744.51	969.24	904	171,139	ホテル・レストラン・レジャー
COCA-COLA HBC AG	213.38	310.35	739	139,844	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	862.23	1,358.28	672	127,290	保険
M&G PLC	2,704.01	2,704.01	594	112,380	金融サービス
ENDEAVOUR MINING PLC	-	280.75	356	67,395	金属・鉱業
WISE PLC	-	962.07	800	151,492	金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,521.8	3,820.71	413	78,203	専門小売り
HALEON PLC	6,227.66	8,367.29	2,645	500,494	パーソナルケア用品
SHELL PLC	9,059.72	10,110.99	25,252	4,776,958	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	1,108.33	1,431.88	1,020	193,075	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	-	271.04	4,500	851,382	ホテル・レストラン・レジャー
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,872.07	2,161.24	1,301	246,286	航空宇宙・防衛
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	281,373	53,227,458	
	77銘柄	81銘柄	-	<3.9%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,467.03	1,874.04	5,942	245,076	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,803.43	2,390.83	6,574	271,149	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	2,877.73	-	-	-	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	36.62	33.3	2,519	103,891	航空宇宙・防衛
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	125.74	-	-	-	半導体・半導体製造装置
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,629.44	1,629.44	2,861	118,002	銀行
ICL GROUP LTD	1,030.67	1,030.67	1,769	72,982	化学
NICE LTD	76.4	90.53	7,264	299,578	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	174.4	294.44	3,954	163,079	銀行
AZRIELI GROUP	46.72	46.72	1,105	45,606	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	31,991	1,319,366	
	10銘柄	8銘柄	-	<0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	4,515.99	-	-	-	資本市場
LOGITECH INTL-REG	237.34	237.34	1,816	308,694	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	3,418.82	4,077.36	39,481	6,709,019	食品
CIE FINANC RICHEMONT	644.58	805.41	10,812	1,837,390	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	872.21	1,070.11	24,312	4,131,490	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	52.36	53.11	1,204	204,686	機械
SIKA INHABER	177.93	233.97	5,729	973,686	化学
SGS SA-REG	7.48	229.78	1,909	324,554	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS	2,693.94	3,120.75	27,400	4,656,113	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	56.75	58.3	829	140,876	保険
BARRY CALLEBAUT AG	4.6	4.6	597	101,461	食品
CLARIANT AG-REG	210.72	229.09	250	42,627	化学
SWISSCOM AG-REG	34.31	44.57	2,242	381,112	各種電気通信サービス
ABB LTD	1,945.38	2,474.95	9,632	1,636,851	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	198.42	264.54	965	163,989	専門サービス
GEBERIT AG	43.77	51.05	2,577	437,910	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	90.27	115.36	5,336	906,840	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	1.37	1.61	1,822	309,700	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.13	0.16	1,798	305,602	食品
GIVAUDAN-REG	11.73	13.92	5,115	869,293	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	187.71	221.6	9,692	1,647,094	保険
ROCHE HOLDING AG-BEARER	36.12	48.1	1,153	196,003	医薬品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
HOLCIM LTD	666.07	775.19	5,158	876,518	建設資材
TEMENOS GROUP	70.82	109.3	967	164,336	ソフトウェア
BACHEM HOLDING AG	46.73	46.73	295	50,146	ライフサイエンス・ツール/サービス
SONOVA HOLDING AG	69.84	81	2,307	392,145	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	68.87	78.9	2,251	382,515	海上運輸
STRAUMANN HOLDING AG	145.31	164.75	2,293	389,703	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	31.3	43	899	152,935	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	92.59	92.59	374	63,564	繊維・アパレル・贅沢品
HELVETIA HOLDING AG	-	49.06	599	101,875	保険
SCHINDLER NAMEN	27.2	42.09	914	155,349	機械
SWISS LIFE HOLDING AG	39.78	45.03	2,804	476,563	保険
BANQUE CANTONALE VAUD	49.03	49.03	518	88,065	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING	8.1	12.45	779	132,438	化学
SWISS PRIME SITE AG	83.72	133.56	1,139	193,709	不動産管理・開発
AVOLTA AG	-	129.33	454	77,271	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	28.52	34.33	4,165	707,919	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	260.31	321.14	1,520	258,395	資本市場
SWISS RE LTD	381.39	455.02	4,663	792,545	保険
BKW AG	31.94	31.94	420	71,535	電力
SIG GROUP AG	383.22	509.69	915	155,554	容器・包装
ALCON INC	612.85	749.22	5,091	865,232	ヘルスケア機器・用品
SANDOZ GROUP AG	-	573.47	1,631	277,244	医薬品
UBS GROUP AG	4,189.21	5,033.06	12,205	2,074,024	資本市場
VAT GROUP AG	33.25	41.31	1,752	297,850	機械
小 計	株 数 銘 柄 数 <比率>	株 数 銘 柄 数 <比率>	208,806	35,482,442	
	22,761.98	22,956.87	-	<2.6%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B	125.49	151.67	14,105	305,662	飲料
A P MOLLER A/S	6.63	6.63	7,170	155,381	海上運輸
AP MOLLER MAERSK A	3.59	5.43	5,766	124,963	海上運輸
DANSKE BANK A/S	853.71	1,023.03	19,882	430,855	銀行
GENMAB A/S	79.26	97.83	18,367	398,025	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	238.59	547.95	20,060	434,709	化学
ROCKWOOL AS	8.73	8.73	1,889	40,938	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B	2,063.49	4,980.24	421,776	9,139,897	医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,254.36	1,545.21	29,108	630,784	電気設備
COLOPLAST-B	153.43	212.91	18,706	405,364	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	238.42	281.9	32,052	694,567	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	113.67	177	6,331	137,199	ヘルスケア機器・用品
TRYG A/S	448.87	582.22	8,366	181,302	保険
PANDORA A/S	124.73	124.73	13,770	298,400	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	125.38	-	-	-	化学
ORSTED A/S	232.4	269.11	10,831	234,722	電力
小 計	株 数 銘 柄 数 <比率>	株 数 銘 柄 数 <比率>	628,185	13,612,774	
	6,070.75	10,014.59	-	<1.0%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA	563.75	731.18	14,448	205,596	食品
NORSK HYDRO ASA	1,629.71	2,211.82	12,448	177,136	金属・鉱業
TELENOR ASA	859.54	1,195.76	13,727	195,339	各種電気通信サービス
KONGSBERG GRUPPEN ASA	111.85	111.85	7,275	103,535	航空宇宙・防衛
ORKLA ASA	1,160.68	1,160.68	8,802	125,260	食品

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	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
EQUINOR ASA	1,156.17	1,298.95	34,292	487,979	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	198.34	294.14	10,597	150,807	化学
AKER BP ASA	387.23	409.33	10,708	152,375	石油・ガス・消耗燃料
SALMAR ASA	72.48	128.97	7,611	108,316	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	257.21	257.21	4,406	62,697	保険
ADEVINTA ASA	243.82	547.15	6,188	88,059	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	1,193.19	1,439.09	29,472	419,394	銀行
小計	株数・金額 柄数<比率>	7,833.97 12銘柄	9,786.13 12銘柄	159,978 -	2,276,499 <0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	3,341.22	3,960.72	66,757	955,973	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	1,942.04	2,418.69	35,409	507,065	機械
ERICSSON LM-B SHS	3,665.51	4,180	23,094	330,713	通信機器
GETINGE AB-B SHS	257.55	389.25	7,720	110,561	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	584.37	-	-	-	金融サービス
LUNDBERGS B	78.59	148.72	8,152	116,748	金融サービス
SKF AB-B SHS	465.94	465.94	9,905	141,852	機械
SANDVIK AB	1,333.5	1,692.18	36,720	525,834	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,958.37	2,502.03	37,230	533,136	銀行
SKANSKA AB-B SHS	439.37	439.37	8,207	117,530	建設・土木
SWEDBANK AB	1,122.96	1,325.81	28,359	406,101	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	702.11	927.95	12,652	181,185	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,844.99	2,188.46	26,611	381,079	銀行
VOLVO AB-A SHS	241.98	241.98	6,591	94,390	機械
VOLVO AB-B SHS	1,916.25	2,375.69	63,157	904,418	機械
HOLMEN AB-B SHS	101.42	173.2	6,872	98,415	紙製品・林産品
TELE2 AB-B SHS	644.16	676.54	5,639	80,759	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	152.92	152.92	5,096	72,986	金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	213.25	213.25	7,107	101,781	金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	269.07	-	-	-	家庭用耐久財
SAAB AB-B	-	117.89	9,145	130,969	航空宇宙・防衛
SECURITAS AB-B SHS	760.85	760.85	8,091	115,872	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	2,263.92	2,715.48	68,104	975,252	金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	822.87	1,046.69	14,768	211,489	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	1,246.12	1,533.68	43,525	623,290	建設関連製品
TELIA CO AB	3,448.1	3,448.1	8,406	120,380	各種電気通信サービス
BOLIDEN AB	362.6	362.6	9,694	138,819	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	353.13	444.07	16,879	241,708	機械
KINNEVIK AB-B	362.78	-	-	-	金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	729.42	729.42	4,655	66,661	不動産管理・開発
INDUTRADE AB	391.78	391.78	10,707	153,329	機械
HUSQVARNA AB-B SHS	477.69	477.69	3,664	52,480	機械
NIBE INDUSTRIER AB	1,858.45	2,128.32	13,978	200,176	建設関連製品
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	183.8	363.81	9,109	130,452	バイオテクノロジー
HEXAGON AB-B SHS	2,481.63	3,071.16	35,333	505,978	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	280.22	280.22	7,033	100,720	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	845.63	1,031.15	19,272	275,977	機械
EPIROC AB-B	412.05	614.87	10,108	144,753	機械
ESSITY AB-B	751.8	869	20,682	296,169	家庭用品
EQT AB	407.16	551.94	15,128	216,642	資本市場
EMBRACER GROUP AB	797.91	-	-	-	娯楽

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
VOLVO CAR AB	637.1	637.1	2,362	33,829	自動車
BEIJER REF AB	—	504.93	7,366	105,494	商社・流通業
LIFCO AB	268.35	396.31	10,625	152,151	コングロマリット
EVOLUTION AB	223.26	282.66	37,062	530,733	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	4,203.56	—	—	—	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	155.39	276.38	7,185	102,901	コングロマリット
小 計	株 数 : 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	46,001.14 45銘柄	47,508.8 42銘柄	788,182 —	11,286,768 <0.8%>
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	907.48	—	—	—	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	199.53	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	207.61	250.25	2,051	331,366	食品
KINGSPAN GROUP PLC	174.51	218.6	1,772	286,350	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	324.22	398.69	1,483	239,554	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,345.37	1,641.56	1,356	219,115	銀行
AIB GROUP PLC	1,475.78	2,269.14	921	148,876	銀行
小 計	株 数 : 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,634.5 7銘柄	4,778.24 5銘柄	7,585 —	1,225,263 <0.1%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	733.77	907.75	13,639	2,203,108	航空宇宙・防衛
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	—	124.03	1,918	309,815	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE DSM NV	222.01	—	—	—	化学
ING GROEP NV-CVA	4,707.18	5,408.15	6,644	1,073,212	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	59.78	72.73	4,062	656,206	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	155.84	155.84	825	133,256	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,258.84	1,466.67	3,907	631,092	生活必需品流通・小売り
HEINEKEN NV	320.26	437.59	3,813	615,901	飲料
AKZO NOBEL	226.27	260.32	1,756	283,648	化学
ASML HOLDING NV	506.05	614.91	52,476	8,475,991	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,155.12	1,217.72	2,266	366,111	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	320.47	387.24	5,520	891,607	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	869.19	1,040.58	4,338	700,786	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	274.12	345.44	1,374	222,065	ライフサイエンス・ツール/サービス
KONINKLIJKE KPN NV	4,757.39	4,960.95	1,589	256,814	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	108.53	176.9	1,275	206,010	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	577.75	839.4	817	132,109	飲料
OCI NV	123.29	123.29	334	54,105	化学
FERRARI NV	154.35	188.5	6,701	1,082,373	自動車
ASR NEDERLAND NV	—	273.65	1,176	190,015	保険
CNH INDUSTRIAL NV	1,246.04	—	—	—	機械
PROSUS NV	1,025.26	2,208.42	6,426	1,038,008	大規模小売り
JDE PEET'S BV	143.85	143.85	322	52,138	食品
EXOR NV	141.42	141.42	1,360	219,695	金融サービス
EURONEXT NV	100.81	140.77	1,115	180,192	資本市場
IMCD NV	68.23	93.32	1,300	210,042	商社・流通業
NN GROUP NV	362.89	434.78	1,628	263,065	保険
ARGENX SE	67.53	90.78	3,279	529,766	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	925.02	1,256.11	3,422	552,866	娯楽
STELLANTIS NV	2,806.95	3,419.19	7,718	1,246,744	自動車
FERROVIAL SE	—	738.17	2,610	421,594	建設・土木
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	226.7	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV	528.35	759.82	1,088	175,805	銀行
ADYEN NV	25.93	33.78	4,889	789,831	金融サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	24,199.19 31銘柄	28,462.07 31銘柄	149,603 -	24,163,985 <1.8%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	242.9	335.45	693	111,939	化学
LOTUS BAKERIES NV	-	0.77	692	111,808	食品
D'IETERN TRDG	27.36	27.36	479	77,512	販売
KBC GROUPE	322.13	359.62	2,269	366,521	銀行
SOFINA	22.81	22.81	501	80,980	金融サービス
SOLVAY SA	90.7	-	-	-	化学
AGEAS	181.36	240.86	926	149,623	保険
UCB SA	167.32	200.2	1,883	304,155	医薬品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	113.18	129.18	901	145,638	金融サービス
ELIA GROUP	40.78	40.78	428	69,161	電力
SYENSQO SA	-	112.17	926	149,670	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,053.27	1,295.06	7,500	1,211,559	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,261.81 10銘柄	2,764.26 11銘柄	17,202 -	2,778,571 <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)	668.78	811.29	2,041	329,761	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	178.24	230.38	1,270	205,181	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	558.55	760.02	1,120	180,945	エネルギー設備・サービス
AROUNDTOWN SA	1,132.25	-	-	-	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,537.82 4銘柄	1,801.69 3銘柄	4,432 -	715,888 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	653.17	798.31	13,560	2,190,226	化学
AXA SA	2,280.92	2,717.13	8,323	1,344,480	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	837.2	981.92	2,894	467,551	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	31.2	31.2	552	89,197	航空宇宙・防衛
DANONE	791.5	965.32	5,861	946,737	食品
SAFRAN SA	425.57	510.62	8,982	1,450,906	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	183.05	314.27	1,170	189,033	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	291.23	291.23	972	157,111	建設・土木
BNP PARIBAS	1,390.23	1,608.93	8,675	1,401,242	銀行
THALES SA	128.86	150.23	2,070	334,495	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	198.39	250.63	5,513	890,598	情報技術サービス
EIFFAGE	117.84	127.06	1,220	197,141	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	294.05	334.67	3,248	524,666	メディア
L'OREAL	301.22	366.99	15,828	2,556,583	パーソナルケア用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	344.54	422.43	33,904	5,476,211	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	1,148.08	1,148.08	716	115,713	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	869.08	983.59	3,296	532,371	自動車用部品
PERNOD-RICARD	248.88	309.48	4,789	773,552	飲料
RENAULT SA	279.02	279.02	1,051	169,858	自動車
REMY COINTREAU	28.66	28.66	279	45,115	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	614.6	695.01	4,722	762,793	建設関連製品
SEB SA	25.96	25.96	287	46,501	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	1,004.09	1,166.35	2,522	407,485	銀行
VINCI S.A.	667.67	763.13	8,794	1,420,456	建設・土木

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SODEXO	98.22	129.1	1,002	161,855	ホテル・レストラン・レジャー	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	678.65	831.64	16,250	2,624,739	電気設備	
VIVENDI SE	989.44	989.44	1,024	165,487	メディア	
TOTALENERGIES SE	3,100.9	3,493.95	21,110	3,409,759	石油・ガス・消耗燃料	
VALEO	265.7	—	—	—	自動車用部品	
ORANGE	2,554.81	2,869.57	3,050	492,785	各種電気通信サービス	
HERMES INTL	39.16	48.8	10,465	1,690,332	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT SYSTEMES SA	819	1,015.97	4,353	703,248	ソフトウェア	
KERING	93.82	114.43	4,761	769,066	繊維・アパレル・贅沢品	
CARREFOUR SA	755.72	906.42	1,356	219,168	生活必需品流通・小売り	
SANOFI	1,424.61	1,744.57	14,956	2,415,725	医薬品	
UBISOFT ENTERTAINMENT	110.32	—	—	—	娯楽	
TELEPERFORMANCE	78.45	95.81	1,291	208,528	専門サービス	
EURAZEO	56.73	56.73	436	70,509	金融サービス	
ESSILORLUXOTTICA	356.82	452.65	8,632	1,394,392	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT AGRICOLE SA	1,437.2	1,669.21	2,036	328,979	銀行	
WENDEL	54.49	—	—	—	金融サービス	
BIOMERIEUX	48.7	48.7	493	79,722	ヘルスケア機器・用品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	31.09	38.55	928	149,998	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ENGIE	2,217.51	2,770.54	3,982	643,322	総合公益事業	
ALSTOM	370.07	474.94	540	87,298	機械	
IPSEN SA	38.73	59.64	616	99,509	医薬品	
ARKEMA SA	63.92	104.89	1,016	164,166	化学	
LEGRAND SA	327.83	411.05	3,739	604,041	電気設備	
ADP	39.75	61.04	725	117,225	運送インフラ	
BUREAU VERITAS SA	397.29	397.29	986	159,398	専門サービス	
GETLINK	635.09	639.68	978	158,081	運送インフラ	
EDENRED	310.91	356.18	1,972	318,602	金融サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	172.93	172.93	668	107,927	ホテル・レストラン・レジャー	
WORLDLINE SA	299.16	362.32	434	70,226	金融サービス	
AMUNDI SA	104.36	112.88	676	109,303	資本市場	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,126.39 55銘柄	35,699.14 52銘柄	247,730 -	40,013,435 <2.9%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADIDAS AG	219.74	245.5	4,292	693,375	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	415.77	497.83	5,036	813,422	自動車	
COMMERZBANK AG	1,410.36	1,587.92	1,664	268,791	銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	489.48	588.14	1,533	247,750	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNITED INTERNET	100.1	—	—	—	各種電気通信サービス	
HANNOVER RUECK SE	71.05	96.38	2,229	360,071	保険	
GEA GROUP AG	174.9	255.13	955	154,408	機械	
CONTINENTAL AG	129.21	176.35	1,342	216,877	自動車用部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,247.72	1,517.35	6,395	1,033,022	航空貨物・物流サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	168.54	233.11	1,071	173,123	自動車	
MERCK KGAA	162.3	202.16	3,113	502,854	医薬品	
RWE AG	778.53	987.51	3,144	507,856	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
SAP SE	1,300.68	1,594.38	26,288	4,246,059	ソフトウェア	
E.ON SE	2,802.87	3,393.66	3,994	645,165	総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	133.76	178.86	1,126	181,945	家庭用品	
SIEMENS AG-REG	953.29	1,161.5	19,169	3,096,240	コングロマリット	
PUMA AG	162.1	172.1	717	115,832	繊維・アパレル・贅沢品	

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		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BAYER AG	1,213.29	1,473.29	4,135	667,970	医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	196.44	241.91	1,698	274,294	家庭用品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	995.29	1,237.37	8,108	1,309,682	自動車	
BASF SE	1,164.08	1,354.42	6,172	996,916	化学	
BEIERSDORF AG	129.4	157.43	2,160	349,000	パーソナルケア用品	
HEIDELBERG MATERIALS AG	208.09	215.86	1,777	287,153	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	238.55	336.32	1,324	213,975	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	509.4	614.13	15,021	2,426,292	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	723.42	1,086.47	803	129,842	旅客航空輸送	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	176.12	209.96	8,606	1,390,083	保険	
RHEINMETALL STAMM	55.96	66.62	2,427	392,111	航空宇宙・防衛	
VOLKSWAGEN AG	33.15	54.6	726	117,292	自動車	
VOLKSWAGEN AG PFD	222.69	304.25	3,583	578,799	自動車	
NEMETSCHKE SE	98.78	102.22	889	143,641	ソフトウェア	
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,537.16	2,826.37	3,371	544,622	資本市場	
BMW VORZUG	78.21	78.21	746	120,577	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	4,033.92	4,822.93	10,658	1,721,589	各種電気通信サービス	
SARTORIUS AG	28.47	36.51	1,202	194,250	ライフサイエンス・ツール/サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,590.23	1,979.36	6,530	1,054,870	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	5.16	5.42	405	65,526	機械	
CARL ZEISS MEDITEC AG	48.66	48.66	538	87,044	ヘルスケア機器・用品	
BECHTLE AG	81.39	145.21	720	116,403	情報技術サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	238.84	287.51	5,377	868,634	資本市場	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	72.94	86.92	1,914	309,286	航空宇宙・防衛	
WACKER-CHEMIE GMBH	-	29.91	289	46,706	化学	
SYMRISE AG	172.65	195.47	1,902	307,324	化学	
BRENNTAG SE	179.34	215.59	1,709	276,139	商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	246.87	428.36	732	118,312	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,054.74	-	-	-	各種電気通信サービス	
TALANX AG	-	103.49	697	112,580	保険	
LEG IMMOBILIEN SE	82.09	119.15	827	133,715	不動産管理・開発	
VONOVIA SE	859.37	1,074.78	2,769	447,363	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	103.42	103.42	583	94,279	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	343.18	449.62	2,415	390,128	ヘルスケア機器・用品	
DR ING HC F PORSCHE AG	151.74	183.71	1,464	236,551	自動車	
SIEMENS ENERGY AG	590.14	748.92	1,054	170,319	電気設備	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	566.93	834.68	2,886	466,198	機械	
ZALANDO SE	313.21	313.21	612	98,928	専門小売り	
SCOUT24 SE	100.48	100.48	653	105,491	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	275.58	275.58	1,343	216,994	化学	
HELLOFRESH SE	178.56	178.56	220	35,690	生活必需品流通・小売り	
DELIVERY HERO SE	225.64	225.64	503	81,273	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,843.98 57銘柄	36,240.4 57銘柄	191,645 -	30,954,661 <2.3%>	
(ユーロ…スイス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DSM-FIRMENICH AG	-	288.46	2,685	433,772	化学	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	288.46 1銘柄	2,685 -	433,772 <0.0%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	346.44	456.06	982	158,669	生活必需品流通・小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,179.56	5,054.41	1,897	306,553	電力	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	594.06	795.85	1,124	181,635	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,120.06 3銘柄	6,306.32 3銘柄	4,004 -	646,858 <0.0%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	7,795.92	9,390.14	10,127	1,635,756	電力
REPSOL SA	1,787.13	1,950.49	2,707	437,279	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	6,649.75	7,557.2	2,701	436,378	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	377.01	509.46	861	139,107	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	235.71	348.36	1,271	205,431	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	7,351.18	9,146.52	8,401	1,357,089	銀行
ACCIONA S.A.	26.42	50.05	551	89,005	電力
NATURGY ENERGY GROUP SA	176.77	176.77	411	66,411	ガス
BANCO SANTANDER SA	20,668.57	24,843.77	9,115	1,472,283	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	490.11	655.89	949	153,294	電力
INDITEX	1,363.21	1,621.41	6,357	1,026,871	専門小売り
ENAGAS	382.7	382.7	548	88,609	ガス
GRIFOLS SA	319.82	319.82	339	54,834	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	635.13	-	-	-	建設・土木
CAIXABANK	5,660.59	6,300.95	2,514	406,175	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	396.88	396.88	553	89,393	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMADEUS IT GROUP SA	547.12	688.48	4,269	689,682	ホテル・レストラン・レジャー
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	98.22	98.22	207	33,505	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AENA SME SA	99.89	116.03	1,925	311,009	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	695.72	819.74	2,701	436,404	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,757.85 20銘柄	65,372.88 19銘柄	56,516 -	9,128,526 <0.7%>
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,446.13	1,446.13	2,970	479,771	保険
INTESA SANPAOLO	20,509.73	23,301.03	6,559	1,059,448	銀行
UNICREDIT SPA	2,411.49	2,446.66	7,282	1,176,266	銀行
ENI SPA	3,151.96	3,532.07	5,122	827,339	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	867.92	867.92	996	161,004	銀行
ENEL SPA	10,193.43	12,028.25	7,113	1,148,973	電力
LEONARDO SPA	-	649.15	1,187	191,771	航空宇宙・防衛
SNAM SPA	2,564.15	3,175.18	1,380	222,989	ガス
TELECOM ITALIA SPA	9,082.86	19,705.16	541	87,526	各種電気通信サービス
TERNA SPA	1,660.64	2,076.55	1,530	247,260	電力
RECORDATI SPA	109.08	181.97	918	148,369	医薬品
AMPLIFON SPA	123	202.49	630	101,847	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	307.28	383.43	1,572	253,919	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	24.29	24.29	210	34,046	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	250.14	297.63	1,776	286,996	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	835.76	835.76	614	99,327	金融サービス
FINECOBANK SPA	751.8	963.93	1,245	201,234	銀行
BANCO BPM SPA	-	2,027.27	1,035	167,193	銀行
POSTE ITALIANE SPA	588.89	887.62	883	142,651	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	418.79	418.79	448	72,513	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,297.34 18銘柄	75,451.28 20銘柄	44,022 -	7,110,450 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	352.52	352.52	606	97,992	生活必需品流通・小売り

