

運用報告書 (全体版)

第8期<決算日2022年2月25日>

4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合 (インデックス型)	
信託期間	2014年7月30日から無期限です。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	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。
主要投資対象	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	運用方法	主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式 (除く日本)、先進国債券 (除く日本) に投資し、各資産クラスのベンチマークを基本配分比率で合成したベンチマーク (合成ベンチマーク) に概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。各資産につき、基本配分比率における各資産の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
組入制限	マザーファンド受益証券以外の投資信託証券 (上場投資信託証券を除きます。) への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の80%未満とします。外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の55%以下とします。	
分配方針	決算日 (原則として2月25日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の配当等収益および売買益 (評価益を含みます。) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

愛称：わたしへの贈りもの

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、「4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>」は、2022年2月25日に第8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

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

4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付(転換社債)比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率						
4期(2018年2月26日)	円 12,782	円 0	% 10.0	ポイント 24,581.26	% 10.4	% 57.7	% 1.2	% 37.3	% -	% -	百万円 1,362
5期(2019年2月25日)	12,628	0	△1.2	24,380.15	△0.8	57.7	1.4	36.8	-	-	1,727
6期(2020年2月25日)	13,291	0	5.3	25,734.50	5.6	55.7	1.5	38.6	-	-	2,086
7期(2021年2月25日)	14,907	0	12.2	28,993.32	12.7	58.7	0.9	36.5	-	-	2,792
8期(2022年2月25日)	15,319	0	2.8	29,902.44	3.1	55.9	1.2	37.4	-	-	4,335

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

(注2) 株式組入比率には、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。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) ベンチマークは委託会社が独自に指数化する合成インデックスです。また、期首の基準価額をもとに指数化しています。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首) 2021年2月25日	円 14,907	% -	ポイント 28,993.32	% -	% 58.7	% 0.9	% 36.5	% -	% -
2月末	14,644	△1.8	28,533.42	△1.6	58.2	0.9	37.2	-	-
3月末	15,237	2.2	29,664.40	2.3	57.0	2.2	36.6	-	-
4月末	15,201	2.0	29,601.78	2.1	56.3	1.9	37.6	-	-
5月末	15,355	3.0	29,925.40	3.2	56.5	1.8	37.3	-	-
6月末	15,495	3.9	30,218.30	4.2	55.8	2.3	37.1	-	-
7月末	15,434	3.5	30,108.56	3.8	56.4	1.5	37.4	-	-
8月末	15,692	5.3	30,626.92	5.6	57.1	1.5	36.8	-	-
9月末	15,869	6.5	30,970.72	6.8	55.2	1.8	37.6	-	-
10月末	16,039	7.6	31,316.27	8.0	56.9	1.8	37.7	-	-
11月末	15,780	5.9	30,801.07	6.2	50.5	1.0	37.7	-	-
12月末	16,120	8.1	31,498.41	8.6	56.4	1.9	36.7	-	-
2022年1月末	15,536	4.2	30,345.74	4.7	53.5	2.0	36.4	-	-
(期末) 2022年2月25日	15,319	2.8	29,902.44	3.1	55.9	1.2	37.4	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

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

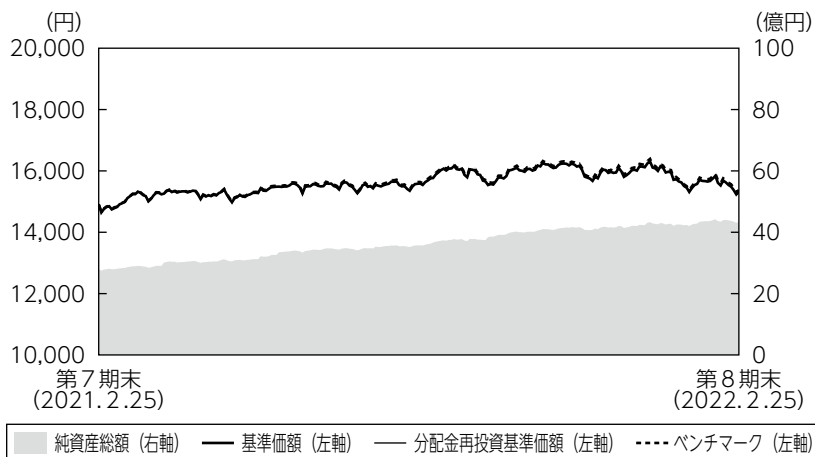
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月26日から2022年2月25日まで）

基準価額等の推移



第8期首：14,907円
 第8期末：15,319円
 (既払分配金0円)
 騰落率：2.8%
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化する合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ウクライナ情勢の悪化などにより2022年に入るとリスクオフの動きとなりましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種進展や経済活動正常化への期待感などを受け、外国株式市場が上昇したことがプラスに寄与しました。また、インフレ懸念や欧米の中央銀行の金融緩和政策の正常化観測の高まりなどから海外金利は上昇（価格は下落）しましたが、主要国との内外金利差の拡大から円安が進んだことがプラス寄与となり、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	△0.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.2%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.6%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.1%

投資環境

国内株式市場は、期初から2021年8月までは、新型コロナウイルスの感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。10月以降、中国の恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。2022年1月から期末にかけては、新型コロナウイルスの新規感染者数の拡大、各国の中央銀行の金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を受けて下落しました。

外国株式市場は上昇しました。前半は新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動正常化や、米国の経済対策法案への期待などから堅調に推移しました。その後はインフレ加速への懸念や、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから下落する場面もありましたが、良好な企業の決算発表や新型コロナウイルスへの警戒感後退などから堅調に推移しました。期末にかけては金融緩和策の急速な転換への懸念や、ウクライナ情勢の緊迫化を受け不安定な値動きとなりました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2021年8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格は上昇）しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いでした。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの見測から利回りは上昇（価格は下落）し、期末にかけては欧米の好調な経済指標の発表を受けインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇しました。

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、FOMC（米連邦公開市場委員会）の早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもECB（欧州中央銀行）がパンデミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要先進国通貨に対して概ね円安の動きとなりました。ドル/円相場は、新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中、経済活動の正常化期待に加え、金融緩和政策の正常化観測が高まったこと等から米国の金利が大きく上昇、内外金利差が拡大し円安ドル高となりました。その他の主要通貨に対しても、経済活動の正常化に対する期待感や各国の金融政策の行方に対する思惑などから主要国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大する中、概ね円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

当ファンドでは、各資産クラスのベンチマークを以下の基本配分比率で合成したベンチマーク（合成ベンチマーク）に概ね連動した投資成果をめざし、各資産への投資比率が基本配分比率から大きく乖離しないよう運用を行いました。

<基本配分比率>

国内株式40%、国内債券22%、先進国株式（除く日本）19%、先進国債券（除く日本）16%、現金等3%

●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。

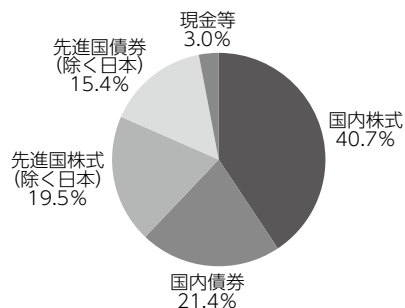
●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

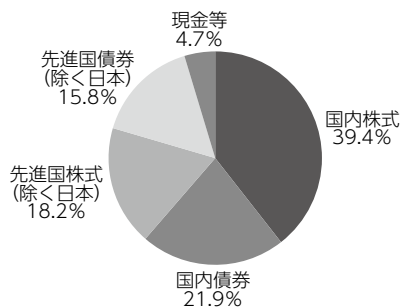
【運用状況】

○マザーファンド組入比率

期首（前期末）



期末

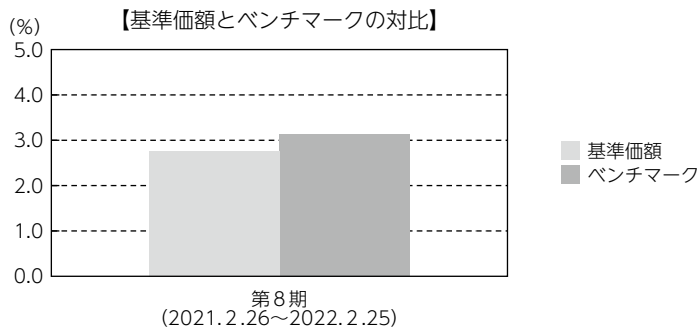


(注) 組入比率は純資産総額に対する各マザーファンドの評価額の割合です。

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3.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.4%と、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年2月26日 ～2022年2月25日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	5,318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

当ファンドでは、引き続き、合成ベンチマークに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本配分比率から大きく乖離しないよう運用を行います。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●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で、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

●外国債券パッシブ・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。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第8期		項目の概要
	(2021年2月26日 ～2022年2月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	24円	0.154%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は15,615円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(10)	(0.066)	
(販売会社)	(10)	(0.066)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(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)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.005	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.014	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(0)	(0.002)	
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(1)	(0.008)	
合計	27	0.174	

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

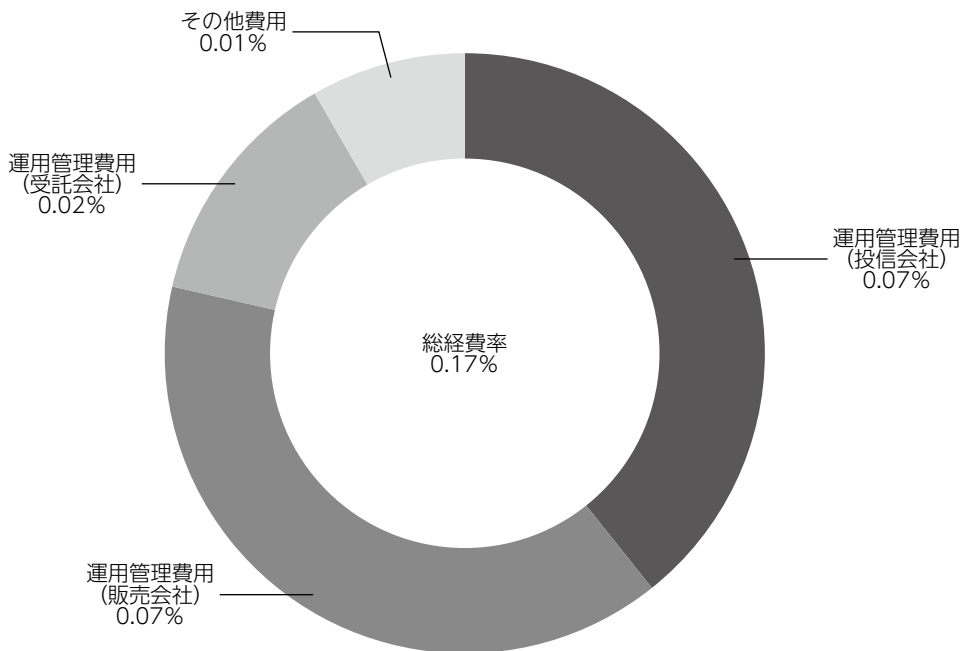
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.17%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（2021年2月26日から2022年2月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	188,535	605,044	1,963	6,325
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	31,642	174,080	3,248	16,368
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	278,214	362,882	1,391	1,815
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	125,595	256,471	1,414	2,861

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	988,300,579千円	745,720,519千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	369,108,651千円	572,165,051千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	2.67	1.30

(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（2021年2月26日から2022年2月25日まで）

【4資産分散投資・ハイクラス＜DC年金＞における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	69千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.938千円
(B)／(A)	1.4%

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

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	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 533,853	百万円 185,530	% 34.8	百万円 454,447	百万円 118,063	% 26.0

平均保有割合 0.4%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 4,124	百万円 3,635	百万円 2,947

(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	額
株 式		百万円 1,300

【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】

(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
公 社 債	百万円 834,078	百万円 107,457	% 12.9	百万円 481,146	百万円 73,218	% 15.2

平均保有割合 0.2%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

【外国債券パッシブ・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。

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	363,312	549,884	1,709,482
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	114,819	143,212	788,372
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	462,177	739,000	950,871
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	216,614	340,795	684,931

■投資信託財産の構成

2022年2月25日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	1,709,482	39.3
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	788,372	18.1
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	950,871	21.9
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	684,931	15.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	212,298	4.9
投 資 信 託 財 産 総 額	4,345,956	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、2022年2月25日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは606,704,470千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは141,308,680千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.57円、1カナダ・ドル=90.21円、1オーストラリア・ドル=82.57円、1香港・ドル=14.80円、1シンガポール・ドル=85.37円、1ニュージーランド・ドル=77.34円、1イギリス・ポンド=154.66円、1イスラエル・シケル=35.59円、1スイス・フラン=125.02円、1デンマーク・クローネ=17.40円、1ノルウェー・クローネ=12.91円、1スウェーデン・クローナ=12.18円、1メキシコ・ペソ=5.619円、1オフショア・人民元=18.287円、1マレーシア・リンギット=27.52円、1ポーランド・ズロチ=27.966円、1ユーロ=129.42円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,345,956,004円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	212,298,311
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	1,709,482,195
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	788,372,544
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	950,871,837
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	684,931,117
(B) 負 債	9,969,544
未 払 解 約 金	6,728,913
未 払 信 託 報 酬	3,160,354
そ の 他 未 払 費 用	80,277
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,335,986,460
元 本	2,830,529,190
次 期 繰 越 損 益 金	1,505,457,270
(D) 受 益 権 総 口 数	2,830,529,190口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	15,319円

(注) 期首における元本額は1,873,009,494円、当期中における追加設定元本額は1,272,874,520円、同解約元本額は315,354,824円です。

■損益の状況

当期 自2021年2月26日 至2022年2月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△31,909円
受 取 利 息	2,322
支 払 利 息	△34,231
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	36,839,276
売 買 損 益	87,757,582
売 買 損	△50,918,306
(C) 信 託 報 酬 等	△5,748,160
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	31,059,207
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	382,119,833
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,092,278,230
(配 当 等 相 当 額)	(699,740,540)
(売 買 損 益 相 当 額)	(392,537,690)
(G) 合 計(D+E+F)	1,505,457,270
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,505,457,270
追 加 信 託 差 損 益 金	1,092,278,230
(配 当 等 相 当 額)	(700,613,021)
(売 買 損 益 相 当 額)	(391,665,209)
分 配 準 備 積 立 金	430,589,020
繰 越 損 益 金	△17,409,980

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	48,469,187円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	1,074,868,250
(d) 分 配 準 備 積 立 金	382,119,833
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,505,457,270
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	5,318.64
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

■当ファンドが投資対象とする「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年12月21日)

*合成インデックスについて

- (注1) 合成インデックスとは、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)、NOMURA-BPI総合、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)、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)、コール・ローンのオーバーナイト物レートを基本アロケーションに基づいて委託会社が合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。
- (注2) 運用環境見通し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響を及ぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- (注3) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所)により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所)は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- (注4) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- (注5) MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注6) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022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20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落 中率			
16期 (2018年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期 (2020年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期 (2021年2月8日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期 (2022年2月7日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

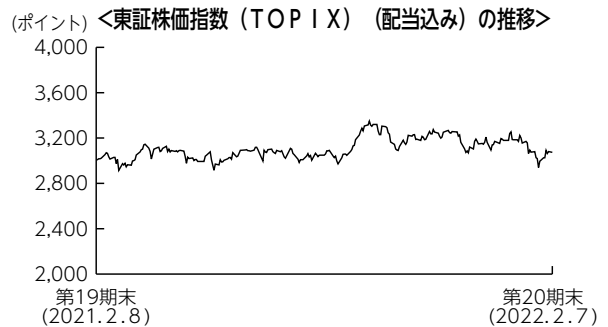
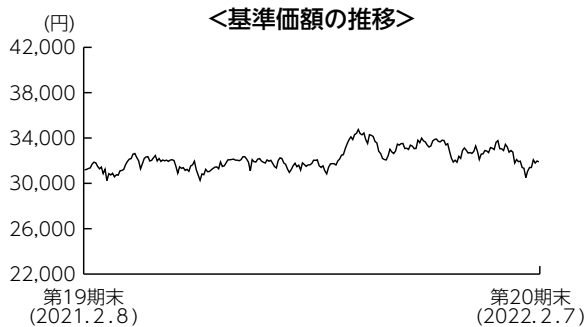
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% -	ポイント 3,006.47	% -	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期 末) 2022年 2月 7日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	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（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の自民党総裁選への不出馬表明を受けて、新たな政策への期待の高まりから基準価額は上昇しました。その後は、中国不動産開発大手の中国恒大集団の信用リスク懸念、米国での金融引き締めによる金利上昇への警戒感の高まり、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大等を要因として基準価額は下落しました。

投資環境

期初から2021年8月までは、国内の感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

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	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1

○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	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174銘柄	

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2.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (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
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238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 (2021年2月9日から2022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
		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	395,856,402

(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 144,564	百万円 142,625	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	875,075,739千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	369,108,651千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	2.37

(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（2021年2月9日から2022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 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133

(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 1,300

(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)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B) / (A)	2.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、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		銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
日本たばこ産業		636.5		791.4	共和レザー		6.8		9.2	トリケミカル研究所		9.8		14.9
ケンコーマヨネーズ		7.3		8.5	昭和電工		87.9		124.8	A D E K A		53.3		66.3
くわばや日洋ホールディングス		7.8		9.6	住友化学		911.2		1,057.7	日油		43.6		49.2
なとり		6.9		8.1	住友精化		5.7		6.4	新日本理化		19		23.6
イフジ産業		2.3		2.5	日産化学		63.9		78.4	ハリマ化成グループ		8.7		11
ピッルスコーポレーション		2.8		7.2	ラサ工業		3.8		5	花王	283.1	325.3		1,709.126
ファーマフーズ		-		14	クレハ		9.9		11.5	第一工業製薬		3.9		5.4
ユーグレナ		51.2		75	多木化学		4.5		5.6	石原ケミカル		3		7.5
紀文食品		-		8.6	テイカ		8.4		10.8	日華化学		4.3		5
ミヨシ油脂		4.4		6.2	石原産業		20.6		23.8	ニイタカ		2.4		3
理研ビタミン		11.2		15.4	片倉コープアグリ		2.4		2.5	三洋化成工業		6.9		8.6
繊維製品 (0.5%)					日本書達		16.2		18.4	有機合成薬品工業		9.2		10.3
片倉工業		15.6		13.8	東ソー		178.9		207.7	大日本塗料		13.2		17.8
グンゼ		8.5		9.6	トクヤマ		34.3		46	日本ペイントホールディングス		95.5		541.2
東洋紡		45.8		56.9	セントラル硝子		22		23.5	関西ペイント		130.1		149.3
ユニチカ		33.8		39.2	東亞合成		70.7		80.1	神東塗料		9.3		10
富士紡ホールディングス		5.6		6.4	大阪ソーダ		11.9		13.5	中国塗料		27.9		34
倉敷紡績		10.7		12.3	関東電化工業		27.3		31.6	日本特殊塗料		8.7		10.9
シキボウ		6.6		7.9	デンカ		42.2		52.4	藤倉化成		16		18.3
日本毛織		38.1		43.4	信越化学工業		214.1		247.4	太陽ホールディングス		8.5		21.2
ダイウボウ		19.3		23.8	日本カーバイド工業		4.2		5.2	D I C		48.9		60.9
トア紡コーポレーション		4.1		4.3	堺化学工業		8.1		10	サカایتクス		25.3		28.7
ダイドーマイテッド		16.6		20.5	第一稀元素化学工業		11.7		13.4	東チキソケイCホールディングス		24.5		30.5
帝国繊維		13		16.3	エア・ウォーター		118.1		136.2	T & K TOKA		9.4		11.7
帯人		109		135.4	日本酸素ホールディングス		95.3		138.5	富士フィルムホールディングス		207.8		258.5
東レ	838.4		1,042.5		日本化学工業		3.2		4.6	資生堂		235		273.9
サカイオーベックス		3.1		-	東邦アセチレン		1.9		2.6	ライオン	153.7	177.6		268.708
住江織物		2.1		3.4	日本パーカライジック		58.4		72.6	高砂香料工業		7.4		10.3
日本フェルト		5.5		5.9	高圧ガス工業		18.5		23.1	マンダム		24.7		30.9
イチカワ		1.3		1.4	チタン工業		1.5		1.7	ミルボン		15.8		18.3
日東製綱		1.3		1.7	四国化成工業		15.5		19	ファンゲル		43		59.6
アツギ		9.3		11.5	戸田工業		2.4		3.2	コーセー		22.2		27.7
ダイニク		3.6		3.8	ステラ ケミファ		6.3		7.2	コタ		7		9.4
セーレン		28.5		29.6	保土独化学工業		3.4		4.6	シーボン		1.3		1.4
ソトー		4		6.2	日本触媒		21		24.2	ポエラ・オルビスホールディングス		50.5		62.8
東海染工		1.3		1.4	大日精化工業		9.6		12	ノビアホールディングス		10		12.6
小松マટેーレ		19.1		23.6	カネカ		30		37.3	アジバンホールディングス		3		3.5
ワコールホールディングス		28.9		35.9	三菱瓦斯化学		116		133.8	新日本製薬		2.4		4
ホギメディカル		15.6		19.5	三井化学		100		130.8	エステー		7.7		9.5
クラウディアホールディングス		2.4		2.5	J S R		116.2		134.4	アグロ カネシヨウ		4.5		5
T S Iホールディングス		34.7		47.9	東京応化工業		19.9		23.3	コニシ		19.5		24.1
マツカカコーポレーション		3.7		4.6	大阪有機化学工業		10.7		12.2	長谷川香料		20.5		25.5
ワールド		15.1		18.9	三菱ケミカルホールディングス		774.1		962.6	星光PMC		6.9		8.6
三陽商会		6		6.9	K Hネオケム		19.1		23.7	小林製薬		33.1		41.3
ナイガイ		3.8		4.1	ダイセル		155.5		207.2	荒川化学工業		9.9		12.3
オノワードホールディングス		69.3		86.3	住友ベークライト		18.2		22.8	メック		8.1		11
ルクホールディングス		4		4.6	積水化学工業		244.9		301.3	日本高純度化学		3.3		4.1
キムラタン		68.3		79.9	日本ゼオン		104.5		129.8	タカラバイオ		31		38.5
ゴールドウイン		19.1		26	アイカ工業		32.2		40.1	J C U		13.3		16.6
デサント		19.8		28.1	宇部興産		58.4		67.8	新田セラチン		7		9.3
キング		4.6		6.7	積水樹脂		19.1		21.9	O A Tアグリオ		2.7		3.2
ヤマインターナショナル		10.6		13.3	タキロンシーアイ		25.2		31.4	デクセリアルズ		33		38.2
パルプ・紙 (0.2%)					旭有機材		6.6		8.1	アース製薬		8.9		12.1
特種東海製紙		7.2		8.9	ニチバン		6.2		8.6	北興化学工業		10.9		13.8
王子ホールディングス		521.3		602.3	リケンテクノス		28.2		35.4	大成ラミック		3.7		4.6
日本製紙		51.1		69	大倉工業		5.5		7.5	クミアイ化学工業		48.8		54.8
三菱製紙		17.1		21.3	積水化成成品工業		15.6		19.6	日本農業		21.2		26.4
北越コーポレーション		82.9		94.7	群栄化学工業		2.2		3.5	アキレス		8.2		9.4
中越パルプ工業		4.7		5.6	タイガースポリマー		6.7		8.5	有沢製作所		16.5		21.5
巴川製紙所		3.7		4.6	ミライアル		3.7		4.7	日東電工		75.7		89
大玉製紙		56		69.6	ダイキアクシス		4.3		5.6	レック		14		19.1
阿波製紙		3		4	ダイキョーニシカワ		24.5		30.7	三光合成		12.4		15.5
レンゴウ		119.4		136.3	竹本容器		4.2		5.3	きもと		18.9		22.9
トーモク		7.2		9	森六ホールディングス		6.3		7.9	藤森工業		10.6		13.2
ザ・パック		8.7		11	恵和		1.7		3.6	前澤成工業		7.8		9.5
化学 (6.6%)					日本たばこ		71.6		113.4	未来工業		4.3		5.5
北の達人コーポレーション		41.4		51.4	カーリットホールディングス		11.5		14.3	ウェーブソフトホールディングス		4		5.6
クラレ		182.3		210.4	日本精化		8.4		11.6	J S P		7		8.7
旭化成		767.5		954.1	扶桑化学工業		9.1		12.9	エフピコ		21.8		27

銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期		銘柄	期首(前期末)		当期	
	株数	株数	千株	千円		株数	株数	千株	千円		株数	株数	千株	千円
天馬	9.9	11.6	30,206		パナドール化学	20.9	24	21,216	日本軽金属ホールディングス	31.9	36.7	65,582		
信越ポリマー	18.2	26.4	29,409	ガス・石油製品 (0.8%)				三井金属鉱業	31.6	39.4	128,444			
東リ	31.1	38.8	8,691	日東紡績	17.5	22	64,658	東邦亜鉛	6.5	8.1	19,658			
ニフコ	43.4	49.1	168,413	A G C	108.6	135.1	680,904	三菱マテリアル	77.2	95.9	199,951			
バルカー	9.7	12	30,336	日本板硝子	59.8	70.5	32,853	住友金属鉱山	149.4	185.8	998,303			
ユニ・チャーム	250.8	283.4	1,248,377	石塚硝子	2.1	2.5	5,107	DOWAホールディングス	29.6	39.7	205,646			
ショーエイコーポレーション	2.6	4	2,648	日本山村硝子	5.3	5.7	4,474	古河機械金属	19.3	24.1	30,438			
医薬品 (4.9%)				日本電気硝子	43.8	59.1	166,130	エス・サイエンス	54.7	69	1,587			
協和ケリン	119	172.7	504,802	オハラ	4.7	5.9	6,549	大塚チタニウムテクノロジーズ	12	16.7	14,345			
武田薬品工業	983.7	1,155.5	3,978,386	住友大阪セメント	21.3	27.3	96,505	東邦チタニウム	20.9	26.2	23,946			
アステラス製薬	1,025.1	1,274.7	2,576,806	太平洋セメント	70	83.5	192,634	U A C J	17.7	22.2	51,415			
大日本住友製薬	87.6	90.9	112,897	日本ヒューム	11	15.4	10,641	C Kサンエツ	2.1	3.2	12,848			
塩野義製薬	148.7	184.8	1,475,443	日本コンクリート工業	25.4	29.1	8,235	古河電気工業	36.4	45.2	99,666			
わかもと製薬	14.3	17.6	5,332	三谷セキサン	5.5	6.9	44,988	住友電気工業	407.9	543.6	848,559			
あすか製薬	13.4	-	-	アジアパイルホールディングス	18.5	23.3	10,298	フジクラ	141.1	162	100,440			
日本新薬	33.5	38.5	294,140	東海カーボン	115.5	123.2	141,310	昭和電線ホールディングス	11.3	12.6	23,927			
ビオフェルミン製薬	2.2	-	-	日本カーボン	6.5	7.6	30,324	東京特殊電線	1.5	1.7	4,921			
中外製薬	369.8	460	1,867,140	東洋炭素	7	9.5	27,559	タツタ電線	20.6	25.7	11,590			
科研製薬	20.2	23.1	94,825	ハタカカンパニーリミテド	6.6	8.2	36,982	カナレ電気	2.2	2.8	4,253			
エーザイ	130.6	176.1	1,012,927	T O T O	84.5	105	512,925	平河ビューテック	6.5	8.2	9,585			
ロート製薬	56.3	75.5	241,977	日本碍子	20	159.3	296,616	リョービ	14.2	17.9	20,083			
小野薬品工業	271.5	337.6	955,576	日本特殊陶業	90	111.9	246,739	アールスティ	14.6	15.4	5,836			
久光製薬	34.4	38.8	142,784	ダントーホールディングス	8.6	9.5	3,344	アサヒホールディングス	21.9	58.3	128,376			
持田製薬	16.4	18.7	69,564	M A R U W A	4.1	5.1	70,482	金属製品 (0.6%)						
参天製薬	205.7	274.1	362,086	黒川プラクティーズ	2.8	3.5	13,772	稲葉製作所	6.7	8.3	10,665			
扶桑薬品工業	3.8	5.2	11,679	富崎播磨	2	2.7	11,947	宮地エンジニアリンググループ	3.8	4.6	14,628			
日本ケムファ	1.2	1.2	2,547	ヨータイ	8.6	9.4	12,097	トーカロ	30.2	37.6	49,632			
ツムラ	39.5	45.7	153,552	インソライト工業	5.3	6.6	7,906	アルファ	4.5	4.8	5,294			
日医工	33.4	45.6	34,063	東京薬業	15.7	19.4	5,975	S U M C O	149.6	223.9	444,217			
キッセイ薬品工業	20.9	26.2	61,805	ニッカトー	5.4	6.8	4,168	川田テクノロジーズ	2.4	3	11,910			
生化学工業	20.9	26	24,700	フジミンコーポレートド	9.5	11.9	79,135	R S Technologies	3.8	4.7	26,555			
栄研化学	20.8	25.9	46,309	クニミネ工業	3.8	4.9	4,914	ジェイテックホールディングス	1	1.6	2,529			
白水製薬	4.6	5.9	5,823	エーアンドエーマテリアル	2.4	3.2	2,880	信和	6.4	9.1	7,543			
鳥居薬品	7.4	8	25,120	ニチアス	29.9	34.2	88,749	東証グループホールディングス	74.5	92.6	140,659			
J C R ファーマ	33.3	41.5	84,328	ニチハ	16.5	20.5	53,669	ホクサンホールディングス	6	8.2	11,627			
東和薬品	17.1	21.1	61,823	鉄鋼 (0.8%)				コロナ	6.8	8.6	7,731			
富士製薬工業	8.1	9.1	10,090	日本製鉄	558.1	650.6	1,279,730	横浜フジツボホールディングス	20.1	25	51,000			
沢井製薬	25.9	-	-	神戸製鋼所	213.7	271.2	154,312	駒井ハルテック	2.4	2.9	6,878			
ゼリア新薬工業	21.5	26.9	51,325	中山製鋼所	17.1	23.1	10,418	高田機工	0.8	0.7	1,989			
第一三共	1,015	1,155.4	2,727,321	合同製鐵	6.3	7.9	10,657	三和ホールディングス	110.2	137.1	164,794			
キョーリン製薬ホールディングス	26.1	29.6	54,967	ジェイエフイーホールディングス	338.2	392.6	602,641	文化シヤッター	34.6	46.4	47,699			
大幸薬品	14.5	22.3	14,338	東京製鐵	45.6	49.6	56,891	三協立山	15	18.9	11,623			
ダイト	7.5	9.4	26,479	共英製鋼	13.1	16.5	25,789	アルインコ	7.8	10.9	9,919			
大塚ホールディングス	245.8	305.5	1,249,800	大和工業	24.9	28	104,160	東洋シヤッター	2.4	2.5	1,357			
大正製薬ホールディングス	28.1	35	199,150	東京製鋼	4.5	6.4	8,652	L I X I L	161	228.9	579,122			
ペプチドリーム	60.1	77.1	155,742	大阪製鐵	6.3	7.9	9,653	日本フイルコン	8.5	10.9	5,831			
あすか製薬ホールディングス	-	16.8	17,421	淀川製鋼所	15.9	19.3	50,373	ノーバツ	24.3	28	45,780			
サワグルーホールディングス	-	32.2	145,061	丸一銅管	37.9	51.5	136,063	長府製作所	12	14.9	28,980			
石油・石化製品 (0.4%)				モリ工業	3.5	4.5	11,403	リンナイ	22.7	27.4	277,014			
日本コークス工業	100.5	123.8	17,332	大同特殊鋼	19.1	23.8	102,340	ダイニチ工業	5.7	7.2	5,133			
ニチレキ	14	18.9	24,381	日本高周波鋼業	4	4.2	1,428	日東精工	15.1	18.4	9,568			
ユシロ化学工業	6.8	7.9	8,500	日本冶金工業	9.1	10.8	31,968	三洋工業	1.3	1.4	2,532			
ピービー・カストロール	4.3	5.5	7,155	山陽特殊製鋼	14	15	33,135	シーテクト	24.1	27.8	20,822			
富士石油	28.8	39.4	10,086	愛知製鋼	6.6	8.2	21,197	東レ	21.9	27.1	33,360			
M O R E S C O	4.5	5.1	5,997	日立金属	110.3	156.7	327,189	高周波熱錬	22.3	25.9	15,306			
出光興産	131.2	163.3	502,147	日本金属	2.9	3.6	3,880	東京製鋼	8.2	8.9	7,885			
ENEOSホールディングス	1,778.3	2,210.8	1,036,201	大洋洋金属	7.8	8.9	26,619	サンコー	10.3	12.9	7,198			
コスモエネルギーホールディングス	37.3	42.6	101,217	新日本電工	75.3	93.6	30,513	モリテックスチール	9	11.4	3,693			
ゴム製品 (0.7%)				栗本鐵工所	5.4	6.8	10,608	パイオラックス	17.3	21.6	38,750			
横浜ゴム	68.4	85	145,350	疋枝	1.3	2.3	2,178	エイチワン	11.6	14.4	9,432			
TOYO TIRE	62.2	77.5	126,557	日本鑄鉄管	1.4	1.6	1,601	日本発条	116.4	133.7	120,330			
ブリヂストン	314.4	423.6	2,201,872	三菱製鋼	8.8	9.2	11,546	中央発条	1	7.2	5,724			
住友ゴム工業	106	132.1	156,934	日本精線	1.7	2.5	11,200	アドバネクス	1.6	2.2	3,260			
藤倉コンポジット	10.8	11.9	9,674	エンビロ・ホールディングス	5.1	4.8	8,016	立川プラインド工業	5.3	6.7	7,370			
オカモト	7.3	8.8	36,168	シンニッター	14.5	18	4,230	三益半導体工業	9.1	11.5	27,370			
フコク	4.4	6.6	6,355	新東工業	3.1	3.8	6,429	機械 (5.3%)						
ニッタ	12.2	15.3	43,084	非鉄金属 (0.8%)				日本ドライケミカル	3	3.8	6,623			
住友理工	22.8	28.7	17,220	大紀アルミニウム工業所	17.7	22	32,186	日本製鋼所	35.5	44.1	165,375			
三ツ星ベルト	14.4	17.9	38,234											

銘柄	期首(前期末)		当期		株数	株数	評価	価額	銘柄	期首(前期末)		当期		株数	株数	評価	価額	銘柄	期首(前期末)		当期		株数	株数	評価	価額
	株数	千株	株数	千株						株数	千株	株数	千株						株数	千株	株数	千株				
三浦工業	50.6	63	207,585					帝国電機製作所	8.3	10.6	13,939							三菱重工業	185.7	231	737,583					
タフマ	39.6	49.2	70,060					東京機械製作所	4.3	-	-							I H I	79.5	91.8	214,353					
ツガミ	24.2	31.9	41,629					新東工業	28.2	32.6	22,689							サノヤホールディングス	15.5	17	2,227					
オークマ	13.6	16.9	81,458					澁谷工業	10.4	12.8	32,256							スター精密	18.2	22.8	33,288					
芝浦機械	12.2	16.5	50,902					アイチコーポレーション	20.5	21.7	17,967							電気機器 (18.0%)								
アマダ	171.2	229.4	251,651					小森コーポレーション	30.1	37.5	26,100							日清紡ホールディングス		72	89.8					88,812
アイダエンジニアリング	30.7	38.2	39,498					鶴見製作所	9.2	11.5	19,630							イビデン		56.8	77.2					465,516
滝澤鉄工所	3.9	4.8	5,726					住友精密工業	1.9	2.4	4,524							ユニカムノルタ	239.4	320.9	159,808					159,808
F U J I	46.6	67	168,103					日本ギア工業	6	6	1,578							ブラザー工業	144.3	179.5	398,490					398,490
牧野フライズ製作所	13.7	16	60,320					酒井重工業	1.9	2.7	7,641							ミネベアミツミ	203.7	253.4	676,831					676,831
オーエスジー	57.6	67.3	136,551					荏原製作所	49	61.1	338,494							日立製作所	568.4	707.2	4,163,993					4,163,993
ダイジェット工業	1	1.1	1,083					石井鐵工所	1.2	1.2	3,584							東芝	-	256.9	1,233,120					1,233,120
旭ダイヤモンド工業	31	38.3	23,133					西島製作所	12.2	13.5	12,433							三菱電機	1,182.4	1,470.1	2,072,841					2,072,841
DMG森精機	73.9	86.3	149,557					北越工業	12.4	14	12,600							富士電機		71.2	88.6					526,284
ソディック	25.6	32.2	25,599					ダイキン工業	150.6	187.4	4,194,949							東洋電機製造		4.7	5.9					5,658
ディスコ	15.9	21.5	693,375					オルガノ	3.8	4.2	32,550							安川電機	127.3	158.4	760,320					760,320
日東工器	5.7	8.1	13,024					トーヨーカネツ	4.4	5.5	14,069							シンプォンテクノロジー	15.4	17.7	22,319					22,319
日進工具	4.6	11.6	16,576					栗田工業	64	79.7	379,770							明電舎		20	24.9					61,104
パンチ工業	9.9	12.2	5,990					榑本チエイン	16.9	19.4	62,856							オリジン		2.6	4					5,032
富士ダイス	6.4	6.8	4,182					大同工業	4.6	6.7	6,231							山洋電気		5.7	6.6					32,802
豊和工業	6.5	7.9	6,557					木村化工機	9.8	12.2	9,064							デンヨー		10.1	12.6					21,092
OKK	4.8	5.6	4,244					アネスト岩田	20	23	18,653							PHCホールディングス		-	16.9					27,124
石川製作所	3	3.9	5,752					ダイフク	65.1	81	690,930							東芝テック		12.7	16					79,120
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613					サムコ	2.9	3.6	8,067							芝浦メカトロニクス		2.1	2.7					22,464
津田駒工業	2.4	3.4	1,975					加藤製作所	6.4	6.9	5,837							マブチモーター		32.7	34.1					122,760
エンシュー	2.4	3.5	2,289					油研工業	1.7	1.8	3,117							日本電産	284.6	381.1	3,803,759					3,803,759
島精機製作所	17.1	21.2	37,078					タダノ	57	77	74,998							ユー・エム・シー・エレクトロニクス		7	6.6					2,534
オプトラン	14.6	18.3	42,016					フジテック	40.8	54.6	147,420							トレックス・セミコンダクター		6.4	7.5					19,740
NCホールディングス	3.1	4.1	6,629					CKD	27.4	43.4	89,317							東光高岳		6	8.2					11,783
イワキ	7.6	9.4	9,428					キトー	10	12.6	21,256							ダブル・スコープ		23.2	42.3					33,163
フリュー	11.5	12.8	16,473					平和	32.9	41.1	78,090							ダイヘン		12.9	16.1					64,319
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221					理想科学工業	9.2	12.3	27,416							ヤーマン		19.3	24					21,456
日阪製作所	14.8	18.3	15,060					SANKYO	28	31.8	96,513							JVCケンウッド	101.9	119.5	22,346					22,346
やまびこ	22.6	28.3	29,941					日本金銭機械	13.2	15	9,660							ミキエンジニアリング		11	13.3					10,374
野村マクロ・サイエンス	-	3.9	16,282					マースグループホールディングス	7.6	9.4	15,199							I - P E X		5.5	6.9					11,854
平田機工	5.5	6.9	39,054					フクシマガリレイ	8.1	10.3	43,105							日新電機		27.7	34.7					50,696
ベガサスミシン製造	12.2	15	8,565					オイーズ	5.1	5.4	2,133							大崎電気工業		23.4	26.8					12,810
マルマエ	4.3	6	14,268					ダイコク電機	5.6	6.9	8,583							オムロン	98.4	122.4	1,006,984					1,006,984
タツモ	4.9	6.9	9,694					竹内製作所	19.7	22.4	63,212							日東工業		17.3	19.6					30,830
ナプテスコ	68.9	82.9	290,564					アmano	31	38.5	84,199							I D E C	15.9	18.3	42,639					42,639
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693					JUKI	16.5	20.5	15,723							正興電機製作所		2.7	4.6					4,774
レオン自動機	11.4	15.6	16,270					サンデン	16.5	20.4	3,957							不二電機工業		2.3	3.4					3,672
SMC	34.6	43.1	2,754,521					ジャノメ	10.6	12.5	9,062							ジーエス・ユサフ コーポレーション		42.4	47.9					108,733
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530					マックス	16.3	19.7	34,947							サクサホールディングス		2.8	2.9					3,822
ユニオンツール	4.4	5.5	20,405					グローリー	30.4	37.7	78,755							メルコホールディングス		4.1	3.3					12,490
オイレ工業	16.5	20.5	33,066					新晃工業	11	13.8	25,267							テクノメディア		2.8	3.5					5,533
日精工・エス・ピー機械	3.4	4.9	14,327					大和冷機工業	19	21.2	23,977							ダイモントエレクトロニックホールディングス		3.4	4.1					4,374
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121					セガサミーホールディングス	107.5	145.9	302,158							日本電気		150.2	186.9					949,452
技研製作所	10.3	12.8	49,792					日本ビストリリング	4.5	5.4	7,225							富士通	106.4	132.4	2,133,626					2,133,626
日本エアテック	3.8	6.8	7,459					リケン	5.5	6.4	17,299							沖電気工業		47.9	59.8					53,521
カワタ	3.2	4.7	5,010					T P R	16	19.9	29,631							岩崎通信機		4.4	6.3					5,134
日精歯工工業	3.2	10.4	10,649					ツパキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657							電気興業		5.7	7.9					18,264
オカダアイヨン	9.8	4.7	6,909					ホシザキ	37.2	43	373,240							サンケン電気		13.8	13.8					65,274
ワイエイシホールディングス	4.6	5.7	7,022					大豊工業	9.8	12	8,592							ナカヨ		1.9	2.2					2,494
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068					日本精工	242.6	276.6	206,620							アイホン		6.8	8.5					18,156
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356					NTN	272.6	314.8	73,348							ルネサスエレクトロニクス	508.7	796.7	1,000,655					1,000,655
日立建機	55.3	58.9	172,577					ジェイテクト	113.3	140.9	147,663							セイコーエプソン	146.6	182.4	335,980					335,980
日工	17.6	20.4	12,444					不二越	11	12.6	53,109							ワコム		85.5	114					101,688
巴工業	4.8	5.9	13,044					日本トムソン	32.2	40.2	24,964							アルバック		21.8	29.3					172,870
井関農機	11.8	13.7	18,303					T H K	73.7	83	233,977							アクセル		4.9	6.3					6,545
TOWA	11	12.6	30,769					ユースキン精機	7.9	11.7	8,154							E I Z O		10	11.5					42,435
丸山製作所	2.4	3.2	4,793					前澤給装工業	4.2	11.4	11,149							ジャパンディスプレイ		404	500					19,000
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526					イーグル工業	14.7	18.3	19,599							日本信号		27.6	37.5					33,975
ローツェ	5.2	7.4	75,924					前澤工業	7.3	8.9	5,936							京三製作所		25.4	31.6					13,272
タカキタ	4.3	5	3,050					日本ビラール工業	12.1	14.9	46,190							能美防災		15.7	19.5					40,540
クボタ	621.2	712.6	1,707,745					キッツ	36.6	49.7	33,000							ホーチキ		8.6	10.9					13,178
荏原実業	2.9	6.9	15,035					マキタ	154.2	179	711,883							星和電機		5.9	7.2					3,916