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	509.56	771.48	1,076	173,830	機械
UPM-KYMMENE OYJ	677.58	779.73	2,211	357,171	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	749.6	959.8	1,034	167,041	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	583.96	709.99	2,879	465,074	保険
FORTUM OYJ	541.94	736.99	803	129,752	電力
NOKIA OYJ	6,795.69	8,270.68	2,687	434,027	通信機器
ELISA OYJ	202.42	202.42	833	134,670	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	505.99	662.48	1,816	293,404	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	438.14	493	2,246	362,791	機械
ORION OYJ	135.59	135.59	537	86,769	医薬品
METSO CORPORATION	—	1,028.31	963	155,695	機械
NORDEA BANK ABP	—	4,924.03	5,288	854,183	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	11,492.99 11銘柄	20,027.02 13銘柄	22,984 —	3,712,404 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	172.58	233.54	935	151,074	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	73.2	106.63	667	107,815	電力
VOEST-ALPINE AG	105.93	180.32	454	73,337	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	456.86	565.74	2,231	360,396	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	808.57 4銘柄	1,086.23 4銘柄	4,288 —	692,622 <0.1%>
(ユーロ…バミューダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON LTD	2,324.33	2,324.33	1,252	202,279	保険
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	2,324.33 1銘柄	2,324.33 1銘柄	1,252 —	202,279 <0.0%>
合 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	1,372,550.07 1,212銘柄	1,726,233.38 1,199銘柄	— —	1,311,536,937 <96.4%>

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

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

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

(2) 外国新株予約権証券

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		
	証 券 数	証 券 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)	証券	証券	千カナダ・ドル	千円	
CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	—	2,968	0	0	
合 計	証 券 数 銘 柄 数 < 比 率 >	— —銘柄	2,968 1銘柄	0 —	0 <0.0%>

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期			比率
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	
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	18.835	24.234	2,746	413,348		0.0
BOSTON PROPERTIES INC	18.531	24.473	1,547	232,835		0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58.993	80.213	1,472	221,628		0.0
PROLOGIS INC	115.173	139.674	18,227	2,743,050		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.932	21.518	3,727	560,896		0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	13.271	16.851	1,581	237,969		0.0
EQUINIX INC	11.399	14.299	11,908	1,792,087		0.1
CROWN CASTLE INC	54.164	65.066	6,883	1,035,970		0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.345	9.893	2,248	338,344		0.0
EQUITY RESIDENTIAL	46.054	54.104	3,173	477,534		0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68.971	90.133	1,519	228,690		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	13.584	16.539	3,457	520,365		0.0
WELLTOWER INC	58.944	77.707	7,255	1,091,880		0.1
KIMCO REALTY	79.991	95.524	1,859	279,889		0.0
IRON MOUNTAIN INC	34.514	43.616	2,946	443,382		0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20.486	27.29	1,806	271,792		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	91.777	110.415	2,144	322,689		0.0
MID AMERICA	13.578	17.537	2,193	330,130		0.0
REALTY INCOME CORP	76.685	129.955	6,678	1,005,030		0.1
REGENCY CENTERS CORP	19.311	21.907	1,318	198,433		0.0
UDR INC	41.516	50.449	1,759	264,735		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	40.894	48.901	6,985	1,051,322		0.1
PUBLIC STORAGE	19.317	23.534	6,600	993,356		0.1
SUN COMMUNITIES INC	14.694	18.509	2,348	353,358		0.0
VENTAS INC	48.092	60.757	2,771	417,026		0.0
WEYERHAEUSER CO	89.893	114.764	3,790	570,455		0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.256	34.18	4,771	718,067		0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	36.258	45.607	6,486	976,181		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	72.327	-	-	-		-
AMERICAN TOWER CORP	58.087	71.26	13,431	2,021,351		0.1
WP CAREY INC	23.664	32.996	1,842	277,227		0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42.371	-	-	-		-
AMERICAN HOMES 4 RENT	42.177	50.995	1,735	261,154		0.0
INVITATION HOMES INC	76.646	96.467	3,118	469,344		0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	30.095	41.252	1,860	280,043		0.0
VICI PROPERTIES INC	120.602	152.711	4,459	671,059		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,612.427	1,923.33	146,658	22,070,635	-
		36銘柄<1.9%>	34銘柄<1.6%>	-	-	1.6
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%
CANADIAN APT PPTYS REIT	8.722	8.722	429	47,770		0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14.424	14.424	265	29,560		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	23.146	23.146	695	77,331	-
		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	432.802	700.332	1,568	153,125	0.0		
GPT GROUP	219.223	349.447	1,551	151,446	0.0		
STOCKLAND	259.328	369.843	1,667	162,812	0.0		
DEXUS	163.989	163.989	1,280	125,014	0.0		
GOODMAN GROUP	214.602	255.895	6,806	664,412	0.0		
VICINITY CENTRES	545.645	545.645	1,113	108,651	0.0		
SCENTRE GROUP	647.197	825.454	2,542	248,163	0.0		
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,482.786 7銘柄<0.1%>	3,210.605 7銘柄<0.1%>	16,531 -	1,613,625 -	- 0.1	
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	262.516	410.116	15,317	294,868	0.0		
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	262.516 1銘柄<0.0%>	410.116 1銘柄<0.0%>	15,317 -	294,868 -	- 0.0	
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	787.231	787.231	1,503	167,878	0.0		
CAPLAND ASCENDAS REIT	440.678	611.078	1,662	185,577	0.0		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474.1	474.1	715	79,929	0.0		
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405.5	405.5	551	61,572	0.0		
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,107.509 4銘柄<0.0%>	2,277.909 4銘柄<0.0%>	4,433 -	494,957 -	- 0.0	
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%	
BRITISH LAND CO PLC	119.111	-	-	-	-	-	
LAND SECURITIES GROUP PLC	77.092	121.345	770	145,763	0.0		
SEGRO PLC	165.081	165.081	1,345	254,448	0.0		
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	361.284 3銘柄<0.0%>	286.426 2銘柄<0.0%>	2,115 -	400,211 -	- 0.0	
(ベルギー)	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
WAREHOUSES DE PAUW	27.206	31.043	786	127,056	0.0		
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	27.206 1銘柄<0.0%>	31.043 1銘柄<0.0%>	786 -	127,056 -	- 0.0	
(フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
GECINA SA	5.045	8.697	832	134,433	0.0		
KLEPIERRE	25.279	36.407	826	133,427	0.0		
COVIVIO	5.066	5.066	209	33,777	0.0		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-	18.477	1,275	205,983	0.0		
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13.535	-	-	-	-	-	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	48.925 4銘柄<0.0%>	68.647 4銘柄<0.0%>	3,142 -	507,622 -	- 0.0	
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	6,925.799 58銘柄<2.2%>	8,231.222 55銘柄<1.9%>	- -	25,586,308 -	- 1.9	

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期		末
			買	建 額	売 建 額
外 国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T			百万円 18,388	百万円 -
	S & P / T S E 6 0 I X F U T			785	-
	S P I 2 0 0 F U T U R E S			475	-
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E			968	-
	D J E U R O S T O X X 5 0			3,381	-

(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

2024年2月15日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 1,311,536,937		% 96.3
投資信託受益証券、投資証券	25,586,308		1.9
コール・ローン等、その他	24,345,898		1.8
投資信託財産総額	1,361,469,144		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、1,360,702,498千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.49円、1カナダ・ドル=111.14円、1オーストラリア・ドル=97.61円、1香港・ドル=19.25円、1シンガポール・ドル=111.65円、1ニュージーランド・ドル=91.65円、1イギリス・ポンド=189.17円、1イスラエル・シケル=41.24円、1スイス・フラン=169.93円、1デンマーク・クローネ=21.67円、1ノルウェー・クローネ=14.23円、1スウェーデン・クローナ=14.32円、1ユーロ=161.52円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,361,991,056,310円
一 般 株 式 (評 価 額)	12,858,145,403
株 式 (評 価 額)	1,311,536,937,030
資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	2,108,582,829
資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	23,477,725,872
未 取 入 当 金	979,953,906
未 差 入 委 託 証 拠	1,045,069,259
(B) 負 債	9,984,642,011
未 払 金	1,032,534,417
未 払 金	734,979,417
未 払 金	297,555,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,360,958,521,893
元 本	162,729,949,242
次 期 繰 越 損 益	1,198,228,572,651
(D) 受 取 基 準 価 額 (C / D)	162,729,949,242円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	83,633円

(注1) 期首元本額	137,221,085,885円	4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	138,504,634円
追加設定元本額	76,071,759,274円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	931,825,289円
一部解約元本額	50,562,895,917円	9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	126,111,412円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット<DC年金>)	62,279,509円
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,150,221,102円	投資のソムリエ (ターゲット<イヤー2040>)	31,482,383円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,531,018円	投資のソムリエ (ターゲット<イヤー2050>)	19,331,816円
MITO ラップ型ファンド (中立的)	6,233,160円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	137,756,308円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	15,643,534円	投資のソムリエ (ターゲット<イヤー2065>)	4,571,353円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,027,667円	Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	26,922,113円
グローバル8資産ラップファンド (中立的)	19,283,292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)	14,029,309円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	13,461,739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)	14,048,261円
たわらノーロード 先進国株式	57,361,664,964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)	8,775,720円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	57,934,709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)	8,434,278円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,884,066,158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)	236,047円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	916,899,062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)	35,948,901円
たわらノーロード バランス (堅実型)	80,325,474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)	12,462,424円
たわらノーロード バランス (標準型)	756,198,335円	三菱UFJ活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	23,066,359円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,019,417,623円	MSCIコクゾク・イデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	340,464,020円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,335円	DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	34,977,326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)	33,236,783円	DIAM外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家専用)	1,003,831,300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)	203,020,399円	DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	197,607,732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)	238,815,086円	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,138,795,896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)	417,682,501円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	293,977,211円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円	AMOneマルチアセット・インカム戦略 (シリアルヘッジ付) (適格機関投資家限定)	897,249円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	123,405円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	5,291,360円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	13,286,479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)	23,104,484円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,251,865円	リスクコントロール世界8資産(5資産ファンド (FOF 5用)) (適格機関投資家専用)	4,021,219円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	10,682,039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)	19,013,111円
たわらノーロード 全世界株式	1,964,292,693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)	36,934,397円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,042,872,613円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,418,942円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,356,391,099円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,754,286円
Oneグローバルバランス	22,754,981円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	927,720円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >1安定型	135,514,309円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,206円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	746,042,424円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	284,746円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,008,349,921円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	14,185,996円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	81,254,701円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	101,538,091円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	228,321,872円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	190,422,402円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	237,223,346円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	668,030,631円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	17,324,819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)	28,599,230円
マネックス資産設計ファンド (積成型)	656,949,333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)	24,316,972円
マネックス資産設計ファンド エコリユーション	119,023,013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)	162,198,269円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	157,468,415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)	5,202,502円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	184,448,070円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	131,734円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	308,125,677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)	56,771,450円
投資のソムリエ	9,174,564,014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)	4,446,099円
フルスクールコントロール	104,334,373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)	21,030,916円
投資のソムリエ<DC年金>	900,536,286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)	36,765,356円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	173,236,376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)	71,611,164円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	285,154,879円	動的パッケージファンド<DC年金>	13,568,830円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,018,133,616円	コア資産形成ファンド	7,035,145円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,329,950,094円	たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジなし) <ラップ専用>	2,827,749,610円
ワールドアセットバランス (基本コース)	106,137,745円	MHAM外国株式インデックスファンド	131,843,275円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	234,745,869円	たわらノーロード 先進国株式(為替ヘッジあり) <ラップ専用>	1,040,748,063円
投資のソムリエ (ターゲット<イヤー2045>)	57,887,085円	MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	1,579,711,581円
投資のソムリエ (ターゲット<イヤー2055>)	29,635,686円	MHAM外国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	1,932,759,205円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,910,823円	期末元本合計	162,729,949,242円
投資のソムリエ (ターゲット<イヤー2035>)	191,573,092円		

■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	20,832,085,328円	
	受取配当金	20,332,078,276	
	受取利息	132,172,297	
	その他の収益	368,792,120	
	支払利息	△957,365	
(B)	有価証券売買損益	301,808,509,319	
	売却益	366,644,884,225	
	売却損	△64,836,374,906	
(C)	先物取引等取引損益	2,947,135,821	
	取引益	6,012,458,571	
	取引損	△3,065,322,750	
(D)	その他費用	△254,583,222	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	325,333,147,246	
(F)	前期繰越損益金	719,000,490,991	
(G)	解約差損益金	△300,527,369,812	
(H)	追加信託差損益金	454,422,304,226	
(I)	計(E+F+G+H)	1,198,228,572,651	
	次期繰越損益金(I)	1,198,228,572,651	

(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。

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21期 (決算日 2024年2月14日)

(計算期間 2023年2月15日～2024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	騰落率	ポイント	騰落率				
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	百万円 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
21期 (2024年2月14日)	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	—	—	535,043

(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)。

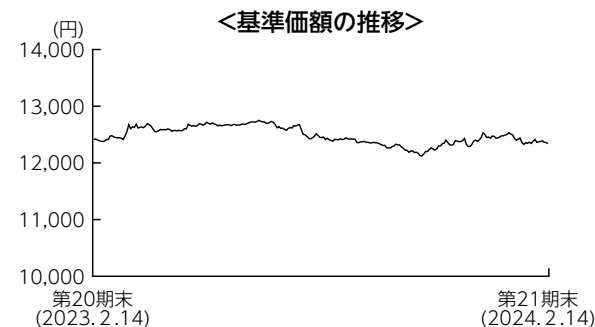
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023年 2月14日	円 12,411	% -	ポイント 367.66	% -	% 99.7	% -	% -
2 月 末	12,476	0.5	369.57	0.5	99.6	-	-
3 月 末	12,649	1.9	374.74	1.9	99.8	-	-
4 月 末	12,680	2.2	375.61	2.2	100.1	-	-
5 月 末	12,668	2.1	375.27	2.1	99.7	-	-
6 月 末	12,700	2.3	376.29	2.3	99.5	-	-
7 月 末	12,505	0.8	370.43	0.8	99.1	-	-
8 月 末	12,415	0.0	367.76	0.0	96.7	-	-
9 月 末	12,326	△0.7	365.13	△0.7	99.5	-	-
10 月 末	12,130	△2.3	359.31	△2.3	99.8	-	-
11 月 末	12,385	△0.2	366.88	△0.2	99.4	-	-
12 月 末	12,436	0.2	368.38	0.2	99.7	-	-
2024年 1 月 末	12,344	△0.5	365.75	△0.5	99.6	-	-
(期 末) 2024年 2月14日	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

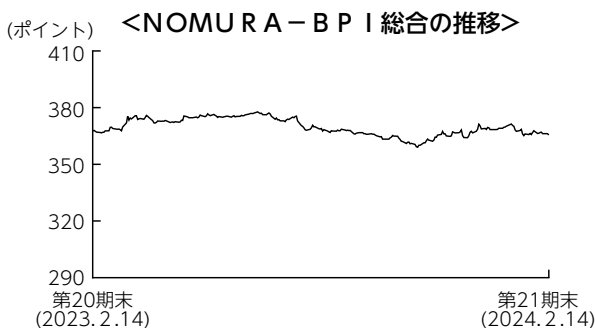


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,339円となり、前期末比で0.6%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2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、基準価額は上昇しました。7月以降は、日銀が金融政策を修正する中で、基準価額は下落基調となりました。11月以降は国内債券に対する堅調な需要を受けて基準価額の上昇が見られましたが、2024年1月から期末にかけては日銀が金融政策を追加修正する可能性が高まっ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2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどをを受けて、利回りは上昇しま

した。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要を受けて利回りは低下しました。2024年1月から期末にかけては日銀のマイナス金利政策解除の観測が高まったことなどから利回りは上昇しました。

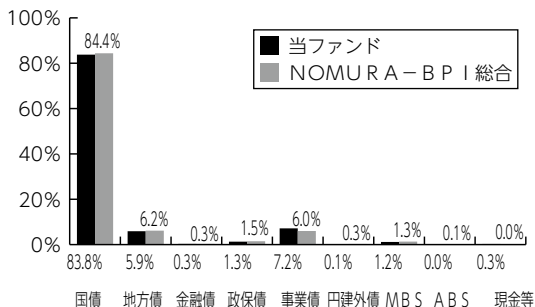
ポートフォリオについて

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。

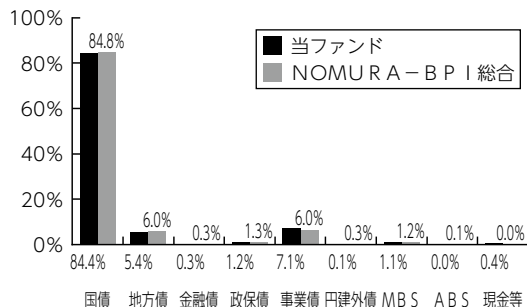
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

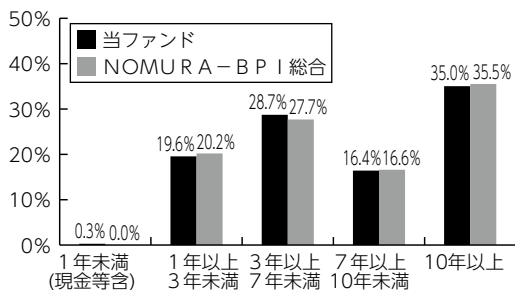


期末

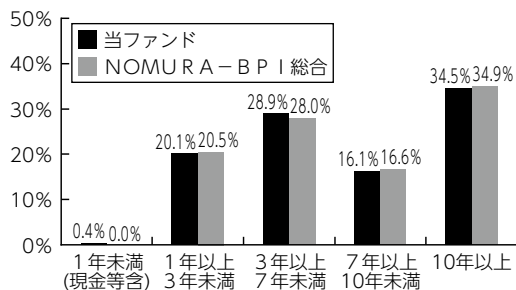


○残存年限別構成比

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0.6%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

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2023年2月15日から2024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	716,806,028	720,895,402 (-)
	地方債証券	-	3,669,163 (-)
	特殊債証券	-	1,030,325 (316,495)
	社債証券	-	1,872,481 (-)

(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 (2023年2月15日から2024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		
	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 716,806	百万円 57,522	% 8.0	百万円 727,467	百万円 67,522	% 9.3

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	464,585,000	451,739,708	84.4	—	52.8	21.6	10.1
地 方 債 証 券	29,139,330	29,000,791	5.4	4.5	3.2	1.7	0.5
特 殊 債 証 券	27,236,846	27,002,386	5.0	—	3.3	1.3	0.5
金 融 債 証 券	1,600,000	1,591,110	0.3	—	—	0.2	0.1
普 通 社 債 証 券	24,520,000	23,641,007	4.4	0.1	2.1	1.8	0.4
合 計	547,081,176	532,975,004	99.6	4.6	61.4	26.7	11.6

(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	
4 4 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,500,000	1,500,075	2025/03/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,700,000	3,704,033	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,230,000	3,244,082	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	184,120	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	71,449	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	40,872	2025/03/20
4 4 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,000,000	999,940	2025/04/01
4 4 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	1,999,620	2025/05/01
4 4 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,800,000	1,799,406	2025/06/01
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,980,000	3,999,462	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	256,255	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	51,318	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	92,493	2025/06/20
4 5 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	12,500,000	12,489,875	2025/08/01
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	7,300,000	7,303,431	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,300,000	3,317,325	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	412,292	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	144,526	2025/09/20
4 5 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,900,000	2,894,548	2025/12/01
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,700,000	4,699,530	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,620,000	3,632,959	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	72,569	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	175,927	2025/12/20

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	
4 5 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	900,000	899,658	2026/01/01
1 4 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,750,000	5,736,200	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,520,000	3,518,521	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	614,355	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	125,454	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	125,204	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,610,000	3,599,855	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,090,000	4,087,586	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	619,966	2026/06/20
8 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,484	2026/06/20
1 4 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,680,000	1,674,556	2026/09/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,570,000	3,567,215	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	495,154	2026/09/20
9 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	116,172	2026/09/20
1 5 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,470,000	1,464,575	2026/12/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,890,000	4,885,110	2026/12/20
9 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,224,565	2026/12/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,900,000	1,891,507	2027/03/20
1 5 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,890,000	1,887,089	2027/03/20
3 4 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,540,000	4,533,008	2027/03/20
9 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	391,115	2027/03/20
9 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	710,293	2027/03/20
1 5 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,210,000	5,179,677	2027/06/20

銘柄	当	期		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,500,000	4,488,030	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	550,000	588,835	2027/06/20
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	127,675	2027/06/20
154回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,400,000	1,394,750	2027/09/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,070,000	4,054,737	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	660,000	707,104	2027/09/20
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	170,848	2027/09/20
155回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	5,700,000	5,715,162	2027/12/20
156回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	4,300,000	4,295,055	2027/12/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,850,000	5,820,984	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	750,000	803,587	2027/12/20
157回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	4,400,000	4,389,308	2028/03/20
158回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,600,000	3,576,672	2028/03/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	6,600,000	6,557,232	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	830,000	895,528	2028/03/20
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	230,000	250,021	2028/03/20
159回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	2,100,000	2,083,326	2028/06/20
160回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	900,000	896,715	2028/06/20
161回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	1,700,000	1,700,714	2028/06/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,400,000	2,380,944	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	500,000	545,590	2028/06/20
103回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	160,000	173,902	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	118,614	2028/06/20
162回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	1,400,000	1,398,726	2028/09/20
163回 利付国庫債券 (5年)	0.4000	3,000,000	3,010,860	2028/09/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,950,000	4,900,648	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	640,000	691,891	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	542,805	2028/09/20
164回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	1,700,000	1,687,437	2028/12/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,690,000	3,646,900	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	600,000	650,166	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	690,000	741,115	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,460,000	2,428,020	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	350,000	377,223	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	478,627	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,130,000	4,072,634	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	460,000	504,629	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	740,000	807,909	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,700,000	2,660,040	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	110,000	124,787	2029/09/20
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,370,000	1,501,136	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,800,000	5,707,142	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	410,000	450,827	2029/12/20
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	397,911	2029/12/20
2回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	111,942	2030/02/20
358回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,150,000	5,059,617	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	530,000	587,589	2030/03/20

銘柄	当	期		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	470,000	518,273	2030/03/20
359回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,050,000	3,971,146	2030/06/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	555,000	610,111	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	470,000	510,857	2030/06/20
360回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,100,000	4,010,661	2030/09/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	640,000	700,774	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	620,473	2030/09/20
4回 利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	232,534	2030/11/20
361回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,500,000	5,366,845	2030/12/20
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	350,000	388,598	2030/12/20
362回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,210,000	4,097,466	2031/03/20
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	671,682	2031/03/20
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	510,000	563,733	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	593,184	2031/03/20
363回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,070,000	4,919,370	2031/06/20
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	370,000	406,974	2031/06/20
364回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,950,000	5,754,780	2031/09/20
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	910,000	995,094	2031/09/20
6回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	227,966	2031/11/20
365回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,430,000	5,236,366	2031/12/20
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	30,000	32,606	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	630,000	689,472	2031/12/20
366回 利付国庫債券 (10年)	0.2000	4,880,000	4,731,208	2032/03/20
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	200,000	219,108	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	130,000	141,415	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	360,000	388,825	2032/03/20
367回 利付国庫債券 (10年)	0.2000	5,700,000	5,510,076	2032/06/20
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	480,000	522,571	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,060,000	1,136,691	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	980,000	1,058,694	2032/06/20
368回 利付国庫債券 (10年)	0.2000	4,750,000	4,577,860	2032/09/20
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	850,000	925,658	2032/09/20
369回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	5,220,000	5,150,208	2032/12/20
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,060,000	1,155,007	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	430,000	472,342	2032/12/20
370回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	4,900,000	4,822,384	2033/03/20
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,230,000	1,329,716	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	750,000	804,367	2033/03/20
371回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	5,200,000	5,058,716	2033/06/20
11回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	250,000	272,517	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,250,000	2,452,657	2033/06/20
372回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	5,300,000	5,338,001	2033/09/20
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	230,000	259,299	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,240,000	2,442,473	2033/09/20
373回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,200,000	1,182,948	2033/12/20
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	150,000	167,725	2033/12/20
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,290,000	1,393,703	2033/12/20

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	
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	393,546	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,730,000	2,922,055	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	303,960	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,290,000	2,450,139	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	280,944	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,930,000	3,103,192	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	313,731	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,160,000	3,279,574	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	461,116	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,529,108	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	323,002	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,740,000	2,866,067	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	388,287	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,020,000	3,121,653	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	357,981	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,280,000	2,301,933	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	341,709	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,280,000	2,140,509	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	412,664	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,580,000	2,353,218	2036/06/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,140,000	2,018,041	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	381,212	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,840,000	1,750,244	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	724,240	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,820,000	1,747,691	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,760,000	1,662,443	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	732,170	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,930,000	1,816,940	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,430,000	2,278,538	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	909,832	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,750,000	2,533,245	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,250,000	2,063,587	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,003,749	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,540,000	1,447,061	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,350,000	2,136,009	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,014,041	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,590,000	1,416,610	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,520,000	1,326,412	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	818,337	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,900,000	1,649,352	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,502,507	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,114,646	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,380,000	1,205,098	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,360,000	2,050,202	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,299,840	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,400,000	2,074,008	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,020,000	1,767,378	2040/12/20

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	
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,355,760	2041/03/20
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,500,000	2,177,675	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,750,000	1,490,195	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,060,000	1,162,088	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,800,000	2,416,932	2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,200,000	1,890,306	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,499,465	2042/03/20
180回 利付国庫債券(20年)	0.8000	2,520,000	2,277,072	2042/03/20
181回 利付国庫債券(20年)	0.9000	1,900,000	1,742,262	2042/06/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,360,000	1,464,638	2042/09/20
182回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,150,000	2,035,319	2042/09/20
183回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,700,000	1,688,661	2042/12/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	850,000	898,509	2043/03/20
184回 利付国庫債券(20年)	1.1000	1,880,000	1,769,700	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,210,000	1,297,144	2043/06/20
185回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,100,000	1,969,632	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,030,000	1,085,002	2043/09/20
186回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,900,000	1,904,313	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,060,000	1,095,764	2043/12/20
187回 利付国庫債券(20年)	1.3000	500,000	482,860	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,000,000	1,032,470	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,410,000	1,453,949	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,163,719	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,150,000	1,141,835	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,870,000	1,853,656	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,340,000	1,349,661	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,720,000	1,667,454	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,300,000	1,257,906	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,150,000	982,985	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,520,000	1,153,011	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,500,000	1,188,690	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,220,000	986,199	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,790,000	1,510,348	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,080,000	908,452	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,040,000	872,092	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,730,000	1,446,193	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	126,511	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,383,377	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,120,000	907,625	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,330,000	1,126,895	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,060,000	852,515	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	330,000	365,445	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	720,000	547,336	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,100,000	810,128	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	952,718	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	948,844	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	596,343	2050/03/20

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	
6 6回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,090,000	791,677	2050/03/20
6 7回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,270,000	971,626	2050/06/20
6 8回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,340,000	1,021,401	2050/09/20
6 9回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,360,000	1,062,323	2050/12/20
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	793,389	2051/03/20
7 0回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,400,000	1,089,788	2051/03/20
7 1回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,480,000	1,148,021	2051/06/20
7 2回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,290,000	997,118	2051/09/20
7 3回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,390,000	1,071,606	2051/12/20
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	710,000	749,781	2052/03/20
7 4回 利付国庫債券 (30年)	1.0000	1,390,000	1,160,872	2052/03/20
7 5回 利付国庫債券 (30年)	1.3000	1,320,000	1,188,316	2052/06/20
7 6回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,320,000	1,215,733	2052/09/20
7 7回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,600,000	1,543,632	2052/12/20
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	940,000	969,976	2053/03/20
7 8回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,800,000	1,653,048	2053/03/20
7 9回 利付国庫債券 (30年)	1.2000	1,600,000	1,396,880	2053/06/20
8 0回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,700,000	1,713,226	2053/09/20
8 1回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	200,000	192,046	2053/12/20
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	880,000	864,503	2054/03/20
8回 利付国庫債券 (40年)	1.4000	990,000	900,286	2055/03/20
9回 利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,890,000	1,252,408	2056/03/20
1 0回 利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,930,000	1,499,783	2057/03/20
1 1回 利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,040,000	775,236	2058/03/20
1 2回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,420,000	938,236	2059/03/20
1 3回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	2,090,000	1,362,889	2060/03/20
1 4回 利付国庫債券 (40年)	0.7000	2,100,000	1,461,096	2061/03/20
1 5回 利付国庫債券 (40年)	1.0000	2,340,000	1,795,271	2062/03/20
1 6回 利付国庫債券 (40年)	1.3000	1,700,000	1,429,513	2063/03/20
小 計	-	464,585,000	451,739,708	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
5回 東京都公募債 20年	2.1100	100,000	102,178	2025/03/19
2 1 3回 神奈川県公募債	0.5340	100,000	100,461	2025/03/19
1 4 4回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	401,568	2025/03/25
1 4 6回 共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	603,186	2025/05/23
2 7年度 4回 千葉県公募債	0.6020	200,000	201,294	2025/07/25
1 4 8回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	502,880	2025/07/25
7回 東京都公募債 20年	2.1600	100,000	103,173	2025/09/19
1回 静岡県公募債 20年	2.1800	100,000	103,196	2025/09/19
1 5 0回 共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	301,635	2025/09/25
27年度 1 5回 愛知県公募債 10年	0.4710	100,000	100,483	2025/11/27
1 5 3回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	100,479	2025/12/25
2 7年度 9回 千葉県公募債	0.0950	100,000	99,716	2026/03/25
1 5 7回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,607	2026/04/24
9回 東京都公募債 20年	2.4400	200,000	210,298	2026/06/19
1 5 9回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,224	2026/06/25
1 6 0回 共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	497,755	2026/07/24

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	
1回 兵庫県公募債 15年	1.6600	200,000	206,898	2026/07/29
2 8年度 6回 北海道公募債	0.0700	100,000	99,557	2026/08/31
7 6 0回 東京都公募債	0.0450	100,000	99,497	2026/09/18
1 0回 東京都公募債 20年	2.3300	300,000	316,152	2026/09/18
4回 京都市公募債 20年	2.5100	100,000	105,820	2026/09/18
4 1 3回 大阪府公募債 10年	0.0210	100,000	99,385	2026/10/28
1 9 0回 大阪府公募債 5年	0.0010	300,000	297,792	2026/12/25
1 6 6回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	498,905	2027/01/25
令和3年度 3回 仙台市公募債 5年	0.0010	300,000	297,768	2027/01/28
2 8年度 8回 福岡県公募債	0.2400	100,000	99,941	2027/02/24
1 6 9回 共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	498,950	2027/04/23
4 1 9回 大阪府公募債 10年	0.1960	100,000	99,713	2027/04/27
2回 静岡県公募債 15年	1.4060	100,000	103,695	2027/06/25
5回 兵庫県公募債 12年	0.6870	100,000	101,282	2027/07/07
1 7 3回 共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,672	2027/08/25
2 9年度 4回 大阪市公募債	0.1500	200,000	198,716	2027/09/21
1 7 4回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,375	2027/09/24
2 4年度 1回 福岡県公募債 15年	1.3290	100,000	103,700	2027/11/29
1 7 8回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,513	2028/01/25
1 7 9回 共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,510	2028/02/25
2 9年度 6回 広島市公募債	0.2300	300,000	298,389	2028/02/25
2 9年度 1 3回 京都府公募債	0.2000	109,330	108,537	2028/03/16
5回 兵庫県公募債 15年	1.3100	300,000	311,415	2028/05/26
7 8 3回 東京都公募債	0.2200	110,000	109,153	2028/06/20
4回 静岡県公募債 15年	1.3380	100,000	104,014	2028/06/23
3 0年度 8回 北海道公募債	0.2490	400,000	396,768	2028/08/31
3 0年度 7回 神戸市公募債 30年	0.2540	300,000	297,681	2028/09/20
第 9 1回 川崎市公募債	0.1850	200,000	197,832	2028/09/20
7回 静岡県公募債 20年	2.3200	300,000	325,803	2028/09/21
3 0年度 3回 広島県公募債	0.2540	100,000	99,224	2028/09/25
3 0年度 3回 堺市公募債	0.1950	100,000	98,742	2028/12/19
2 3 7回 神奈川県公募債	0.1350	200,000	197,008	2028/12/20
2 0回 2号 福岡県公募債	2.0500	100,000	107,617	2028/12/20
6回 大阪市公募債 20年	2.2100	200,000	216,702	2028/12/20
1 7回 横浜市公募債 20年	2.0700	100,000	107,737	2028/12/20
6回 北九州市公募債 20年	2.0300	100,000	107,471	2028/12/20
3 0年度 6回 福岡県公募債	0.2000	200,000	197,622	2028/12/21
1 8 9回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,855	2028/12/25
3 0年度 1 4回 北海道公募債	0.1950	400,000	394,936	2028/12/28
1 8回 東京都公募債 20年	2.2200	100,000	108,736	2029/03/19
3 0年度 1 9回 愛知県公募債	0.1150	200,000	196,408	2029/03/28
3 0年度 3回 岡山県公募債 10年	0.1500	200,000	196,756	2029/03/29
1 9 4回 共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	294,294	2029/05/25
6回 川崎市公募債 20年	2.2100	200,000	217,928	2029/05/25
令和元年度 1回 福岡県公募債	0.0290	200,000	195,300	2029/06/21
9回 兵庫県公募債 15年	1.0200	100,000	102,798	2029/07/13
1 1回 神奈川県公募債 20年	2.0800	100,000	108,530	2029/07/20

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	
196回 共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	488,870	2029/07/25
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	195,152	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	195,262	2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	390,400	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	195,074	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	109,761	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	195,662	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	195,830	2030/01/30
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	110,220	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	97,629	2030/02/25
802回 東京都公募公債	0.1300	400,000	391,140	2030/03/19
511回 名古屋市長公募公債 10年	0.0750	200,000	194,898	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募公債	0.1350	400,000	390,784	2030/04/12
令和2年 2回 大阪府公募公債	0.1310	300,000	292,668	2030/05/22
9回 埼玉県公募公債 20年	2.1500	100,000	110,017	2030/05/24
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	203,708	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	97,296	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募公債	0.1350	100,000	97,228	2030/10/23
36回2年 宮城県公募公債 10年	0.1350	250,000	242,980	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
22年度14回 愛知県公募公債	2.0870	300,000	330,165	2030/12/13
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	220,734	2030/12/17
813回 東京都公募公債	0.1790	300,000	292,077	2030/12/20
16回 神奈川県公募公債 20年	2.0900	300,000	330,453	2031/01/24
464回 大阪府公募公債 10年	0.0720	200,000	192,918	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募公債	0.1450	100,000	96,870	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募公債	0.2140	200,000	194,634	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募公債	0.2140	200,000	194,680	2031/03/19
251回 神奈川県公募公債 10年	0.1990	200,000	194,474	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募公債	0.1400	200,000	193,670	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	0.1900	200,000	194,180	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募公債	0.1750	100,000	96,880	2031/04/25
467回 大阪府公募公債 10年	0.1640	200,000	193,604	2031/04/28
469回 大阪府公募公債 10年	0.1280	200,000	192,658	2031/06/27
11回 北九州市公募公債 20年	2.0190	300,000	329,586	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公募公債	0.1050	200,000	191,810	2031/09/25
472回 大阪府公募公債 10年	0.1000	200,000	191,586	2031/09/29
474回 大阪府公募公債 10年	0.1190	300,000	287,223	2031/11/28
19回 神奈川県公募公債 20年	1.8180	100,000	108,645	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	482,465	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	480,210	2032/03/25
258回 神奈川県公募公債 10年	0.2900	300,000	289,497	2032/06/18
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	1.6350	300,000	321,906	2032/08/16
10回 大阪府公募公債 20年	1.7200	200,000	215,816	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募公債	1.7110	200,000	215,950	2032/12/17
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	102,889	2033/04/15

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	
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	106,953	2033/05/20
1回 東京都公募公債 30年	2.2100	200,000	224,866	2033/06/20
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	318,219	2034/05/08
26年度4回 愛知県公募公債 20年	1.5420	200,000	212,100	2034/05/15
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	105,940	2034/05/26
16回 名古屋市長公募公債 20年	1.5200	100,000	105,842	2034/06/09
5回 群馬県公募公債 20年	1.5290	100,000	105,941	2034/06/16
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	105,799	2034/06/20
31回 東京都公募公債 20年	1.2380	200,000	205,728	2034/09/20
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	101,888	2035/02/16
2回 横浜市公募公債 30年	2.4900	100,000	115,694	2035/03/20
18回 千葉県公募公債 20年	1.1380	100,000	101,490	2035/04/13
17回 名古屋市長公募公債 20年	1.2030	100,000	102,088	2035/05/28
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	101,743	2035/09/28
14回 大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	93,216	2036/09/29
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	91,915	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	117,612	2037/03/19
29年度2回 広島市公募公債	0.6160	200,000	185,874	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	277,719	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	92,618	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募公債	0.7010	200,000	184,544	2038/10/19
2019年度5回 福岡市長公募公債 20年	0.2860	100,000	85,242	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	113,464	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募公債	2.2800	100,000	112,418	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募公債	0.4640	100,000	85,941	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	109,178	2041/09/20
5回 川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	108,991	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	109,203	2042/09/19
14回 東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	107,627	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	147,594	2045/06/20
27年度2回 広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	81,807	2046/03/22
6回 埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	171,040	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公募公債	0.3690	300,000	212,850	2049/06/18
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	0.4320	200,000	144,450	2049/06/18
12回 埼玉県公募公債 30年	0.4740	300,000	217,158	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	151,146	2051/06/20
小 計	-	29,139,330	29,000,791	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
21回 政保中部国際空港債	0.4500	100,000	100,401	2025/03/17
24回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4500	500,000	502,040	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,349	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	409,928	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	100,571	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4400	100,000	100,469	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,706	2025/09/19
85回 中日本高速道路債	0.0700	300,000	298,986	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	100,443	2025/11/20

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	
2 3 回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	103,358	2025/12/19
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	102,881	2025/12/19
F 5 3 8 回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	497,820	2025/12/25
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,648	2026/03/13
3 3 回 政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	298,941	2026/03/16
8 7 回 中日本高速道路債券	0.0600	400,000	397,924	2026/03/18
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	104,754	2026/03/20
2 7 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	298,920	2026/03/31
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,599	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	398,380	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	103,368	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
3 2 5 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	309,873	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,662	2026/12/14
3 0 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	99,707	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	206,076	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	299,007	2027/04/13
3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	797,536	2027/04/30
9 6 回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,990	2027/05/28
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	198,316	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,661	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,939	2027/11/19
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	99,449	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	103,914	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	296,307	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	298,044	2028/02/18
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	99,208	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	206,138	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	214,862	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	102,925	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	327,294	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	328,032	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,900	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	217,514	2029/09/20
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	109,439	2029/12/28
7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	101,254	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,884	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	216,362	2030/10/29
1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	541,375	2030/10/31
1 2 1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	109,893	2031/01/28
9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	192,776	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	383,484	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	108,901	2031/09/19
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	108,696	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	216,450	2031/12/26
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	384,036	2032/04/14

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	
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	107,062	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	107,963	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	107,271	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	214,502	2032/09/28
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	105,383	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	586,595	2033/12/20
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	105,372	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	105,597	2034/04/28
3 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	520,115	2034/09/28
4 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	298,458	2035/01/26
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	306,267	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	100,422	2035/05/18
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	102,214	2035/06/20
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	204,606	2035/06/28
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	103,148	2035/06/29
第 2 6 2 回 政保道路債	1.1090	500,000	504,910	2035/11/30
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,802	2036/06/20
2 8 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,272	2036/08/29
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,194	2037/04/28
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	187,104	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	233,730	2037/09/18
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,332	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	90,651	2038/04/20
F 1 7 4 回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	323,085	2038/05/28
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,457	2038/09/17
5 0 回 高速道路機構債	0.5000	300,000	261,801	2039/03/18
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	249,837	2039/09/28
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	423,105	2040/04/24
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	299,532	2040/07/27
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	105,683	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	39,840	39,922	2041/03/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	262,347	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	14,543	15,049	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	91,485	95,618	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	137,552	142,813	2045/05/10
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	97,988	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	19,385	20,065	2045/07/10
1 回 高速道路機構債	2.9900	300,000	365,850	2045/09/20
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	190,616	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	90,510	2045/12/20
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	93,062	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	16,717	17,291	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	19,533	20,123	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	20,588	21,207	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	176,331	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	25,093	25,777	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	61,990	63,137	2047/09/10

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	
3 6 回 高速道路機構債	2.8400	300,000	357,984	2048/03/20
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	27,869	28,479	2048/09/10
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	34,215	34,555	2049/03/10
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	34,841	35,184	2049/05/10
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	38,462	38,743	2049/07/10
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	39,819	39,807	2049/11/10
3 9 8 回 政保道路債	0.4220	300,000	215,955	2049/12/28
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	45,186	44,313	2050/02/10
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 3 0 年	0.5170	300,000	218,448	2050/04/28
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	50,831	50,142	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	76,186	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	152,808	2050/06/20
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	52,733	52,311	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	148,552	2051/08/31
4 2 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	150,504	2051/10/31
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	199,941	190,849	2051/11/10
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	67,846	65,087	2052/02/10
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	67,335	64,691	2052/03/10
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	67,696	64,966	2052/04/10
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	211,506	201,639	2052/11/10
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	211,575	201,595	2053/01/10
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	144,312	137,350	2053/03/10
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	215,997	205,032	2053/04/10
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	214,077	203,291	2053/05/10
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	373,440	355,589	2053/10/10
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	74,406	70,786	2053/12/10
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	76,806	72,208	2054/03/10
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	248,163	231,548	2055/03/10
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	97,883	2055/03/19
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	330,528	309,275	2055/05/10
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	254,616	238,524	2055/09/10
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	260,364	243,979	2056/05/10
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	794,556	742,520	2056/07/10
4 1 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	135,102	2061/02/28
小 計	-	27,236,846	27,002,386	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第 8 4 3 号 利付商工債	0.1200	100,000	99,735	2025/08/27
3 6 9 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0600	400,000	398,876	2025/08/27
い第 8 5 1 号 利付商工債	0.0900	300,000	298,101	2026/04/27
3 7 7 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0400	300,000	298,296	2026/04/27
い第 8 5 4 号 利付商工債	0.0800	300,000	297,708	2026/07/27
い第 8 5 5 号 利付商工債	0.0800	200,000	198,394	2026/08/27
小 計	-	1,600,000	1,591,110	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
1 0 回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,381	2025/02/28
2 6 回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	100,504	2025/05/21
2 9 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,544	2025/06/11

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	
1 2 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	100,653	2025/06/20
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	307,218	2025/06/20
4 9 7 回 関西電力社債	1.0020	100,000	100,872	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	204,598	2025/06/20
1 2 回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,596	2025/07/09
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	205,810	2025/09/19
2 7 回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,236	2025/12/19
1 4 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,314	2025/12/19
2 6 回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,672	2026/03/18
4 2 回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,504	2026/03/24
9 6 回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,312	2026/04/15
1 6 3 回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	298,002	2026/04/15
2 8 回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	297,675	2026/04/21
4 9 3 回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,446	2026/05/25
1 0 6 回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,866	2026/05/26
2 4 回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,476	2026/06/03
4 0 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,148	2026/06/03
3 5 回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	297,507	2026/06/05
1 1 回 グレディ・アグリコル・エス・エー・興社債 (2016)	0.4000	100,000	99,016	2026/06/10
5 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,523	2026/06/19
7 9 回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	298,149	2026/06/19
8 3 回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,766	2026/06/19
6 1 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,800	2026/06/19
6 9 回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,672	2026/06/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	125,644	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	101,459	2026/06/25
9 0 回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	198,712	2026/07/27
2 0 回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	297,354	2026/07/27
3 回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	296,466	2026/09/04
9 1 回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	496,400	2026/09/17
6 2 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,395	2026/09/18
1 7 回 パナソニック社債	0.4700	100,000	99,897	2026/09/18
2 7 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,732	2026/10/16
4 8 8 回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,574	2026/10/23
3 3 回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	299,535	2026/12/14
3 4 回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	199,972	2026/12/16
1 2 回 リソナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	104,231	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	105,786	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	299,376	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	299,703	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,262	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	298,335	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	106,514	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,996	2027/09/24
2 5 回 フランス相互証券銀行 (BF CM) 円債債 (2017)	0.5100	300,000	295,200	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,148	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	197,394	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	99,222	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	296,820	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,744	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,284	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,098	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	98,784	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	107,938	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	98,027	2029/04/12
1 4 回 プリザーストン社債	0.3750	300,000	294,570	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,704	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	392,104	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	390,344	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	194,654	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	290,241	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	193,470	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	108,359	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	195,508	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	97,017	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	97,265	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	194,260	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	390,836	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	97,185	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	292,026	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	193,402	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	193,926	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	388,756	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,357	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	290,607	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	288,195	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	217,508	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	192,236	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	187,466	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	95,906	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	287,508	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	284,229	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	286,134	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	284,712	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	473,415	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	190,592	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	193,142	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	288,636	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	193,290	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	291,132	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	93,318	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	181,972	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	181,886	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	91,027	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,425	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	90,459	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	177,542	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	89,098	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	181,828	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	88,282	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,864	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,896	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	170,884	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	82,501	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	84,566	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,514	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,008	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	82,981	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	91,760	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	84,283	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	74,850	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	146,124	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	191,754	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	68,471	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	66,718	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	68,042	2060/12/17
小 計	-	24,520,000	23,641,007	-
合 計	-	547,081,176	532,975,004	-

■投資信託財産の構成

2024年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
公 社 債	532,975,004	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,195,447	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	535,170,451	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

(2024年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	535,170,451,990円
一 公 司 債 券 (評価額)	1,146,537,036
一 社 債 (評価額)	532,975,004,601
一 未 払 利 費	851,415,151
(B) 負 債	127,352,000
一 未 払 金	127,352,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	535,043,099,990
一 元 本	433,635,920,893
一 次 期 繰 越 損 益	101,407,179,097
(D) 受 取 権 益 総 額	433,635,920,893円
一 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,393円
(注1) 期首元本額	446,785,885,792円
追加設定元本額	581,209,223,036円
一部解約元本額	594,359,187,935円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	26,445,559,786円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	56,606,049円
M I T O ラップ型ファンド (中立的型)	87,780,257円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	46,315,205円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	777,318,271円
グローバル8資産ラップファンド (中立的型)	271,566,704円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	40,009,486円
たわらノーロード 国内債券	19,198,371,011円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	5,643,042,131円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,562,213,631円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,036,245,918円
たわらノーロード バランス (積極型)	418,452,135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)	192,215,501円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	2,441,981,254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)	2,731,291,553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)	824,901,392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)	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	37,274,547円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	20,761,641円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	193,622,319円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,019,391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国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,288,509,146円
O n e グローバルバランス	99,032,940円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	10,956,808,045円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	16,342,447,363円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	7,495,480,579円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	2,655,296,811円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,757,571,061円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	520,501,398円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	74,055,112円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,816,801,094円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,416,875円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	5,297,839,731円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	2,349,035,825円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	482,650,017円
投資のソムリエ	90,500,056,135円
グルーズコントロール	1,148,797,889円
投資のソムリエ<DC年金>	8,880,659,007円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,325,921,180円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,157,585,678円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,420,751,107円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	34,063,239,343円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	514,904,079円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	264,258,876円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	91,237,587円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,029,090,803円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,536,190,751円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,558,314,912円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,200,480,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	679,094,815円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	280,353,329円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	172,141,111円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,203,233,548円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	40,681,178円
O n e グローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	165,621,139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)	1,183,200,695円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	1,182,101,124円
マルチアセット・インカム戦略ファンド2020-08 (適格機関投資家限定)	1,143,992,121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)	711,889,754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)	1,156,117,973円
インカム重視マルチアセット運用ファンド1 2021-04 (適格機関投資家限定)	3,005,245,833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・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	1,992,568,129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)	1,048,536,393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)	2,040,423,193円
予測モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	1,944,132,777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)	10,164,316,653円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,179,872,920円
投資のソムリエ・私塾 (適格機関投資家限定)	2,899,325,828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)	597,580,172円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	267,019,349円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	2,397,299,626円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家向け)	2,408,636,925円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	2,381,224,582円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	1,953,854,751円
リスコントロール世界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)	38,996,223円
A M O n e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)	465,443,530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)	149,736,384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)	96,780,040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)	21,757,666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)	57,519,512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)	30,515,732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)	383,617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)	2,811,312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)	93,208,060円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,672,002,806円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,146,463,178円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,390,842,814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)	56,186,546円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	133,021,861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)	1,599,270,553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)	102,733,521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)	576,326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)	1,492,236,253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)	29,216,169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)	276,501,966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)	483,425,446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)	784,416,491円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	205,921,080円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	58,717,183円
コアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	213,242,040円
コア資産形成ファンド	109,306,062円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	21,839,360,333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)	24,944,266,426円
M H A M日本債券バッシブファンド (適格機関投資家限定)	18,573,817,425円
M H 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)	117,422,889円
期末元本合計	433,635,920,893円