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末					
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額			
	千株	千株	千円		千株	千株		千株	千株	千円		千株	千株		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
タカラトミー	52.9	61.5	71,586	東日本旅客鉄道	208.1	258.8	1,799,954	東海運	7.9	8.6	2,631	エーアイティー	7.2	8.4	12,786	エーアイティー	7.2	8.4	12,786	エーアイティー	7.2	8.4	12,786
広済堂ホールディングス	8.1	9	6,993	西日本旅客鉄道	105.3	178.4	880,939	イーアイディー	4.1	5.8	10,481	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481	イーアイディー	4.1	5.8	10,481	内外トランスライン	4.1	5.8	10,481
エステールホールディングス	4	4	2,552	東海旅客鉄道	98.3	122.1	1,825,395	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
タカノ	4.5	5.4	3,758	西武ホールディングス	142.4	191.8	227,474	情報・通信業(8.0%)				NECネットアジア	38.3	47.8	82,789	NECネットアジア	38.3	47.8	82,789	NECネットアジア	38.3	47.8	82,789
プロネクサス	10.3	11.5	12,443	鴻池運輸	19	23.5	27,518	クロスカット	3	3.9	6,438	クロスカット	3	3.9	6,438	クロスカット	3	3.9	6,438	クロスカット	3	3.9	6,438
ホクシン	8.5	11	1,705	西日本鉄道	32.8	40.7	103,296	システナ	41.4	205.8	74,088	システナ	41.4	205.8	74,088	システナ	41.4	205.8	74,088	システナ	41.4	205.8	74,088
ウッドワン	3.4	4.6	4,590	ハマキョウワックス	9.1	10.6	30,390	デジタルアーツ	6.8	7.9	51,508	デジタルアーツ	6.8	7.9	51,508	デジタルアーツ	6.8	7.9	51,508	デジタルアーツ	6.8	7.9	51,508
大建工業	8	8.7	18,661	サカイ引越センター	5.5	6.9	30,291	日鉄ソリューションズ	17.3	20.9	75,344	日鉄ソリューションズ	17.3	20.9	75,344	日鉄ソリューションズ	17.3	20.9	75,344	日鉄ソリューションズ	17.3	20.9	75,344
凸版印刷	179.6	223.5	488,124	近鉄グループホールディングス	111.9	139.3	475,709	キョーブシステム	6.2	7.5	6,982	キョーブシステム	6.2	7.5	6,982	キョーブシステム	6.2	7.5	6,982	キョーブシステム	6.2	7.5	6,982
大日本印刷	142.8	173.8	476,038	阪急阪神ホールディングス	149.3	174.1	600,645	WOW WORLD	1.8	2.2	2,598	WOW WORLD	1.8	2.2	2,598	WOW WORLD	1.8	2.2	2,598	WOW WORLD	1.8	2.2	2,598
共同印刷	3.7	4.6	12,479	南海電気鉄道	53.1	62.3	143,788	コア	4.9	6.4	9,888	コア	4.9	6.4	9,888	コア	4.9	6.4	9,888	コア	4.9	6.4	9,888
N I S S H A	24.3	30.2	44,877	京阪ホールディングス	49.9	62.1	172,079	ラクーンホールディングス	8.2	10.3	12,318	ラクーンホールディングス	8.2	10.3	12,318	ラクーンホールディングス	8.2	10.3	12,318	ラクーンホールディングス	8.2	10.3	12,318
光村印刷	0.8	0.7	987	神戸電鉄	2.8	3.3	10,741	ソリトンシステムズ	5.8	7.3	9,300	ソリトンシステムズ	5.8	7.3	9,300	ソリトンシステムズ	5.8	7.3	9,300	ソリトンシステムズ	5.8	7.3	9,300
TAKARA & COMPANY	5.8	7.4	13,912	名古屋鉄道	92.1	114.5	209,420	ソフトウェイトホールディングス	4.5	6.4	24,128	ソフトウェイトホールディングス	4.5	6.4	24,128	ソフトウェイトホールディングス	4.5	6.4	24,128	ソフトウェイトホールディングス	4.5	6.4	24,128
アジックス	104.6	129.9	310,720	山陽電気鉄道	8.1	11	22,000	T I S	116	137.6	379,638	T I S	116	137.6	379,638	T I S	116	137.6	379,638	T I S	116	137.6	379,638
ツツミ	3	3.8	7,079	アルプス物流	—	9.9	10,038	JNSホールディングス	5.5	6.7	2,767	JNSホールディングス	5.5	6.7	2,767	JNSホールディングス	5.5	6.7	2,767	JNSホールディングス	5.5	6.7	2,767
ローランド	6.9	10.3	44,856	日本通運	38.8	—	—	電算システム	4.3	—	—	電算システム	4.3	—	—	電算システム	4.3	—	—	電算システム	4.3	—	—
小松ウオール工業	3.7	4.3	7,942	ヤマトホールディングス	157	195.2	484,681	グリ	71.1	65.7	55,647	グリ	71.1	65.7	55,647	グリ	71.1	65.7	55,647	グリ	71.1	65.7	55,647
ヤマハ	70.3	85.5	459,135	丸連	28.7	36.6	149,145	GMOペパボ	0.8	1.5	3,427	GMOペパボ	0.8	1.5	3,427	GMOペパボ	0.8	1.5	3,427	GMOペパボ	0.8	1.5	3,427
河合楽器製作所	3.3	4.1	12,209	丸全昭と運輸	9.1	11.5	36,627	コーエーテクモホールディングス	23.7	46.1	190,623	コーエーテクモホールディングス	23.7	46.1	190,623	コーエーテクモホールディングス	23.7	46.1	190,623	コーエーテクモホールディングス	23.7	46.1	190,623
クリナップ	11.4	14	7,462	セノーホールディングス	61.9	69.9	64,587	三菱総合研究所	5	6.3	24,223	三菱総合研究所	5	6.3	24,223	三菱総合研究所	5	6.3	24,223	三菱総合研究所	5	6.3	24,223
ピジョン	75.9	89	195,889	トナミホールディングス	2.3	3.4	12,546	ボルテージ	2.8	4	1,312	ボルテージ	2.8	4	1,312	ボルテージ	2.8	4	1,312	ボルテージ	2.8	4	1,312
オリバー	2.4	—	—	ニッコンホールディングス	37.6	46.8	99,216	電算	1	1.1	2,476	電算	1	1.1	2,476	電算	1	1.1	2,476	電算	1	1.1	2,476
兼松サステック	0.6	0.6	990	日本石油輸送	0.9	1.1	2,905	AGS	6.1	7.2	5,803	AGS	6.1	7.2	5,803	AGS	6.1	7.2	5,803	AGS	6.1	7.2	5,803
キングジム	10.2	12.3	10,750	福山通運	14.4	23	83,950	ファインデックス	9.7	12.1	11,240	ファインデックス	9.7	12.1	11,240	ファインデックス	9.7	12.1	11,240	ファインデックス	9.7	12.1	11,240
リンテック	25.4	31.6	81,496	セイノホールディングス	83.9	94.9	108,660	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836
イトーキ	23.3	26.8	9,326	エスライン	3	3.2	2,870	K L a b	21.2	26.3	11,440	K L a b	21.2	26.3	11,440	K L a b	21.2	26.3	11,440	K L a b	21.2	26.3	11,440
任天堂	67.7	83	4,854,670	神奈川中央交通	2.5	3.4	11,424	チャットワークスホールディングス	15.4	20.9	20,628	チャットワークスホールディングス	15.4	20.9	20,628	チャットワークスホールディングス	15.4	20.9	20,628	チャットワークスホールディングス	15.4	20.9	20,628
三菱鉛筆	19.5	24.2	29,741	日通物流	24.7	26.9	144,184	イーブリックインシアティブジャパン	1.9	—	—	イーブリックインシアティブジャパン	1.9	—	—	イーブリックインシアティブジャパン	1.9	—	—	イーブリックインシアティブジャパン	1.9	—	—
タカラスタンダード	24.5	30.5	41,541	丸和運輸機関	23.6	29.5	34,220	ネクソン	293.1	325.4	761,110	ネクソン	293.1	325.4	761,110	ネクソン	293.1	325.4	761,110	ネクソン	293.1	325.4	761,110
ココロ	56.6	70.5	119,850	C&Fロジホールディングス	11.4	14.3	19,347	アイスタイル	35.3	43.7	8,871	アイスタイル	35.3	43.7	8,871	アイスタイル	35.3	43.7	8,871	アイスタイル	35.3	43.7	8,871
ナカバヤシ	12.1	14	7,224	九州旅客鉄道	86.4	107.8	262,277	EMアパホールディングス	3	16.4	12,956	EMアパホールディングス	3	16.4	12,956	EMアパホールディングス	3	16.4	12,956	EMアパホールディングス	3	16.4	12,956
グローブライド	5.7	13.2	35,970	S Gホールディングス	211.7	263.3	622,441	エイチーム	8	9.9	7,365	エイチーム	8	9.9	7,365	エイチーム	8	9.9	7,365	エイチーム	8	9.9	7,365
オカムラ	45.4	50.6	60,517	N I P P O N EXPRESSホールディングス	—	48.2	325,350	エニジモ	10.9	15.5	9,935	エニジモ	10.9	15.5	9,935	エニジモ	10.9	15.5	9,935	エニジモ	10.9	15.5	9,935
美津濃	11.7	14.7	33,236	海運業(0.6%)				テクノスジャパン	8.9	11.2	5,084	テクノスジャパン	8.9	11.2	5,084	テクノスジャパン	8.9	11.2	5,084	テクノスジャパン	8.9	11.2	5,084
電気・ガス業(1.1%)				日本郵船	93.6	116.4	1,080,192	e n i s h	5.9	8.8	3,176	e n i s h	5.9	8.8	3,176	e n i s h	5.9	8.8	3,176	e n i s h	5.9	8.8	3,176
東京電力ホールディングス	1,002.3	1,100.2	392,771	商船三井	66.4	77.1	669,999	コロプラ	38	47.3	32,069	コロプラ	38	47.3	32,069	コロプラ	38	47.3	32,069	コロプラ	38	47.3	32,069
中部電力	361.8	449.8	504,675	川崎汽船	34.5	42.9	288,717	オルトプラス	6.8	11.2	3,550	オルトプラス	6.8	11.2	3,550	オルトプラス	6.8	11.2	3,550	オルトプラス	6.8	11.2	3,550
関西電力	448	557	595,990	N Sユナイテッド海運	5.4	7.7	27,373	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,933	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,933	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,933	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,933
中国電力	170.7	229.8	200,615	明治海運	12.3	16.5	13,447	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644
北陸電力	108.1	134.6	71,607	飯野海運	52.4	64.5	35,668	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046
東北電力	276.8	343.8	249,255	共栄タンカー	2.2	2.5	2,310	システム情報	8.5	10.9	10,235	システム情報	8.5	10.9	10,235	システム情報	8.5	10.9	10,235	システム情報	8.5	10.9	10,235
四国電力	98.2	132.5	103,880	乾汽船	5.9	9.4	22,080	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984
九州電力	261	303	249,369	空運業(0.4%)				じげん	28.2	40.6	12,504	じげん	28.2	40.6	12,504	じげん	28.2	40.6	12,504	じげん	28.2	40.6	12,504
北海道電力	110.3	127.8	64,283	日本航空	272.7	319.2	730,968	アイキューブ	6.3	14.7	11,848	アイキューブ	6.3	14.7	11,848	アイキューブ	6.3	14.7	11,848	アイキューブ	6.3	14.7	11,848
沖縄電力	23	31.4	44,117	ANAホールディングス	302.1	353.8	914,926	エンカレッジ・テクノロジ	2.2	3.4	1,846	エンカレッジ・テクノロジ	2.2	3.4	1,846	エンカレッジ・テクノロジ	2.2	3.4	1,846	エンカレッジ・テクノロジ	2.2	3.4	1,846
電源開発	94	125.2	246,644	パスコ	2.2	2.8	3,687	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248
エフオン	7.2	8.9	4,823	倉庫・運輸関連業(0.2%)				ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140	ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140	ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140	ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140
イーレックス	17.3	21.7	31,877	トラン																			

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
システムインテグレター		千株	千円	EDULAB		千株	千円	日本電信電話		千株	千円			千株	千円			千株	千円	
朝日ネット	3.2	4.8	2,654	東海ソフト	1.1	—	—	1,357.1	1,509.2	5,054.310			1,509.2	5,054.310			1,509.2	5,054.310		
e B A S E	9.4	13.3	8,246	ウイングアーク1st	1.4	2.4	2,198	930.4	1,051.8	3,938.991			930.4	1,051.8			930.4	1,051.8		
アドソル日進	13.8	17.2	9,718	東名	—	8.2	11,422	1,054.5	2,185.1	3,148.729			1,054.5	2,185.1			1,054.5	2,185.1		
アドソル日進	12.4	15.5	17,654	サバーワークス	2	3.4	6,613			234,558										
ADKソリューションズ	4.1	5.1	8,445	ヴェイツ	—	2.6	6,125			8,037										
フリート	2	3	1,911	トピラシステムズ	0.6	1.5	1,426			127,443										
コムチュア	6.9	8.6	7,808	Sansan	0.4	1.2	1,555			5,649										
サイバークム	10.7	16.2	47,968	Link-U	1.1	2.9	2,375			1,004										
アステリア	2.1	2.4	2,613	ギフティ	—	51.3	62,842			179,672										
アイル	8.3	10.4	9,318	フォーカスシステムズ	0.7	2.7	2,033			21,593										
マークラインズ	6.5	8	10,040	JMDC	5.2	12.6	13,759			24,242										
メディカル・データ・ビジョン	4.8	7.4	17,915	アルファシステムズ	1	2.6	11,414			2,014										
gumi	13.2	18.3	18,702	オビック	—	13.5	66,892			2,468										
ショーケース	16	20	11,720	ジャストシステム	7.7	9.6	8,937			9,750										
モバイルファクトリー	2.4	3.4	1,557	TDCソフト	7.9	10.7	18,136			114,570										
テラスカイ	2.4	3.3	3,392	Zホールディングス	120.1	139	174,167			405,978										
データヘルズ	3.7	5.2	7,638	トレンドマイクロ	36.6	45.6	859,104			82,720										
PCIホールディングス	5.1	6.4	7,756	IDホールディングス	16.5	20.5	101,065			866,755										
パイプHD	4.4	6.6	6,903	日本オラクル	10.2	12.6	13,154			13,261										
アイビシー	2.4	2.8	7,210	アルファシステムズ	1,593.8	2,096.9	1,214,314			8,828										
ネオジャパン	1.9	2.6	1,716	フューチャー	61.9	77.1	472,623			71,743										
P R T I M E S	2.2	4	4,300	CAC Holdings	4.5	9.4	7,980			397,903										
ラクス	2.4	3.2	8,995	S B テクノロジー	23.5	23.4	195,244			16,755										
ランドコンピュータ	—	49.6	108,723	トーセ	3.1	3.3	12,292			393,737										
ダブルスタンダード	1.5	2.5	2,052	アイティフォー	14	30.5	44,560			6,283										
オープンシア	1.5	4.5	11,101	東計電算	7.5	8.6	11,567			8,969										
マイネット	6.9	8.6	14,258	エックスネット	4.2	6.4	15,507			195,600										
アカツキ	3.8	5.1	2,565	イーエムシステムズ	3.3	4.5	3,253			11,496										
ベネフィットジャパン	4.6	6.4	18,835	ウェザーニューズ	11.9	13.9	60,395			19,813										
Ubicomホールディングス	0.9	1.1	2,327	C I J	52.9	65.7	193,552			72,614										
カナミックネットワーク	3	3.9	8,853	イーエムシステムズ	15.1	17.4	13,519			77,000										
ナムシステムコーポレーション	10.6	15.4	6,976	イーエムシステムズ	1.8	1.7	8,117			96,487										
チェンジ	5.1	7.6	1,938	イーエムシステムズ	2.2	2.5	2,407			366,800										
シンクロ・フード	16.2	26.5	37,683	イーエムシステムズ	62.8	78	333,450			19,999										
オーグネット	6.9	7.5	2,347	イーエムシステムズ	13.5	19.4	27,819			14,719										
キャピタル・アセット・プランニング	6.1	7.7	11,711	イーエムシステムズ	14.4	20.8	72,696			16,344										
セグエグループ	1.5	2.9	2,293	イーエムシステムズ	10.8	16.4	9,626			4,627,750										
エイトレード	2.9	3.8	2,200	イーエムシステムズ	19.1	23.8	88,774			501										
A O I T Y O H O L D I N G S	2.2	2.2	4,639	イーエムシステムズ	19.2	24	15,696			9,410										
マクロミル	12	—	—	イーエムシステムズ	3.4	4.5	35,640			2,502										
ビッグリー	23.6	29.5	32,509	イーエムシステムズ	7.9	9.8	7,947			14,835										
オロ	2.3	3.4	3,910	イーエムシステムズ	1.2	1.7	5,873			12,296										
ユーザローカル	3.6	4.6	10,718	イーエムシステムズ	11.6	14.9	2,547			10,487										
テモナ	1.8	4.5	6,570	イーエムシステムズ	5.7	7	12,173			44,660										
ニーズウェル	2.5	3.3	1,402	イーエムシステムズ	10.3	12.7	8,509			15,408										
マネーフォワード	2.2	3.4	2,077	イーエムシステムズ	6.9	8.7	4,845			15,408										
サインポスト	—	22	109,340	イーエムシステムズ	10	12.2	7,112			22,638										
電音システムホールディングス	2.6	4.6	4,135	イーエムシステムズ	47.3	55	150,315			6,363										
ソルクシーズ	—	6	15,768	イーエムシステムズ	25.5	30.8	3,172			306,368										
フェイス	4.4	12.2	5,099	イーエムシステムズ	9	11.4	35,454			272,877										
プロトコーポレーション	3.6	4	2,664	イーエムシステムズ	18.2	22.8	16,507			35,728										
ハイマックス	10.4	15.4	19,404	イーエムシステムズ	19.9	24.9	33,316			1,794										
野村総合研究所	2.9	4	4,788	イーエムシステムズ	40.3	45.1	141,388			8,495										
サイバネットシステム	211.8	278.9	1,126,756	イーエムシステムズ	6.4	8	30,800			20,851										
C E ホールディングス	8.2	10.3	6,509	イーエムシステムズ	4.3	7.5	10,515			396,562										
日本システム技術	6.2	7.6	3,655	イーエムシステムズ	76.9	87.7	159,877			1,101										
インテックホールディングス	2.1	2.9	6,342	イーエムシステムズ	96.6	120.4	159,891			36,647										
東邦システムサイエンス	14.4	16.6	30,892	イーエムシステムズ	12.1	14.9	10,549			4,992										
インフォコム	3	4.1	3,813	イーエムシステムズ	35.8	34.7	55,832			115,596										
シブレイクスホールディングス	54.7	61.7	9,810	イーエムシステムズ	76.3	122	55,022			93,046										
H E R O Z	10.6	15.9	30,925	イーエムシステムズ	8.5	10.6	21,571			9,895										
ラクスル	—	16.8	34,809	イーエムシステムズ	4.1	5.3	5,803			14,031										
I P S	3.2	4	3,708	イーエムシステムズ	14.2	24.6	25,682			20,286										
F I G	9.4	15.9	57,876	イーエムシステムズ	3.1	3.6	1,702			10,527										
システムサポート	2.1	4	7,356	イーエムシステムズ	4.4	13.8	34,817			7,556										
イーソル	12.6	16	4,528	イーエムシステムズ	4.8	5.5	1,826			26,937										
アルティアネットワークス	3.4	4.3	4,136	イーエムシステムズ	6.7	10.4	14,653			4,186										
	6.2	8.7	4,732	イーエムシステムズ	102	119.8	23,840			4,583										
	12.8	18.3	25,180	イーエムシステムズ	2.3	2.9	2,549			4,755										

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	千円	千円	千円		株数	株数	千円	千円	千円		株数	株数	千円	千円	千円
TOKAIホールディングス	56.6	70.4	63,219	77,000	80,000	OUGホールディングス	1.8	2.3	6,175	7,000	8,000	J Kホールディングス	10.7	11.7	11,629	12,500	13,500
黒谷	3.3	4	2,548	2,700	2,800	スターゼン	4.3	10.9	22,868	22,868	22,868	日伝	9.7	12.1	26,111	26,111	26,111
Cominix	1.7	1.8	1,317	1,317	1,317	山善	45.5	60.9	60,839	60,839	60,839	北沢産業	7.3	7.6	1,725	1,725	1,725
三洋貿易	11.6	14.7	15,199	15,199	15,199	椿本興業	1.7	2.3	9,487	9,487	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242	14,242	14,242
ビューティガレージ	1.9	2.5	7,800	7,800	7,800	住友商事	734.9	913.9	1,678,377	1,678,377	1,678,377	崎電機産業	31.1	38.7	99,962	99,962	99,962
ワイン・パートナーズ	8.5	10.9	10,823	10,823	10,823	内田洋行	4.6	6.3	28,948	28,948	28,948	東テック	3.9	4.6	11,145	11,145	11,145
ミタチ産業	3	4	3,604	3,604	3,604	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	4,289,400	4,289,400	ミスミグループ本社	14.6	181.7	630,499	630,499	630,499
シップヘルスケアホールディングス	20.6	46.5	119,551	119,551	119,551	第一実業	5.3	6.7	28,542	28,542	28,542	アルテック	8.8	10.3	3,162	3,162	3,162
明治電機工業	3.1	4.7	5,757	5,757	5,757	キヤノンマーケティングジャパン	28.9	35.9	89,821	89,821	89,821	タキヒヨー	4	4.1	5,781	5,781	5,781
デリカフーズホールディングス	5.2	6	3,222	3,222	3,222	西華産業	6.2	7.9	12,687	12,687	12,687	戴玉産業	1.9	2.2	4,037	4,037	4,037
スターティアホールディングス	2.3	3.4	2,590	2,590	2,590	佐藤商事	10	12.1	14,023	14,023	14,023	スズケン	49.3	56.6	200,647	200,647	200,647
コマダホールディングス	25.4	31.6	67,782	67,782	67,782	菱洋エレクトロ	8.8	8.6	17,397	17,397	17,397	ジェコス	8.2	10.8	8,640	8,640	8,640
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	1,521	1,521	東京産業	11	13.2	9,438	9,438	9,438	グローセル	12.9	17.1	7,609	7,609	7,609
Aセネットク	2.9	4.9	3,474	3,474	3,474	ユアサ商事	12	13.8	40,020	40,020	40,020	小売業 (4.2%)					
富士興産	3.5	3.8	3,689	3,689	3,689	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	12,750	12,750	ローソン	29.5	32.1	154,240	154,240	154,240
協栄産業	1.5	1.7	2,618	2,618	2,618	トルク	5.8	6	1,272	1,272	1,272	サンエー	8.8	11	44,935	44,935	44,935
フルサト・マルカホールディングス	-	14	30,716	30,716	30,716	阪和興業	23.2	28.9	95,370	95,370	95,370	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577	26,577	26,577
ヤマエグループホールディングス	-	9.8	10,201	10,201	10,201	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	38,352	38,352	イービーシー・マート	18.1	22.7	118,040	118,040	118,040
小野建	10.7	14.3	24,238	24,238	24,238	カナデン	9.6	12	12,060	12,060	12,060	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319	5,319	5,319
南陽	2.1	2.3	4,473	4,473	4,473	菱電商事	8.4	11.6	20,218	20,218	20,218	アスグル	10.1	32.7	54,249	54,249	54,249
佐鳥電機	7.4	9.1	8,399	8,399	8,399	フルサト工業	6.3	-	-	-	-	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445	22,445	22,445
エコトレーディング	2.6	2.9	1,722	1,722	1,722	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	183,744	183,744	アダストリア	16.1	15.5	27,125	27,125	27,125
伯東	7.1	8.7	19,783	19,783	19,783	ナイス	4.7	5.1	9,205	9,205	9,205	ジーフット	7.6	10	3,170	3,170	3,170
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	11,982	11,982	昭光通商	3.4	-	-	-	-	シー・ヴィー・エス・バイエリア	2	2.3	869	869	869
中山福	7.1	7.6	3,108	3,108	3,108	ニチモウ	1.6	2.4	6,182	6,182	6,182	くら寿司	6.9	15.1	55,115	55,115	55,115
ナガイレイベン	15.5	19.3	40,916	40,916	40,916	極東貿易	3	4.1	10,893	10,893	10,893	キャンドゥ	5.6	5.3	10,780	10,780	10,780
三菱食品	12.9	14.2	45,298	45,298	45,298	アズテナホールディングス	15.2	20.3	8,363	8,363	8,363	アイケイ	2.5	4	1,544	1,544	1,544
松田産業	8.5	10.7	25,209	25,209	25,209	三菱石油	28.7	35.6	32,716	32,716	32,716	パルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878	20,878	20,878
第一興商	17.3	27.5	91,850	91,850	91,850	稲畑産業	27.9	31.8	64,617	64,617	64,617	エディオン	49.3	66.3	73,924	73,924	73,924
メディカルホールディングス	116.7	156.2	339,266	339,266	339,266	G S Iクレオス	2.8	6.9	7,741	7,741	7,741	サーラコーポレーション	29.9	29.6	18,766	18,766	18,766
S P K	5.2	6	7,668	7,668	7,668	明和産業	10.8	13.3	14,856	14,856	14,856	ワッツ	5.2	7.2	4,960	4,960	4,960
視原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	10,675	10,675	クワサホールディングス	4.4	4.6	2,865	2,865	2,865	ハロース	4.4	6.7	18,900	18,900	18,900
アズワン	8.3	21.1	129,132	129,132	129,132	ヤマエク野	8.5	-	-	-	-	フジオフードグループ本社	9.8	12.3	16,605	16,605	16,605
スズデン	3.5	5.3	10,732	10,732	10,732	ワキタ	22.9	31	31,434	31,434	31,434	あみやき亭	2.5	3.4	9,860	9,860	9,860
尾家産業	3	3.2	3,184	3,184	3,184	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	87,373	87,373	ひらまつ	21.9	30.8	5,821	5,821	5,821
シモジマ	6.5	9	9,117	9,117	9,117	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	60,364	60,364	大黒天物産	2.7	4.7	22,419	22,419	22,419
ドウシシャ	11	13.8	20,920	20,920	20,920	ミツロコグループホールディングス	17.1	21.3	21,917	21,917	21,917	ハニースホールディングス	9.1	11.5	11,879	11,879	11,879
小津産業	2.3	2.5	4,920	4,920	4,920	シナネホールディングス	4.3	5.4	17,685	17,685	17,685	フューマライホールディングス	3.3	4	2,860	2,860	2,860
高速	6.3	8.8	12,944	12,944	12,944	伊藤忠エネクス	26	32.1	33,448	33,448	33,448	アルペン	8.9	11.2	23,990	23,990	23,990
たけびし	3.5	5.6	8,092	8,092	8,092	サンリオ	32.6	44.9	105,290	105,290	105,290	ハブ	3.6	4.8	2,836	2,836	2,836
リックス	2.2	2.5	3,875	3,875	3,875	サンワ テクノス	7.6	8.8	11,915	11,915	11,915	クオールホールディングス	15.7	17.8	23,745	23,745	23,745
丸文	10.6	12.7	9,258	9,258	9,258	リョーサン	12.8	16	36,576	36,576	36,576	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528	66,528	66,528
ハピネット	9.7	12.1	18,452	18,452	18,452	新光商事	15.9	22	19,162	19,162	19,162	ピックカメラ	69	85.7	88,271	88,271	88,271
橋本総業ホールディングス	2	3	6,027	6,027	6,027	トーホー	5.4	6.8	7,289	7,289	7,289	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,578	98,578	98,578
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	42,942	42,942	三信電気	6.4	6.8	11,131	11,131	11,131	ベッパードサービス	13.2	19.7	6,934	6,934	6,934
タカショー	7.4	11	7,271	7,271	7,271	東陽テクノカ	12.2	14.3	15,015	15,015	15,015	Mon o t a R O	82.8	183.1	337,087	337,087	337,087
マルカ	3.8	-	-	-	-	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	57,777	57,777	東京一番フーズ	2.6	4	2,372	2,372	2,372
IDOM	39.3	43.9	29,544	29,544	29,544	加賀電子	10.5	13.1	42,837	42,837	42,837	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365	4,365	4,365
進和	7	8.7	17,748	17,748	17,748	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	13,423	13,423	きちりホールディングス	3.4	4.1	1,455	1,455	1,455
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	1,382	1,382	立花エレテック	8.7	11.7	18,532	18,532	18,532	フジコロピアホールディングス	13.7	10.8	23,727	23,727	23,727
グイトロン	5	6.3	12,814	12,814	12,814	フォーバル	4.3	6.6	6,177	6,177	6,177	J. フロント リテイリング	139	172.8	185,932	185,932	185,932
シークス	14.8	20.6	27,047	27,047	27,047	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	89,624	89,624	トール・ビレスホールディングス	18.4	25	40,125	40,125	40,125
田中商事	3.1	3.3	2,128	2,128	2,128	三谷産業	15.6	17.1	5,232	5,232	5,232	マツキョココカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528	363,528	363,528
オーハンテクノカ	6.2	8.2	11,693	11,693	11,693	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	3,662	3,662	ブロンコビリー	6.1	8.3	18,467	18,467	18,467
白鋼	3.6	4.7	12,502	12,502	12,502	Smeltacホールディングス	2.6	3.4	10,642	10,642	10,642	ZOZO	68.7	99.8	306,386	306,386	306,386
ダイコー通産	1.1	1.7	2,012	2,012	2,012	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.1	1.2	2,354	2,354	2,354	トレジャー・ファクトリー	3.4	4.3	4,089	4,089	4,089
伊藤忠商事	814.6	1,012.8	3,766,603	3,766,603	3,766,603	コア商事ホールディングス	3.3	10.9	6,714	6,714	6,714	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216	45,216	45,216
丸紅	1,148.1	1,428.3	1,684,679	1,684,679	1,684,679	国際紙パルプ商事	25.5	30	9,450	9,450	9,450	ココカラファイン	10.4	-	-	-	-
高島	1.6	2.3	5,444	5,444	5,444	ヤマタネ	5.3	6.9	11,102	11,102	11,102	三越伊勢丹ホールディングス	203.4	253.3	236,582	236,582	236,582
長瀬産業	65.5	79.6	144,872	144,872	144,872	丸紅建材リース	0.9	1.1	1,967	1,967	1,967	H a m e	2.9	3.8	4,111	4,111	4,111
蝶理	7.5	8.2	14,678	14,678	14,678	日鉄物産	8.3	10.4	55,224	55,224	55,224	マーケットインタープライズ	-	1.1	860	860	860
豊田通商	116.9	145.3	717,782	717,782	717,782	泉州電業	3.3	4.1	25,953	25,953							

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
		千株	千円			千株			千株			千円			千株			千株		千円
オイシックス・ラ・大地	11.5	20.8	53,185			13.6			16.9		4,867			パロールホールディングス	23.8		32.1		72,225	
ネクステージ	19.9	29.3	85,907			8.2			10.3		48,049			藤久	2.7		—		—	
ジョイフル本田	34.2	42.4	64,660			4.8			5.5		1,545			ベルク	5.8		6.4		34,496	
鳥旗ホールディングス	3.3	5.3	9,714			3.1			3.6		2,390			大庄	6.3		8		8,256	
ホットランド	8.6	11	14,069			23.2			28.9		194,786			ファーストリテイリング	15.6		19.4		1,242,570	
すかいらーくホールディングス	130.4	186.9	280,536			5.1			7.3		17,571			サンドラッグ	43.8		54.5		162,628	
SFPホールディングス	5.7	7.2	10,188			14.2			19.3		2,952			サックス/イーホールディングス	10		13.8		7,120	
綿半ホールディングス	8.8	11	14,289			16.6			22.3		20,159			ヤマザワ	2.6		2.9		4,738	
ヨシヅホホールディングス	2.3	2.9	6,252			10.8			13.3		23,368			やまや	2.5		3		7,482	
エフエフ・スーパーマーケットホールディングス	33.9	42.3	45,684			15.3			19.3		42,884			ペルーナ	25		31.1		23,418	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6	7.6	8,109			14.6			20		16,260			銀行業 (5.6%)						
B E E N O S	5.4	7.5	13,702			20.9			26.4		9,794			島根銀行	4.3		4.5		2,533	
あさひ	8.6	12	17,112			9.9			12.9		1,380			じもとホールディングス	8		10.8		7,430	
日本調剤	7.1	8.8	12,883			14.1			17.6		22,792			めがまきファイナシアルグループ	604.6		751.7		208,220	
コスモス薬品	11.8	14.7	207,270			21.6			26.9		22,918			東京きほしファイナシアルグループ	14.6		18.3		30,707	
トーエル	5.7	6.8	5,861			13.7			16.6		35,275			九州フィナンシャルグループ	238		296.3		135,705	
オンリー	2.6	—	—			19.2			70.4		117,004			ゆうちょ銀行	330.8		342.8		402,447	
セブ&アイ・ホールディングス	455.6	566.6	3,282,880			20.3			24.9		46,961			富士第一銀行	28.6		35.7		11,424	
グレイト・レストラン・ホールディングス	62.5	77.1	58,596			0.6			0.6		562			コンピュータ・フィナンシアルグループ	709.7		828		416,484	
ツルハホールディングス	25.4	31.6	288,192			13			18		25,416			西日本フィナンシアルホールディングス	77.6		94.6		80,788	
サマルクホールディングス	9.1	11.5	18,285			12.2			14		10,668			関西あけびファイナシアルグループ	54.8		—		—	
フェリシモ	2.6	3.4	4,372			8.8			13.5		41,242			三三フィナンシアルグループ	10.2		13.7		21,344	
トリドルホールディングス	28.8	35.9	83,682			14.4			17.9		40,650			鹿児島フィナンシアルグループ	19		23.6		65,584	
TOKYO BASE	10.4	13.2	5,913			15.9			18.2		11,156			ひろぎんホールディングス	172.2		214.3		150,652	
ویلプラスホールディングス	1.9	2.5	2,425			11.7			15.3		4,758			おきなわフィナンシアルグループ	—		13.1		30,418	
JMホールディングス	8.8	9.8	16,787			23.1			28		16,856			十六フィナンシアルグループ	—		19.5		47,541	
サツドラホールディングス	1.5	7.4	4,684			18.2			22.8		21,500			北星フィナンシアルホールディングス	—		13.4		42,880	
アレンザホールディングス	6.7	11.2	12,208			18			22.4		61,219			新生銀行	95.1		94.6		221,458	
専科田中ホールディングス	3	3.9	8,037			25.7			29.7		20,582			あおぞら銀行	69.4		81		222,912	
ハロッグジャパンリミテッド	8.1	10.6	9,508			13.5			16.8		176,904			三北フィナンシアルグループ	7,977.2		9,093.4		6,731,844	
クリミアオキホールディングス	11.6	14.4	98,928			5.2			8		2,408			りそなホールディングス	1,267.6		1,659.4		901,386	
力の源ホールディングス	5.4	7.7	4,319			84.7			105.3		117,725			三井住友トラスト・ホールディングス	220.5		274.1		1,162,184	
FOOD & LIFE COMPANIES	63.9	84.7	300,685			25.4			29.1		21,155			三井住友フィナンシアルグループ	807.1		1,003.6		4,351,609	
メディカルシステムネットワーク	—	14.2	7,668			55			68.5		56,992			千葉銀行	388.8		483.8		381,718	
一家ホールディングス	10.2	2.7	1,422			2.8			5.5		14,756			群馬銀行	239.9		277.9		121,271	
藤久ホールディングス	—	3.5	2,688			98.5			114.3		259,918			武蔵野銀行	27.3		21.6		41,752	
はるやまホールディングス	6.1	6.9	3,519			9.7			11.4		37,848			千葉興業銀行	19.8		34.5		10,005	
ノジマ	20.7	23.4	58,125			6.3			6.9		2,732			筑波銀行	48.4		56.9		11,778	
カッパ・クリエイイト	16.4	20.4	27,478			448.1			557.2		1,481,594			七十七銀行	36.6		45.5		73,164	
ライトオン	8.8	11.2	8,064			23.6			26.3		86,395			青森銀行	9		11.3		22,249	
ジーンズメイト	3.6	—	—			21.5			26.8		52,474			秋田銀行	7.1		9.4		17,343	
良品計画	154.5	166.7	293,892			14.1			17.6		32,929			山形銀行	13		16.3		16,348	
三城ホールディングス	14.9	15.7	3,940			13.2			16.5		109,560			岩手銀行	7.6		9.4		18,593	
アドヴァングループ	12	14.9	14,125			14			19.7		18,064			東邦銀行	104.1		121.4		26,950	
アルピス	3.7	4.8	10,502			103.7			133.4		165,282			東北銀行	5.9		7.5		8,047	
コナカ	14.1	16.9	5,965			6			7.9		5,609			みちのく銀行	7.5		9.5		8,540	
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.2	2,026			14.3			22.8		5,198			ふくおかフィナンシアルグループ	105.1		122		289,018	
G-7ホールディングス	6.9	16.2	24,526			1.6			3		3,264			静岡銀行	283.9		353.2		323,531	
イオン北海道	15.6	25.7	29,400			1.1			—		—			十六銀行	14.6		—		—	
ゴジマ	19.9	24.8	13,392			5.1			6.4		22,848			スルガ銀行	101.6		127		63,627	
ヒマラヤ	4.3	5.1	5,232			2.3			3.4		3,910			八十二銀行	262.3		326		144,418	
コーナン商事	16.6	20.6	72,821			6.8			8.8		9,160			山梨中央銀行	13.6		16		15,472	
エコス	4.3	5.4	11,334			1.1			2.4		5,904			大垣共立銀行	23		28.8		60,307	
ワタミ	15.3	17.6	16,227			16.9			19.4		115,818			福井銀行	10		12.5		18,587	
マルシェ	3	4	1,760			3.2			4.1		10,455			北國銀行	10.9		—		—	
パルパフィイン・インターナショナルホールディングス	232.8	289.5	480,859			390.2			528.8		210,462			清水銀行	4.9		6.3		10,508	
西松屋チェーン	25.5	31.7	47,264			18.2			22.8		34,884			富士銀行	1.9		2.2		4,818	
ゼンショーホールディングス	62.5	70.8	195,903			46.3			57.6		936,000			滋賀銀行	23.3		27.3		62,844	
幸楽苑ホールディングス	7.3	9.2	12,493			8.4			12		12,144			南都銀行	17		22.8		46,603	
ハークスレイ	2	6.3	3,024			7.6			8.1		1,417			百五銀行	105.2		140		51,380	
サイゼリヤ	17.2	21.5	59,340			6			7.9		8,121			京都銀行	41.7		51.9		295,311	
VTホールディングス	43.9	54.6	24,897			38.2			50.6		121,035			紀伊銀行	41.3		49.2		74,390	
魚力	3.5	3.9	7,979			5.6			7		25,375			ほくほくフィナンシアルグループ	77.5		90.5		87,061	
ポプパ	3.3	4.6	648			15.7			22.3		24,061			山陰合同銀行	73.6		86.3		58,597	
フジ・コーポレーション	3.1	7.9	9,345			8.8			11		11,506			中国銀行	100.4		116		110,316	
ユナイテッドアローズ	13.2	15.1	27,240			7.7			9.5		56,525			鳥取銀行	4		4.2		5,191	
ハイデイド白鶴	16.8	20.9	35,927			13.2			16.4		33,029			伊予銀行	154.6		192.3		120,956	
YU-MA CREATION HOLDINGS	6.4	8.6	1,720			8.7			11.2		16,497			百十四銀行	12.2		15.4		27,273	
コロワイド	38.6	59.5	100,436			22.1			27.7		60,940			四国銀行	16.7		22.3		18,419	

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	価 額		株	数	株	価 額		株	数	株	価 額	
		千株		千円			千株		千円			千株		千円	
キャリアデザインセンター		2.5		4,194	リソルホールディングス		0.9		1.6	7,000	プロレド・パートナーズ		1.6	3	2,436
ベネフィット・ワン		41.2		153,548	テクノプロ・ホールディングス		22.5		84.1	295,191	and factory		1	3.3	1,214
エムスリー	199.3	247.9	1,042,667		アトラグループ		2.5		2.6	676	テノ・ホールディングス		0.9	2	1,206
ツカガ・グローバルホールディング		9.5		2,380	インターワークス		3.5		4.5	1,687	7フロント・マネジメント		2	3.6	2,350
プラス		1.5		1,392	アイ・アールジャパンホールディングス		4.6		6.6	32,505	ピアラ		0.6	2.3	1,258
アウトソーシング		64.7		108,514	Keep Per 技研		7.3		9	16,929	コプロ・ホールディングス		0.6	2.9	3,204
ウエルネット		11.5		6,263	ファーストロジック		2.2		2.9	2,166	ギークス		1.5	2.6	3,803
ワールドホールディングス		3.9		13,484	三機サービズ		2.3		3	2,907	カーブホールディングス		31	38.7	27,244
ディー・エヌ・エー		47.8		95,783	Gunosy		6.8		8.8	6,274	フォーラムエンジニアリング		5.8	9.9	8,613
博報堂DYホールディングス		157.2		350,124	デザインワン・ジャパン		3.5		3.6	673	FAST FITNESS JAPAN		-	2	4,224
ぐるなび		19.6		8,724	イー・ガーディアン		4.9		5.6	14,795	ダイレクトマーケティングミックス		4.4	15.2	21,964
タカミヤ		14.1		7,128	リブセンス		6.2		8.7	1,400	ポピュラスホールディングス		2.3	3.4	8,493
ジャパネット東武		8.9		8,610	ジャパンマテリアル		34.8		43.2	71,625	LITALICO		-	11.5	35,190
ファンコミュニケーションズ		31.3		13,267	ペクトル		14		19.7	20,448	アドバティビティスマネジメント		5.7	7.2	5,184
ライク		3		6,805	ウチヤマホールディングス		5.8		7.4	2,412	リリコグループ		61.7	76.9	158,337
ビジネス・ブレークスルー		5.1		2,304	チャーム・ケア・コーポレーション		8.4		10.6	12,084	東祥		7.1	10.6	16,472
エスプール		28.9		39,342	キャリアリンク		3.6		5.1	8,573	TR Eホールディングス		-	19.4	28,731
WDBホールディングス		5.2		18,513	IBJ		9.1		11.5	8,728	人・夢・技術グループ		-	5.6	10,102
手間いらず		1.1		8,496	アサンテ		4.1		6.4	10,419	エイチ・アイ・エス		16.4	31.3	64,165
ティア		7.2		3,801	N・フィールド		7.6		-	-	ラックランド		3.2	4.1	11,836
CDG		1.3		1,912	バリュウHR		4.5		5.6	13,904	共立メンテナン		18.7	25	103,875
アドウェイズ		13.7		15,863	M&Aキャピタルパートナーズ		9.3		11.6	55,042	イチネンホールディングス		11.8	14.6	18,804
パリュウ・コマース		7.5		39,032	ライオンシステムホールディングス		4.3		5.4	8,262	建設技術研究所		7.3	8.5	20,102
インフォマート		114.3		97,880	ER Iホールディングス		2.8		4	4,660	スペース		7.7	10.4	9,505
J Pホールディングス		32.6		8,246	アビスト		1.8		2.2	6,435	長 大		4.5	-	-
Eコナックホールディングス		20.7		2,288	ジグマシステムホールディングス		6.2		8.6	19,049	燦ホールディングス		4.7	6.3	9,714
E P Sホールディングス		15.3		-	ウィルグループ		8.2		10.4	13,176	スバル興業		0.7	0.7	5,537
C Lホールディングス		2.7		3,594	エスコロー・エージェンツ・ジャパン		16.6		18.9	3,553	東京テアトル		4.6	5.4	6,615
プラステック・インターナショナル		42.2		37,832	メドピア		5.3		10.9	30,498	タナベ経営		2.2	4.8	3,028
アマユーズ		6.2		16,216	レアジョブ		1.6		2.8	2,282	ナガワ		3.6	4.6	43,608
ドリームインキュベータ		3.5		8,088	リクルートホールディングス		809.3	1,083.7	6,140,244	よみうりランド		0.6	-	-	
クイック		7		15,801	エラン		15.6		19.4	19,826	東京競馬		7.3	10.7	46,224
T A C		6.3		1,952	土木管理総合試験所		5.7		6.9	2,187	常盤興産		4.7	5.4	7,317
ケネディクス		32.3		-	ネットマーケティング		5.4		6.9	3,029	カナモト		19.9	24.8	57,015
電通グループ		127	144.8	605,988	日本郵政		855.3	1,834.3	1,880,157	東京ドーム		44.5	-	-	
デアアンドガ・ニーズ		5.2		6,880	ベルシスチーム24ホールディングス		18.9		20.1	28,642	西尾レントオール		10.4	12.9	36,894
びあ		3.2		16,415	鎌倉新書		11.4		16	8,400	アゴラ ホスピタリティ・グループ		71.2	75.2	1,654
イオンファンタジー		4.3		11,718	SMN		2.4		3.4	2,046	トランス・コスモス		10.8	17.9	57,101
シーティーエス		12.6		12,976	一蔵		1.7		2.3	899	乃村工藝社		48.3	60.2	57,671
ネクシースグループ		3.5		3,445	LITALICO		4.6		-	-	藤田観光		4.4	6.2	15,196
H. U. グループホールディングス		31.7		108,411	グローバルKCOMPANY		2.1		2.7	2,130	KNT-CTホールディングス		6	8.7	12,754
アルプス技研		10		23,347	エアトリ		6.1		9	27,270	日本管財		12.2	15.1	42,083
サンックス		17.7		4,733	アトラエ		3.4		9.8	20,482	トーカイ		11	12.5	22,887
ダイオーズ		2.2		3,475	ストライク		4.2		5.3	21,995	白洋舎		1	1.7	2,050
日本空調サービス		12.2		11,730	ソラスト		27.7		34.5	36,570	セコム	111.3	138.5	1,147,749	
オリエンタルランド		120.1	166.1	3,474,812	セラク		3.5		4.6	5,602	セントラル警備保障		5.4	6.8	16,109
ダスキン		26.2		89,650	インソース		9.4		13.7	26,112	丹青社		21.1	28.7	20,635
明光ネットワークジャパン		14.2		9,322	ベイカレント・コンサルティング		7.4		9.9	402,435	メイテック		13.8	17	113,900
ファルコホールディングス		5.4		14,048	Orchestra Holdings		2.5		2.8	7,834	応用地質		13.2	16	34,160
秀英予備校		2.8		1,519	アイモバイル		4		4	4,660	船井総研ホールディングス		23.1	28.8	66,643
田谷		1.7		991	キャリアインデックス		4.6		4.8	3,609	進学会ホールディングス		4.9	5.1	1,672
ラウンドワン		38.5		57,310	MS-Japan		4.5		5.7	5,061	オオバ		7.9	10.2	7,405
リゾートトラスト		51.7		123,390	船場		1.6		1.7	1,269	いであ		2.7	3.9	6,953
ビー・エム・エル		14.6		66,339	グレイステクノロジー		5.7		-	-	学究社		3.4	4.7	7,219
ワタベウェディング		1.7		-	ジャパリエンターテインメントホールディングス		32.5		44.5	71,422	ベネッセホールディングス		41.4	46.8	106,516
りらあコミュニケーションズ		17.1		21,917	フルテック		1.8		2.2	2,893	イオンデベライト		13.9	17.3	52,332
リソノ教育		57.3		26,105	グリーンズ		4.2		5.3	2,501	ナック		5.6	7.4	7,266
早稲田アカデミー		4.4		8,104	ツナグループ・ホールディングス		1.7		3.4	1,030	ダイセキ		18.9	26	127,270
ユー・エス・エス		126.4		299,656	GAMEWITH		3.5		4.3	1,917	ステップ		4.3	5.3	9,481
東京個別指導学院		9.9		7,699	ソウルドアウト		2.7		3.5	3,174					
サイバーエージェント		69.6		508,221	MS&Consulting		1.9		2.4	1,576					
楽天グループ		526.6		705,529	ウエルビー		-		9.1	11,129					
クリーグ・アンド・リバー社		5.8		13,087	エル・ディー・エス		0.8		1.8	4,152					
モーニングスター		12.4		14,424	ミダックホールディングス		2.4		6.2	15,710					
デー・オー・ダブリュー		19.8		7,489	日総工業		8.7		11	8,558					
山田コンサルティンググループ		6.6		8,565	キューベネットホールディングス		5.2		6.6	11,180					
セントラルスポーツ		4.2		12,844	RPAホールディングス		12.8		19.7	7,052					
フルキャストホールディングス		9.8		26,460	スプリックス		3.2		4	5,788					
エン・ジャパン		20.1		66,341	マネジメントソリューションズ		5.5		6.9	22,770					
合計															
		株数	金額	124,117.8	161,644	387,140,847									
		銘柄数	比率	2,183銘柄	2,174銘柄	<97.4%>									

(注1) 銘柄柄の()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 10,035		百万円 -

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 387,140,847		% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,580,070		3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	399,720,917		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

(2022年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	399,670,143,174円
一 般 金 庫	11,420,891,042
株 式 (評 価 額)	387,140,847,090
未 収 入 金	11,243,540
未 収 入 金	655,237,202
未 収 入 金	441,924,300
(B) 負 債	2,333,527,720
未 払 金	909,720
未 払 金	2,332,618,000
(C) 純 資 産	397,336,615,454
元 本	124,570,625,521
次 期 繰 越 損 益	272,765,989,933
(D) 受 取 金	124,570,625,521円
1 万 円 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	31,896円