■損益の状況

当期 自2023年2月15日 至2024年2月14日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益		3,407,110,674円
受	取 利 息		3,409,137,096
支	払 利 息		△2,026,422
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益		△9,054,042,305
売	買 益		4,732,773,783
売	買 損		△13,786,816,088
(C) 当	期 損 益 金(A+B)		△5,646,931,631
(D) 前	期 繰 越 損 益 金		107,728,829,513
(E) 解	約 差 損 益 金		△145,497,077,749
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金		144,822,358,964
(G) 合	計(C+D+E+F)		101,407,179,097
次	期 繰 越 損 益 金(G)		101,407,179,097

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024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	純資産総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
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
21期（2024年2月21日）	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-	260,393

（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）。

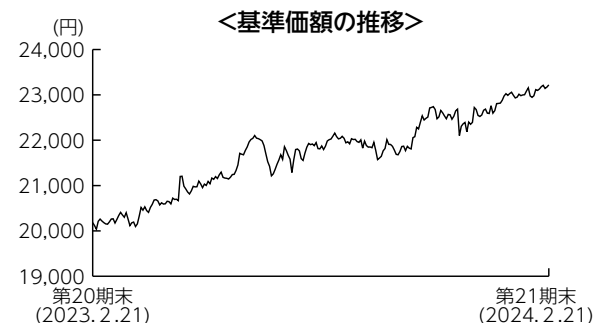
■当期中の基準価額と市況の推移

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 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 2 月 21 日	円 20,182	% -	ポイント 126,494.96	% -	% 99.0	% -
2 月 末	20,261	0.4	126,903.56	0.3	98.9	-
3 月 末	20,517	1.7	128,532.24	1.6	98.7	-
4 月 末	20,668	2.4	129,370.99	2.3	98.6	-
5 月 末	21,198	5.0	132,828.99	5.0	98.8	-
6 月 末	22,045	9.2	138,284.08	9.3	98.7	-
7 月 末	21,569	6.9	135,227.94	6.9	98.7	-
8 月 末	22,157	9.8	138,880.03	9.8	98.9	-
9 月 末	21,834	8.2	136,810.50	8.2	98.6	-
10 月 末	21,807	8.1	136,724.14	8.1	98.7	-
11 月 末	22,569	11.8	141,488.31	11.9	98.5	-
12 月 末	22,596	12.0	141,801.08	12.1	98.5	-
2024 年 1 月 末	22,998	14.0	144,118.59	13.9	99.4	-
(期 末) 2024 年 2 月 21 日	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年2月22日から2024年2月21日まで）

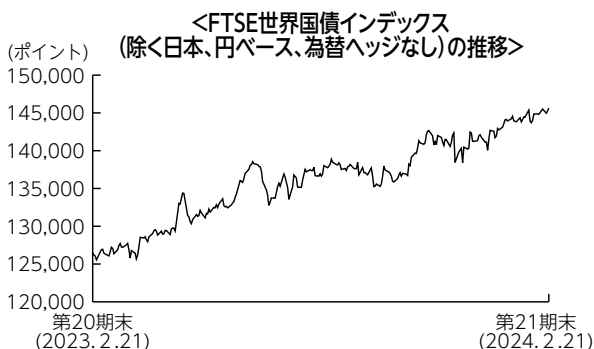


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下（価格は上昇）したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドル／円については日銀が金融緩和を継続する中、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを継続したことを受け、日米金利差が意識され円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから、基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債利回りは上昇、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドイツ債については、金融引き締め長期化観測が高まり上昇したのちに、ユーロ圏の景気懸念やインフレの鈍化などから利回りは低下しました。

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、F R Bが金融引き締めを継続する中、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

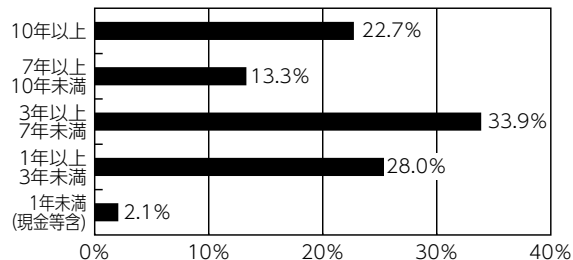
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

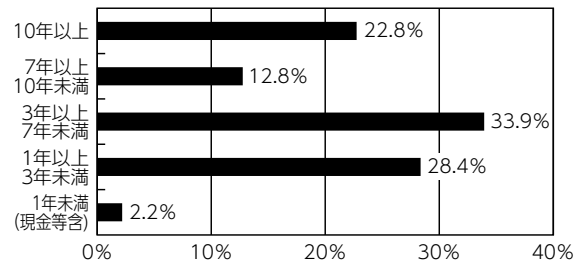
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	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%	-

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	46.7%	47.2%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	48.7%	49.2%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.0%
計	0.8%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.7%	1.8%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.0%	8.1%	△0.1%
ドイツ	6.3%	6.3%	△0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.3%	7.3%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
ユーロ計	31.8%	32.1%	△0.3%
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	5.2%	5.2%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	38.1%	38.5%	△0.4%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.3%	1.4%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	8.3%	8.5%	△0.2%
シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	10.7%	11.0%	△0.3%
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	1.3%	-	-
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15.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークと同程度となり、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

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 (保 管 費 用)	3円	0.015%	(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
(そ の 他)	(3)	(0.014)	
合 計	(0)	(0.001)	
	3	0.015	
期中の平均基準価額は21,728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 (2023年2月22日から2024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 459,048	千アメリカ・ドル 331,987
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 25,463	千カナダ・ドル 17,904
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 16,897	千オーストラリア・ドル 13,157
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 3,224	千シンガポール・ドル 2,464
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 2,597	千ニュージーランド・ドル 989
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 40,138	千イギリス・ポンド 22,621
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シュケル 7,410	千イスラエル・シュケル 3,549
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 11,286	千デンマーク・クローネ 12,347
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 13,227	千ノルウェー・クローネ 10,083
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 9,524	千スウェーデン・クローナ 2,541
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 113,030	千メキシコ・ペソ 81,670
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 730,187	千オフショア・人民元 137,577
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 11,910	千マレーシア・リンギット 7,301
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 16,614	千ポーランド・ズロチ 10,609
国	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	アイルランド	国債証券	3,525	2,887
	オランダ	国債証券	11,284	8,015
	ベルギー	国債証券	12,412	9,503
	フランス	国債証券	70,879	54,149
	ドイツ	国債証券	54,900	40,085
	スペイン	国債証券	40,842	30,090
	イタリア	国債証券	62,054	47,199
	フィンランド	国債証券	3,929	2,451
	オーストリア	国債証券	10,493	7,197

(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 (2023年2月22日から2024年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 916,450	千アメリカ・ドル 810,479	千円 121,701,636	% 46.7	% -	% 19.6	% 19.4	% 7.8	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 50,260	千カナダ・ドル 46,076	千円 5,115,401	2.0	-	1.1	0.5	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,065	千オーストラリア・ドル 35,489	千円 3,492,489	1.3	-	0.9	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,855	千シンガポール・ドル 9,323	千円 1,041,728	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,570	千ニュージーランド・ドル 6,419	千円 594,617	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 86,324	千イギリス・ポンド 70,878	千円 13,437,202	5.2	-	3.5	1.1	0.6	
イスラエル	千イスラエル・シケル 22,320	千イスラエル・シケル 19,889	千円 810,730	0.3	-	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 32,720	千デンマーク・クローネ 30,676	千円 668,129	0.3	-	0.2	0.0	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,620	千ノルウェー・クローネ 29,940	千円 429,040	0.2	-	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 37,140	千スウェーデン・クローナ 35,693	千円 517,914	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 273,005	千メキシコ・ペソ 250,053	千円 2,201,447	0.8	-	0.5	0.3	0.0	
中 国	千オフショア・人民元 1,000,520	千オフショア・人民元 1,032,940	千円 21,528,239	8.3	-	3.7	3.7	0.8	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,060	千マレーシア・リンギット 38,987	千円 1,219,734	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,150	千ポーランド・ズロチ 35,744	千円 1,344,336	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	10,200	9,105	1,478,204	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
オランダ	25,700	23,264	3,776,775	1.5	-	0.8	0.5	0.1	
ベルギー	30,390	27,580	4,477,411	1.7	-	1.2	0.5	0.1	
フランス	141,120	128,977	20,938,250	8.0	-	4.8	2.6	0.6	
ドイツ	108,580	100,614	16,333,748	6.3	-	3.3	2.1	0.8	
スペイン	82,390	77,154	12,525,285	4.8	-	2.7	1.6	0.6	
イタリア	122,640	116,425	18,900,577	7.3	-	4.1	2.5	0.7	
フィンランド	9,630	8,170	1,326,408	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
オーストリア	21,230	18,965	3,078,798	1.2	-	0.6	0.5	0.1	
合 計	-	-	千円 256,938,107	98.7	-	48.9	36.6	13.1	

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

(注2) 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	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	
(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	2,371	356,089	2026/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	5,740	5,288	794,126	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	4,000	600,691	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	725	108,912	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,819	573,587	2028/01/31
US T N/B 4.125 01/31/25	国債証券	4.1250	1,800	1,785	268,146	2025/01/31
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	3,400	3,261	489,813	2030/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	5,700	5,256	789,361	2026/01/31
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,380	2,310	346,875	2028/01/31
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	3,000	2,968	445,728	2027/01/15
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	4,300	4,243	637,175	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,400	2,464	370,083	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,360	1,120	168,216	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,540	1,255	188,501	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,370	973	146,217	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,000	903	135,633	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,860	1,992	299,197	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	500	515	77,347	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,230	1,267	190,255	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,424	213,888	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	4,610	3,530	530,129	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	5,000	3,219	483,415	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	603	90,611	2038/02/15
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	3,800	3,277	492,149	2053/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,690	1,723	258,845	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,636	395,854	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,780	3,405	511,431	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	6,090	5,751	863,678	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,810	2,020	303,350	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,360	1,825	274,185	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,037	306,020	2048/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,981	297,545	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,830	4,477	672,407	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,540	4,283	643,206	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,556	534,113	2027/02/15
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,189	328,837	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,917	287,912	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	9,690	7,896	1,185,695	2031/02/15
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	3,500	3,186	478,547	2043/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	5,100	3,485	523,327	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	4,420	2,712	407,376	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	8,280	6,939	1,041,964	2032/02/15
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	7,900	7,436	1,116,617	2033/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,000	150,171	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,830	4,128	619,966	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	5,210	4,844	727,417	2027/02/28
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,867	430,577	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	4,690	4,143	622,257	2028/02/29

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 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,700	4,196	630,186	2029/02/28	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,766	715,767	2026/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,397	660,307	2025/02/15	
US T N/B 4.0 02/28/30	国債証券	4.0000	3,000	2,955	443,775	2030/02/28	
US T N/B 4.0 02/29/28	国債証券	4.0000	3,200	3,163	474,993	2028/02/29	
US T N/B 4.0 02/15/26	国債証券	4.0000	4,000	3,956	594,070	2026/02/15	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,746	262,297	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,300	3,150	473,093	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	3,200	2,856	428,894	2027/03/31	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,726	409,343	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	4,610	4,084	613,360	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	5,720	5,290	794,463	2026/03/31	
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	4,000	3,655	548,928	2029/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	4,000	3,786	568,508	2027/03/31	
US T N/B 3.625 03/31/30	国債証券	3.6250	3,300	3,183	478,087	2030/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,868	580,908	2025/03/15	
US T N/B 3.625 03/31/28	国債証券	3.6250	3,800	3,703	556,131	2028/03/31	
US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	4.6250	3,630	3,634	545,751	2026/03/15	
US T N/B 3.875 03/31/25	国債証券	3.8750	1,050	1,038	155,949	2025/03/31	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,954	293,521	2025/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	2,060	1,968	295,603	2026/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	5,100	4,508	677,014	2028/04/30	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,100	315,397	2027/04/30	
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,800	3,555	533,875	2029/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	6,000	5,533	830,889	2026/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/28	国債証券	3.5000	3,100	3,005	451,331	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,428	364,723	2025/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	6,000	5,713	857,953	2027/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	3,000	2,873	431,413	2030/04/30	
US T N/B 3.75 04/15/26	国債証券	3.7500	6,000	5,904	886,600	2026/04/15	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,925	439,288	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	839	126,116	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,210	1,197	179,777	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,630	1,601	240,549	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	869	130,615	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	933	140,155	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,790	268,860	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	3,696	555,136	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,201	180,401	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,290	1,011	151,893	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,251	187,879	2047/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,346	502,453	2052/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,730	1,226	184,132	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,224	334,027	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,015	302,659	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,600	3,435	515,839	2049/05/15	
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	3,510	3,029	454,981	2053/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	609	91,556	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	4,420	3,201	480,734	2041/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,823	574,086	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,594	689,924	2028/05/15	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,770	3,439	516,436	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,166	625,673	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	755	810	121,723	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	5,170	4,856	729,232	2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	8,380	4,185	628,531	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,250	2,135	320,676	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	8,740	7,316	1,098,697	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,532	230,147	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,143	472,092	2042/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	800	728	109,316	2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	8,050	7,264	1,090,860	2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	7,500	6,979	1,048,025	2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	2,980	2,632	395,230	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,140	3,652	548,447	2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	7,050	5,653	848,990	2030/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	4,910	4,651	698,405	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,065	460,240	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	5,630	5,177	777,521	2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	2,500	2,435	365,721	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	1,690	1,595	239,555	2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	3,500	3,397	510,121	2030/05/31
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	3,500	3,434	515,746	2026/05/15
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	2,200	2,145	322,144	2025/05/15
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	1,012	152,073	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	2,880	2,715	407,729	2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,448	367,718	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,265	490,340	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,293	494,529	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	4,200	4,057	609,214	2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	4,510	4,152	623,586	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,500	3,329	500,000	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	2,420	2,361	354,536	2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国債証券	4.0000	2,000	1,977	296,906	2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国債証券	4.1250	4,700	4,661	700,031	2026/06/15
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	5,700	5,531	830,535	2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,143	321,828	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,500	2,352	353,183	2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	9,270	8,049	1,208,687	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,304	496,221	2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	2,500	2,459	369,343	2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,563	535,067	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	3,070	2,827	424,508	2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国債証券	4.1250	2,500	2,484	373,061	2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	5,100	4,651	698,507	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,625	544,426	2027/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,124	469,137	2025/07/15
US T N/B 4.5 07/15/26	国債証券	4.5000	4,100	4,102	615,956	2026/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,220	1,105	165,966	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,198	179,897	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,240	957	143,852	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,684	252,930	2044/08/15

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,480	1,492	224,181	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,287	193,397	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,810	3,522	528,927	2051/08/15
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	1,600	1,512	227,173	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,355	203,495	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	3,550	3,411	512,338	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,640	246,263	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	4,140	2,705	406,314	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	5,540	4,220	633,695	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	2,000	1,948	292,647	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,270	1,526	229,150	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,810	2,922	438,881	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,955	593,938	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,030	6,545	982,844	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	5,030	4,742	712,199	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,777	266,844	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,360	2,938	441,214	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,482	372,739	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	5,310	3,510	527,153	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,060	2,456	368,814	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	6,870	3,546	532,522	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	7,840	6,984	1,048,768	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	8,000	7,742	1,162,613	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,960	7,241	1,087,383	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	7,740	6,153	923,979	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	2,800	2,596	389,899	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,354	503,781	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,249	488,017	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,680	402,439	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,950	4,517	678,384	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,960	444,578	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,935	440,838	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,783	568,138	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国債証券	4.3750	4,000	3,991	599,431	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,703	255,861	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,810	3,312	497,388	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国債証券	4.6250	3,000	3,057	459,067	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,444	216,919	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	4,980	4,354	653,898	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,465	520,399	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	3,220	3,197	480,106	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	5,510	5,036	756,246	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,944	442,183	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	4,550	4,459	669,563	2029/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国債証券	4.6250	3,500	3,514	527,756	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	2,270	2,208	331,602	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,410	2,240	336,454	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,134	620,794	2028/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,187	478,590	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	4,490	4,118	618,411	2026/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,700	2,662	399,730	2029/10/31

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 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,340	3,315	497,919	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,714	557,809	2025/10/31
US T N/B 4.625 10/15/26	国債証券	4.6250	3,400	3,415	512,877	2026/10/15
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	4,000	3,972	596,451	2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,350	1,406	211,165	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,200	2,334	350,598	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,960	1,543	231,777	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,300	1,261	189,496	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,197	179,882	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	843	126,592	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,300	195,336	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,652	248,089	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	5,280	2,917	438,077	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	5,370	3,146	472,444	2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	4,860	4,492	674,588	2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	460	359	53,947	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	818	122,902	2046/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	992	149,086	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,450	2,834	425,581	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,690	2,478	372,127	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,120	4,916	738,276	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	5,480	5,213	782,857	2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,830	7,347	1,103,278	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,038	456,239	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,360	3,259	489,371	2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	3,120	2,895	434,789	2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	4,320	2,717	408,105	2040/11/15
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	500	512	76,927	2043/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	2,923	438,985	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,680	252,318	2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	7,600	7,507	1,127,285	2032/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,850	2,497	375,063	2029/11/15
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	2,000	2,033	305,294	2033/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	8,590	6,959	1,044,999	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	9,480	7,624	1,144,902	2030/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,403	511,082	2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	4,700	4,317	648,244	2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	5,000	4,406	661,701	2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	5,190	4,815	723,118	2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,800	2,742	411,825	2029/11/30
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,300	3,248	487,727	2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,559	534,542	2025/11/15
US T N/B 4.625 11/15/26	国債証券	4.6250	3,900	3,919	588,620	2026/11/15
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	3,000	2,894	434,704	2025/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,962	294,640	2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,566	535,578	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,600	4,022	603,948	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	4,000	3,701	555,861	2025/12/31
US T N/B 3.875 12/31/29	国債証券	3.8750	2,800	2,741	411,628	2029/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	4,020	3,497	525,216	2027/12/31
US T N/B 4.375 12/15/26	国債証券	4.3750	4,800	4,796	720,289	2026/12/15

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,093	614,692	2025/12/15
US T N/B 3.875 12/31/27	国債証券	3.8750	4,600	4,527	679,794	2027/12/31
小計	—	—	916,450	810,479	121,701,636	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,150	127,675	2025/02/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	676	75,148	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,306	145,062	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	910	844	93,769	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	1,630	1,619	179,792	2028/03/01
CANADA 3.0 04/01/26	国債証券	3.0000	1,400	1,370	152,122	2026/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,063	118,083	2025/04/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,700	1,608	178,594	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	818	90,862	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	716	79,595	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	630	728	80,894	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	740	790	87,730	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	930	871	96,783	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,283	142,538	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	504	56,015	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	530	498	55,311	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	2,350	2,051	227,786	2030/06/01
CANADA 2.75 06/01/33	国債証券	2.7500	1,180	1,109	123,221	2033/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	238,845	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,590	1,417	157,375	2032/06/01
CANADA 3.5 08/01/25	国債証券	3.5000	400	394	43,835	2025/08/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	2,310	2,180	242,092	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	1,050	1,015	112,775	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	2,670	2,484	275,819	2026/09/01
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	1,200	1,181	131,149	2028/09/01
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	1,660	1,625	180,456	2025/10/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	800	806	89,588	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	850	756	83,977	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	3,460	2,590	287,617	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,180	1,515	168,246	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	339	37,706	2064/12/01
CANADA 2.75 12/01/55	国債証券	2.7500	300	263	29,268	2055/12/01
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	2,100	2,056	228,316	2033/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	2,600	2,132	236,789	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,420	2,089	231,956	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,520	1,403	155,853	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	700	655	72,741	2029/12/01
小計	—	—	50,260	46,076	5,115,401	—
(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	1,090	849	83,589	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	1,100	1,090	107,360	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,540	1,585	156,040	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,600	1,615	158,958	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,400	1,362	134,035	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,660	1,702	167,580	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	830	783	77,150	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,780	1,674	164,777	2028/05/21

銘	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		
(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 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,660	1,529	150,519	2030/05/21		
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	960	762	75,080	2041/05/21		
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	2,130	1,706	167,951	2032/05/21		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,800	1,734	170,694	2034/05/21		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	820	716	70,462	2039/06/21		
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,010	1,689	166,222	2031/06/21		
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	650	563	55,483	2035/06/21		
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	2,520	1,420	139,792	2051/06/21		
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	2,615	2,408	237,000	2026/09/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	450	429	42,287	2028/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,430	1,380	135,820	2027/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,400	1,319	129,819	2029/11/21		
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,670	1,513	148,951	2033/11/21		
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,850	1,527	150,297	2032/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	2,470	1,969	193,799	2031/11/21		
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,460	1,372	135,065	2025/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,670	1,374	135,234	2030/12/21		
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	1,500	1,407	138,513	2034/12/21		
小計	—	—	40,065	35,489	3,492,489	—		
(シンガポール)			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	810	90,501	2027/03/01		
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	460	441	49,339	2046/03/01		
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	840	672	75,082	2050/03/01		
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	660	636	71,104	2042/04/01		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	340	334	37,399	2028/05/01		
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	780	769	85,999	2025/06/01		
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	590	576	64,404	2026/06/01		
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	640	635	70,970	2029/07/01		
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	190	174	19,487	2039/07/01		
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	840	760	84,946	2031/07/01		
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	125	127	14,224	2072/08/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	890	816	91,260	2036/08/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	620	613	68,510	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	580	594	66,424	2033/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	198	22,223	2027/09/01		
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	510	409	45,725	2051/10/01		
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	510	485	54,281	2026/11/01		
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	280	267	29,842	2025/11/01		
小計	—	—	9,855	9,323	1,041,728	—		
(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 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	800	793	73,529	2027/04/15		
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	450	406	37,662	2033/04/14		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	810	635	58,902	2037/04/15		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	670	650	60,235	2025/04/15		
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	750	693	64,206	2029/04/20		
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	540	355	32,892	2051/05/15		
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	247	22,932	2041/05/15		
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	880	706	65,439	2031/05/15		
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	123	11,456	2034/05/15		
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	910	739	68,519	2032/05/15		
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	650	540	50,074	2028/05/15		

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	
(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 0.5 05/15/26		国債証券	0.5000	580	526	48,766	2026/05/15
小計		-	-	7,570	6,419	594,617	-
(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	1,640	1,356	257,233	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国債証券	3.5000	1,550	1,324	251,087	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国債証券	4.0000	900	816	154,822	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国債証券	1.7500	1,130	658	124,799	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国債証券	3.7500	1,650	1,543	292,668	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国債証券	0.8750	1,350	664	125,901	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国債証券	1.1250	2,110	1,354	256,764	2039/01/31
UK TREASURY 4.625 01/31/34		国債証券	4.6250	400	416	78,930	2034/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国債証券	1.0000	2,470	1,970	373,512	2032/01/31
UK TREASURY 3.25 01/31/33		国債証券	3.2500	2,500	2,351	445,707	2033/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国債証券	0.5000	1,880	1,590	301,513	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国債証券	0.1250	1,340	1,152	218,484	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国債証券	0.2500	1,700	1,630	309,123	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国債証券	0.1250	1,750	1,617	306,579	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国債証券	4.1250	2,340	2,334	442,643	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国債証券	5.0000	1,485	1,488	282,244	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国債証券	4.2500	1,300	1,302	246,995	2036/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国債証券	4.2500	1,770	1,804	342,006	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国債証券	0.6250	1,060	1,008	191,181	2025/06/07
UK TREASURY 4.5 06/07/28		国債証券	4.5000	1,750	1,779	337,300	2028/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国債証券	1.5000	1,200	671	127,395	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国債証券	1.2500	1,730	839	159,095	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国債証券	3.7500	970	841	159,613	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国債証券	1.5000	1,210	612	116,163	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国債証券	1.7500	1,260	664	125,977	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国債証券	2.5000	1,250	790	149,810	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国債証券	3.5000	1,480	1,209	229,224	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国債証券	1.5000	1,900	1,785	338,431	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国債証券	1.2500	1,100	1,002	190,046	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国債証券	0.8750	2,100	1,577	299,050	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国債証券	0.2500	2,240	1,707	323,797	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国債証券	0.6250	1,650	1,119	212,208	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国債証券	4.2500	1,060	1,037	196,777	2039/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国債証券	2.0000	1,110	1,069	202,679	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国債証券	4.5000	1,200	1,235	234,298	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国債証券	1.7500	1,890	1,394	264,361	2037/09/07
UK TREASURY 3.75 10/22/53		国債証券	3.7500	1,800	1,553	294,531	2053/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国債証券	1.6250	1,270	659	124,953	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61		国債証券	0.5000	1,880	553	105,010	2061/10/22
UK TREASURY 4.0 10/22/63		国債証券	4.0000	820	741	140,616	2063/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国債証券	1.6250	830	380	72,117	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73		国債証券	1.1250	740	267	50,729	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国債証券	1.2500	1,750	1,062	201,452	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国債証券	0.6250	1,640	653	123,948	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国債証券	1.6250	1,030	929	176,235	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国債証券	0.8750	1,430	1,211	229,594	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国債証券	0.3750	1,390	1,103	209,195	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国債証券	0.3750	2,430	2,199	417,048	2026/10/22

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)						
UK TREASURY 3.5 10/22/25	国債証券	3.5000	千イギリス・ポンド 1,500	千イギリス・ポンド 1,475	千円 279,692	2025/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	980	1,066	202,208	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,380	1,433	271,745	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,745	1,738	329,574	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,280	1,217	230,757	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,112	1,051	199,340	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,310	1,318	249,993	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,770	1,722	326,463	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,495	1,566	297,060	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,317	1,247	236,498	2049/12/07
小計	—	—	86,324	70,878	13,437,202	—
(イスラエル)						
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	千イスラエル・シケル 1,410	千イスラエル・シケル 1,557	千円 63,474	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	1,430	1,340	54,621	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,810	1,561	63,652	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	1,660	1,573	64,133	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,401	97,869	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	2,300	1,845	75,210	2032/04/30
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,819	74,162	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	2,420	1,697	69,175	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,000	1,941	79,122	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	2,360	2,199	89,634	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	1,220	1,294	52,768	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	国債証券	2.8000	960	660	26,904	2052/11/29
小計	—	—	22,320	19,889	810,730	—
(デンマーク)						
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	千デンマーク・クローネ 4,560	千デンマーク・クローネ 2,443	千円 53,218	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,650	9,509	207,116	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	3,740	3,675	80,049	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	4,850	4,516	98,367	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	5,140	4,627	100,786	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	5,080	4,236	92,261	2031/11/15
DENMARK 2.25 11/15/33	国債証券	2.2500	1,700	1,667	36,328	2033/11/15
小計	—	—	32,720	30,676	668,129	—
(ノルウェー)						
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	千ノルウェー・クローネ 6,710	千ノルウェー・クローネ 6,386	千円 91,511	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	5,100	4,792	68,683	2027/02/17
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	1,130	1,099	15,759	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,924	27,576	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	2,030	1,788	25,630	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	4,610	3,978	57,006	2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国債証券	3.0000	2,900	2,715	38,916	2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,920	2,627	37,652	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,950	2,460	35,254	2031/09/17
NORWAY 3.5 10/06/42	国債証券	3.5000	2,200	2,166	31,049	2042/10/06
小計	—	—	32,620	29,940	429,040	—
(スウェーデン)						
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローナ 3,990	千スウェーデン・クローナ 4,443	千円 64,482	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	3,390	3,159	45,848	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	5,920	5,870	85,174	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	4,920	4,191	60,812	2031/05/12

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	
(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 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	4,050	4,004	58,106	2032/06/01	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	8,210	7,852	113,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,960	3,622	52,565	2029/11/12	
SWEDEN 1.75 11/11/33	国債証券	1.7500	2,700	2,548	36,979	2033/11/11	
小計	—	—	37,140	35,693	517,914	—	
(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	36,282	33,436	294,374	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	25,080	22,431	197,487	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	3,680	3,495	30,777	2025/03/06	
MEXICAN BONDS 03/01/29	国債証券	8.5000	9,500	9,173	80,763	2029/03/01	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	24,159	23,435	206,327	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,148	27,780	244,579	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	19,290	17,202	151,446	2033/05/26	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	28,146	26,588	234,081	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	13,290	11,397	100,340	2053/07/31	
MEXICAN BONDS 09/03/26	国債証券	7.0000	8,000	7,502	66,049	2026/09/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,707	21,151	186,219	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	19,561	17,001	149,680	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,631	128,813	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,803	51,092	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	10,035	9,020	79,413	2034/11/23	
小計	—	—	273,005	250,053	2,201,447	—	
(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	15,500	15,832	329,979	2032/02/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	国債証券	2.8800	11,200	11,589	241,546	2033/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	40,500	40,634	846,893	2025/02/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	19,100	21,625	450,709	2050/03/16	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	11,253	234,531	2029/03/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	3.0300	54,000	55,050	1,147,353	2026/03/11	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	2.8000	10,000	10,231	213,231	2030/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	15,820	17,880	372,661	2052/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	7,600	9,140	190,494	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	国債証券	3.1900	8,500	9,524	198,515	2053/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	25,100	25,320	527,716	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	18,500	19,263	401,475	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	9,000	9,195	191,659	2032/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	国債証券	2.6700	14,500	14,741	307,229	2033/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	54,000	55,641	1,159,653	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	国債証券	3.2900	4,000	4,205	87,647	2029/05/23	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	64,600	65,640	1,368,063	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	国債証券	2.3000	39,500	39,609	825,527	2026/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,500	177,163	2025/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	23,500	23,977	499,730	2027/06/04	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	22,000	22,447	467,837	2029/06/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	18,450	18,952	395,004	2026/06/06	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	国債証券	2.6200	10,000	10,119	210,916	2030/06/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	国債証券	3.8600	5,800	7,059	147,125	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	国債証券	2.4000	25,000	25,102	523,181	2028/07/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,567	428,669	2027/07/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	21,000	21,379	445,593	2032/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	20,000	20,016	417,187	2025/08/25	

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 2.69 08/12/26		国債証券	2.6900	60,600	61,382	1,279,310	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27		国債証券	3.5900	5,000	5,262	109,681	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26		国債証券	2.1800	42,000	41,999	875,345	2026/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50		国債証券	3.8100	17,500	21,268	443,269	2050/09/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32		国債証券	2.6000	18,300	18,441	384,348	2032/09/01
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30		国債証券	2.6000	3,000	3,034	63,243	2030/09/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29		国債証券	2.6200	18,000	18,257	380,521	2029/09/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52		国債証券	3.1200	9,500	10,348	215,677	2052/10/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51		国債証券	3.5300	12,450	14,536	302,960	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48		国債証券	4.0800	10,300	12,842	267,651	2048/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28		国債証券	2.9100	29,100	29,934	623,887	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27		国債証券	2.4400	21,000	21,134	440,477	2027/10/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32		国債証券	2.8000	31,300	32,050	667,976	2032/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31		国債証券	2.8900	15,100	15,568	324,466	2031/11/18
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30		国債証券	3.2700	3,000	3,166	65,990	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29		国債証券	3.1300	8,000	8,341	173,843	2029/11/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25		国債証券	2.2800	31,800	31,878	664,392	2025/11/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26		国債証券	2.3900	22,000	22,131	461,263	2026/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30		国債証券	2.5400	3,000	3,021	62,981	2030/12/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29		国債証券	2.7900	24,000	24,550	511,670	2029/12/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27		国債証券	3.2800	18,500	19,287	401,976	2027/12/03
小計		—	—	1,000,520	1,032,940	21,528,239	—
(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	1,000	1,011	31,652	2027/03/15
MALAYSIA 4.457 03/31/53		国債証券	4.4570	2,000	2,077	64,985	2053/03/31
MALAYSIA 4.736 03/15/46		国債証券	4.7360	300	324	10,155	2046/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国債証券	4.3920	1,050	1,070	33,485	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国債証券	4.4980	1,200	1,250	39,132	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国債証券	3.8440	1,660	1,655	51,799	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国債証券	4.7620	1,700	1,835	57,423	2037/04/07
MALAYSIA 2.632 04/15/31		国債証券	2.6320	1,100	1,020	31,914	2031/04/15
MALAYSIA 4.504 04/30/29		国債証券	4.5040	2,950	3,068	96,012	2029/04/30
MALAYSIA 3.502 05/31/27		国債証券	3.5020	650	650	20,346	2027/05/31
MALAYSIA 3.757 05/22/40		国債証券	3.7570	1,500	1,447	45,274	2040/05/22
MALAYSIA 4.254 05/31/35		国債証券	4.2540	1,400	1,437	44,977	2035/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28		国債証券	3.7330	2,000	2,008	62,822	2028/06/15
MALAYSIA 4.232 06/30/31		国債証券	4.2320	670	687	21,501	2031/06/30
MALAYSIA 4.065 06/15/50		国債証券	4.0650	1,700	1,664	52,076	2050/06/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48		国債証券	4.9210	1,990	2,203	68,947	2048/07/06
MALAYSIA 3.906 07/15/26		国債証券	3.9060	1,920	1,942	60,766	2026/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34		国債証券	3.8280	1,820	1,811	56,668	2034/07/05
MALAYSIA 3.582 07/15/32		国債証券	3.5820	1,400	1,372	42,924	2032/07/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29		国債証券	3.8850	700	707	22,148	2029/08/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25		国債証券	3.9550	1,950	1,964	61,467	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43		国債証券	4.9350	1,600	1,767	55,286	2043/09/30
MALAYSIA 4.696 10/15/42		国債証券	4.6960	960	1,035	32,410	2042/10/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26		国債証券	3.9000	1,660	1,679	52,550	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27		国債証券	3.8990	1,730	1,752	54,811	2027/11/16
MALAYSIA 4.642 11/07/33		国債証券	4.6420	1,450	1,540	48,191	2033/11/07
小計		—	—	38,060	38,987	1,219,734	—

銘柄	当期				期末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(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	3,190	3,265	122,805	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,460	3,162	118,954	2028/04/25
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	5,440	4,178	157,143	2032/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	4,170	3,973	149,430	2025/04/25
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	3,650	3,511	132,070	2027/05/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	3,290	3,104	116,759	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	1,590	1,551	58,339	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,175	81,802	2027/07/25
POLAND 7.5 07/25/28	国債証券	7.5000	3,400	3,709	139,526	2028/07/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	2,000	1,767	66,476	2029/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	4,720	3,684	138,558	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,661	62,470	2026/10/25
小計	—	—	39,150	35,744	1,344,336	—
(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	708	115,032	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	660	608	98,854	2031/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	590	602	97,848	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	169	27,533	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	650	472	76,713	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	290	257	41,861	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	960	951	154,412	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	710	664	107,847	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	678	110,182	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,120	1,079	175,166	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	780	678	110,181	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	286	46,572	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	420	389	63,203	2027/05/15
IRISH 3.0 10/18/43	国債証券	3.0000	210	211	34,264	2043/10/18
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	670	550	89,393	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	600	495	80,386	2032/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	350	300	48,749	2030/10/18
小計	—	—	10,200	9,105	1,478,204	—
(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	1,495	242,756	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,710	1,708	277,407	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,430	688	111,827	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	1,090	1,202	195,264	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,320	1,489	241,846	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,310	1,301	211,215	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	990	675	109,626	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,310	929	150,963	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	660	563	91,466	2054/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,030	911	147,947	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,280	1,187	192,795	2027/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	2,180	2,065	335,374	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,820	1,727	280,449	2026/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,480	1,371	222,591	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,460	1,374	223,123	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,360	1,206	195,842	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	596	96,847	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,900	1,577	256,126	2031/07/15

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	国債証券	2.5000	350	346	56,179	2033/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	1,000	844	137,122	2032/07/15
小計	—	—	25,700	23,264	3,776,775	—
(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	1,600	1,776	288,389	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,450	235,491	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,105	179,418	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	930	1,013	164,453	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,570	1,867	303,248	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	1,110	973	158,033	2033/04/22
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	320	304	49,401	2039/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	640	683	110,954	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	920	664	107,920	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	960	686	111,405	2050/06/22
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	1,390	889	144,352	2053/06/22
BELGIUM 3.3 06/22/54	国債証券	3.3000	270	264	43,005	2054/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	304	49,363	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	336	54,614	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	870	366	59,536	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,460	1,401	227,450	2026/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,393	226,228	2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	940	867	140,834	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	930	600	97,519	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,350	1,235	200,622	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	580	584	94,898	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	523	84,915	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,380	1,337	217,178	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,210	1,138	184,787	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	780	641	104,095	2037/06/22
BELGIUM 3.45 06/22/43	国債証券	3.4500	240	245	39,829	2043/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,200	1,022	166,015	2030/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/33	国債証券	3.0000	1,200	1,213	197,039	2033/06/22
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	1,050	861	139,842	2032/06/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	1,040	845	137,314	2031/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	1,080	980	159,248	2027/10/22
小計	—	—	30,390	27,580	4,477,411	—
(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	3,700	3,413	554,081	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	3,530	3,335	541,536	2026/02/25
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	3,780	3,509	569,691	2028/02/25
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	国債証券	2.7500	3,100	3,112	505,345	2029/02/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	1,570	1,515	245,982	2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,850	3,903	633,708	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,690	3,164	513,653	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,728	280,656	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,460	1,673	271,725	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,100	3,518	571,247	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	2,330	2,729	443,077	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,540	2,541	412,649	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,539	249,906	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	3,720	2,568	416,982	2050/05/25

銘柄	当	期				末										
		種	類	利	率		額	面	金	額		償	還	年	月	日
										外	貨					
(ユーロ…フランス)																
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国	債	証	券	%	千	ユ	ー	ロ	千	ユ	ー	ロ	千	円	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国	債	証	券	0.7500	3,470	1,878	305,020								2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国	債	証	券	1.7500	940	636	103,318								2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国	債	証	券	0.5000	790	306	49,798								2072/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国	債	証	券	2.5000	4,650	4,611	748,628								2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国	債	証	券	0.7500	5,090	4,707	764,175								2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国	債	証	券	1.5000	5,780	5,338	866,601								2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国	債	証	券	0.5000	3,430	3,317	538,591								2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国	債	証	券	0.5000	3,590	3,218	522,455								2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国	債	証	券	1.2500	3,560	3,051	495,395								2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国	債	証	券	0.5000	4,960	4,712	765,097								2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国	債	証	券	1.0000	3,560	3,374	547,800								2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国	債	証	券	0.5000	1,950	1,298	210,748								2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国	債	証	券	1.2500	4,080	3,353	544,449								2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国	債	証	券	1.2500	900	708	115,058								2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国	債	証	券	2.5000	1,200	1,073	174,267								2043/05/25
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	国	債	証	券	3.0000	3,000	3,046	494,567								2033/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国	債	証	券	0.0000	2,790	2,232	362,342								2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国	債	証	券	1.7500	2,450	2,055	333,667								2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国	債	証	券	0.5000	1,490	893	145,019								2044/06/25
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	国	債	証	券	2.5000	4,120	4,090	664,120								2026/09/24
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国	債	証	券	6.0000	2,170	2,274	369,268								2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国	債	証	券	2.7500	3,240	3,247	527,129								2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国	債	証	券	4.0000	2,040	2,258	366,661								2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国	債	証	券	5.7500	2,610	3,196	518,890								2032/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国	債	証	券	1.0000	2,740	2,649	430,136								2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国	債	証	券	0.2500	4,020	3,757	609,921								2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国	債	証	券	0.7500	4,600	4,216	684,425								2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国	債	証	券	0.0000	3,670	2,983	484,326								2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国	債	証	券	0.0000	4,280	3,582	581,580								2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国	債	証	券	2.0000	3,850	3,622	588,020								2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国	債	証	券	0.0000	3,590	3,090	501,787								2029/11/25
小計	-	-	-	-	-	141,120	128,977	20,938,250								-
(ユーロ…ドイツ)																
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国	債	証	券	%	千	ユ	ー	ロ	千	ユ	ー	ロ	千	円	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国	債	証	券	5.6250	1,310	1,460	237,126								2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国	債	証	券	6.2500	840	1,017	165,110								2030/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国	債	証	券	5.5000	2,620	3,139	509,635								2031/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国	債	証	券	4.0000	2,030	2,365	383,970								2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国	債	証	券	0.5000	1,650	1,606	260,751								2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/29	国	債	証	券	0.5000	3,860	3,693	599,524								2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国	債	証	券	0.2500	1,430	1,292	209,847								2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国	債	証	券	0.5000	2,120	1,970	319,897								2028/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国	債	証	券	0.2500	2,420	2,264	367,601								2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国	債	証	券	0.0000	2,340	1,999	324,656								2031/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国	債	証	券	2.3000	3,050	3,045	494,359								2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国	債	証	券	0.0000	2,500	2,086	338,727								2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国	債	証	券	0.0000	1,720	1,502	243,849								2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国	債	証	券	2.3000	700	698	113,433								2033/02/15
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国	債	証	券	0.0000	1,590	1,534	249,117								2025/04/11
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	国	債	証	券	2.2000	2,100	2,083	338,203								2028/04/13
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国	債	証	券	0.0000	3,510	3,315	538,291								2026/04/10

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	2,060	1,906	309,455	2027/04/16	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,760	1,344	218,291	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	1,660	1,358	220,475	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,880	1,394	226,448	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	650	731	118,831	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,180	1,292	209,857	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,730	2,097	340,472	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,456	236,518	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,320	2,289	371,653	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,610	2,075	336,902	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,020	2,450	397,834	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,240	2,215	359,662	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	2,540	1,258	204,270	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	1,850	1,571	255,105	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,820	2,164	351,439	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,350	381,540	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,610	2,443	396,671	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	3,590	3,367	546,672	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	2,570	2,344	380,561	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	2,290	2,021	328,216	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	3,140	1,632	264,969	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	2,330	2,222	360,879	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,890	2,443	396,601	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,010	527	85,639	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	3,730	3,223	523,261	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	890	768	124,796	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,100	929	150,960	2031/08/15	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	2,760	2,580	418,939	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	2,650	2,529	410,601	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	2,280	2,191	355,829	2027/10/15	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,050	1,009	163,950	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,350	1,290	209,524	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,481	240,547	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,560	2,295	372,664	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	国債証券	2.4000	300	301	48,942	2030/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	2,000	1,975	320,653	2029/11/15	
小計	-	-	108,580	100,614	16,333,748	-	
(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	1,960	2,238	363,423	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,660	1,792	290,935	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,330	1,288	209,149	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,910	1,755	284,907	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,880	1,678	272,436	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,640	1,548	251,458	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,598	259,500	2025/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,510	1,446	234,837	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,730	1,693	274,938	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,044	331,931	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,500	1,396	226,756	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,850	1,533	248,942	2032/04/30	
SPAIN 3.15 04/30/33	国債証券	3.1500	1,570	1,565	254,101	2033/04/30	

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 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,800	1,553	252,120	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,880	1,527	247,974	2031/04/30
SPAIN 3.5 05/31/29	国債証券	3.5000	500	513	83,408	2029/05/31
SPAIN 2.8 05/31/26	国債証券	2.8000	1,800	1,792	290,984	2026/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	870	835	135,584	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,330	2,488	403,962	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,910	2,202	357,479	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,880	2,135	346,662	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,012	164,419	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,895	1,933	313,918	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,665	270,353	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,965	2,350	381,630	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,870	1,740	282,629	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	740	710	115,353	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,038	330,964	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,940	1,667	270,762	2035/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,600	1,149	186,678	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	348	56,648	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,550	1,443	234,289	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	1,700	1,513	245,744	2029/07/30
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	2,060	2,256	366,374	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,457	236,662	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,300	1,134	184,116	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,560	1,292	209,805	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	1,270	846	137,401	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	660	321	52,136	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,790	963	156,389	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,810	1,784	289,724	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,860	1,768	287,018	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,630	2,521	409,413	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	2,130	1,872	303,968	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	2,140	1,769	287,305	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,644	266,943	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,810	1,261	204,801	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	2,450	2,187	355,135	2030/10/31
SPAIN 3.55 10/31/33	国債証券	3.5500	1,820	1,867	303,199	2033/10/31
小計	-	-	82,390	77,154	12,525,285	-
(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	1,710	1,603	260,306	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	1,310	1,316	213,707	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,660	3,071	498,627	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,470	1,472	239,117	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	2,540	2,430	394,583	2028/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,528	248,192	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,800	1,566	254,297	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,270	989	160,649	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,690	1,491	242,136	2048/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	400	289	47,000	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	216	35,094	2072/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,110	2,163	351,237	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,290	1,983	322,022	2032/03/01

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 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	1,060	927	150,556	2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	2,120	2,014	327,063	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	2,170	2,183	354,505	2030/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,320	1,005	163,245	2036/03/01	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	818	132,867	2041/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,480	1,026	166,718	2037/03/01	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	545	88,579	2038/03/01	
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	国債証券	4.2000	400	412	66,994	2034/03/01	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,299	210,944	2028/03/15	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	1,160	1,171	190,235	2035/04/30	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	1,110	694	112,713	2045/04/30	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,375	223,276	2030/04/01	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	2,110	1,766	286,838	2031/04/01	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	1,150	1,158	188,072	2028/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	2,020	1,890	306,906	2026/04/01	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,300	1,221	198,368	2027/04/01	
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	国債証券	3.8000	1,500	1,519	246,661	2026/04/15	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,260	2,621	425,553	2031/05/01	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,430	1,397	226,943	2025/05/15	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	1,600	1,685	273,614	2033/05/01	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	2,850	2,753	447,077	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,560	1,524	247,437	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,590	1,544	250,738	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,580	1,282	208,224	2032/06/01	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,169	189,781	2029/06/15	
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	国債証券	3.7000	1,400	1,418	230,276	2030/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,790	1,747	283,749	2026/07/15	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	979	159,002	2028/07/15	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,215	197,396	2025/07/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	2,360	2,591	420,706	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,890	2,063	335,050	2039/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,700	1,639	266,236	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	2,210	2,173	352,882	2029/08/01	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,920	1,554	252,364	2031/08/01	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,156	187,819	2030/08/01	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,318	214,039	2025/08/15	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,850	1,714	278,404	2026/08/01	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,520	1,321	214,555	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,560	1,658	269,197	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,380	1,185	192,407	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	2,180	2,316	376,027	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,650	1,802	292,638	2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,200	863	140,183	2050/09/01	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,120	677	110,034	2051/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,195	194,047	2033/09/01	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	960	632	102,624	2052/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	1,380	1,290	209,522	2049/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,360	1,128	183,161	2036/09/01	
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	国債証券	4.4500	800	816	132,586	2043/09/01	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,556	252,712	2027/09/15	
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	国債証券	3.8500	1,500	1,524	247,503	2026/09/15	