(注1) 期首元本額 102,109,610,506円
 追加設定元本額 163,175,331,486円
 一部解約元本額 140,714,316,471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	561,857,238円
MHAM TOP I Xオープン	2,725,686,605円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,087,968,915円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253円
D I AM国内株式バッシブ・ファンド	4,704,569,337円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,424,028円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	23,972,661円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	78,308,323円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,249,023円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,103,225円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,896,115円
たわらノーロード TOP I X	1,306,069,812円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,033,861,326円
たわらノーロード バランス(堅実型)	40,906,841円
たわらノーロード バランス(標準型)	262,619,504円
たわらノーロード バランス(積極型)	394,664,404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)	3,669,806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)	174,139,046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)	434,342,242円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	283,511,087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)	405,598,982円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	705,164円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,916,286円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	36,588,931円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,020,593円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	19,092,798円
D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円
Oneグローバルバランス	5,199,858円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,065,319,872円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,512,005,009円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,794,173,475円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	3,343,318,358円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	30,317,366円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	1,055,563,450円
マネックス資産設計ファンド エゴリユーション	18,529,124円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	304,544,955円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	306,459,778円
D I AM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	545,764,310円
投資のソムリエ	13,743,021,171円
フルズコントロール	128,837,057円
投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円
D I AMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,701,235円
D I AMコア資産設計ファンド(積極型)	5,513,567円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	41,503,360円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	20,515,309円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,618,660円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	146,712,017円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	42,977,458円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	17,916,384円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	15,092,602円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	105,875,155円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2065)	985,477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)	22,944,960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)	23,431,080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)	21,508,092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)	14,273,870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)	22,637,856円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04(適格機関投資家限定)	193,585,816円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ) 21-05	41,677,610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	84,110,969円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ) 21-07	68,984,011円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ) 21-08	47,924,787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)	22,733,018円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ) 21-09	49,987,822円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ) 21-12	70,694,127円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	329,597,803円
D I AMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	34,825,039円
日米興業総合戦略ファンド(インカム重視)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	116,640,502円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(FOF5用)(適格機関投資家限定)	39,121,859円
リスクコントロール8資産/ラップファンド(FOF5用)(適格機関投資家専用)	7,907,522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)	57,045,218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)	101,888,672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)	4,956,036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)	26,722,846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)	5,712,676円
D I AM国内重視/バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,338,373円
D I AM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,152,634円
D I AM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,835,196円
D I AMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	557,427,217円
D I AMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	634,827,723円
D I AMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,809,585,772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)	31,302,862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)	31,388,733円
D I AM 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)	301,727,248円
D I AM世界アセット/バランスファンドVA(適格機関投資家限定)	74,733,048円
D I AM世界/バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,406,645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)	349,638,945円
D I AM世界アセット/バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,826,409円
D I AM世界アセット/バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	73,311,471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)	173,199,524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)	237,769,545円
D I AM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,321,734円
D I AM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	18,177,991円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージ・ファンド<DC年金>	19,960,341円
コア資産形成ファンド	13,478,680円
MHAM TOP I XファンドVA(適格機関投資家専用)	692,612,483円
MHAM TOP I XファンドVA(適格機関投資家専用)	65,067,902円
MHAM動的パッケージ・ファンド(適格機関投資家限定)	2,686,127,829円
MHAM日本株式バッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,050,559,819円
期末元本合計	124,570,625,521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2021年2月9日 至2022年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	7,296,744,510円	
	受取配当金	7,292,821,896	
	受取利息	44,549	
	その他の収益	6,677,036	
	支払利息	△2,798,971	
(B)	有価証券売買損益	△7,496,155,473	
	売買益	39,449,298,775	
	売買損	△46,945,454,248	
(C)	先物取引等取引損益	654,522,360	
	取引益	1,686,367,190	
	取引損	△1,031,844,830	
(D)	当期損益金(A+B+C)	455,111,397	
(E)	前期繰越損益金	216,481,029,551	
(F)	解約差損益金	△309,165,756,529	
(G)	追加信託差損益金	364,995,605,514	
(H)	合計(D+E+F+G)	272,765,989,933	
	次期繰越損益金(H)	272,765,989,933	

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2022年2月15日）

（計算期間 2021年2月16日～2022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20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	（円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	ポイント 1,070,930.74	% 10.2	% 95.7	% 2.2	百万円 284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565
20期(2022年2月15日)	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8	642,642

(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

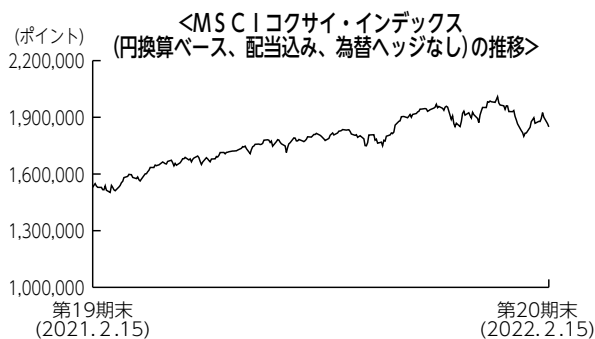
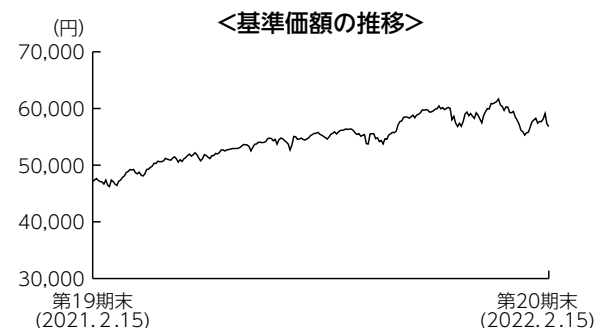
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 15日	47,083	% -	1,529,401.79	% -	% 95.5	% 2.5
2 月 末	46,501	△1.2	1,513,956.06	△1.0	95.5	2.4
3 月 末	49,621	5.4	1,611,609.95	5.4	94.8	3.1
4 月 末	51,949	10.3	1,687,947.89	10.4	94.9	3.0
5 月 末	52,709	11.9	1,713,776.65	12.1	95.8	2.2
6 月 末	54,024	14.7	1,757,211.68	14.9	94.2	3.6
7 月 末	54,788	16.4	1,782,621.67	16.6	95.5	2.3
8 月 末	56,137	19.2	1,826,693.61	19.4	95.9	1.8
9 月 末	54,830	16.5	1,784,539.69	16.7	90.4	1.7
10 月 末	58,844	25.0	1,915,338.44	25.2	95.7	2.2
11 月 末	58,620	24.5	1,907,177.99	24.7	94.2	3.1
12 月 末	61,010	29.6	1,986,097.70	29.9	95.7	2.9
2022年 1 月 末	56,736	20.5	1,847,457.63	20.8	95.5	2.3
(期 末) 2022年 2月 15日	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	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（2021年2月16日から2022年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は56,820円となり、前期末比で20.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

金融緩和策の急速な転換への懸念や新型コロナウイルス変異株の感染拡大などにより、先進国株式市場が調整する場面はあったものの、新型コロナウイルスへの警戒感後退や経済活動正常化への期待などから主要国の株式市場が上昇したことに加え、為替市場でも米ドルなど多くの通貨が対円で上昇したことがプラス寄与となり、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。前半は新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動正常化や、米国の経済対策法案への期待などから堅調に推移しました。その後はインフレ加速への懸念や、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから下落する場面もありましたが、良好な企業

決算や新型コロナウイルスへの警戒感後退などから堅調に推移しました。期末にかけては金融緩和策の急速な転換への懸念や、ウクライナ情勢の緊迫化を受け不安定な値動きとなりました。

為替市場では、米ドルは新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気悪化への懸念などからリスク回避姿勢が強まり、対円で弱含む局面もありましたが、経済活動正常化やインフレ率上昇により金融緩和策の転換が意識されたことなどから対円で上昇しました。ユーロやイギリスポンドなども対円で上昇しました。

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	12.1%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.6
3	メディア・娯楽	7.1
4	資本財	6.2
5	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.1
6	小売	5.8
7	銀行	5.6
8	ヘルスケア機器・サービス	5.1
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	各種金融	4.4

期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.8%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.5
3	銀行	6.4
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
5	メディア・娯楽	6.1
6	資本財	5.8
7	小売	5.1
8	各種金融	4.7
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	ヘルスケア機器・サービス	4.5



(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20.9%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	3円 (3) (0) (1) (0) (0)	0.006% (0.005) (0.000) (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)	14 (14) (0) (0)	0.025 (0.025) (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)	22 (0) (22)	0.040 (0.000) (0.040)	(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	39	0.071	
期中の平均基準価額は54,626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 (2021年2月16日から2022年2月15日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 204,724.74 (△1,530.59)	千アメリカ・ドル 2,595,140 (△5,237)	百株 172,588.72	千アメリカ・ドル 2,211,299
	カ ナ ダ	百株 24,833.91 (423.14)	千カナダ・ドル 166,598 (△95)	百株 22,900.88	千カナダ・ドル 140,622
	オーストラリア	百株 42,059.1 (683.68)	千オーストラリア・ドル 102,911 (△235)	百株 41,195.94	千オーストラリア・ドル 88,861
	香 港	百株 47,840 (511.64)	千香港・ドル 227,627 (△99)	百株 42,535.6	千香港・ドル 192,452
	シンガポール	百株 17,787 (2,093.13)	千シンガポール・ドル 11,615 (△444)	百株 14,922.13	千シンガポール・ドル 9,359
国	ニュージーランド	百株 2,577.86 (-)	千ニュージーランド・ドル 1,704 (-)	百株 1,816.58	千ニュージーランド・ドル 1,007
	イギリス	百株 196,421.44 (△153.18)	千イギリス・ポンド 115,835 (1,106)	百株 178,461.82	千イギリス・ポンド 102,958

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	イスラエル	百株 1,689.86 (-)	千イスラエル・シュケル 7,297 (-)	百株 1,206.41	千イスラエル・シュケル 5,097	
	スイス	百株 12,180.84 (-)	千スイス・フラン 103,265 (△222)	百株 11,124.7	千スイス・フラン 89,715	
	デンマーク	百株 3,322.56 (1,469.61)	千デンマーク・クローネ 197,176 (-)	百株 3,551.28	千デンマーク・クローネ 179,121	
	ノルウェー	百株 3,334.59 (-)	千ノルウェー・クローネ 49,197 (-)	百株 2,771.78	千ノルウェー・クローネ 38,408	
	スウェーデン	百株 20,824.18 (6,804.24)	千スウェーデン・クローナ 405,047 (-)	百株 17,585.4	千スウェーデン・クローナ 316,601	
国	ユ	アイスランド	百株 749.41 (-)	千ユーロ 5,589 (-)	百株 631.07	千ユーロ 4,649
		オランダ	百株 11,228.93 (950.19)	千ユーロ 62,517 (△86)	百株 9,414.88	千ユーロ 51,688
		ベルギー	百株 1,043.4 (-)	千ユーロ 6,196 (-)	百株 889.01	千ユーロ 5,172
		ルクセンブルグ	百株 1,209.38 (-)	千ユーロ 2,642 (-)	百株 854.02	千ユーロ 1,800
		フランス	百株 17,424.9 (1,088.41)	千ユーロ 102,391 (-)	百株 17,283.63	千ユーロ 91,357
		ドイツ	百株 16,409.95 (1,451.76)	千ユーロ 87,638 (△343)	百株 15,207.49	千ユーロ 77,479
	ロ	ポルトガル	百株 824.54 (-)	千ユーロ 856 (-)	百株 406.68	千ユーロ 507
		スペイン	百株 31,251.38 (22,513.82)	千ユーロ 23,204 (△77)	百株 49,233.07	千ユーロ 19,370
		イタリア	百株 35,574.5 (-)	千ユーロ 17,142 (△2)	百株 36,788.57	千ユーロ 14,890
		フィンランド	百株 5,643.53 (-)	千ユーロ 8,720 (-)	百株 5,301.59	千ユーロ 7,189
		オーストリア	百株 497.64 (-)	千ユーロ 2,000 (-)	百株 365.79	千ユーロ 1,468

(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	ス イ ス	証券 -	千スイス・フラン -	証券 87,844 (-)	千スイス・フラン 28 (-)

(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		千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7.915	1,611	6.133	1,247	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
BOSTON PROPERTIES INC	4.07	473	2.216	274	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	-	-	22.693	657	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	81.1	686	58.509	493	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
PROLOGIS INC	46.303	6,342	40.623	5,636	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9.677	2,226	8.65	2,022	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
CAMDEN PROPERTY TRUST	12.453	1,811	11.656	1,653	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
EQUINIX INC	6.083	4,781	5.373	4,212	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
DUKE REALTY TRUST	12.617	708	9.24	546	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28.217	5,245	25.02	4,595	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.092	988	2.464	802	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
EQUITY RESIDENTIAL	30.821	2,566	31.532	2,583	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23.858	795	19.455	665	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
SBA COMMUNICATIONS CORP	6.199	2,128	5.486	1,933	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
WELLTOWER INC	32.254	2,651	29.921	2,444	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
IRON MOUNTAIN INC	3.849	175	-	-	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22.487	1,784	22.001	1,743	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
HOST HOTELS & RESORTS INC	44.413	716	32.749	518	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
MID AMERICA	5.789	1,109	4.944	931	
	(-)	(-)	(-)	(-)	
REALTY INCOME CORP	41.631	2,829	35.88	2,454	
	(18.05)	(-)	(-)	(-)	

	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
REGENCY CENTERS CORP	3.639	260	3.473	270
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	38.514	2,062	37.282	1,986
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	21.117	2,879	17.329	2,452
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	10.449	3,254	9.007	2,855
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	5.79	1,099	4.394	857
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	19.098	1,052	13.711	712
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	23.728	1,062	21.319	914
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	48.016	1,759	39.928	1,479
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	8.076	1,464	6.463	1,122
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	19.54	3,025	15.672	2,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	76.011	1,576	75.842	1,601
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	50.845	783	52.553	814
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	23.054	1,081	17.984	838
	(△25.604)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	28.174	7,568	23.609	6,307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	20.944	1,621	17.027	1,295
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	47.749	1,885	43.017	1,704
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	5.738	100
	(5.738)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	43.226	1,246	32.427	906
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	4.337	241	4.071	223
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	84.707	247	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	49.06	236	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	49.463	231	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	119.11	1,246	126.88	1,329
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	122.45	2,770	112.622	2,653
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	179.768	543	120.66	390
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	212.6 (-)	14,716 (-)	213.1 (-)	14,405 (-)
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	295.4 (57,741)	611 (89)	291.6 (-)	604 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	478 (-)	1,446 (△6)	522 (-)	1,533 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	- (-)	- (-)	192.1 (-)	272 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	473 (-)	849 (△4)	258.6 (-)	480 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	- (-)	- (△1)	- (-)	- (-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	76.052 (-)	389 (-)	70.101 (-)	371 (-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.185 (-)	127 (-)	- (-)	- (-)
SEGRO PLC	53.28 (-)	602 (-)	33.876 (-)	385 (-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	1.093 (-)	145 (-)	- (-)	- (-)
KLEPIERRE	- (-)	- (△17)	- (-)	- (-)

(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 213,419	百万円 216,105	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	744,105,008千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	572,165,051千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	1.30

(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 (2021年2月16日から2022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		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		
AMAZON.COM INC	380.64	444.06	137,806	15,905,674		インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,585.92	1,727.2	21,206	2,447,661		ヘルスケア機器・用品
AES CORP	567.35	654.52	1,404	162,118		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	39.87	42.71	1,240	143,170		ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	798.02	873.09	11,363	1,311,548		情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,053.11	1,223.07	13,976	1,613,112		半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	429.77	464.19	22,003	2,539,594		ソフトウェア
CHUBB LTD	406.4	429.3	8,674	1,001,252		保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	198.54	216.51	5,271	608,471		化学
ALLEGHANY CORP	12.63	12.56	844	97,447		保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	-	-	-		バイオテクノロジー
ALLSTATE CORP	283.81	305.8	3,816	440,487		保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	627.86	674.78	12,597	1,453,999		コンプロマリット
AMGEN INC	524.53	552.91	12,400	1,431,220		バイオテクノロジー
HESS CORP	247.76	269.32	2,551	294,467		石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	616.15	655.69	12,612	1,455,699		消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	450.17	484.16	4,172	481,588		電力
AFLAC INC	582.83	624.14	4,008	462,629		保険
AMERICAN INTL GROUP	754.5	830.45	4,898	565,422		保険
AMERCO	9.29	9.29	536	61,889		陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	335.79	518.67	7,986	921,799		半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	192.19	-	-	-		バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	653.14	696.42	4,631	534,532		建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	374	422.88	3,794	437,912		石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	79.7	83.94	2,661	307,237		ソフトウェア
APPLE INC	15,286.24	16,106.99	272,014	31,395,953		コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	818.51	881.06	11,617	1,340,909		半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	95.36	111.8	2,545	293,797		化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	517.45	544.75	4,146	478,604		食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	92.78	-	-	-		電力
AMEREN CORP	222.73	254.36	2,165	249,926		総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	66.51	62.95	784	90,508		電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	75.7	-	-	-		自動車部品
AUTODESK INC	198.42	214.23	4,860	561,042		ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	386.31	413.9	8,359	964,905		情報技術サービス
AUTOZONE INC	21.6	20.86	4,014	463,378		専門小売り
AVERY DENNISON CORP	76.27	80.95	1,471	169,841		容器・包装
BALL CORP	288.47	315.98	2,915	336,548		容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,250.78	1,292.71	40,627	4,689,201		各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	702.98	794.62	4,884	563,772		資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	443.26	484.18	4,137	477,529		ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	260.87	280.24	7,535	869,765		ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	200.08	226.36	2,946	340,062		電気設備
VERIZON COMM INC	3,685.67	4,048.08	21,564	2,488,930		各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	125.11	128.04	1,145	132,251		保険
BEST BUY CO INC	215.6	212.38	2,137	246,697		専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	18.59	23.24	1,443	166,569		ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	273.93	286.66	3,480	401,667		ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FIRSTENERGY CORP	478	518.27	2,111	243,701		電力
BOEING CO	481.42	542.08	11,385	1,314,154		航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	111.11	112.38	1,343	155,106		専門サービス
BORGWARNER INC	219.38	209.23	894	103,262		自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,290.98	1,387.96	5,930	684,527		ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	117.19	123.82	1,104	127,492		航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	106.87	107.92	1,803	208,104		娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.08	22.29	3,156	364,326		ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,018.55	2,157.51	14,414	1,663,701		医薬品
ONEOK INC	392.84	420.2	2,643	305,158		石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	80.93	74.44	1,011	116,694		保険
UNITED RENTALS INC	61.81	69.35	2,172	250,737		商社・流通業
SEMPRA ENERGY	261.13	310.48	4,195	484,246		総合公益事業
FEDEX CORP	224.18	247.48	5,653	652,576		航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	87.62	103.4	2,208	254,871		情報技術サービス
AMPHENOL CORP	262.07	581.23	4,377	505,221		電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	260.85	297.33	1,973	227,767		飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	971.36	599	69,174		メディア
CSX CORP	686.59	2,203.61	7,474	862,723		陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	314.16	785.16	1,823	210,517		石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	166.23	203.34	895	103,336		食品
SEAGATE TECHNOLOGY	196.41	-	-	-		コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	146.75	164.21	3,840	443,218		飲料
CARDINAL HEALTH INC	247.18	290.05	1,516	175,054		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	471.45	763.02	1,629	188,112		ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	486.12	532.89	10,651	1,229,446		機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	102.58	1,330	153,538		ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	99.33	115.3	1,175	135,687		ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	921.88	913	105,445		各種電気通信サービス
CERNER CORP	272.58	285.28	2,614	301,809		ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,725.45	2,913.79	44,432	5,128,385		銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	212.87	245.63	2,396	276,616		家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128.72	144.65	1,728	199,477		保険
CINTAS CORP	80.99	89.31	3,308	381,917		商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,769.58	4,107.04	21,841	2,520,915		通信機器
CLOROX COMPANY	117.85	114.55	1,637	188,999		家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,644.71	4,005.62	24,306	2,805,410		飲料
COPART INC	186.28	203.22	2,494	287,871		商業サービス・用品
COGNEX CORP	146.77	162.62	1,028	118,717		電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	712.97	784.14	6,215	717,346		家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	256.86	265.14	4,542	524,311		ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	52.03	55.04	1,692	195,352		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	210.39	227.63	880	101,624		電力
COMCAST CORP-CL A	4,081.73	4,460.29	21,141	2,440,183		メディア
CONAGRA BRANDS INC	461.45	454.72	1,605	185,267		食品
CONSOLIDATED EDISON INC	298.44	340.89	2,830	326,646		総合公益事業
CMS ENERGY CORP	259.36	272.38	1,699	196,142		総合公益事業
COOPER COS INC	50.31	47.32	1,851	213,742		ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	165.13	169.84	839	96,858		飲料
CORNING INC	710.11	838.66	3,462	399,679		電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	133.82	847	97,785		容器・包装

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
HEICO CORP-CL A	62.36	74.77	855	98,761		航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	137.18	139.26	3,055	352,714		機械
DR HORTON INC	322.07	327.87	2,719	313,905		家庭用耐久財
DANAHER CORP	572.81	625.65	16,986	1,960,569		ライフサイエンス・ツール/サービス
MOODY'S CORP	151.99	163.35	5,283	609,865		資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	470.43	512.62	4,420	510,252		情報技術サービス
TARGET CORP	449.86	474.94	9,905	1,143,330		複合小売り
DEERE & CO	267.97	286.89	11,110	1,282,327		機械
MORGAN STANLEY	1,216.65	1,330.94	13,651	1,575,650		資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	191.36	215.52	2,555	294,946		商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	34.38	412.01	2,718	313,810		専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,619.66	1,767.79	26,667	3,077,918		娯楽
DOLLAR TREE INC	219.16	231.67	3,172	366,222		複合小売り
DOVER CORP	126.52	141.72	2,283	263,614		機械
OMNICOM GROUP	196.63	203.13	1,721	198,675		メディア
DTE ENERGY CO	177.93	184.19	2,137	246,713		総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	642.05	753.03	7,526	868,712		電力
DARDEN RESTAURANTS INC	109.02	133.37	1,912	220,774		ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	614.91	628.16	3,654	421,817		インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	6,976.37	7,384.33	35,016	4,041,603		銀行
CITIGROUP INC	1,867.17	1,979.43	13,155	1,518,383		銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	122.29	133.26	1,608	185,631		化学
EATON CORP PLC	364.97	390.25	5,938	685,414		電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	246.39	268.13	3,809	439,702		ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	214.2	226.45	701	80,945		メディア
ECOLAB INC	230.5	252.97	4,627	534,056		化学
PERKINELMER INC	97.55	118.35	2,143	247,422		ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	251.42	275.61	3,676	424,357		娯楽
SALESFORCE.COM INC	815.12	953.48	19,679	2,271,445		ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	411	47,526		保険
EMERSON ELECTRIC CO	522.99	583.88	5,486	633,277		電気設備
ATMOS ENERGY CORP	115.03	124.29	1,317	152,034		ガス
ENTERGY CORP	171.95	188.13	1,965	226,910		電力
EOG RESOURCES INC	540.41	567.51	6,436	742,858		石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	103.22	116.63	2,577	297,470		専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	202.15	226.64	6,886	794,834		パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	139.42	163.66	1,751	202,138		航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,789.44	4,127.07	32,595	3,762,184		石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	114.16	121.83	1,410	162,763		化学
NEXTERA ENERGY INC	1,752.42	1,911.83	14,323	1,653,210		電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	32.46	38.74	1,549	178,868		資本市場
FAIR ISAAC CORP	24.82	28.1	1,439	166,186		ソフトウェア
ASSURANT INC	55.23	55.23	894	103,262		保険
FASTENAL CO	504.82	549.13	2,851	329,071		商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	636.46	666.81	3,216	371,193		銀行
M&T BANK CORP	114.32	121.75	2,196	253,519		銀行
FISERV INC	514.04	576.52	5,643	651,379		情報技術サービス
FORD MOTOR CO	3,423.19	3,805.63	6,644	766,923		自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	276.05	839	96,859		資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,269.73	1,425.79	6,052	698,577		金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	-	11.92	917	105,937		銀行