銘柄	当	期				末												
		種	類	利	率		額	面	金	額		償	還	年	月	日		
										外	貨						建	金
(ユーロ…イタリア)				%		千	ユー	ロ		千	ユー	ロ		千	円			
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	国	債	証	券	4.5000		670			684			111,073					2053/10/01
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	国	債	証	券	4.0000	1,400			1,441			234,048						2031/10/30
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国	債	証	券	7.2500	1,250			1,381			224,293						2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国	債	証	券	6.5000	2,010			2,242			363,991						2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国	債	証	券	5.2500	2,640			2,902			471,221						2029/11/01
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国	債	証	券	2.5000	1,550			1,531			248,654						2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国	債	証	券	2.0000	1,660			1,625			263,935						2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国	債	証	券	1.2500	2,180			2,072			336,527						2026/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国	債	証	券	2.8000	1,940			1,902			308,884						2028/12/01
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国	債	証	券	0.9500	1,700			1,400			227,412						2031/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国	債	証	券	1.6500	2,140			1,904			309,105						2030/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国	債	証	券	2.5000	1,340			1,224			198,827						2032/12/01
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国	債	証	券	3.8500	1,700			1,740			282,518						2029/12/15
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国	債	証	券	2.6500	1,720			1,688			274,059						2027/12/01
小計	-	-	-	-	-	122,640			116,425			18,900,577						-
(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	640			298			48,521						2052/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国	債	証	券	0.7500	600			524			85,162						2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国	債	証	券	1.3750	380			276			44,937						2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国	債	証	券	0.5000	460			438			71,143						2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国	債	証	券	1.1250	480			407			66,172						2034/04/15
FINLAND 2.75 04/15/38	国	債	証	券	2.7500	370			356			57,931						2038/04/15
FINLAND 0.5 04/15/43	国	債	証	券	0.5000	380			239			38,880						2043/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国	債	証	券	0.1250	280			199			32,347						2036/04/15
FINLAND 1.375 04/15/27	国	債	証	券	1.3750	210			201			32,734						2027/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国	債	証	券	4.0000	220			222			36,135						2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国	債	証	券	2.7500	320			321			52,181						2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国	債	証	券	2.6250	330			309			50,246						2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国	債	証	券	0.5000	800			711			115,483						2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国	債	証	券	0.8750	810			784			127,336						2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国	債	証	券	0.5000	650			590			95,917						2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国	債	証	券	0.5000	400			370			60,186						2027/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国	債	証	券	0.2500	290			185			30,036						2040/09/15
FINLAND 1.5 09/15/32	国	債	証	券	1.5000	700			632			102,699						2032/09/15
FINLAND 0.125 09/15/31	国	債	証	券	0.1250	700			576			93,646						2031/09/15
FINLAND 0.0 09/15/30	国	債	証	券	0.0000	510			428			69,583						2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/26	国	債	証	券	0.0000	100			93			15,124						2026/09/15
小計	-	-	-	-	-	9,630			8,170			1,326,408						-
(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	310			357			58,062						2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国	債	証	券	1.5000	740			549			89,179						2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国	債	証	券	0.5000	1,520			1,366			221,903						2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国	債	証	券	0.7500	935			867			140,901						2028/02/20
AUSTRIA 2.9 02/20/34	国	債	証	券	2.9000	150			150			24,387						2034/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国	債	証	券	0.0000	1,410			1,165			189,278						2031/02/20
AUSTRIA 2.9 02/20/33	国	債	証	券	2.9000	1,300			1,306			212,033						2033/02/20
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国	債	証	券	0.9000	600			519			84,364						2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国	債	証	券	0.0000	1,180			1,006			163,383						2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国	債	証	券	4.8500	1,210			1,257			204,062						2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国	債	証	券	4.1500	1,010			1,131			183,652						2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国	債	証	券	0.7500	590			344			55,892						2051/03/20

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…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	410	185	30,075	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,340	1,251	203,166	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	870	832	135,183	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	590	464	75,354	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	140	22,859	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	550	552	89,772	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	615	684	111,049	2027/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	460	451	73,309	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	295	47,998	2117/09/20
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,330	1,263	205,073	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	890	864	140,395	2025/10/20
AUSTRIA 3.15 10/20/53	国債証券	3.1500	420	423	68,799	2053/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	840	598	97,092	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	271	44,131	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	620	547	88,955	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	18,478	2086/11/02
小 計	—	—	21,230	18,965	3,078,798	—
合 計	—	—	—	—	256,938,107	—

■投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比	評 価 額	率
公 社 債	千円	%		
	256,938,107	98.3		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,534,468	1.7		
投 資 信 託 財 産 総 額	261,472,575	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、259,685,707千円、99.3%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、2024年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.16円、1カナダ・ドル=111.02円、1オーストラリア・ドル=98.41円、1シンガポール・ドル=111.73円、1ニュージーランド・ドル=92.63円、1イギリス・ポンド=189.58円、1イスラエル・シケル=40.76円、1デンマーク・クローネ=21.78円、1ノルウェー・クローネ=14.33円、1スウェーデン・クローナ=14.51円、1メキシコ・ペソ=8.803円、1オフショア・人民元=20.841円、1マレーシア・リンギット=31.284円、1ポーランド・ズロチ=37.609円、1ユーロ=162.34円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	262,047,572,911円
コ ー ル ・ 公 社 債 (評価額)	2,571,862,881
未 収 入 金 息	256,938,107,694
前 払 収 入 金 用 意	575,027,153
未 払 収 入 金 用 意	1,747,978,124
(B) 負 債	1,654,049,105
未 払 収 入 金	1,628,558,105
未 払 収 入 金	25,491,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	260,393,523,806
元 次 本 金	112,140,675,109
(D) 受 益 権 益 総 額	148,252,848,697
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	112,140,675.109円
	23,220円

(注1) 期首元本額	92,568,430,085円	Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,009,306円
追加設定元本額	57,122,203,209円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
一部解約元本額	37,549,958,225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)	237,386,300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)	238,317,641円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	6,936,625,396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)	95,585,889円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,145,444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)	143,381,639円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,898,297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)	544,565円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	33,055,375円	インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定)	621,159,184円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,463,237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)	543,853,224円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,934,640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)	211,165,647円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,209,559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)	866,888,247円
たわらノーロード 先進国債券	20,317,116,345円	予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	634,044,700円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円	D I AM海替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	4,747,484,094円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,175,860,175円	D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
たわらノーロード バランス (堅実型)	70,372,889円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,512,206,226円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,159,511円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	90,074,981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)	222,937,463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)	17,547,319円	D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	43,680,338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)	1,061,778,662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)	393,718,174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)	1,874,531,468円	D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	322,665,524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)	939,477,666円	D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	208,816,275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)	721,685,160円	D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,704,671円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,181,174円	D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	20,619,600円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	12,367,147円	D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,524,169円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	192,544,517円	D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,265円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	20,620,422円	D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,512,264円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	38,634,144円	D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	33,413,721円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,881,458,772円	D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,252,683,690円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,443,766,551円	D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,244,567,605円
Oneグローバルバランス	60,758,637円	D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,359,122,210円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	50,385,127円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	100,205,864円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円	D I AM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)	1,142,198,851円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円	D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	202,876,714円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	155,039円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	822,838,550円	D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	199,846,920円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	23,358,394円	D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	259,826,276円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	887,363,869円	D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	336,700,092円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	15,215,627円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,520,121円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159,329,380円	動的パッケージファンド<DC年金>	48,713,270円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	160,868,965円	コア資産形成ファンド	24,325,247円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	260,318,009円	たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,593,798,610円
クルーズコントロール	1,073,014,665円	たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	12,277,305,584円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円	MH AM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,666,776,191円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	854,009,676円	MH AM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,479,083円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円	期末元本合計	112,140,675,109円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円		
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	488,705,414円		
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,190,355円		

■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,766,181,304	円
	受取利息	5,766,646,977	
	その他の収益	5,079	
	支払利息	△470,752	
(B)	有価証券売買損益	26,829,583,002	
	売却益	30,605,561,933	
	売却損	△3,775,978,931	
(C)	その他の費用	△34,657,163	
(D)	当期損益金(A+B+C)	32,561,107,143	
(E)	前期繰越損益金	94,253,940,578	
(F)	解約差損益金	△43,521,353,795	
(G)	追加信託差損益金	64,959,154,771	
(H)	計(D+E+F+G)	148,252,848,697	
	次期繰越損益金(H)	148,252,848,697	

(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。

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2024年6月6日）

（計算期間 2023年6月7日～2024年6月6日）

J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証R E I T指数		投資証券比率	不動産投信先物指数率	純資産総額
	期中騰落率	期中騰落率	(配当込み)ベンチマーク	期中騰落率			
14期 (2020年6月8日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期 (2020年6月8日)	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
15期 (2021年6月7日)	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531
16期 (2022年6月6日)	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3	199,921
17期 (2023年6月6日)	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2	200,500
18期 (2024年6月6日)	23,008	△2.9	4,307.31	△2.9	97.1	2.8	176,077

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証R E I T指数（配当込み）の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P X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、J P X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J P X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）。

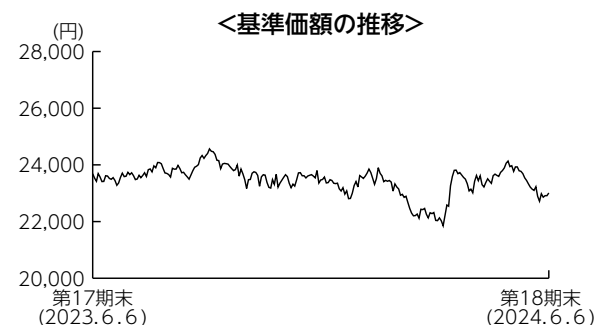
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 率 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 比 率 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 6 月 6 日	円 23,686	% -	ポ イ ン ト 4,437.30	% -	% 97.8	% 2.2
6 月 末	23,600	△0.4	4,421.28	△0.4	97.8	2.1
7 月 末	23,876	0.8	4,472.88	0.8	97.7	2.2
8 月 末	24,229	2.3	4,539.20	2.3	97.2	2.7
9 月 末	23,852	0.7	4,468.30	0.7	97.0	2.9
10 月 末	23,355	△1.4	4,372.14	△1.5	97.1	2.9
11 月 末	23,801	0.5	4,455.46	0.4	97.2	2.7
12 月 末	23,412	△1.2	4,382.85	△1.2	97.1	2.8
2024 年 1 月 末	23,392	△1.2	4,378.56	△1.3	97.1	2.7
2 月 末	22,258	△6.0	4,166.74	△6.1	97.3	2.7
3 月 末	23,557	△0.5	4,410.17	△0.6	97.2	2.7
4 月 末	23,800	0.5	4,455.74	0.4	97.2	2.7
5 月 末	22,980	△3.0	4,302.09	△3.0	97.2	2.7
(期 末) 2024 年 6 月 6 日	23,008	△2.9	4,307.31	△2.9	97.1	2.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2023年6月7日から2024年6月6日まで）

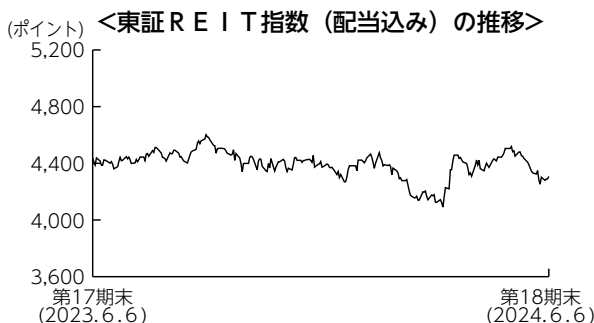


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,008円となり、前期末比で2.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

日銀による金融政策の早期正常化観測などを背景に東証REIT指数（配当込み）が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。



投資環境

リート市場は下落しました。2024年1月半ばまでは日米の金融政策の先行き不透明感から方向感に欠ける展開が続きました。その後、日銀の金融政策正常化への警戒感から下落しましたが、3月の金融政策決定会合においてマイナス金利解除が決まると先行き不透明感が払拭され、加えて金融緩和的な環境が当面続くとの観測から反発しました。期末にかけては、日銀が金融政策の正常化を早めるとの観測が強まり、軟調に推移しました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.9%下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(投資証券)	(0)	(0.001)	
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は23,451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 (2023年6月7日から2024年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
国内	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	1.82	215,974	2.101	248,909
	(-)	(-)	(-)	(-)
サンケイリアルエステート投資法人	2.866	261,292	3.31	299,730
	(-)	(-)	(-)	(-)
S O S I L A物流リート投資法人	4.492	549,146	5.155	627,392
	(-)	(-)	(-)	(-)
東海道リート投資法人	1.678	210,433	1.831	227,205
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本アコモデーションファンド投資法人	3.081	1,929,478	3.559	2,215,658
	(-)	(-)	(-)	(-)
森ヒルズリート投資法人	10.515	1,480,261	12.142	1,693,861
	(-)	(-)	(-)	(-)
産業ファンド投資法人	19.279	2,617,554	16.329	2,225,882
	(-)	(-)	(-)	(-)
アドバンス・レジデンス投資法人	9.196	3,051,767	10.901	3,601,098
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2.89	657,189	16.463	3,519,258
	(-)	(-)	(-)	(-)
アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4.631	1,862,059	5.419	2,171,683
	(-)	(-)	(-)	(-)
G L P投資法人	30.123	4,081,394	35.003	4,676,432
	(-)	(-)	(-)	(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4.602	1,491,072	5.032	1,613,794
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本プロロジスリート投資法人	15.626	4,310,532	17.979	4,878,631
	(-)	(-)	(-)	(-)
星野リゾート・リート投資法人	2.245	1,315,222	1.883	1,119,686
	(-)	(-)	(-)	(-)
Oneリート投資法人	1.557	405,199	1.798	465,279
	(-)	(-)	(-)	(-)
イオンリート投資法人	12.369	1,780,060	12.612	1,799,162
	(-)	(-)	(-)	(-)
ヒューリックリート投資法人	8.359	1,291,991	9.654	1,491,758
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本リート投資法人	2.905	1,005,465	3.355	1,160,649
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
		千□		千円		千□		千円
積水ハウス・リート投資法人		26.852		2,158,993		31.012		2,508,612
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		1.871		259,702		2.371		327,950
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		1.704		491,759		9.75		2,652,150
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		2.207		313,314		2.548		358,481
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		2.657		298,187		2.802		311,461
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		28.903		4,727,220		33.38		5,404,280
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		1.478		162,524		1.707		187,696
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		12.375		1,860,122		13.144		1,950,287
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		18.561		1,062,613		15.279		887,851
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		1.406		177,552		1.594		201,606
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4.074		1,914,082		4.263		1,968,867
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ホテル&レジデンシャル投資法人		1.359		93,573		1.728		116,580
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		14.575		663,663		13.561		620,717
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		3.116		1,189,632		3.561		1,357,297
		(-)		(-)		(-)		(-)
CREロジスティクスファンド投資法人		3.886		622,019		4.445		708,229
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.453		170,595		1.678		195,775
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		5.304		520,584		4.907		485,949
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人		3.959		499,714		4.523		568,458
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		10.424		6,292,531		12.039		7,189,709
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		9.209		5,236,328		10.599		5,957,540
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		42.515		4,137,198		53.819		5,196,002
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		17.806		3,070,729		20.564		3,548,381
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		6.113		2,156,108		7.06		2,474,634
		(-)		(-)		(-)		(-)
NTT都市開発リート投資法人		9.364		1,214,627		9.795		1,268,538
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		5.992		1,054,823		6.921		1,213,089
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		6.638		744,935		7.614		851,266
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	19.993 (-)	3,005,653 (-)	23.089 (-)	3,443,613 (-)
森トラストリート投資法人	18.408 (-)	1,344,609 (-)	19.85 (-)	1,440,247 (-)
インヴィンシブル投資法人	50.923 (-)	3,073,858 (-)	49.476 (-)	3,003,666 (-)
フロンティア不動産投資法人	3.315 (-)	1,492,992 (-)	3.829 (-)	1,722,127 (-)
平和不動産リート投資法人	7.538 (-)	1,063,901 (-)	7.308 (-)	1,026,115 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	5.64 (-)	1,617,816 (-)	7.189 (-)	2,054,307 (-)
福岡リート投資法人	4.616 (-)	762,262 (-)	5.332 (-)	873,951 (-)
KDX不動産投資法人	31.031 (24.335)	7,788,795 (-)	17.614 (-)	3,381,983 (-)
いちごオフィスリート投資法人	7.328 (-)	623,720 (-)	8.462 (-)	720,480 (-)
大和証券オフィス投資法人	1.867 (3.676)	1,200,170 (-)	2.283 (-)	1,361,843 (-)
阪急阪神リート投資法人	4.709 (-)	665,980 (-)	4.905 (-)	686,661 (-)
スターツプロシード投資法人	1.551 (-)	325,486 (-)	1.791 (-)	375,512 (-)
大和ハウスリート投資法人	13.465 (-)	3,557,715 (-)	15.552 (-)	4,085,667 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	31.902 (-)	2,301,345 (-)	34.265 (-)	2,511,266 (-)
大和証券リビング投資法人	14.334 (-)	1,555,762 (-)	14.764 (-)	1,598,601 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	7.704 (-)	989,812 (-)	9.801 (-)	1,265,802 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 20,724	百万円 19,938	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2023年6月7日から2024年6月6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
投 資 証 券	百万円 100,979	百万円 13,310	% 13.2	百万円 112,099	百万円 13,897	% 12.4
不動産投信指数先物取引	20,724	5,118	24.7	19,938	9,265	46.5

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 4,180

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	2,468千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	885千円
(B) / (A)	35.9%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当 期		末	
		□	数	□	数	評 価 額	比 率
不動産ファンド			千□		千□	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人			3.762		3.481	418,068	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			5.929		5.485	467,322	0.3
S O S I L A物流リート投資法人			9.206		8.543	1,002,948	0.6
東海道リート投資法人			3.078		2.925	359,190	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			6.391		5.913	3,843,450	2.2
森ヒルズリート投資法人			21.763		20.136	2,625,734	1.5
産業ファンド投資法人			28.239		31.189	3,907,981	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人			18.505		16.8	5,510,400	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			13.573		—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人			9.771		8.983	3,373,116	1.9
G L P 投資法人			62.397		57.517	7,644,009	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			8.85		8.42	2,723,870	1.5
日本プロロジスリート投資法人			32.182		29.829	7,433,386	4.2
星野リゾート・リート投資法人			3.237		3.599	1,885,876	1.1
One リート投資法人			3.228		2.987	761,386	0.4
イオンリート投資法人			21.247		21.004	2,810,335	1.6
ヒューリックリート投資法人			17.316		16.021	2,351,882	1.3
日本リート投資法人			6.012		5.562	1,888,299	1.1
積水ハウス・リート投資法人			55.614		51.454	4,121,465	2.3
トーセイ・リート投資法人			4.106		3.606	498,349	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			8.046		—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人			4.563		4.222	545,904	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人			4.811		4.666	492,263	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人			59.85		55.373	7,818,667	4.4
いちごホテルリート投資法人			3.066		2.837	313,488	0.2
ラサールロジポート投資法人			22.657		21.888	3,307,276	1.9
スターアジア不動産投資法人			23.108		26.39	1,593,956	0.9
マリモ地方創生リート投資法人			2.827		2.639	342,278	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			7.311		7.122	3,155,046	1.8
日本ホテル&レジデンシャル投資法人			2.987		2.618	195,041	0.1
投資法人みらい			22.485		23.499	1,058,629	0.6
三菱地所物流リート投資法人			6.358		5.913	2,288,331	1.3
C R E ロジスティクスファンド投資法人			7.93		7.371	1,068,795	0.6
ザイマックス・リート投資法人			3.002		2.777	331,851	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			8.724		9.121	902,066	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人			8.067		7.503	907,863	0.5
日本ビルファンド投資法人			21.591		19.976	11,725,912	6.7

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	比 率	
不動産ファンド	千□	千□	千円	%	
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,979	17,589	9,163,869	5.2	
日本都市ファンド投資法人	93,381	82,077	7,444,383	4.2	
オリックス不動産投資法人	36,876	34,118	5,455,468	3.1	
日本プライムリアルティ投資法人	12,657	11,71	3,881,865	2.2	
N T T都市開発リート投資法人	17,791	17.36	2,046,744	1.2	
東急リアル・エステート投資法人	12,409	11.48	1,796,620	1.0	
グローバル・ワン不動産投資法人	13.62	12,644	1,284,630	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人	41.4	38,304	5,431,507	3.1	
森トラストリート投資法人	34,447	33,005	2,323,552	1.3	
インヴィンシブル投資法人	81.46	82,907	5,662,548	3.2	
フロンティア不動産投資法人	6,867	6,353	2,877,909	1.6	
平和不動産リート投資法人	13.04	13.27	1,762,256	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,479	10.93	2,992,634	1.7	
福岡リート投資法人	9,572	8,856	1,416,074	0.8	
K D X不動産投資法人	10,769	48,521	7,399,452	4.2	
いちごオフィスリート投資法人	15,165	14,031	1,149,138	0.7	
大和証券オフィス投資法人	3,834	7,094	1,992,704	1.1	
阪急阪神リート投資法人	8.36	8,164	1,091,526	0.6	
スターツプロシード投資法人	3,208	2,968	606,065	0.3	
大和ハウスリート投資法人	27,898	25,811	6,540,507	3.7	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	59,684	57,321	4,522,626	2.6	
大和証券リビング投資法人	25,646	25,216	2,624,985	1.5	
ジャパンエクセレント投資法人	16,978	14,881	1,827,386	1.0	
合 計	□ 数 ・ 金 額	1,128,309	1,091,979	170,968,898	-
	銘 柄 数 < 比 率 >	60銘柄 < 97.8% >	58銘柄 < 97.1% >	-	97.1

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

(注3) いちごホテルリート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、ザイマックス・リート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、K D X不動産投資法人、インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、スターツプロシード投資法人、トーセイ・リート投資法人、福岡リート投資法人、S O S I L A物流リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、森トラストリート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、投資法人みらい、C R Eロジスティクスファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、O n eリート投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、東海道リート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人(みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント)が運用会社または一般事務受託会社となっています。(当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載)

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	東 証 R E I T	百万円 4,979		百万円 -

■投資信託財産の構成

2024年6月6日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 170,968,898		% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,029,246		3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	177,998,145		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

(2024年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	177,998,145,093円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	4,452,172,984
投 資 証 券(評価額)	170,968,898,350
未 収 入 金	1,077,568,704
未 収 配 当 金	1,319,496,712
差 入 委 託 証 拠 金	180,008,343
(B) 負 債	1,920,896,895
未 払 払 金	226,286,895
未 払 払 解 約 金	1,694,610,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	176,077,248,198
元 本	76,529,156,421
次 期 繰 越 損 益 金	99,548,091,777
(D) 受 益 権 総 口 数	76,529,156,421口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	23,008円

(注1) 期首元本額	84,649,761,469円
追加設定元本額	43,457,370,268円
一部解約元本額	51,577,975,316円
(注2) 期末における元本の内訳	
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	274,804円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,143,704円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	2,907,813円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	3,263,162円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	3,763,743円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	2,003,505円
たわらノーロード 国内リート	5,959,788,163円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,691,467,158円
たわらノーロード バランス (堅実型)	47,220,839円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,082,290,459円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,367,082,467円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	363,532,982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)	1,004,444,746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)	714,849,012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)	854,144,072円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	4,118,390円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	82,954,597円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	14,531,791円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	26,594,772円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,646,122円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	473,314,451円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,539,059円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	152,407,293円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	236,914,240円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	528,218,240円
投資のソムリエ	3,343,920,338円
投資のソムリエ<DC年金>	354,825,931円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,908,401円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	714,661,133円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,188,732,008円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	60,679,736円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	31,642,088円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	6,628,675円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	74,459,869円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	110,119,108円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	134,261,239円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	27,251,818円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	33,832,205円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	20,798,045円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,257,990円
On eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	55,791,387円
Jリートインデックスファンド (DC)	80,982,635円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド (隔月決算型)	14,068,198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)	67,677,043円

マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-04 (適格機関投資家限定)	213,663,893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)	67,645,374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)	89,471,283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)	40,737,084円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル連日本政府保証償活用型) (適格機関投資家限定)	187,394,813円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	81,150,070円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型・シグナルヘッジ付き) 21-03 (適格機関投資家限定)	213,274,938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)	104,578,140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)	172,266,444円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-05 (適格機関投資家限定)	26,270,997円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-07 (適格機関投資家限定)	43,694,307円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-08 (適格機関投資家限定)	30,480,697円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	81,099,581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)	46,826,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-09 (適格機関投資家限定)	30,344,037円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-12 (適格機関投資家限定)	43,911,261円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家限定)	174,653,236円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	124,680,497円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型・シグナルヘッジ付き) 24-04 (適格機関投資家限定)	111,255,376円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2024-05 (適格機関投資家限定)	175,975,490円
D I A M J-R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)	3,087,015,147円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	53,275,042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)	24,607,627円
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	319,808,903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)	111,939,256円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用)	1,961,878円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	112,498,130円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド<DC年金>	7,051,073,596円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド (毎月決算型)	31,672,270,859円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド (年1回決算型)	2,630,987,832円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	5,218,394,727円
期末元本合計	76,529,156,421円

■損益の状況

当期 自2023年6月7日 至2024年6月6日

項	目	当	期
(A)	配当等収当益	8,115,346,474	円
	受取配当金	8,115,874,480	
	受取利息	576,101	
	その他の収益	6	
	支払利息	△1,104,113	
(B)	有価証券売買損益	△13,925,966,692	
	売却益	2,997,248,845	
	売却損	△16,923,215,537	
(C)	先物取引等取引損益	△188,895,920	
	取引益	297,573,890	
	取引損	△486,469,810	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△5,999,516,138	
(E)	前期繰越損益金	115,851,031,341	
(F)	解約差損益金	△69,011,497,158	
(G)	追加信託差損益金	58,708,073,732	
(H)	計(D+E+F+G)	99,548,091,777	
	次期繰越損益金(H)	99,548,091,777	

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

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2024年6月24日）

（対象期間 2023年6月23日～2024年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率	純資産額
	円	期中騰落率	ポイント	期中騰落率			
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	—	百万円 34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	—	78,959
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3	—	56,003
16期(2023年6月22日)	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4	—	81,199
17期(2024年6月24日)	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0	87,881

（注1）不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）S & P 先進国 REIT インデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが委託会社に付与されています。S & P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、委託会社により一定の目的でサブライセンスされています。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

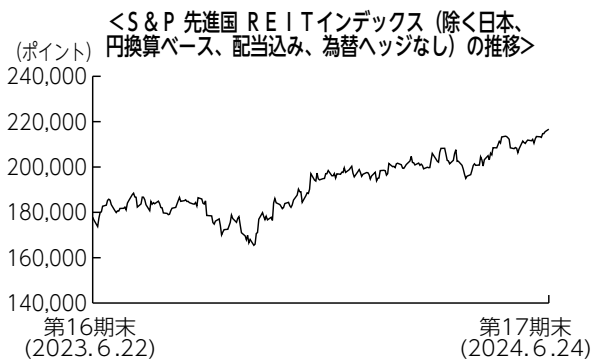
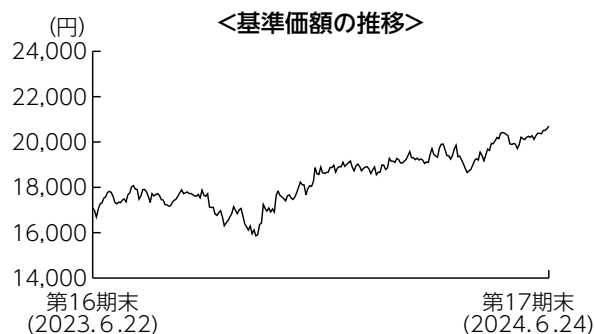
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率		
(期 首) 2023年 6 月22日	円 17,096	% -	ポイント 177,832.19	% -	% 99.4	% -
6 月 末	17,529	2.5	182,685.34	2.7	99.1	-
7 月 末	17,623	3.1	183,725.47	3.3	99.7	-
8 月 末	17,891	4.7	186,587.56	4.9	99.6	-
9 月 末	16,888	△1.2	176,100.67	△1.0	99.1	-
10 月 末	15,911	△6.9	165,961.31	△6.7	99.7	-
11 月 末	17,563	2.7	183,266.40	3.1	99.6	-
12 月 末	18,976	11.0	198,444.21	11.6	99.1	-
2024年 1 月 末	18,816	10.1	196,616.69	10.6	99.6	-
2 月 末	19,149	12.0	200,192.11	12.6	99.5	-
3 月 末	19,901	16.4	208,220.30	17.1	99.2	-
4 月 末	19,554	14.4	204,506.61	15.0	99.4	-
5 月 末	19,877	16.3	207,988.97	17.0	99.3	-
(期 末) 2024年 6 月24日	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は20,700円となり、前期末比で21.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

カナダやシンガポール、香港などのリート市場は下落しマイナスの影響となりました。一方、米国や豪州で浮上した早期利下げ観測や、株高に伴うリスク選好の改善などから、両国のリート市場が上昇したことや、為替市場で全ての指数構成通貨に対し円安となったことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国リート市場はまちまちの結果となりました。前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となり、2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や米欧長期金利上昇への警戒感から下落しました。その後は米国や豪州で早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから両国のリート市場は上昇しましたが、カナダやシンガポール、香港などのリート市場は下落しました。

為替市場では、米ドルは期前半、F R Bの利上げ長期化観測や日銀の金融政策修正観測の後退などから円安米ドル高となりました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年以降は米国の利下げ観測は後退したほか、3月の日銀のマイナス金利解除決定後も日米金利差は残るとの見方などから改めて円安米ドル高が進行しました。ユーロなど他の指数構成通貨に対しても円安となりました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	2円 (0) (0) (2)	0.013% (0.000) (0.002) (0.011)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	4 (0) (4)	0.024 (0.002) (0.022)	(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)	8 (7) (1)	0.046 (0.038) (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	15	0.083	
期中の平均基準価額は18,397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 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

(1) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44.521	4,791	51.491	5,440
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	0.7	130	0.861	161
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	42.103	2,474	47.241	2,780
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	73.871	2,399	78.516	2,541
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	28.657	200	41.562	287
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	29.363	1,710	30.57	1,712
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	3.203	59	3.719	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	17.22	655	19.099	746
	(-)	(-)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	20.917	908	24.191	1,014
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	262.201	29,328	303.138	34,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	40.914	7,276	47.416	8,292
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXP INDUSTRIAL TRUST	60.11	529	72.905	634
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
CAMDEN PROPERTY TRUST	30.337	2,942	35.142	3,339
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	25.854	413	27.396	438
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	26.952	20,491	30.643	22,767
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	49.099	1,892	57.324	2,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	-	-	1.936	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	35.373	732	42.016	852
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	-	-	-	-
	(△14.046)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	37.223	464	46.279	564
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	12.207	221	12.873	215
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18.669	4,210	21.491	4,749
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	101.285	6,084	114.785	6,785
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19.889	1,875	23.003	2,129
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	36.575	1,700	42.101	1,970
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	163.634	2,990	192.551	3,410
	(68.793)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	30.158	571	35.968	667
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.711	485	29.203	582
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	34.114	248	41.344	307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	191.286	16,821	173.196	14,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	13.221	2,224	13.918	2,300
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	181.693	3,331	211.022	3,816
	(22.741)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	33.041	1,051	37.091	1,184
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	12.892	419	14.463	456
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	42.905	89	54.866	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	29.058	114	45.368	192
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
IRON MOUNTAIN INC	84.737	5,378	97.576	6,262
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	52.643	613	61.448	740
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	58.647	3,863	61.535	4,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	32.368	491	34.118	511
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	205.808	3,509	239.71	4,083
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	34.115	4,503	39.173	5,045
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.369	92	22.894	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	8.55	440	10.426	532
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	3.326	192	3.69	213
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.963	39	4.265	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	14.309	406	14.653	402
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	12.409	131	15.407	158
	(△37.596)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	241.687	12,818	238.92	12,253
	(46.343)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	45.789	2,777	52.728	3,167
	(4.873)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	88.351	3,213	104.621	3,730
	(-)	(-)	(-)	(-)
COPT DEFENCE PROPERTIES	25.01	611	29.107	693
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	5.322	193	5.894	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	93.859	11,200	109.206	13,072
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	0.859	113	-	-
	(△38.877)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	45.539	12,126	52.779	13,992
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	36.367	4,250	42.011	4,935
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER INC	30.312	736	32.271	791
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	15.546	224	14.922	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	7.301	93	8.897	108
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.496	58	2.833	107
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	119.656	5,316	135.393	5,812
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	46.64	1,053	53.971	1,220
	(-)	(-)	(-)	(-)
ELME COMMUNITIES	23.129	334	27.066	381
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	56.332	1,197	67.413	1,415
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	59.182	7,298	69.034	8,586
	(34.794)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15.813	38	22.988	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	43.304	416	54.462	522
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	64.136	2,501	73.264	2,856
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	99.952	12,895	99.877	12,501
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	55.669	460	61.361	506
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	120.97	728	144.998	696
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	49.277	627	57.755	720
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	34.935	436	37.953	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	27.099	152	33.126	187
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	-	-	9.459	56
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	30.512	1,761	24.342	1,362
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12.003	240	15.468	306
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	31.451	312	39.557	398
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	75.049	2,057	88.383	2,457
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23.04	311	29.698	397
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	5.225	51	8.382	82
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	55.891	782	65.968	921
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	4.626	47	5.285	58
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	19.816	105	28.132	158
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	49.348	1,722	55.784	1,926
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	63.87	3,683	71.761	4,009
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	19.265	320	22.63	374
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	3.576	51	5.844	79
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	101.71	1,585	118.698	1,748
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18.44	1,707	19.352	1,793
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	16.204	175	20.226	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	29.193	1,053	31.906	1,094
	(△60.818)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	43.806	532	48.563	566
	(△102.067)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	66.598	3,215	68.832	3,276
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	92.827	3,264	103.625	3,574
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	53.26	789	63.653	913
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	5.684	452	6.967	560
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	19.549	284	28.115	407
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	-	-	-	-
	(△63.796)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	163.111	5,371	191.011	6,172
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	-	-	100.1	33
	(-)	(△3)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	23.574	194	34.234	284
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8.418	177	10.3	210
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	51.48	1,217	47.358	1,062
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	77.068	3,550	85.668	3,876
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82.72	1,759	97.129	2,051
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	-	-	-	-
	(31.76)	(△1)	(-)	(-)

	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
POSTAL REALTY TRUST INC	5.632	80	5.703	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	-	-	2.368	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21.094	522	22.303	544
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	15.013	165	22.077	237
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	7.744	37
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	17.614	278	17.012	268
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	44.817	1,016	31.887	698
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEAKSTONE REALTY TRUST	25.787	461	12.15	175
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	-	-	2.103	140
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	30.863	1,050	34.113	1,157
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK HOMES TRUST INC	-	-	1.188	15
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	38.971	1,266	48.023	1,509
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	34.595	514	42.683	618
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAR HOLDINGS	-	-	5.322	75
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	5.848	121	6.978	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	394.3	218	239.1	125
	(-)	(△6)	(-)	(-)
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	26.412	394	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	-	-	-
	(5.763)	(1)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	28.405	128	43.11	192
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17.038	154	16.798	146
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	28.38	451	33.49	522
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20.737	249	23.172	269
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19.339	230	27.887	345
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	163.733	829	64.263	312
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3.317	122	3.621	118
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	15.828	492	24.069	822
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.372	186	6.899	194
	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	61.027	955	65.631	1,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	28.67	240	42.191	355
	(42.743)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	-	-	-	-
	(0.629)	(4)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	49.336	652	60.888	808
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	301.198	8,852	331.053	9,514
	(-)	(-)	(-)	(-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	28.644	652	30.699	687
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	20.529	484	23.651	547
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	25.791	1,179	29.746	1,323
	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	49.618	460	54.877	496
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.659	404	34.075	475
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	40.883	738	47.516	833
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALLIED PROPERTIES REIT	15.152	269	17.905	303
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	-	-	3.363	36
	(△2.585)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.644	663	9.605	658
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4.232	26	6.905	41
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	16.028	209	18.95	242
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19.459	245	24.11	299
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31.25	138	35.58	159
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	-	-	2.22	34
	(-)	(-)	(-)	(-)
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	-	-	4.643	14
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	23.695	304	27.414	342
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.558 (-)	602 (-)	10.2 (-)	703 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	- (△17.707)	- (-)	- (-)	- (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	35.392 (-)	462 (-)	42.996 (-)	544 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	1.955 (-)	33 (-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.913 (-)	165 (-)	14.896 (-)	203 (-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	17.876 (-)	43 (-)
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	5.878 (-)	31 (-)
SLATE GROCERY REIT	10.756 (-)	124 (-)	10.653 (-)	115 (-)
PRIMARIS REIT	13.25 (-)	178 (-)	14.806 (-)	198 (-)
SLATE OFFICE REIT	- (-)	- (-)	17.818 (-)	27 (-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	8.337 (-)	85 (-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.472 (-)	297 (-)	18.761 (-)	315 (-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	171.757 (-)	609 (-)	158.601 (-)	548 (-)
MIRVAC GROUP	1,167.272 (-)	2,476 (-)	1,323.343 (-)	2,806 (-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	206.513 (-)	84 (-)	318.514 (-)	125 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	158.557 (-)	534 (-)	184.015 (-)	606 (-)
GPT GROUP	569.358 (-)	2,289 (-)	647.888 (-)	2,601 (-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	308.93 (-)	449 (-)	270.119 (-)	395 (-)
ABACUS GROUP	174.871 (-)	184 (-)	201.768 (-)	218 (-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	71.254 (-)	188 (-)	94.114 (-)	245 (-)
STOCKLAND	722.285 (-)	2,908 (-)	829.224 (-)	3,360 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	114.527 (-)	494 (-)	119.742 (-)	515 (-)
DEXUS	314.91 (-)	2,289 (-)	352.435 (-)	2,546 (-)
GOODMAN GROUP	502.781 (-)	11,860 (-)	567.649 (-)	13,506 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
VICINITY CENTRES	1,003.623 (-)	1,841 (-)	1,173.558 (-)	2,109 (-)
CHARTER HALL GROUP	136.538 (-)	1,411 (-)	154.812 (-)	1,569 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	84.538 (-)	196 (-)	108.784 (-)	242 (-)
REGION RE LTD	238.016 (-)	520 (-)	286.625 (-)	605 (-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	122.699 (-)	370 (-)	149.701 (-)	458 (-)
ARENA REIT	67.105 (-)	228 (-)	85.07 (-)	285 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	151.636 (-)	516 (-)	185.161 (-)	626 (-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	19.686 (-)	54 (-)	17.711 (-)	48 (-)
NATIONAL STORAGE REIT	296.673 (-)	659 (-)	326.065 (-)	709 (-)
RURAL FUNDS GROUP	94.174 (-)	184 (-)	119.787 (-)	225 (-)
SCENTRE GROUP	1,544.091 (-)	4,175 (-)	1,777.304 (-)	4,775 (-)
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	- (-)	- (-)	140.343 (-)	97 (-)
HMC CAPITAL LTD	64.179 (-)	330 (-)	76.071 (-)	404 (-)
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	538.614 (-)	643 (-)	503.146 (-)	594 (-)
HEALTHCO REIT	75.434 (-)	104 (-)	56.03 (-)	81 (-)
ABACUS STORAGE KING	72.902 (195.539)	78 (-)	44.226 (-)	44 (-)
CENTURIA OFFICE REIT	44.311 (-)	48 (-)	69.257 (-)	80 (-)
WAYPOINT REIT LTD	116.495 (-)	277 (-)	150.326 (-)	350 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	630.5 (-)	24,255 (-)	728.7 (-)	26,800 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	419 (-)	578 (-)	496 (-)	612 (-)
CHAMPION REIT	366 (-)	965 (-)	527 (-)	1,230 (-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71 (-)	127 (-)	77 (-)	146 (-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	277 (-)	1,382 (-)	364 (-)	1,680 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,515.1 (-)	2,845 (△10)	1,699.9 (-)	3,109 (-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,078.6 (-)	2,935 (△21)	1,142.7 (-)	3,029 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	490.3 (-)	578 (△5)	597.5 (-)	686 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,060.7 (-)	1,656 (△46)	1,154.3 (-)	1,782 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	330.7 (-)	164 (-)	415.3 (-)	195 (-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	640.9 (-)	609 (△17)	639.4 (-)	582 (-)
KEPPEL REIT	713.6 (-)	599 (-)	694.3 (-)	592 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	379.1 (-)	818 (-)	387.4 (-)	828 (-)
ESR LOGOS REIT	1,470.2 (-)	427 (△9)	1,976.2 (-)	561 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	158 (-)	155 (△3)	275.3 (-)	274 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	179.7 (-)	148 (△23)	278.4 (-)	225 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (△1)	538.1 (-)	115 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	267.8 (-)	340 (△5)	223.3 (-)	283 (-)
PARKWAY LIFE REIT	121.8 (-)	440 (△5)	131.9 (-)	465 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	563.2 (-)	1,259 (△1)	623.2 (-)	1,379 (-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	592.1 (-)	833 (△11)	673.9 (-)	907 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	184.8 (-)	115 (-)	201.7 (-)	121 (-)
PARAGON REIT	361.8 (-)	313 (-)	368.5 (-)	309 (-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	53.6 (-)	37 (△0.47114)	71.2 (-)	43 (-)
QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	135.2 (-)	44 (△0.70461)	1,174.355 (-)	240 (-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	448.9 (-)	257 (-)	579.5 (-)	312 (-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	80.3 (-)	47 (△5)	307 (-)	164 (-)
KEPPEL DC REIT	319.8 (-)	618 (△10)	376.9 (-)	696 (-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	657.9 (-)	736 (△15)	783.9 (-)	827 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	348.222	420	328.964	382
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	13.547	32	223.11	450
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	202.439	431	246.973	520
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	315.744	267	384.422	321
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	189.174	211	200.554	220
	(-)	(-)	(-)	(-)
STRIDE STAPLED GROUP	30.039	41	263.389	331
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	270.474	895	307.817	1,018
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	35.117	700	39.543	764
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	56.282	598	55.829	551
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	1,244.694	312	1,539.073	383
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	220.397	1,342	255.575	1,536
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	31.106	155	35.891	177
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	144.545	1,345	162.453	1,483
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	233.58	215	298.954	274
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	421.322	3,294	431.267	3,288
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	135.122	556	85.135	334
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	691.22	294	800.762	337
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	-	-	50.234	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	-	-	52.789	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
HELICAL PLC	-	-	5.963	13
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	170.84	113	185.846	120
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	160.763	88	201.78	109
	(△354.973)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	43.415	325	51.935	373
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	376.435	696	396.622	709
	(401.903)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	182.131 (-)	122 (-)	243.237 (-)	165 (-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	549.049 (-)	655 (-)	635.277 (-)	748 (-)
WAREHOUSE REIT PLC	58.167 (-)	48 (-)	60.241 (-)	48 (-)
NEWRIVER REIT PLC	30.491 (-)	26 (-)	64.763 (-)	49 (-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	- (-)	- (-)	293.773 (-)	233 (-)
PRS REIT PLC/THE	141.145 (-)	109 (-)	180.137 (-)	135 (-)
CLS HOLDINGS PLC	- (-)	- (-)	38.026 (-)	45 (-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	178.71 (-)	107 (-)	214.964 (-)	121 (-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	325.039 (-)	246 (-)	381.621 (-)	291 (-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	582.838 (157.608)	831 (-)	662.654 (-)	941 (-)
CUSTODIAN REIT PLC	101.126 (-)	83 (-)	104.931 (-)	86 (-)
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	436.589 (-)	342 (-)	183.813 (-)	141 (-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	131.486 (-)	114 (-)	175.194 (-)	155 (-)
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	- (-)	- (-)	103.977 (-)	71 (-)
LIFE SCIENCE REIT PLC	201.363 (-)	143 (-)	53.766 (-)	34 (-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC-RTS	- (96.861)	- (-)	96.861 (-)	102 (-)
AEW UK REIT PLC	33.925 (-)	29 (-)	62.221 (-)	52 (-)
LXI REIT PLC	366.301 (△730.734)	331 (-)	403.027 (-)	356 (-)
REGIONAL REIT LTD	56.067 (-)	24 (-)	- (-)	- (-)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	98.957 (-)	111 (-)	130.393 (-)	141 (-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	100.219 (-)	84 (-)	115.933 (-)	93 (-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シュケル	千□	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	37.888 (-)	555 (-)	44.537 (-)	652 (-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	57.219 (-)	422 (-)	65.119 (-)	479 (-)
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	39.089 (-)	68 (-)	59.731 (-)	103 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	10.475 (-)	42,625 (-)	49.828 (-)	194,286 (-)
E KOCREF CR-REIT CO LTD	- (-)	- (-)	11.135 (-)	54,863 (-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21.366 (-)	131,851 (-)	24 (-)	151,899 (-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.697 (-)	26,264 (55)	24.051 (-)	100,182 (-)
LOTTE REIT CO LTD	43.393 (-)	133,723 (-)	51.072 (-)	159,436 (-)
KORAMCO LIFE INFRA REIT	10.885 (-)	58,631 (-)	8.873 (-)	45,653 (-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	- (-)	- (-)	9.851 (-)	31,664 (-)
JR REIT XXVII	44.308 (-)	179,948 (-)	45.023 (-)	182,075 (-)
SK REITS CO LTD	16.994 (-)	74,021 (△3,172)	- (-)	- (-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	29.522 (-)	109,361 (△159)	39.496 (-)	147,731 (-)
D&D PLATFORM REIT CO LTD	17.128 (-)	55,171 (△24)	19.888 (-)	64,614 (-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	9.562 (-)	34,844 (△544)	8.876 (-)	30,237 (-)
SK REITS CO LTD-RTS	- (11.9)	- (△16)	11.9 (-)	77 (-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD-RTS	- (7.341)	- (△55)	7.341 (-)	796 (-)
ユーロ (ガーンジー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
SHURGARD SELF STORAGE LTD	14.26 (-)	568 (-)	1.676 (-)	71 (-)
ユーロ (シンガポール)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	95.4 (-)	127 (△16)	128.2 (-)	163 (-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	60.918 (-)	58 (-)	83.346 (-)	78 (-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
VASTNED RETAIL	3.282 (-)	65 (-)	3.903 (-)	75 (-)
WERELDHAVE NV	8.41 (-)	124 (-)	12.56 (-)	175 (-)
NSI NV	2.777 (-)	48 (-)	3.792 (-)	65 (-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10.687 (-)	225 (-)	12.016 (-)	244 (-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COFINIMMO SA	10.952 (-)	703 (-)	9.881 (-)	603 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
RETAIL ESTATES	4.347	252	4.62	266
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3.366	60	15.979	330
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	54.907	1,367	53.483	1,278
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	5.641	396	4.493	312
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	17.307	963	15.759	838
	(-)	(7)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	4.423	53	5.343	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA SA-RTS	-	-	17.659	7
	(17.659)	(△7)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	13.195	360	9.442	256
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	16.193	1,555	19.88	1,884
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	5.38	172	7.293	220
	(-)	(△24)	(-)	(-)
ALTAREA	1.572	123	1.761	137
	(-)	(△0.33328)	(-)	(-)
KLEPIERRE	54.725	1,290	62.745	1,440
	(-)	(△74)	(-)	(-)
COVIVIO	13.935	594	14.422	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	27.097	222	25.38	209
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	11.681	165	15.53	218
	(-)	(△20)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	27.41	1,428	34.451	1,773
	(-)	(△100)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	11.372	72	15.044	94
	(-)	(△12)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	-	-	3.939	15
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	66.154	362	84.623	456
	(-)	(△7)	(-)	(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	11.497	66	18.351	104
	(-)	(△1)	(-)	(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	81.925	694	96.047	794
	(-)	(△30)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買		建		売		建	
	新規買付額	決済額	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	不動産投信指数先物取引	百万円 1,922	百万円 1,032	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		比率
		数	数	外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
不動産ファンド						
(アメリカ)						
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		391.9	291.8	39	6,344	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0	0.0
PRIME US REIT		317.6	349.36	40	6,423	0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		144.6	299.8	178	28,519	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		839	839	55	8,853	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		70.549	63.579	7,410	1,184,833	1.3
ALEXANDER'S INC.		1.021	0.86	188	30,159	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		63.691	58.553	3,601	575,729	0.7
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		104.551	99.906	3,298	527,427	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		65.982	53.077	423	67,633	0.1
AGREE REALTY CORP		41.761	40.554	2,494	398,752	0.5
BRT APARTMENTS CORP		6.159	5.643	101	16,158	0.0
SL GREEN		28.057	26.178	1,444	230,988	0.3
EPR PROPERTIES		33.842	30.568	1,247	199,447	0.2
PROLOGIS INC		414.926	373.989	40,914	6,541,393	7.4
AVALONBAY COMMUNITIES INC		63.859	57.357	11,694	1,869,719	2.1
LXP INDUSTRIAL TRUST		131.103	118.308	1,050	167,965	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		47.839	43.034	4,720	754,766	0.9
VERIS RESIDENTIAL INC		35.212	33.67	487	77,948	0.1
EQUINIX INC		42.028	38.337	29,327	4,688,929	5.3
NNN REIT INC		82.288	74.063	3,126	499,935	0.6
CTO REALTY GROUTH INC		9.356	7.42	126	20,285	0.0
COUSINS PROPERTIES INC		68.071	61.428	1,420	227,162	0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		14.046	-	-	-	-
SITE CENTERS CORP		81.813	72.757	1,043	166,808	0.2
SAFEHOLD INC		17.782	17.116	324	51,856	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		11.922	11.922	9	1,562	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		28.759	25.937	7,216	1,153,724	1.3
EQUITY RESIDENTIAL		152.806	139.306	9,515	1,521,416	1.7
FEDERAL REALTY INVS TRUST		33.218	30.104	3,017	482,506	0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		58.984	53.458	2,526	404,010	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		244.412	284.288	5,469	874,495	1.0
EQUITY COMMONWEALTH		49.039	43.229	837	133,943	0.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC		48.223	42.731	1,109	177,354	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST		76.925	69.695	353	56,494	0.1
WELLTOWER INC		223.439	241.529	24,713	3,951,153	4.5
EAST GROUP		20.032	19.335	3,231	516,614	0.6
KIMCO REALTY		277.027	270.439	5,132	820,653	0.9
KILROY REALTY CORP		47.193	43.143	1,362	217,829	0.2
LTC PROPERTIES INC		18.9	17.329	587	93,922	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		101.192	89.231	233	37,377	0.0