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		
ARTHUR J GALLAGHER & CO	179.22	200.01	3,067	354,010		保険
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	202.22	1,082	124,963		ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	215.99	231.98	4,898	565,410		航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	538.66	588.18	3,977	459,124		食品
GENUINE PARTS CO	133.93	136.11	1,729	199,608		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,130.1	1,218.49	7,446	859,439		バイオテクノロジー
GARTNER INC	75.22	88.55	2,555	294,941		情報技術サービス
MCKESSON CORP	142.89	150.01	4,060	468,642		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	552.38	2,433.72	59,059	6,816,599		半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,857.77	1,070.26	10,338	1,193,294		コングロマリット
WW GRAINGER INC	42.34	41.48	1,934	223,289		商社・流通業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	-	309.23	1,708	197,194		ソフトウェア
HALLIBURTON CO	774.83	838.43	2,713	313,152		エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	345.68	386.22	3,189	368,076		飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	293.78	329.9	11,884	1,371,687		資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	189.69	193.75	4,259	491,575		航空宇宙・防衛
HASBRO INC	113.83	121.84	1,152	132,977		レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	115.16	143.58	1,088	125,599		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	36.23	35.96	500	57,725		航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	136.22	152.45	3,100	357,810		食品
HP INC	1,251.84	1,162.73	4,245	489,972		コンピュータ・周辺機器
F5 INC	55.29	55.57	1,076	124,301		通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	120.24	123.36	1,460	168,523		容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	352.9	1,192	137,632		通信機器
HOLOGIC INC	240.09	243.1	1,709	197,280		ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	963.81	1,028.3	36,150	4,172,538		専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	162.88	198.15	1,783	205,857		バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	262.54	290.21	1,377	158,972		食品
CENTERPOINT ENERGY INC	490.65	611.05	1,644	189,789		総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	34.21	898	103,747		建設関連製品
HUMANA INC	119.37	125.74	5,276	609,019		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	75.44	87.52	1,684	194,444		陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	938.57	1,419.2	2,228	257,172		銀行
BIOGEN INC	144.18	143.44	3,071	354,493		バイオテクノロジー
IDEX CORP	72.94	73.32	1,405	162,211		機械
ILLINOIS TOOL WORKS	275.8	307.86	6,747	778,781		機械
INTUIT INC	233.97	266.2	14,083	1,625,495		ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	77.82	82.25	4,157	479,914		ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	-	-	-		バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	218.91	230.51	3,491	402,939		建設関連製品
INTEL CORP	3,802.57	3,947.83	18,783	2,168,023		半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	199.06	239.91	3,157	364,433		化学
INTERNATIONAL PAPER CO	319.83	343.88	1,589	183,489		容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	353.17	369.48	1,296	149,599		メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	110.33	131.48	1,586	183,121		専門サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	68.74	77.48	1,318	152,187		情報技術サービス
INCYTE CORP	159.42	179.58	1,185	136,840		バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,351.55	2,569.27	42,547	4,910,787		医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	334.76	328	2,284	263,717		保険
KLA CORPORATION	141.3	147.87	5,399	623,224		半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	560.14	624.62	3,264	376,761		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	
KELLOGG CO	219.54	265.78	1,720	198,629	食品
KEYCORP	875.97	916.12	2,373	273,968	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	308.61	326.7	4,324	499,137	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	136.68	147.89	11,244	1,297,808	資本市場
KROGER CO	712.62	684.81	3,128	361,137	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	130.86	138.76	7,746	894,075	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	33.02	44.17	1,841	212,560	電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	84.38	105.55	1,551	179,108	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	141.53	152.64	1,688	194,939	情報技術サービス
PLUG POWER INC	-	526.24	1,129	130,405	電気設備
LENNAR CORP	258.81	264.83	2,399	276,903	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	771.11	791.98	18,586	2,145,309	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	-	269.67	1,483	171,282	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	180.9	170.02	1,206	139,210	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	633.18	709.53	15,183	1,752,448	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	284.52	292.04	3,948	455,755	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	225.05	244.24	9,451	1,090,875	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	217.59	223.94	1,368	158,003	保険
LOWE'S COS INC	679.92	674.34	15,236	1,758,621	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	733.73	787.03	6,197	715,357	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	458.5	387	1,727	199,440	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	215.14	249.05	2,500	288,603	食品
MCDONALD'S CORPORATION	664.19	727.78	18,441	2,128,485	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	215.72	233.63	8,894	1,026,606	資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	34.16	42.82	1,255	144,868	保険
MARKET CORPORATION	12.01	14.47	1,787	206,344	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	561.91	605.91	6,527	753,400	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	442.08	495.58	7,518	867,778	保険
MASCO CORP	231.51	232.33	1,330	153,518	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	52.58	58.93	2,174	251,016	建設資材
METLIFE INC	679.99	714.43	5,010	578,288	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235.91	-	-	-	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,200.14	1,313.85	13,441	1,551,475	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	696.43	756.57	6,166	711,684	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,175.45	1,287.35	13,259	1,530,435	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	2,257.06	2,465.91	18,856	2,176,453	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	366.51	413.6	2,426	280,029	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	85.88	92.82	2,531	292,129	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	6,425.29	6,957.86	205,256	23,690,747	ソフトウェア
MICRON TECH INC	999.6	1,090.85	9,802	1,131,390	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	218.94	533.22	3,795	438,133	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	612.87	-	-	-	半導体・半導体製造装置
3M CO	515.39	566.66	8,953	1,033,446	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	59.63	857	98,984	家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	-	136.39	1,719	198,413	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	-	54.58	1,787	206,274	ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	150.06	163.01	3,485	402,275	通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	83.46	-	-	-	陸運・鉄道
ILLUMINA INC	131.34	142.46	4,693	541,705	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	465.91	516.15	3,427	395,571	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	80.58	97.13	840	96,995	バイオテクノロジー

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
NETAPP INC	198.04	212.2	1,862	215,016		コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	333.17	404.89	1,008	116,457		家庭用耐久財
NEWMONT CORP	726.65	774.43	4,983	575,190		金属・鉱業
NOVAVAX INC	-	78.86	631	72,916		バイオテクノロジー
NVR INC	3.05	3.38	1,682	194,199		家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,116.09	1,245.17	17,630	2,034,896		繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	46.44	47.87	1,063	122,719		機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	229.57	242.35	6,598	761,594		陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	305.69	328.72	2,702	311,911		電力
NISOURCE INC	314.27	420.35	1,194	137,836		総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	173.65	200.11	2,431	280,647		資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	136.98	148.6	5,804	669,934		航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	3,503.46	4,001.7	23,149	2,671,953		銀行
NUCOR CORP	288.6	282.85	3,319	383,107		金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	191.9	231.2	2,702	311,922		石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	417.51	430.6	6,680	771,043		消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	852.06	902.66	3,721	429,554		石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	87.12	95.78	2,815	324,959		陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	-	-	-		電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	65.76	66.72	4,410	509,055		専門小売り
ORACLE CORP	1,782.61	1,632.21	12,886	1,487,336		ソフトウェア
PACCAR INC	304.46	359.38	3,341	385,677		機械
PTC INC	94.33	110.92	1,241	143,271		ソフトウェア
EXELON CORP	853.23	956.45	4,036	465,860		電力
PARKER HANNIFIN CORP	119	125.93	3,792	437,702		機械
PAYCHEX INC	298.42	313.87	3,718	429,216		情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	65.29	73.03	3,692	426,235		ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	713.2	734.82	2,083	240,444		電力
PEPSICO INC	1,235.16	1,349.24	22,491	2,596,007		飲料
PENTAIR PLC	155.64	163.39	963	111,189		機械
PFIZER INC	4,971.81	5,460.72	27,194	3,138,775		医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	229.37	215.43	972	112,190		水道
CONOCOPHILLIPS	1,233.91	1,306.12	11,957	1,380,137		石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,239.99	1,524.96	1,720	198,540		電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	181.44	222.38	4,982	575,071		石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,673.74	1,796.13	8,996	1,038,412		タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	382.89	415.17	8,493	980,277		銀行
BROWN & BROWN INC	203.08	217.93	1,437	165,962		保険
GARMIN LTD	123.65	145.29	1,754	202,506		家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	206.85	230.64	3,442	397,363		化学
IPG PHOTONICS CORP	33.53	33.53	491	56,765		電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	394.44	429.9	21,777	2,513,503		食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	200.07	218.51	3,149	363,527		資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	119.26	124.93	1,627	187,870		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,223.79	2,369.3	37,136	4,286,284		家庭用品
PROGRESSIVE CORP	528.87	569.36	6,047	697,964		保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	445.03	490.59	3,177	366,752		総合公益事業
PULTE GROUP INC	243.05	238.14	1,138	131,438		家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	271.25	283.31	4,163	480,553		情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,010	1,096.16	18,100	2,089,204		半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	107.44	197.29	2,159	249,299		資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
EXACT SCIENCES CORP	139.11	179.82	1,408	162,572		バイオテクノロジー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	40.52	—	—	—		保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	95.04	101.93	6,355	733,568		バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	60.97	—	—	—		保険
RESMED INC	132.86	140.92	3,292	379,982		ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,226.62	1,379.88	7,985	921,670		銀行
SEAGEN INC	102.96	128.63	1,601	184,853		バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	343.83	370.32	1,719	198,409		保険
ROSS STORES INC	311.97	342.98	3,233	373,184		専門小売り
ROLLINS INC	185.67	191.56	590	68,186		商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	91.27	103.18	4,562	526,605		コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	107.18	111.67	2,996	345,900		電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	158.79	212.92	1,761	203,359		ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	110.04	128.97	1,090	125,843		化学
ACCENTURE PLC-CL A	568.7	618.55	20,172	2,328,341		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,278.63	1,364.94	9,027	1,041,978		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	117.94	124.53	2,725	314,573		保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	221.48	241.52	4,124	476,042		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	557.29	599.27	6,681	771,220		情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	36.87	39.84	10,141	1,170,579		ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,309.4	1,365.54	5,366	619,409		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,376.29	1,406.74	12,342	1,424,598		資本市場
POOL CORP	35.32	43.36	1,955	225,677		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	181.87	200.7	2,347	271,004		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	133.04	135.81	1,369	158,052		食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	102.94	611	70,575		資本市場
ANTHEM INC	226.07	238.09	10,570	1,220,045		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	138.36	149.22	2,091	241,431		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	250.38	257.42	1,909	220,428		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	73.88	243.75	6,592	760,958		化学
CENTENE CORP	509.9	563.86	4,624	533,726		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	45.32	56.17	3,491	402,946		銀行
SMITH (A.O.) CORP	113.51	140.37	999	115,403		建設関連製品
SNAP-ON INC	48.25	57.83	1,218	140,643		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	372.26	375.64	4,349	502,066		保険
ADVANCE AUTO PARTS	62.26	56.94	1,277	147,397		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	350.41	362.4	2,176	251,220		電力
SOUTHERN CO	923.98	1,035.27	6,817	786,847		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,215.55	1,291.44	8,136	939,065		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	117.91	132.2	599	69,243		旅客航空輸送業
AT&T INC	6,363.97	6,960.38	16,739	1,932,097		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,721.63	1,886.45	25,782	2,975,771		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	140.26	153.85	2,528	291,806		機械
STATE STREET CORP	324.04	351.58	3,469	400,437		資本市場
STARBUCKS CORP	1,049.03	1,144.57	10,718	1,237,175		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	219.29	1,351	155,937		金属・鉱業
STRYKER CORP	304.36	331.3	8,297	957,686		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	394.98	430.24	17,062	1,969,299		娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	552.31	1,628	187,927		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	158.87	873	100,797		陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	133.81	147.52	4,351	502,221		ソフトウェア

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		
SYSCO CORP	421.71	496.62	4,071	469,965		食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	105.44	346.96	9,754	1,125,856		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	40.02	44.66	1,417	163,577		ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	1,057.57	901	103,999		医薬品
TERADYNE INC	142.84	154.54	1,735	200,327		半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	818.5	895.92	14,556	1,680,054		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	194.86	206.83	1,418	163,668		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	354.62	382.78	21,481	2,479,363		ライフサイエンス・ツール/サービス
GLOBE LIFE INC	105.78	91.68	953	110,081		保険
DAVITA INC	64.97	64.97	738	85,224		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	104.62	109.61	2,388	275,707		専門小売り
BIO-TECHNE CORP	-	42.2	1,745	201,472		ライフサイエンス・ツール/サービス
TRIMBLE INC	224.42	260.37	1,714	197,891		電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	34.73	39.35	1,838	212,228		ソフトウェア
TYSON FOODS INC	249.8	277.88	2,636	304,307		食品
UGI CORP	200.72	184.69	692	79,917		ガス
UNION PACIFIC CORP	605.64	637.38	15,459	1,784,353		陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,372.1	1,472.36	13,776	1,590,126		航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	849.87	920.02	43,645	5,037,592		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	61.53	77.37	1,022	118,073		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	81.39	-	-	-		ヘルスケア機器・用品
VF CORP	287.12	356.87	2,137	246,686		繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	493.63	570.34	1,997	230,597		メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	239.38	250.92	5,802	669,669		バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	121.7	126.76	2,330	269,042		建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	668.71	704.44	3,336	385,067		食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,264.14	1,502.63	20,127	2,323,142		食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	383.57	406.53	5,763	665,208		商業サービス・用品
WATERS CORP	52.11	57.5	1,828	211,078		ライフサイエンス・ツール/サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	-	204.18	1,248	144,132		銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	70.09	71.03	2,725	314,551		ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	103.06	99.44	1,366	157,733		食品
VAIL RESORTS INC	35.9	41.8	1,134	130,957		ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	258.67	293.01	1,548	178,768		コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	162.57	170.97	1,495	172,627		機械
WHIRLPOOL CORP	56.56	57.37	1,128	130,194		家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	153.31	159.24	2,145	247,626		半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	86.39	120.04	1,105	127,549		ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	100.97	110.34	1,897	218,960		資本市場
CME GROUP INC	321.8	348.92	8,345	963,193		資本市場
WILLIAMS COS INC	1,125.35	1,163.01	3,498	403,777		石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	236.91	287.85	1,547	178,643		販売
ALLIANT ENERGY CORP	228.29	238.72	1,357	156,694		電力
WEC ENERGY GROUP INC	290.02	305.23	2,735	315,763		総合公益事業
CARMAX INC	142.09	152.87	1,696	195,780		専門小売り
XILINX INC	214	253.18	4,934	569,595		半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,081.5	1,168.23	7,942	916,757		専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	45.61	56.09	2,391	276,060		電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,087	620	71,638		不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	206	204	1,228	141,815		コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	-	-	-		コングロマリット

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	102.39	108.82	1,617	186,717	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	—	56.1	1,858	214,564	銀行
CBRE GROUP INC	296.17	323.38	3,175	366,564	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	145.97	404	46,634	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	855.82	974.23	2,388	275,716	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	36.41	38.08	1,640	189,305	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	37.37	40.44	1,752	202,255	半導体・半導体製造装置
T-MOBILE US INC	499.8	607.01	7,618	879,336	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	302.77	367.69	1,699	196,109	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	325.92	385.15	1,718	198,353	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32.09	39.59	1,466	169,221	資本市場
CELANESE CORP	115.88	109.17	1,683	194,260	化学
DEXCOM INC	87.06	93.5	3,805	439,225	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	153.62	130.68	384	44,374	メディア
EXPEDIA GROUP INC	115.08	136.45	2,690	310,524	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	202.05	1,443	166,649	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	106.14	108.96	3,279	378,479	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23	943	108,933	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	487.85	551.66	6,886	794,888	資本市場
LIVE NATION	138.04	153.12	1,765	203,717	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	23.26	27.13	4,242	489,726	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	47.45	50.93	3,212	370,770	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	798.24	858.46	32,120	3,707,306	情報技術サービス
WESTERN UNION CO	353.67	448.68	888	102,537	情報技術サービス
OWENS CORNING	99.65	97.4	881	101,705	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	128.66	123.03	1,074	124,052	専門サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	188	21,747	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	99.59	117.8	1,706	196,931	情報技術サービス
DELTA AIR LINES INC	147.23	147.23	617	71,320	旅客航空輸送業
INSULET CORP	55.66	64.81	1,591	183,687	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	269.75	286.45	3,556	410,498	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	289.3	318.46	4,570	527,568	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	45.05	54.04	1,213	140,083	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	108.17	114.58	3,593	414,783	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	74.64	213.2	2,634	304,100	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	40.41	43.13	4,826	557,050	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	45.38	52.74	1,912	220,754	専門小売り
INVESCO LTD	334.43	369.04	842	97,200	資本市場
MSCI INC	76.17	79.74	4,249	490,523	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,392.7	1,520.6	16,611	1,917,245	タバコ
VISA INC	1,505.8	1,644.41	37,055	4,276,903	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	484.8	709.52	2,703	312,011	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	169.15	173.37	2,566	296,213	水道
DISCOVERY INC-C	304.21	303.88	891	102,871	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	595.87	618.96	4,899	565,521	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	117.44	127.87	1,141	131,707	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,859.92	1,960.57	3,370	388,990	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	172.22	170.83	1,524	175,995	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	246.36	261.91	2,623	302,749	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.84	34.82	631	72,847	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	146.41	156.99	1,961	226,442	ソフトウェア

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		
EPAM SYSTEMS INC	53.33	53.99	2,310	266,678		情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC	53.66	76.58	439	50,690		不動産管理・開発
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	148.14	—	—	—		資本市場
HCA HEALTHCARE INC	236.31	250.49	5,897	680,635		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	136.44	146.24	2,805	323,756		専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	52.57	61.52	875	101,049		医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	78.06	73.99	1,810	208,963		情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	149.86	169.47	2,910	335,986		銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	243.75	258.51	4,805	554,614		半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	116.67	136.87	1,017	117,423		専門サービス
LEAR CORP	46.81	52.16	872	100,683		自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	104.72	105.27	1,269	146,507		資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	202.43	215.54	1,619	186,930		ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	218.25	225.66	4,526	522,502		複合小売り
FORTINET INC	121.46	134.08	4,161	480,282		ソフトウェア
HORIZON PHARMA PLC	189.86	204.15	1,969	227,359		バイオテクノロジー
TESLA INC	667.04	819.66	71,782	8,285,141		自動車
GENERAC HOLDINGS INC	54.02	59.93	1,620	187,073		電気設備
ENPHASE ENERGY INC	101.63	122.17	1,758	202,953		半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,164.31	1,267.27	6,133	707,938		自動車
XPO LOGISTICS INC	76.14	—	—	—		陸運・鉄道
ALLY FINANCIAL INC	338.57	374.66	1,811	209,037		消費者金融
VOYA FINANCIAL INC	135.03	—	—	—		各種金融サービス
APTIV PLC	236.97	260.18	3,554	410,209		自動車部品
PHILLIPS 66	399.51	424.28	3,840	443,280		石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	71.72	86.28	815	94,077		ソフトウェア
META PLATFORMS INC	2,150.14	2,321.43	50,537	5,833,041		インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	168.96	185.72	4,455	514,244		ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	157.27	2,051	236,830		石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	172.89	192.63	11,164	1,288,600		ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	84.6	94.41	4,918	567,745		ソフトウェア
WORKDAY INC	155.26	186.02	4,333	500,218		ソフトウェア
ABBVIE INC	1,581.52	1,721.56	24,618	2,841,445		バイオテクノロジー
ZOETIS INC	426.6	460.53	9,046	1,044,111		医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	383.72	854	98,675		メディア
CDW CORP	127.68	129.43	2,279	263,072		電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	381.27	404.34	1,377	159,001		航空宇宙・防衛
TWILIO INC	119	158.35	3,099	357,694		情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	62.46	77.32	1,010	116,586		ソフトウェア
SNAP INC	822.23	1,027.74	4,071	469,979		インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	36.48	418.52	3,202	369,585		ソフトウェア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	195.46	221.57	1,380	159,298		娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	83.24	421	48,671		メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	143.46	725	83,767		メディア
OKTA INC	106.51	116.92	2,214	255,607		情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	130.42	167.75	1,099	126,877		ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	572.74	779.09	2,223	256,639		エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	131.81	—	—	—		食品
ALTICE USA INC-A	215.06	—	—	—		メディア
BROADCOM INC	360.27	398.94	23,081	2,664,109		半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	67.99	73.05	1,228	141,782		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		
MONGODB INC	41.88	61.01	2,623	302,746	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	56.02	68.61	1,540	177,852	専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	358.24	404.49	1,016	117,322	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	118.32	132.96	3,030	349,786	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	690.05	829.81	2,961	341,826	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	132.14	159.85	906	104,647	電気設備
EVERGY INC	210.39	223.98	1,386	160,048	電力
ALLEGION PLC	90.22	89.24	1,055	121,880	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	114.54	133.6	934	107,863	ソフトウェア
STERIS PLC	73.9	96.49	2,185	252,305	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	152.47	185.2	2,236	258,176	ソフトウェア
WIX.COM LTD	49.18	55.67	626	72,363	情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	281.7	687	79,301	ソフトウェア
KKR & CO INC	472.67	503.37	3,048	351,905	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	-	-	-	医薬品
FUTU HOLDINGS LTD ADR	-	47.58	209	24,229	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	155.78	209	2,969	342,760	ソフトウェア
MODERNA INC	240.31	334.13	4,760	549,439	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	258.78	266.16	4,030	465,195	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	186.32	213.87	769	88,816	ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	-	571.24	1,013	117,030	娯楽
CIGNA CORP	331.16	331.11	7,457	860,793	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	205.86	277.83	1,628	187,913	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	647.07	722.56	4,395	507,309	化学
AMCOR PLC	1,461.49	1,618.22	1,872	216,098	容器・包装
PINTEREST INC	420.97	521.77	1,289	148,810	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELTON INTERACTIVE INC	178.7	254.18	834	96,314	レジャー用品
FOX CORP-A	317.51	346.81	1,479	170,802	メディア
FOX CORP-B	130.09	150.8	584	67,445	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	-	408.46	672	77,599	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	130.78	182.31	3,292	380,022	ソフトウェア
CHEVY INC	65.86	90.68	477	55,084	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	445.09	486.39	1,719	198,507	ライフサイエンス・ツール/サービス
LYFT INC	-	245.89	983	113,494	陸運・鉄道
DYNATRACE INC	159.49	194.17	829	95,740	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	132.18	225.54	2,380	274,791	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	70.65	98.86	815	94,067	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	750.77	798.71	3,577	412,906	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	375.35	422.26	3,367	388,679	機械
INMODE LTD	-	55.11	251	29,005	ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	838.27	1,191.09	4,119	475,528	陸運・鉄道
CORTEVA INC	686.39	717.05	3,649	421,258	化学
MATCH GROUP INC	215.66	253.22	2,881	332,540	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	325.12	-	-	-	ソフトウェア
BILL.COM HOLDINGS INC	-	78.3	1,879	216,897	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	585.87	665.78	8,069	931,353	資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	-	32.02	263	30,379	インターネット販売・通信販売
CARLYLE GROUP INC	125.09	170.2	796	91,877	資本市場
10X GENOMICS INC	53.12	76.67	685	79,130	ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	130.21	183.67	3,018	348,408	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	-	209.24	2,220	256,309	コンピュータ・周辺機器