銘	柄	期 首(前期末)	当		期		末
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
(アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
BRANDYWINE REALTY TRUST		81.948	65.638	297	47,643		0.1
IRON MOUNTAIN INC		131.248	118.409	10,521	1,682,229		1.9
THE MACERICH COMPANY		95.956	87.151	1,278	204,407		0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		78.222	75.334	4,846	774,936		0.9
ACADIA REALTY TRUST		44.351	42.601	739	118,171		0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC		318.701	284.799	5,220	834,632		0.9
MID AMERICA		52.249	47.191	6,652	1,063,528		1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST		13.525	—	—	—		—
NATIONAL HEALTH INVS INC		19.429	17.553	1,171	187,325		0.2
CENTERSPACE		6.622	6.258	419	67,125		0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		8.132	5.83	138	22,183		0.0
GETTY REALTY CORP		20.182	19.838	524	83,796		0.1
RPT REALTY		40.594	—	—	—		—
REALTY INCOME CORP		302.637	351.747	18,695	2,989,013		3.4
REGENCY CENTERS CORP		68.717	66.651	4,141	662,173		0.8
UDR INC		138.65	122.38	4,983	796,732		0.9
COPT DEFENCE PROPERTIES		50.428	46.331	1,141	182,444		0.2
SAUL CENTERS INC		5.447	4.875	176	28,261		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		147.007	131.66	19,243	3,076,638		3.5
LIFE STORAGE INC		38.018	—	—	—		—
PUBLIC STORAGE		71.125	63.885	18,593	2,972,765		3.4
SUN COMMUNITIES INC		55.989	50.345	5,916	945,937		1.1
TANGER INC		46.487	44.528	1,182	189,013		0.2
UMH PROPERTIES INC		26.109	26.733	414	66,290		0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		16.72	15.124	209	33,562		0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		6.151	4.814	185	29,678		0.0
VENTAS INC		179.26	163.523	8,244	1,318,183		1.5
VORNADO REALTY TRUST		71.874	64.543	1,665	266,336		0.3
ELME COMMUNITIES		40.732	36.795	555	88,771		0.1
KITE REALTY GROUP TRUST		99.789	88.708	1,944	310,883		0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC		60.583	85.525	13,592	2,173,167		2.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		53.55	46.375	74	11,863		0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		94.114	82.956	840	134,354		0.2
CUBESMART		100.353	91.225	4,130	660,411		0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC		131.006	131.081	19,445	3,109,005		3.5
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		91.448	85.756	715	114,346		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST		266.517	242.489	1,163	186,091		0.2
DOUGLAS EMMETT INC		76.09	67.612	905	144,743		0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C		55.617	52.599	643	102,932		0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC		58.595	52.568	378	60,512		0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		50.883	41.424	241	38,677		0.0
TERRENO REALTY CORP		32.893	39.063	2,264	361,982		0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC		23.022	19.557	421	67,319		0.1
RLJ LODGING TRUST		70.804	62.698	601	96,231		0.1
AMERICOLD REALTY TRUST		121.186	107.852	2,734	437,119		0.5

銘 柄	期 首(前期末)	当 期			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	55.166	48.508	672	107,568	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23.664	23.664	53	8,550	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	22.868	19.711	162	26,030	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	103.588	93.511	1,369	218,875	0.2
WHITESTONE REIT	19.598	18.939	251	40,150	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61.059	52.743	257	41,235	0.0
STAG INDUSTRIAL INC	79.986	73.55	2,608	416,980	0.5
WP CAREY INC	96.284	88.393	4,872	778,970	0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC	33.832	30.467	499	79,788	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15.596	13.328	175	28,085	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	169.898	152.91	2,454	392,378	0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25.104	24.192	2,410	385,311	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	29.672	25.65	281	45,028	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63.531	—	—	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	106.824	—	—	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	90.045	87.811	3,909	625,026	0.7
AMERICAN HOMES 4 RENT	140.789	129.991	4,725	755,460	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	101.147	90.754	1,642	262,626	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	12.848	11.565	1,245	199,194	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	43.096	34.53	506	80,988	0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	63.796	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	260.485	232.585	8,238	1,317,117	1.5
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	62.501	51.841	471	75,341	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17.079	15.197	320	51,315	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	66.693	70.815	1,901	303,993	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	26.881	26.881	92	14,741	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	118.272	109.672	4,866	777,999	0.9
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	136.117	121.708	2,744	438,793	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22.683	22.683	62	9,936	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC	7.309	7.238	95	15,228	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6.752	4.384	67	10,759	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	29.365	28.156	690	110,468	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	23.717	16.653	192	30,831	0.0
CITY OFFICE REIT INC	17.231	17.231	86	13,774	0.0
ORION OFFICE REIT INC	28.112	20.368	69	11,104	0.0
NETSTREIT CORP	28.118	28.72	485	77,600	0.1
CARETRUST REIT INC	44.457	57.387	1,428	228,458	0.3
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	13.637	148	23,699	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	2.103	—	—	—	—
PHILLIPS EDISON & CO INC	52.693	49.443	1,603	256,436	0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1.188	—	—	—	—
APARTMENT INCOME REIT CORP	67.666	58.614	2,285	365,383	0.4
BROADSTONE NET LEASE INC	83.884	75.796	1,192	190,620	0.2
STAR HOLDINGS	5.322	—	—	—	—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	11.835	10.705	239	38,269	0.0

銘 柄	期 首(前期末)		当 期		末	
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	-	26.412	394	63,045	0.1	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	5.763	138	22,177	0.0	
PARAMOUNT GROUP INC	78.702	63.997	287	45,940	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26.422	26.662	234	37,554	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	52.509	47.399	856	136,937	0.2	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	42.482	40.047	487	77,921	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	49.736	41.188	586	93,838	0.1	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING I	-	99.47	284	45,483	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10.016	9.712	361	57,840	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	36.394	28.153	1,189	190,171	0.2	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10.321	9.794	226	36,249	0.0	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	95.647	91.043	1,328	212,371	0.2	
GLOBAL NET LEASE INC	48.468	77.69	553	88,438	0.1	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE	14.638	15.267	74	11,862	0.0	
CLIPPER REALTY INC	5.086	5.086	18	2,894	0.0	
PARK HOTELS & RESORTS INC	96.622	85.07	1,260	201,566	0.2	
VICI PROPERTIES INC	451.537	421.682	11,849	1,894,460	2.2	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	39.634	37.579	921	147,379	0.2	
小 計	□ 数 ・ 金 額	11,681.835	10,964.702	423,772	67,752,784	-
	銘 柄 数<比 率>	145銘柄<77.0%>	139銘柄<77.1%>	-	-	77.1
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円	%	
SMARTCENTRES REIT	31.367	28.245	608	71,084	0.1	
CANADIAN APT PPTYS REIT	37.034	33.079	1,424	166,306	0.2	
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58.204	52.945	457	53,459	0.1	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	46.831	41.415	599	69,953	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66.005	59.372	972	113,521	0.1	
ALLIED PROPERTIES REIT	28.626	25.873	396	46,329	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	8.533	2.585	47	5,552	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.738	9.777	670	78,211	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	24.568	21.895	140	16,382	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INV	24.648	21.726	267	31,193	0.0	
INTERENT REAL ESTATE INVEST	32.303	27.652	326	38,088	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	55.673	51.343	238	27,868	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	8.705	6.485	95	11,203	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT	4.643	-	-	-	-	
DREAM INDUSTRIAL REIT	56.937	53.218	654	76,409	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.423	15.423	48	5,635	0.0	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	13.984	12.342	816	95,272	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21.434	3.727	30	3,606	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	72.055	64.451	804	93,891	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	9.341	7.386	107	12,553	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25.088	22.105	284	33,234	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	17.876	-	-	-	-	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.769	9.891	45	5,345	0.0	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.104	8.104	125	14,624	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	率
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SLATE GROCERY REIT	12.066	12.169	133	15,540		0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	14.455	14.455	95	11,136		0.0
PRIMARIS REIT	21.998	20.442	268	31,306		0.0
SLATE OFFICE REIT	17.818	—	—	—		—
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	8.337	—	—	—		—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	24.983	23.694	396	46,271		0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	792.546	649.799	10,057	1,173,982	—
		30銘柄<1.7%>	26銘柄<1.3%>	—	—	1.3
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%
BWP TRUST	209.056	222.212	806	85,631		0.1
MIRVAC GROUP	1,776.143	1,620.072	3,175	337,094		0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP	632.521	520.52	216	22,932		0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT	230.204	204.746	685	72,815		0.1
GPT GROUP	853.243	774.713	3,191	338,843		0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	302.227	341.038	601	63,901		0.1
ABACUS GROUP	195.539	168.642	198	21,125		0.0
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	160.446	137.586	335	35,638		0.0
STOCKLAND	1,071.893	964.954	4,284	454,831		0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	162.299	157.084	761	80,878		0.1
DEXUS	479.312	441.787	2,893	307,195		0.3
GOODMAN GROUP	769.687	704.819	25,288	2,684,670		3.1
VICINITY CENTRES	1,758.932	1,588.997	2,995	317,976		0.4
CHARTER HALL GROUP	212.89	194.616	2,382	252,883		0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	126.146	101.9	241	25,637		0.0
REGION RE LTD	515.147	466.538	1,045	110,941		0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	240.142	213.14	667	70,822		0.1
ARENA REIT	165.205	147.24	584	62,055		0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	299.469	265.944	922	97,967		0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	91.184	93.159	281	29,867		0.0
NATIONAL STORAGE REIT	538.807	509.415	1,186	126,005		0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85.857	85.857	297	31,627		0.0
GDI PROPERTY GROUP	222.442	222.442	133	14,168		0.0
RURAL FUNDS GROUP	173.97	148.357	307	32,601		0.0
SCENTRE GROUP	2,339.436	2,106.223	6,718	713,273		0.8
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	140.343	—	—	—		—
HMC CAPITAL LTD	109.034	97.142	720	76,519		0.1
HOMECO DAILY NEEDS REIT	709.912	745.38	913	96,933		0.1
HEALTHCO REIT	182.619	202.023	232	24,663		0.0
ABACUS STORAGE KING	—	224.215	266	28,325		0.0
CENTURIA OFFICE REIT	210.931	185.985	223	23,693		0.0
WAYPOINT REIT LTD	300.308	266.477	620	65,913		0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	15,265.344	14,123.223	63,182	6,707,435	—
		31銘柄<6.8%>	31銘柄<7.6%>	—	—	7.6
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	1,145.32	1,047.12	33,350	683,357		0.8

銘柄	期首(前期末)	当 期			末	
		□ 数	□ 数	外貨建金額		邦貨換算金額
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円	%	
PROSPERITY REIT	538	538	747	15,322	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	985	908	889	18,232	0.0	
CHAMPION REIT	896.07	735.07	1,117	22,893	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	445	439	768	15,741	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	678	591	2,316	47,469	0.1	
小 計	□ 数 ・ 金 額	4,687.39	4,258.19	39,190	803,017	-
	銘柄 数<比 率>	6銘柄<1.4%>	6銘柄<0.9%>	-	-	0.9
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,246.609	2,061.809	3,999	471,869	0.5	
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,505.56	1,441.46	3,646	430,224	0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,005.29	898.09	951	112,304	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,469.02	1,375.42	1,788	210,935	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	614.9	530.3	254	30,028	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	995.816	997.316	882	104,123	0.1	
KEPPEL REIT	890.7	910	755	89,102	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	480.7	472.4	1,006	118,702	0.1	
ESR LOGOS REIT	2,901.84	2,395.84	658	77,725	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	394.5	277.2	266	31,393	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	548.48	449.78	301	35,550	0.0	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	538.1	-	-	-	-	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	228.595	273.095	344	40,593	0.0	
PARKWAY LIFE REIT	173.2	163.1	570	67,343	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	912.62	852.62	1,824	215,248	0.2	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,038.8	957	1,167	137,734	0.2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	481.4	464.5	285	33,700	0.0	
PARAGON REIT	493.8	487.1	421	49,705	0.1	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	112.4	112.4	15	1,856	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	259.9	242.3	159	18,865	0.0	
OUÉ REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,039.155	-	-	-	-	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	847.2	716.6	408	48,186	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	226.7	-	-	-	-	
KEPPEL DC REIT	594.4	537.3	951	112,191	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	1,304.864	1,178.864	1,131	133,507	0.2	
小 計	□ 数 ・ 金 額	21,304.549	17,794.494	21,792	2,570,894	-
	銘柄 数<比 率>	25銘柄<3.6%>	22銘柄<2.9%>	-	-	2.9
(ニュージーランド)	千□	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%	
PRECINCT PROPERTIES	610.508	629.766	714	69,905	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209.563	-	-	-	-	
GOODMAN PROPERTY TRUST	476.422	431.888	898	87,856	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	710.515	641.837	532	52,100	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	376.442	365.062	376	36,774	0.0	
STRIDE STAPLED GROUP	233.35	-	-	-	-	
小 計	□ 数 ・ 金 額	2,616.8	2,068.553	2,521	246,636	-
	銘柄 数<比 率>	6銘柄<0.4%>	4銘柄<0.3%>	-	-	0.3

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC	416.926	379.583	1,567	316,937	0.4	
DERWENT LONDON PLC	49.785	45.359	1,031	208,531	0.2	
BIG YELLOW GROUP PLC	78.821	79.274	930	188,154	0.2	
HAMMERSON PLC	1,850.26	1,555.881	440	89,018	0.1	
LAND SECURITIES GROUP PLC	339.433	304.255	1,903	384,752	0.4	
WORKSPACE GROUP PLC	60.495	55.71	328	66,338	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	0	0	0.0	
UNITE GROUP PLC	178.13	160.222	1,438	290,880	0.3	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	600.827	535.453	488	98,726	0.1	
SEGRO PLC	550.499	540.554	4,827	975,904	1.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	114.09	164.077	554	112,119	0.1	
ASSURA PLC	1,318.883	1,209.341	472	95,596	0.1	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184.841	134.607	68	13,797	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	256.281	203.492	91	18,595	0.0	
HELICAL PLC	48.089	42.126	100	20,269	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	248.473	233.467	158	31,954	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	395.99	—	—	—	—	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	96.433	87.913	701	141,831	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	441.765	823.481	1,604	324,475	0.4	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU	351.056	289.95	223	45,136	0.1	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	875.198	788.97	1,090	220,437	0.3	
WAREHOUSE REIT PLC	184.359	182.285	143	29,039	0.0	
NEWRIVER REIT PLC	148.157	113.885	84	17,060	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	293.773	—	—	—	—	
PRS REIT PLC/THE	249.964	210.972	162	32,842	0.0	
CLS HOLDINGS PLC	83.611	45.585	42	8,607	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	153.569	117.315	66	13,519	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	552.98	496.398	358	72,557	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	844.097	921.889	1,415	286,090	0.3	
CUSTODIAN REIT PLC	190.248	186.443	136	27,591	0.0	
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	—	252.776	203	41,087	0.0	
HOME REIT PLC	286.621	286.621	0	0	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	288.036	244.328	229	46,481	0.1	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO P	103.977	—	—	—	—	
LIFE SCIENCE REIT PLC	—	147.597	49	9,936	0.0	
AEW UK REIT PLC	78.98	50.684	45	9,160	0.0	
LXI REIT PLC	767.46	—	—	—	—	
REGIONAL REIT LTD	180.491	236.558	49	9,995	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	221.68	190.244	235	47,692	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	185.316	169.602	145	29,453	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	13,500.634 38銘柄<4.7%>	11,717.937 36銘柄<4.9%>	21,390 —	4,324,575 —	— 4.9
(イスラエル)	千□	千□	千イスラエル・シユケル	千円	%	
REIT 1 LTD	87.414	80.765	1,102	46,935	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	92.361	84.461	554	23,588	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当期			末	
		□数	□数	外貨建金額		邦貨換算金額
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シケル	千円	%	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314.331	293.689	441	18,780	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	494.106 3銘柄<0.1%>	458.915 3銘柄<0.1%>	2,097 -	89,303 -	- 0.1
(韓国)	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%	
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	39.353	-	-	-	-	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	11.135	-	-	-	-	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	29.807	27.173	168,200	19,359	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18.354	-	-	-	-	
LOTTE REIT CO LTD	55.954	48.275	162,686	18,725	0.0	
KORAMCO LIFE INFRA REIT	20.53	22.542	104,031	11,974	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9.851	-	-	-	-	
JR REIT XXVII	66.386	65.671	273,191	31,444	0.0	
SK REITS CO LTD	31.791	48.785	231,728	26,671	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	73.968	63.994	292,132	33,624	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	26.101	23.341	78,659	9,053	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	20.887	21.573	78,849	9,075	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	404.117 12銘柄<0.2%>	321.354 8銘柄<0.2%>	1,389,480 -	159,929 -	- 0.2
(ユーロ…ガーデンジ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
SHURGARD SELF STORAGE LTD	-	12.584	482	82,504	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄<-%>	12.584 1銘柄<0.1%>	482 -	82,504 -	- 0.1
(ユーロ…シンガポール)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CROMWELL REIT EUR	162.64	129.84	184	31,520	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	162.64 1銘柄<0.0%>	129.84 1銘柄<0.0%>	184 -	31,520 -	- 0.0
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	198.163	175.735	159	27,309	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	198.163 1銘柄<0.0%>	175.735 1銘柄<0.0%>	159 -	27,309 -	- 0.0
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	7.975	7.354	173	29,670	0.0	
WERELDHAVE NV	18.149	13.999	187	32,021	0.0	
NSI NV	8.534	7.519	145	24,834	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19.196	17.867	393	67,199	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	53.854 4銘柄<0.2%>	46,739 4銘柄<0.2%>	899 -	153,727 -	- 0.2
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
COFINIMMO SA	13.78	14.851	849	145,226	0.2	
RETAIL ESTATES	5.13	4.857	307	52,561	0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12.613	-	-	-	-	
WAREHOUSES DE PAUW	69.994	71.418	1,804	308,415	0.4	
MONTEA SCA	6.01	7.158	563	96,307	0.1	
AEDIFICA	17.659	19.207	1,098	187,823	0.2	
CARE PROPERTY INVEST NV	16.012	15.092	197	33,748	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当期				比率
		数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
XIOR STUDENT HOUSING NV	10.247	14	403	68,931	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	151.445 8銘柄<1.0%>	146.583 7銘柄<1.0%>	5,223 -	893,013 -	- 1.0
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	24.437	20.75	1,886	322,460	0.4	
ICADE	14.462	12,549	305	52,304	0.1	
ALTAREA	2.083	1,894	168	28,818	0.0	
KLEPIERRE	86.815	78,795	2,029	347,007	0.4	
COVIVIO	20.812	20,325	929	158,935	0.2	
MERCIALYS	35.663	37.38	397	67,930	0.1	
CARMILA SA	26.256	22,407	364	62,363	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	48.183	41,142	3,023	516,831	0.6	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	258.711 8銘柄<1.7%>	235.242 8銘柄<1.8%>	9,105 -	1,556,652 -	- 1.8
(ユーロ…ドイツ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
HAMBORNER REIT AG	32.393	28,721	188	32,161	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3.939	-	-	-	-	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	36.332 2銘柄<0.0%>	28,721 1銘柄<0.0%>	188 -	32,161 -	- 0.0
(ユーロ…スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	133.768	115,299	637	109,004	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	26.318	19,464	134	22,960	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	148.852	134.73	1,420	242,772	0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	308.938 3銘柄<0.4%>	269,493 3銘柄<0.4%>	2,191 -	374,737 -	- 0.4
(ユーロ…イタリア)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20.555	20,555	35	6,149	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	20.555 1銘柄<0.0%>	20,555 1銘柄<0.0%>	35 -	6,149 -	- 0.0
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	71,937.959 324銘柄<99.4%>	63,422.659 302銘柄<99.0%>	- -	86,986,336 -	- 99.0

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、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。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期		末
		買	建 額 売	
外国	D J U S R E A L E S T A T E		百万円 895	百万円 -

(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

2024年6月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券、投資証券	86,986,336 千円	98.4 %
コール・ローン等、その他	1,451,023	1.6
投資信託財産総額	88,437,359	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、87,853,241千円、99.3%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、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1香港・ドル=20.49円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シケル=42.573円、100韓国・ウォン=11.51円、1ユーロ=170.96円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	88,649,701,899円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	300,886,231
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	9,407,460,726
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	77,578,875,696
未 収 入 金	636,567,111
未 収 配 当 金	289,741,082
差 入 委 託 証 拠	436,171,053
(B) 負 債	767,857,343
未 払 金	754,822,343
未 払 解 約 金	13,035,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	87,881,844,556
元 本	42,455,688,196
次 期 繰 越 損 益 金	45,426,156,360
(D) 受 益 権 総 口 数	42,455,688,196口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	20,700円

(注1) 期首元本額 47,496,039,171円
追加設定元本額 32,421,167,258円
一部解約元本額 37,461,518,233円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国リート (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	3,553,671,263円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,401,394円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,121,852円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	39,716,333円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	45,898,769円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,586,104円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	27,197,441円
たわらノーロード 先進国リート	15,330,920,587円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	128,586,248円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	250,596,932円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	4,258,594,024円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,106,523円
たわらノーロード バランス (標準型)	618,010,808円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,446,430,148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)	1,255,966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)	633,358,212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)	672,887,840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)	1,200,068,581円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	536,766円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	40,159,308円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	13,385,607円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	33,328,539円
One DC先進国リートインデックスファンド	2,255,560,675円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	15,876,493円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	596,420,560円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	79,425,412円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	189,471,408円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	313,572,673円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	612,101,769円
投資のソムリエ	3,856,050,647円
投資のソムリエ<DC年金>	413,259,951円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	270,614,486円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,013,891円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,452,619,453円
ワールドアセットバランス (基本コース)	246,980,107円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	680,485,328円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	63,029,259円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	32,850,694円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,386,291円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	86,191,058円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,215,386,591円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,783,516円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	38,983,095円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	35,002,071円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	22,084,482円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	5,403,231円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	68,809,621円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	270,424,593円
D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金>	383,275,072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)	217,802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)	647,540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)	125,270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)	867,926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)	711,941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)	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	5,202円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	62,054,960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)	895,492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)	572,716円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用)	2,122,603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)	40,047,574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)	101,133,689円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	711,941円
投資のソムリエ	16,902,701円
期末元本合計	42,455,688,196円

■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,544,474,640円	
	受取配当金	3,509,420,266	
	受取利息	22,157,843	
	その他の収益	12,979,415	
	支払利息	△82,884	
(B)	有価証券売買損益	11,467,586,659	
	売買益	18,334,949,393	
	売買損	△6,867,362,734	
(C)	先物取引等取引損益	4,548,586	
	取引益	5,384,758	
	取引損	△836,172	
(D)	その他費用	△38,379,043	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	14,978,230,842	
(F)	前期繰越損益金	33,703,055,639	
(G)	解約差損益金	△27,955,379,863	
(H)	追加信託差損益金	24,700,249,742	
(I)	計(E+F+G+H)	45,426,156,360	
	次期繰越損益金(I)	45,426,156,360	

(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

■先物取引等の指図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12日)