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
UPSTART HOLDINGS INC	—	20.8	217	25,111		消費者金融
INGERSOLL RAND INC	312.82	405.29	2,180	251,668		機械
PAYCOM SOFTWARE INC	43.3	52.5	1,815	209,490		ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	—	177.12	1,109	128,076		自動車
PPD INC	108.28	—	—	—		ライフサイエンス・ツール/サービス
ASANA INC	—	71.34	489	56,535		ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	—	53.67	577	66,647		ソフトウェア
AON PLC	208.07	220.29	6,165	711,619		保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	547.34	656	75,808		消費者金融
BENTLEY SYSTEMS INC	—	160.02	624	72,086		ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	—	39.76	776	89,602		資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	—	92.04	402	46,423		情報技術サービス
IAC/INTERACTIVECORP	70.64	72.5	954	110,189		インタラクティブ・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	—	227.11	3,853	444,730		ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	100.21	119.15	1,386	160,062		ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	—	318.81	1,533	177,030		電力
ROYALTY PHARMA PLC	103.61	355.64	1,390	160,538		医薬品
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	235.77	1,304	150,621		インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,128.66	1,248.58	1,876	216,598		医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	218.14	1,771	204,518		ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	146.71	334.59	742	85,732		ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	28.05	203.94	5,937	685,283		情報技術サービス
DOORDASH INC	—	109.22	1,060	122,418		インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	—	91.44	155	17,973		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	50.42	218.59	2,684	309,870		通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	371.77	2,439	281,616		各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	—	1,532.71	2,032	234,576		ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	344.11	367.14	3,957	456,805		専門サービス
FNF GROUP	245.67	254.51	1,216	140,415		保険
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	794.17	5,380	621,017		半導体・半導体製造装置
ROBINHOOD MARKETS INC	—	198.72	265	30,619		資本市場
LUCID GROUP INC	—	421.36	1,156	133,449		自動車
CATALENT INC	146.73	174.39	1,725	199,207		医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	454.91	599.85	2,641	304,840		消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	415.03	435.54	2,337	269,748		銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	34.57	529	61,119		ソフトウェア
WAYFAIR INC	55.43	69.59	989	114,224		インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.07	174.12	2,889	333,468		電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	37.41	43.07	2,351	271,369		ソフトウェア
QORVO INC	101.68	111.07	1,436	165,771		半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	29.47	24.25	361	41,762		メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	131.89	145.2	2,207	254,786		メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18	—	—	—		化学
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	42.57	49.59	1,235	142,645		半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	145.4	165.74	1,332	153,745		情報技術サービス
KORNIT DIGITAL LTD	—	49.78	489	56,485		機械
ETSY INC	102.37	117.13	1,670	192,850		インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	167.6	189.9	1,910	220,453		専門サービス
BLOCK INC	335.06	489.39	5,463	630,602		情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	477.57	506.8	4,019	463,981		化学
CARVANA CO	53.47	77.35	1,087	125,550		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	
COCA-COLA EURO-PACIFIC PARTNERS PLC	182.96	215.37	1,227	141,640	飲料
TELADOC HEALTH INC	104.54	147.9	1,047	120,928	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO	227.78	262.97	1,204	138,981	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	568.79	640.01	2,213	255,516	食品
NOVOCURE LTD	74.08	97.72	770	88,967	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	259.81	329.64	2,144	247,496	機械
WASTE CONNECTIONS INC	247.78	261.86	3,126	360,903	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	269	293.14	79,456	9,170,832	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,162.57	1,231.01	2,076	239,694	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	1,000.53	1,086.55	12,399	1,431,174	情報技術サービス
SEA LTD ADR	-	132.32	1,709	197,273	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	352.77	343.46	1,165	134,545	各種金融サービス
SUNRUN INC	100	162.13	366	42,291	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C	133.76	156.65	909	104,993	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	267.96	280.94	76,022	8,774,501	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	61.93	77.59	2,129	245,764	ソフトウェア
CABLE ONE INC	3.92	5.42	813	93,881	メディア
LINDE PLC	470.49	503.98	14,792	1,707,329	化学
ATHENE HOLDING LTD	118.47	-	-	-	保険
ROKU INC	95.87	119.01	1,892	218,432	娯楽
AVALARA INC	71.02	78.24	776	89,636	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	129.32	124.76	7,584	875,421	メディア
VISTRA CORP	380.32	397.58	858	99,119	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>	278,491.28 592銘柄	309,096.71 608銘柄	3,769,273 -	435,049,586 <67.7%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	205.78	455.67	3,042	275,894	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	784.79	-	-	-	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	1,559.61	1,736.87	4,663	422,885	金属・鉱業
ATCO LTD	71.93	-	-	-	総合公益事業
BALLARD POWER SYSTEMS INC	-	212.72	251	22,780	電気設備
BANK OF MONTREAL	584.93	630.76	9,381	850,695	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,094.36	1,191.19	11,020	999,374	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	291.32	326	3,339	302,800	銀行
BCE INC	149.59	72.75	483	43,836	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	1,159.24	1,379.3	9,951	902,415	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	281.92	281.92	888	80,604	医薬品
SAPUTO INC	253.95	253.95	755	68,485	食品
BLACKBERRY LTD	466.71	466.71	409	37,158	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	561.93	622.22	1,103	100,037	総合公益事業
CGI INC	198.59	229.85	2,458	222,955	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	153.58	153.58	981	89,019	容器・包装
CAE INC	250.06	304.43	967	87,730	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	326.27	346.76	959	87,006	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	315.43	373.08	2,458	222,979	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	409.56	436.21	7,043	638,742	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,007.58	1,152.17	7,725	700,530	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	58.89	1,068	96,912	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	97.93	343	31,116	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	634.82	691.09	10,810	980,316	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC	843.17	-	-	-	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	159.11	208.15	1,025	92,997		繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	252.61	258.68	1,456	132,063		ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	589	53,431		食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,278.09	1,185.75	867	78,707		金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	99.63	94.52	690	62,637		商業サービス・用品
FORTIS INC	452.28	452	2,584	234,406		電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	496.94	569.14	2,014	182,646		金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	1,011	91,698		各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	252.5	252.5	1,003	91,037		保険
IMPERIAL OIL LTD	215.42	220.66	1,241	112,593		石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,830.5	1,964.79	10,372	940,544		石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	60.69	53.66	243	22,086		資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,716.81	1,892.5	5,119	464,210		保険
LOBLAW CO LTD	151.36	154.86	1,560	141,480		食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	-	788.73	4,152	376,563		食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	270.24	302.02	2,946	267,161		自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	518.08	570.83	3,900	353,695		保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23.98	23.2	1,505	136,482		保険
METRO INC	207.6	227.64	1,534	139,171		食品・生活必需品小売り
EMERA INC	224.33	238.36	1,401	127,049		電力
ONEX CORP	66.46	64.89	595	54,028		資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	187.66	187.66	572	51,901		金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	465.51	564.39	2,363	214,337		保険
QUEBECOR INC-B	160.42	160.42	493	44,760		メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,270.82	1,394.86	20,225	1,834,045		銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	122.36	906.81	8,307	753,304		陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	434.84	426.01	1,603	145,405		メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,308.06	1,431.08	5,415	491,050		石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	643.1	643.1	767	69,629		金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	438.24	1,997	181,172		金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	150.49	167.4	2,169	196,700		専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	74.17	93.88	1,066	96,699		商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) CS	1,612.38	1,778.19	18,896	1,713,564		銀行
TC ENERGY CORP	824.24	949.79	6,328	573,863		石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	72	92.98	1,158	105,064		紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	61.84	78.86	1,101	99,878		食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	125.15	179.01	3,242	294,021		保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	409.93	470.07	2,539	230,265		金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	18.64	19.31	4,105	372,330		ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	176.52	186.23	3,394	307,771		金属・鉱業
B2GOLD CORP	1,016.75	-	-	-		金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	202.85	-	-	-		資本市場
TOURMALINE OIL CORP	-	323.64	1,497	135,762		石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	166.68	237.72	737	66,911		石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	144.97	144.97	503	45,616		石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	239.44	240.53	666	60,395		ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	504.1	564.42	2,386	216,447		石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	269.06	264.38	1,684	152,738		複合小売り
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,197.09	1,344.22	2,683	243,300		石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	175.68	234.9	853	77,364		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
TMX GROUP LTD	50.58	47.97	638	57,875		資本市場

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	218.4	—	—	—	金属・鉱業
IVANHOE MINES LTD	—	619.3	699	63,402	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD	418.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	506.3	555.64	5,191	470,751	化学
TFI INTERNATIONAL INC	—	89.99	1,223	110,963	陸運・鉄道
SSR MINING INC	180	—	—	—	金属・鉱業
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	113.46	415	37,676	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC	101.94	129.91	2,103	190,733	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	122.78	116.6	947	85,939	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	164.85	164.85	630	57,193	商業サービス・用品
NUVEI CORP	—	49.6	391	35,496	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	108.45	108.45	477	43,290	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CANADA	107.22	179.4	434	39,433	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	251.76	264.43	1,922	174,299	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	97.39	109.46	11,810	1,070,947	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	35.03	32.93	636	57,700	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	186.34	199	18,113	医薬品
HYDRO ONE LTD	273.4	357.38	1,151	104,448	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	35,759.37 87銘柄	38,115.54 86銘柄	251,560 —	22,811,543 <3.5%>
(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	168.54	171.34	1,089	89,695	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,577.13	2,757.53	7,776	640,061	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,180.22	3,565.97	8,515	700,913	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,535.17	1,622.22	3,690	303,769	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	3,644.09	3,896.81	1,582	130,223	各種電気通信サービス
AMP LTD	3,024.14	—	—	—	各種金融サービス
ASX LTD	191.62	189.26	1,569	129,172	資本市場
BHP GROUP LTD	2,637.49	3,064.96	14,812	1,219,254	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	209.46	677	55,773	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	380.4	516.04	1,189	97,947	情報技術サービス
CSL LIMITED	407.66	464.24	11,307	930,681	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	57.45	58.28	789	64,970	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,508.16	2,937.86	3,769	310,248	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	526.93	—	—	—	飲料
COCHLEAR LTD	55.33	58.75	1,116	91,912	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,328.6	1,463.6	908	74,811	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,589.4	1,728.88	17,295	1,423,610	銀行
RIO TINTO LIMITED	338.59	359.15	4,366	359,410	金属・鉱業
APA GROUP	1,182.05	1,182.05	1,182	97,294	ガス
ARISTOCRAT LEISU	517.17	620.13	2,494	205,345	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,251.8	2,694.3	1,271	104,674	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	398.39	462.46	2,159	177,725	建設資材
ORICA LTD	413.11	413.11	608	50,052	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	—	—	—	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	621.16	621.16	623	51,332	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	496.93	469.46	882	72,606	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	1,160.56	1,422.58	1,240	102,104	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	298.21	337.36	6,552	539,312	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,174.54	1,202.9	1,411	116,139	保険

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,998.19	3,188.61	9,702	798,649	銀行
NEWCREST MINING LTD	732.02	868.79	2,059	169,478	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,978.95	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
QANTAS AIRWAYS LIMITED	622.82	1,074.83	570	46,977	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,448.68	1,336.24	1,697	139,682	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	934.04	966.92	870	71,628	金属・鉱業
REECE LTD	—	303.19	605	49,811	商社・流通業
SANTOS LTD	1,596.18	3,333.93	2,573	211,848	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	401.48	406.13	1,523	125,390	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	84.06	247.11	655	53,940	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	2,056.49	2,145.97	1,115	91,850	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	1,015.75	1,094.81	5,897	485,443	複合小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD	861.96	906.41	2,486	204,645	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,117.03	1,204.4	4,084	336,163	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	99.95	155.53	283	23,337	資本市場
SEEK LTD	358.36	361.4	1,003	82,636	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	—	60.86	615	50,664	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	427	35,189	電力
AGL ENERGY LTD	490.76	—	—	—	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,271.66	1,300.28	1,224	100,818	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	415	34,188	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	1,409.64	1,502.3	594	48,967	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,501.5	1,381.66	500	41,168	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	576.67	759.03	806	66,411	飲料
XERO LTD	104.98	140.63	1,532	126,170	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD	—	228.52	627	51,650	各種消費者サービス
AFTERPAY LTD	183.22	—	—	—	情報技術サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	—	1,195.74	749	61,710	食品・生活必需品小売り
MEDIBANK PVT LTD	2,831.54	2,831.54	900	74,114	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,123.45	4,093.17	1,854	152,619	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,210.32	1,227.26	2,002	164,857	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	136.04	136.04	621	51,116	ソフトウェア
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	65,373.59 58銘柄	66,920.43 55銘柄	146,885 —	12,090,177 <1.9%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	329	—	—	—	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	2,692	39,827	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,038.6	—	—	—	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,345	1,620	12,935	191,319	電力
PCCW LTD	3,310	—	—	—	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	495	535	2,725	40,314	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,090.4	1,164.4	50,930	753,267	資本市場
MTR CORP	1,260	1,375	5,878	86,937	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD	657	758	12,726	188,229	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,154.5	1,204.5	4,185	61,905	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,345	1,460	7,285	107,751	電力
HONG KONG & CHINA GAS	9,132.92	11,754.56	14,223	210,358	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,970	2,000	9,150	135,328	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,175	3,535	11,241	166,258	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,630.66	1,630.66	5,348	79,105	不動産管理・開発
SINO LAND CO	2,554	5,054	5,195	76,841	不動産管理・開発

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,085	1,385	13,510	199,822	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	495	495	2,393	35,397	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,285	1,320	17,608	260,434	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,660	1,660	3,585	53,031	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	—	2,172	3,492	51,655	専門小売り
AIA GROUP LTD	10,872.27	11,750.27	102,462	1,515,418	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	4,450	4,841	71,607	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,988	2,520	5,544	81,995	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	—	1,330	4,176	61,765	海運業
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,188	32,363	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,497.5	1,517.5	5,455	80,685	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD	1,474	2,038	5,319	78,670	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,812	26,805	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,506	1,506	3,471	51,340	飲料
WH GROUP LTD	8,970	8,970	5,139	76,017	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,553.32	2,563.32	15,315	226,521	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,248.32	1,863.32	9,745	144,130	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	76,797.49 33銘柄	82,613.53 30銘柄	350,582 —	5,185,109 <0.8%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,095	418	35,843	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,557	1,766	6,569	562,942	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	259	22,270	不動産管理・開発
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	674	656	56,253	資本市場
CAPITALAND LTD	3,088.15	—	—	—	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,268	7,242	557	47,783	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,349	814	69,819	コングロマリット
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,716.53	3,209.53	4,281	366,882	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,768.22	8,084.22	2,061	176,647	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,608.5	1,580.5	823	70,560	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,024	1,113	3,639	311,869	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	295	25,334	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	421	762	65,368	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,814	1,814	823	70,570	食品
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	—	2,952.15	1,068	91,575	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	27,111.4 14銘柄	32,069.4 14銘柄	23,033 —	1,973,722 <0.3%>
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,102.26	1,102.26	796	60,909	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	494.49	462	35,337	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	550.91	—	—	—	食品
FISHER & PAYKEL	490.44	573.88	1,607	122,856	ヘルスケア機器・用品
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	2,629.43	1,156	88,425	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	357	27,319	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	1,241.62	1,241.62	607	46,404	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>	5,897.74 7銘柄	6,659.02 6銘柄	4,988 —	381,252 <0.1%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	317.98	352.61	489	76,550	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTAD GROUP	389.16	430.03	2,081	325,256	商社・流通業
SEVERN TRENT PLC	219.33	294.58	833	130,251	水道
BHP GROUP PLC	1,844.54	—	—	—	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	16,088.89	16,512.19	3,228	504,363	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	822.83	922.35	570	89,174	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	7,955.07	8,502.62	1,638	255,992	各種電気通信サービス
BHP GROUP LTD	—	2,059.88	5,184	810,060	金属・鉱業
BUNZL PLC	288.34	355.08	945	147,792	商社・流通業
AVIVA PLC	3,634.64	3,815.43	1,644	256,928	保険
CRODA INTERNATIONAL	125.68	136.93	1,002	156,689	化学
DIAGEO PLC	2,096.47	2,277.84	8,273	1,292,591	飲料
SCHRODERS PLC	113.54	113.54	366	57,316	資本市場
DCC PLC	78.98	106.84	679	106,132	コンプロマリット
NATIONAL GRID PLC	3,068.81	3,522.37	3,786	591,610	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,971.59	2,114.6	672	105,095	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,737.49	3,096.99	1,858	290,324	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,065.85	2,127.07	7,251	1,132,924	タバコ
HALMA PLC	319.01	342.01	796	124,505	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	114.67	131.97	944	147,590	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	877.08	896.52	1,596	249,468	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	191.07	191.07	337	52,705	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,075.54	1,255.2	4,540	709,436	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,564.43	1,721.99	3,067	479,301	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	18,255.85	19,905.53	11,111	1,736,024	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,146.92	5,733.2	1,559	243,645	保険
UNILEVER PLC	2,351.36	2,528.12	9,632	1,504,925	パーソナル用品
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	2,302.12	—	—	—	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	677.14	677.14	707	110,504	水道
RSA INSURANCE GROUP LTD	954.87	—	—	—	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	311.66	322.09	604	94,507	食品
PEARSON PLC	650.09	637.46	398	62,267	メディア
PERSIMMON PLC	281.26	336.88	823	128,690	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,268.96	2,544.6	2,994	467,937	保険
RIO TINTO PLC	1,010.08	1,091.55	6,245	975,851	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	24,232.37	27,067.74	3,694	577,267	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	645.58	692.96	4,091	639,322	家庭用品
RELX PLC	1,741.63	1,892.62	4,237	662,078	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,697.66	1,934.06	963	150,605	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	6,709.69	7,958.64	936	146,354	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	4,230.54	5,723.46	1,388	216,941	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	497.89	483.93	727	113,602	資本市場
SSE PLC	886.46	999.67	1,524	238,187	電力
BP PLC	18,382.94	19,568.09	7,838	1,224,761	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	1,084.48	924.78	631	98,598	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	403.17	354	545	85,203	コンプロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	65.74	76.48	916	143,151	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,400.93	2,427.25	1,335	208,654	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	64,953.56	69,189.54	3,577	558,885	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	3,467.94	3,467.94	527	82,466	家庭用耐久財
TESCO PLC	8,605.34	8,098.05	2,392	373,751	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	886.51	1,019.75	1,348	210,628	資本市場

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	
SMITH & NEPHEW PLC	769.28	880.29	1,061	165,869	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,499.85	4,896.01	7,692	1,201,893	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	275.89	317.95	2,185	341,476	資本市場
WPP PLC	1,115.98	1,134.03	1,353	211,465	メディア
ASTRAZENECA PLC	1,175.51	1,508.4	12,641	1,975,170	医薬品
WHITBREAD PLC	185.94	187.44	599	93,743	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	138.42	161.39	833	130,213	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	389.5	387.64	760	118,888	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	166.52	162.86	822	128,549	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,902.05	1,828.62	507	79,225	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	200.87	608	95,093	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	115.81	105.59	431	67,358	家庭用耐久財
SHELL PLC-A SHS	3,777.76	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHELL PLC-B SHS	3,238.58	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	182	180.34	350	54,831	医薬品
AVEVA GROUP PLC	104.08	104.08	278	43,548	ソフトウェア
ABRDN PLC	2,063.13	2,063.13	489	76,492	資本市場
EXPERIAN PLC	803.76	893.61	2,560	400,004	専門サービス
MONDI PLC	471.7	458.75	855	133,638	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	280.11	353.12	460	71,998	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	173.85	—	—	—	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	427.89	449.09	584	91,250	食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC	1,493.58	1,515.66	922	144,073	メディア
GLENCORE PLC	8,804.08	9,681.28	4,086	638,469	金属・鉱業
ENTAIN PLC	496.18	581.26	979	152,979	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	487.65	—	—	—	金属・鉱業
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	—	—	—	保険
COCA-COLA HBC AG	152.08	202.33	486	76,026	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	517.21	565.61	371	58,077	保険
FERGUSON PLC	205.31	216.07	2,367	369,827	商社・流通業
M&G PLC	2,049.4	2,591.17	549	85,907	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.86	2,354.9	396	61,996	専門小売り
SHELL PLC	—	7,503.11	15,047	2,351,019	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	980.62	1,046.24	667	104,323	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,246.75	4,701.29	714	111,648	コングロメラット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	266,360.93 85銘柄	284,167.37 79銘柄	184,216 —	28,781,938 <4.5%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,023.59	1,077.44	3,565	126,397	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,307.03	1,436.45	4,918	174,370	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	21.98	1,238	43,910	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,021.34	1,061.43	2,259	80,115	銀行
ICL GROUP LTD	494.11	680.48	2,206	78,236	化学
NICE LTD	55.35	61.29	5,225	185,261	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	167.84	2,047	72,594	銀行
AZRIELI GROUP	44.14	44.14	1,226	43,488	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,067.6 8銘柄	4,551.05 8銘柄	22,688 —	804,375 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,257.7	2,530.13	2,103	262,754	資本市場
LOGITECH INTL-REG	144.29	180.08	1,314	164,244	コンピュータ・周辺機器

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
NESTLE SA-REGISTERED	2,570.32	2,745.36	32,203	4,023,451	食品	
CIE FINANCIER RICHEMONT	474.14	508.16	6,654	831,395	繊維・アパレル・贅沢品	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	628.85	680.16	23,275	2,907,987	医薬品	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	34.67	41.22	917	114,639	機械	
SIKA INHABER	123.63	138.38	4,097	511,933	化学	
SGS SA-REG	5.4	6.13	1,579	197,291	専門サービス	
NOVARTIS AG-REG SHS	1,981.27	2,138.86	16,937	2,116,187	医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	42.59	42.59	683	85,405	保険	
BARRY CALLEBAUT AG	2.65	3.29	687	85,909	食品	
CLARIANT AG-REG	199.79	199.79	335	41,935	化学	
SWISSCOM AG-REG	24.89	24.19	1,325	165,621	各種電気通信サービス	
ABB LTD	1,657.76	1,605.91	5,042	630,017	電気設備	
ADECCO GROUP AG-REG	129.44	140.95	657	82,169	専門サービス	
GEBERIT AG	31.81	35.39	2,109	263,528	建設関連製品	
LONZA GROUP AG-REG	68.69	71.69	4,322	540,104	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDT & SPRUENGLI PART	0.95	1.1	1,108	138,533	食品	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.09	0.1	1,031	128,813	食品	
GIVAUDAN-REG	8.12	9.01	3,230	403,566	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	135.85	147.34	6,527	815,503	保険	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	-	36.04	1,338	167,235	医薬品	
HOLCIM LTD	478.95	511.47	2,593	323,988	建設資材	
TEMENOS GROUP	57.23	67.53	730	91,290	ソフトウェア	
BACHEM HOLDING AG	-	5	252	31,547	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SONOVA HOLDING AG	46.98	52.1	1,661	207,583	ヘルスケア機器・用品	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	45.18	49.34	1,248	156,024	海運業	
STRAUMANN HOLDING AG	9.19	11.25	1,553	194,109	ヘルスケア機器・用品	
THE SWATCH GROUP AG-B	24.41	29.91	859	107,325	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	254	31,755	繊維・アパレル・贅沢品	
SCHINDLER NAMEN	16.63	14.94	330	41,326	機械	
SWISS LIFE HOLDING AG	27.61	30.53	1,806	225,737	保険	
BANQUE CANTONALE VAUD	25	-	-	-	銀行	
VIFOR PHARMA AG	46.45	52.56	856	107,039	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING	8.27	6.16	562	70,305	化学	
SWISS PRIME SITE AG	83.37	80.4	717	89,653	不動産管理・開発	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	16.58	21.76	2,706	338,205	資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	201.18	210.08	1,222	152,707	資本市場	
SWISS RE LTD	248.71	292.13	2,864	357,906	保険	
ALCON INC	429.61	485.73	3,446	430,635	ヘルスケア機器・用品	
UBS GROUP AG	3,314.28	3,427.79	6,535	816,493	資本市場	
VAT GROUP AG	-	24.12	819	102,400	機械	
小 計	株 数 銘 柄 数 < 金 額 数 < 比 率 >	15,648.45 39銘柄	16,704.59 41銘柄	148,505 -	18,554,267 <2.9%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	99.74	104.57	10,765	188,826	飲料	
A P MOLLER A/S	5.68	5.27	11,936	209,367	海運業	
AP MOLLER MAERSK A	2.55	3.41	7,311	128,235	海運業	
DANSKE BANK A/S	593.05	687.25	9,002	157,912	銀行	
GENMAB A/S	61.9	62.51	13,745	241,103	バイオテクノロジー	
NOVOZYMES-B SHS	177.4	191.32	7,444	130,572	化学	
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	8.13	8.13	1,990	34,908	建設関連製品	
NOVO NORDISK A/S-B	1,540.44	1,640.82	105,521	1,850,840	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	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
GN STORE NORD A/S	128.95	104.48	3,823	67,072	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	181.27	979.91	15,952	279,814	電気設備
COLOPLAST-B	107.34	119.22	10,925	191,630	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	190.49	198.61	25,044	439,284	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	107.39	107.39	2,870	50,349	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	48.4	—	—	—	医薬品
TRYG A/S	111.07	357.84	5,439	95,403	保険
PANDORA A/S	82.51	92.65	6,650	116,648	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	93.36	89.84	4,288	75,228	化学
AMBU A/S B	141.56	141.56	1,705	29,919	ヘルスケア機器・用品
ORSTED A/S	164.71	192.05	12,586	220,775	電力
小 計	株 数 3,845.94 銘柄 数 <比率> 19銘柄	株 数 5,086.83 銘柄 数 18銘柄	257,006	4,507,892	<0.7%>
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	435.37	432.02	10,161	132,094	食品
DNB ASA	807.09	—	—	—	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,290.36	1,290.36	9,984	129,802	金属・鉱業
TELENOR ASA	630.38	674.35	9,258	120,364	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	75.37	75.37	1,746	22,702	メディア
ORKLA ASA	652.83	694.4	5,862	76,207	食品
EQUINOR ASA	831.49	943.06	25,816	335,611	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	151.93	151.93	6,730	87,496	化学
AKER BP ASA	—	152.17	4,129	53,688	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	294.84	6,262	81,411	保険
ADEVINTA ASA	222.65	222.65	1,847	24,023	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	—	895.96	19,003	247,043	銀行
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	1,514	19,686	メディア
小 計	株 数 5,338.75 銘柄 数 <比率> 11銘柄	株 数 5,901.56 銘柄 数 12銘柄	102,317	1,330,132	<0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	564.89	636.97	31,695	389,856	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	360.51	401.9	17,474	214,937	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,649.68	2,794.5	32,175	395,763	通信機器
GETINGE AB-B SHS	—	244.21	8,667	106,604	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	—	557.33	11,531	141,833	各種金融サービス
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,471	42,702	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	348.49	322.28	6,055	74,484	機械
SANDVIK AB	1,034	1,143.71	26,637	327,635	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,449.9	1,664.38	20,072	246,890	銀行
SKANSKA AB-B SHS	316.53	319.68	7,624	93,779	建設・土木
SWEDBANK AB	798.25	893.78	15,061	185,262	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	529.45	543.82	8,807	108,328	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,392.3	1,340.2	12,981	159,668	銀行
VOLVO AB-A SHS	—	236.91	5,041	62,009	機械
VOLVO AB-B SHS	1,305.9	1,342.82	28,320	348,336	機械
SWEDISH MATCH AB	138.45	1,583.29	11,026	135,620	タバコ
TELE2 AB-B SHS	470.55	460.83	6,020	74,055	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	119.55	142.73	4,104	50,490	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	119.4	3,371	41,473	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	252.19	4,546	55,927	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	483.54	5,751	70,746	商業サービス・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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
INVESTOR AB-B SHS	395.67	1,694.19	33,029	406,268	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	688.14	662.7	11,793	145,058	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	870.21	1,010.25	26,418	324,941	建設関連製品
TELIA CO AB	2,104.77	2,699.54	10,043	123,536	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB	147.39	207.62	7,019	86,341	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	283.76	240.47	9,638	118,547	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	283.92	279.3	7,932	97,565	機械
KINNEVIK AB-B	217.22	214.49	5,430	66,799	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	89.67	114.01	6,687	82,260	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	90.09	-	-	-	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	451.58	5,477	67,375	機械
NIBE INDUSTRIER AB	288.34	1,340.88	11,416	140,419	建設関連製品
HEXAGON AB-B SHS	265.34	1,852.43	22,738	279,684	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	-	183.48	4,678	57,548	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	607.5	593.63	11,273	138,658	機械
EPIROC AB-B	308.99	389.43	6,308	77,597	機械
ESSITY AB-B	521.43	576.54	15,249	187,568	家庭用品
EQT AB	209.34	300.03	10,171	125,103	資本市場
EMBRACER GROUP AB	-	491.42	4,155	51,118	娯楽
LIFCO AB	-	257.38	5,237	64,423	コングロマリット
EVOLUTION AB	136.41	161.47	17,115	210,524	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	2,957.52	3,102.72	34,018	418,424	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	149.45	149.45	3,987	49,044	コングロマリット
SINCH AB	-	562.99	5,393	66,339	ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,051.27 38銘柄	33,094.29 44銘柄	545,655 -	6,711,557 <1.0%>
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	716.53	755.8	3,302	431,120	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	141.28	175.84	2,343	305,910	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	147.3	149.68	1,607	209,883	食品
KINGSPAN GROUP PLC	134.52	143.07	1,244	162,509	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	208.7	242.28	1,139	148,765	容器・包装
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,348.33 5銘柄	1,466.67 5銘柄	9,636 -	1,258,190 <0.2%>
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	531.76	575.35	6,691	873,618	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	152.1	168.59	2,683	350,306	化学
ING GROEP NV-CVA	3,448.92	3,804.32	4,902	640,037	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	-	42.71	1,167	152,398	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	126.01	112.39	707	92,326	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	992.8	1,063.9	3,060	399,623	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	226.83	245.94	2,291	299,136	飲料
AKZO NOBEL	179.59	187.17	1,717	224,184	化学
ASML HOLDING NV	380.98	403.14	22,563	2,945,922	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,503.49	1,893.23	909	118,770	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	829.19	886.59	2,596	338,983	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	257.15	266.29	2,328	304,001	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	541.76	650.99	2,545	332,323	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	207.63	204.27	876	114,412	ライフサイエンス・ツール/サービス
VOPAK (KON.)	53.64	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	3,478.24	3,414.47	1,051	137,304	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HEINEKEN HOLDING NV-A	100.04	106.67	804	105,077	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	553.04	553.04	574	75,020	飲料
FERRARI NV	115.42	120.5	2,335	304,895	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	893.78	1,061.55	1,480	193,272	機械
PROSUS NV	442.19	906.79	6,150	803,042	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV	73.08	73.08	191	25,065	食品
EURONEXT NV	—	96.19	795	103,796	資本市場
IMCD NV	—	53.59	757	98,933	商社・流通業
NN GROUP NV	252.74	281.24	1,418	185,209	保険
ARGENX SE	38.79	42.55	1,073	140,160	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	—	679.41	1,426	186,277	娯楽
STELLANTIS NV	1,769.58	1,962.48	3,206	418,665	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	108.36	160.29	615	80,350	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV	342.51	343.82	443	57,871	銀行
EXOR NV	99.66	99.66	719	93,891	各種金融サービス
ADYEN NV	15.89	19.2	3,605	470,717	情報技術サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	17,715.17 28銘柄	20,479.41 31銘柄	81,691 —	10,665,597 <1.7%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	176.54	177.49	573	74,918	化学
KBC GROUPE	210.38	265.87	2,042	266,726	銀行
SOFINA	13.82	13.82	469	61,347	各種金融サービス
SOLVAY SA	71.83	69.31	736	96,192	化学
AGEAS	143.65	170.55	754	98,509	保険
UCB SA	105.71	127.78	1,085	141,705	医薬品
COLRUYT NV	46.73	46.73	168	21,988	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	99.04	107.14	995	129,922	各種金融サービス
PROXIMUS	137.39	137.39	247	32,296	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	34.26	—	—	—	バイオテクノロジー
ELIA GROUP	28.62	28.62	325	42,560	電力
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	663.27	740.93	4,035	526,920	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,731.24 12銘柄	1,885.63 11銘柄	11,436 —	1,493,086 <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)	615.94	639.79	1,685	220,020	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	113.3	139.43	1,185	154,733	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	369.59	529.85	609	79,588	エネルギー設備・サービス
SES FDR	288.47	—	—	—	メディア
AROUNDTOWN SA	830.54	1,060.18	560	73,222	不動産管理・開発
INPOST SA	—	203.95	128	16,746	航空貨物・物流サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,217.84 5銘柄	2,573.2 5銘柄	4,169 —	544,311 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	412	465.78	6,619	864,263	化学
AXA SA	1,694.93	1,895.06	5,225	682,257	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	507.07	674.38	2,124	277,436	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	2.95	29.5	340	44,408	航空宇宙・防衛
DANONE	543.15	632.31	3,462	452,067	食品
SAFRAN SA	280.36	333.08	3,737	488,010	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	173.8	173.8	575	75,108	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	214.17	202.22	649	84,776	建設・土木

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		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BNP PARIBAS	1,017.91	1,099.14	6,787	886,135		銀行
THALES SA	105.13	104.48	867	113,301		航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	149.12	155.19	2,996	391,251		情報技術サービス
NATIXIS	701.66	—	—	—		資本市場
EIFFAGE	84.65	84.77	813	106,248		建設・土木
PUBLICIS GROUPE	185.95	253.45	1,604	209,462		メディア
FAURECIA	61.17	107.74	445	58,165		自動車部品
L'OREAL	224.47	245.54	8,670	1,131,957		パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	248.73	270.69	18,136	2,367,866		繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	708.07	345	45,094		娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	148.02	162.26	2,348	306,648		自動車部品
PERNOD-RICARD	190.38	204.47	3,890	507,883		飲料
RENAULT SA	190.19	190.19	653	85,382		自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.47	324	42,369		飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	445.6	491.74	2,981	389,254		建設関連製品
SEB SA	22.18	24.39	328	42,925		家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	695.95	788.64	2,665	347,969		銀行
VINCI S.A.	472.57	523.44	5,236	683,676		建設・土木
SODEXO	91.78	93.25	788	102,925		ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	483.76	528.92	7,517	981,420		電気設備
VIVENDI SE	709.95	687.46	805	105,147		メディア
TOTALENERGIES SE	2,258.11	2,445.35	12,503	1,632,401		石油・ガス・消耗燃料
VALEO	196.53	253.93	646	84,440		自動車部品
ORANGE	1,840.93	1,917.27	2,086	272,396		各種電気通信サービス
HERMES INTL	28.8	30.76	3,649	476,501		繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	121.83	645.96	2,601	339,665		ソフトウェア
KERING	68.27	72.93	4,493	586,729		繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	305	39,864		保険
CARREFOUR SA	499.26	611.89	1,052	137,447		食品・生活必需品小売り
ATOS SE	89.72	—	—	—		情報技術サービス
SANOFI	1,014.54	1,108.56	10,220	1,334,443		医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	76.86	71.51	360	47,092		娯楽
TELEPERFORMANCE	53.12	59.18	1,896	247,558		専門サービス
EURAZEO	52.29	30.08	212	27,687		各種金融サービス
ESSILORLUXOTTICA	249.84	278.64	4,582	598,292		繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	986.85	1,149.26	1,558	203,464		銀行
ORPEA	49.32	49.32	182	23,850		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	22.2	206	26,926		各種金融サービス
ILIAD SA	10.46	—	—	—		各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	46.12	466	60,846		ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	23.87	24.56	865	112,998		ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,660.61	1,774.63	2,537	331,278		総合公益事業
ALSTOM	217.79	285.33	733	95,739		機械
ELECTRICITE DE FRANCE	547.78	415.49	338	44,134		電力
IPSEN SA	36.46	36.46	340	44,450		医薬品
ARKEMA SA	63.93	60.09	750	97,988		化学
LEGRAND SA	238.06	259.78	2,216	289,378		電気設備
ADP	23.13	23.13	299	39,061		運送インフラ
SCOR SE	156.67	—	—	—		保険
BUREAU VERITAS SA	298.1	298.1	730	95,392		専門サービス
GETLINK	376.46	415.25	574	75,006		運送インフラ

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SUEZ SA	266.2	-	-	-	総合公益事業
EDENRED	214.88	248.65	953	124,530	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	80.92	80.92	292	38,213	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	223.86	235.7	1,071	139,955	情報技術サービス
AMUNDI SA	59.24	59.24	402	52,555	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,068.91 64銘柄	24,298.59 59銘柄	150,074 -	19,593,711 <3.0%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	172.02	184.33	4,260	556,288	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	312.17	329.21	3,048	397,967	自動車
COMMERZBANK AG	831.18	1,062.15	910	118,885	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	390.3	388.3	1,420	185,447	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	98.82	98.82	340	44,460	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	203	26,631	化学
HANNOVER RUECK SE	48.68	53.21	913	119,281	保険
GEA GROUP AG	118.38	164.92	670	87,484	機械
CONTINENTAL AG	103.36	97.95	859	112,243	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	869.75	959.37	4,912	641,432	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	126.49	159.12	1,360	177,582	自動車
MERCK KGAA	118.74	123.64	2,176	284,187	医薬品
RWE AG	592.73	644.26	2,352	307,186	総合公益事業
SAP SE	934.54	1,015.97	10,706	1,397,813	ソフトウェア
E.ON SE	2,098.42	2,086.41	2,491	325,247	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	86.02	103.66	730	95,345	家庭用品
SIEMENS AG-REG	686.52	746.31	10,411	1,359,263	コンゴロマリット
PUMA AG	92.39	104.48	918	119,876	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	887.08	948.61	5,005	653,559	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	162.41	175	1,286	167,978	家庭用品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	780.56	827.56	6,149	802,891	自動車
BASF SE	832.15	895.92	5,953	777,274	化学
BEIERSDORF AG	83.71	103.42	904	118,120	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	17.07	-	-	-	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	145.71	140.32	900	117,542	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	201.91	188.36	1,089	142,192	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	375.04	401.57	8,959	1,169,690	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	279.9	702.48	512	66,943	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	123.01	135.09	3,547	463,156	保険
VOLKSWAGEN AG	27.58	31.53	757	98,962	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	163.61	179.03	3,270	427,045	自動車
NEMETSCHKE SE	50.95	48.41	370	48,414	ソフトウェア
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,659.49	2,132.85	2,963	386,954	資本市場
BMW VORZUG	41.16	69.57	539	70,439	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,993.58	3,241.17	5,619	733,687	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	30.44	26.86	1,104	144,166	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,188.79	1,266.18	4,111	536,769	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4.79	4.79	326	42,613	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG	37.71	35.01	461	60,267	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	25.11	75.33	354	46,303	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	167.52	196.7	3,101	404,991	資本市場
LANXESS AG	68.56	71.94	371	48,559	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	48.73	48.07	931	121,660	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	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN	290.97	-	-	-	不動産管理・開発
SYMRISE AG	113.08	121.06	1,225	160,031	化学
BRENNTAG SE	140.44	163.1	1,249	163,072	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	171.16	233.4	675	88,188	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	983.85	983.85	260	34,026	各種電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN SE	59.34	61.13	688	89,907	不動産管理・開発
KION GROUP AG	59.03	75.08	586	76,557	機械
VONOVIA SE	454.51	700.86	3,315	432,906	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	68.6	68.6	604	78,906	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	238.05	284.75	1,576	205,811	ヘルスケア機器・用品
TEAMVIEWER AG	136.68	-	-	-	ソフトウェア
SIEMENS ENERGY AG	358.31	357.61	667	87,122	電気設備
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	-	378.31	1,186	154,918	機械
ZALANDO SE	147.56	208.57	1,287	168,069	インターネット販売・通信販売
SCOUT24 SE	96.7	96.7	505	66,054	インタラクティブ・メディアおよびサービス
COVESTRO AG	163.37	191.58	1,010	131,866	化学
HELLOFRESH SE	128.38	169.9	829	108,337	食品・生活必需品小売り
UNIPER SE	182.03	104.27	406	53,092	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	109.74	166.45	720	94,033	インターネット販売・通信販売
小計	株数 : 金額 銘柄数 <比率>	22,034.34 61銘柄	24,688.56 59銘柄	124,078 -	16,199,712 <2.5%>
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	195.17	331.35	644	84,142	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,386.62	2,686.36	1,074	140,292	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	400.88	382.82	382	49,911	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数 : 金額 銘柄数 <比率>	2,982.67 3銘柄	3,400.53 3銘柄	2,101 -	274,346 <0.0%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	5,508.72	5,945.92	5,436	709,848	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	212.06	212.06	347	45,322	電気設備
REPSOL SA	1,359.9	1,502.89	1,753	228,946	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	4,558.87	5,375.23	2,353	307,313	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	277.36	286.39	524	68,537	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	213.95	228.77	502	65,590	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,782.51	6,440.62	3,691	481,912	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	236.12	162.89	400	52,252	ガス
BANCO SANTANDER SA	15,869.57	16,741.54	5,601	731,360	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	345.96	462.37	786	102,744	電力
INDITEX	1,004.23	1,042.55	2,640	344,780	専門小売り
ENAGAS	234.77	234.77	436	57,011	ガス
GRIFOLS SA	235.18	306.87	443	57,853	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	405.93	464.37	1,105	144,294	建設・土木
CAIXABANK	3,073.31	4,097.23	1,348	176,046	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	-	279.72	475	62,084	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMADEUS IT GROUP SA	411.18	467.67	2,821	368,429	情報技術サービス
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	213.57	-	-	-	建設・土木
AENA SME SA	62.56	70.76	1,061	138,576	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	272.34	487.6	1,901	248,278	各種電気通信サービス
小計	株数 : 金額 銘柄数 <比率>	40,278.09 19銘柄	44,810.22 19銘柄	33,633 -	4,391,186 <0.7%>

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	975.69	1,117.77	2,051	267,865	保険
INTESA SANPAOLO	15,123.69	15,981.58	4,422	577,349	銀行
UNICREDIT SPA	1,939.1	2,056.36	3,089	403,415	銀行
ENI SPA	2,193.31	2,418.13	3,221	420,653	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	574.42	574.42	583	76,233	銀行
ENEL SPA	7,299.44	7,880.51	4,980	650,251	電力
SNAM SPA	1,712.94	1,989.63	944	123,310	ガス
TELECOM ITALIA SPA	7,626.75	8,325.8	343	44,893	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	-	-	-	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	452.99	457.18	739	96,547	運送インフラ
TERNA SPA	1,136.54	1,671.4	1,106	144,460	電力
RECORDATI SPA	103.03	103.03	461	60,236	医薬品
AMPLIFON SPA	113.72	113.72	395	51,579	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	223.28	218.22	600	78,463	電気設備
DIASORIN SPA	22.23	22.23	266	34,755	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	175.67	228.55	1,244	162,446	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	430.97	435.86	551	71,957	情報技術サービス
FINECOBANK SPA	538.18	652.74	1,011	132,008	銀行
POSTE ITALIANE SPA	400.15	557.49	601	78,572	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	233.44	232.81	206	26,979	各種電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	46,251.5 20銘柄	45,037.43 19銘柄	26,822 -	3,501,981 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	240.85	238.04	630	82,358	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	349.35	486.12	496	64,832	機械
UPM-KYMMENE OYJ	448.29	559.82	1,837	239,881	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	532.5	555.48	1,009	131,811	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	448.22	499.85	2,214	289,103	保険
FORTUM OYJ	394.09	408.2	962	125,615	電力
NOKIA OYJ	5,185.32	5,106.9	2,489	325,043	通信機器
ELISA OYJ	136.42	136.42	691	90,266	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	367.96	432.9	1,627	212,456	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	298.9	319.56	1,750	228,551	機械
ORION OYJ	80.51	81.06	281	36,797	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,482.41 11銘柄	8,824.35 11銘柄	13,991 -	1,826,718 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	128.17	170.07	951	124,255	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	69.24	69.16	650	84,877	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	301	39,426	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	242.04	315.46	1,319	172,324	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	179.11	195.72	509	66,489	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	717.31 5銘柄	849.16 5銘柄	3,732 -	487,372 <0.1%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	974,571.62 1,224銘柄	1,063,294.07 1,228銘柄	- -	598,417,771 <93.1%>

(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) < >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		期末	
		証券数		証券数	評価額		比率
		証券数	金額		外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		証券	証券	千スイス・フラン	千円		
CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23		87,844	-	-	-		
合計	証券数・金額	87,844	-	-	-		
	銘柄数<比率>	1銘柄	-銘柄	-	-		<-%>

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当期		期末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
不動産ファンド		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
(アメリカ)							
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		12.006	13.788	2,531	292,214		0.0
BOSTON PROPERTIES INC		12.947	14.801	1,730	199,789		0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		22.693	-	-	-		-
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		127.559	150.15	1,079	124,604		0.0
PROLOGIS INC		66.35	72.03	10,468	1,208,313		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		12.329	13.356	3,180	367,120		0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST		9.643	10.44	1,691	195,243		0.0
EQUINIX INC		7.992	8.702	5,824	672,315		0.1
DUKE REALTY TRUST		31.929	35.306	1,925	222,292		0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		38.831	42.028	7,043	812,909		0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		5.504	6.132	1,939	223,898		0.0
EQUITY RESIDENTIAL		35.108	34.397	2,955	341,111		0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		45.543	49.946	1,603	185,049		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP		9.838	10.551	3,263	376,725		0.1
WELLTOWER INC		38.411	40.744	3,246	374,661		0.1
IRON MOUNTAIN INC		24.591	28.44	1,241	143,283		0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		16.087	16.573	1,268	146,429		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		63.952	75.616	1,355	156,485		0.0
MID AMERICA		10.854	11.699	2,428	280,294		0.0
REALTY INCOME CORP		29.466	53.267	3,563	411,244		0.1
REGENCY CENTERS CORP		14.499	14.665	955	110,292		0.0
UDR INC		27.057	28.289	1,544	178,308		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		28.083	31.871	4,458	514,629		0.1
PUBLIC STORAGE		13.834	15.276	5,432	627,048		0.1
SUN COMMUNITIES INC		9.67	11.066	2,093	241,678		0.0
VENTAS INC		35.021	40.408	2,022	233,474		0.0
VORNADO REALTY TRUST		12.714	15.123	616	71,111		0.0
WEYERHAEUSER CO		64.096	72.184	2,953	340,840		0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		12.385	13.998	2,718	313,775		0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		23.492	27.36	3,724	429,915		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST		53.911	54.08	1,123	129,706		0.0
AGNC INVESTMENT CORP		46.028	44.32	607	70,132		0.0
VEREIT INC		20.534	-	-	-		-
AMERICAN TOWER CORP		39.736	44.301	10,379	1,197,976		0.2
WP CAREY INC		15.529	19.446	1,474	170,174		0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	末
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
INVITATION HOMES INC	50.475	55.207	2,285	263,800	0.0	
VICI PROPERTIES INC	47.083	57.882	1,629	188,129	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 1,135.78	金額 11,814.981	比率 -	比率 1.8
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
CANADIAN APT PPTYS REIT	7.954	8.22	456	41,361	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13.467	13.467	319	28,966	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 21.421	金額 70,328	比率 -	比率 0.0
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%	
MIRVAC GROUP	329.418	414.125	1,031	84,875	0.0	
GPT GROUP	158.232	207.292	1,048	86,334	0.0	
STOCKLAND	194.018	243.481	954	78,560	0.0	
DEXUS	108.972	101.202	1,028	84,632	0.0	
GOODMAN GROUP	148.357	158.185	3,609	297,121	0.0	
VICINITY CENTRES	371.711	371.711	631	52,012	0.0	
SCENTRE GROUP	420.268	479.376	1,414	116,399	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 1,730.976	金額 799,936	比率 -	比率 0.1
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT	200.2	199.7	13,280	196,411	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 200.2	金額 196,411	比率 -	比率 0.0
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	483.636	545.177	1,117	95,768	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292.606	248.606	703	60,287	0.0	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	-	-	-	-	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270.1	484.5	838	71,824	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	192.3	348	29,825	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 1,430.742	金額 257,705	比率 -	比率 0.0
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC	69.819	75.77	407	63,737	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	55.843	74.028	583	91,233	0.0	
SEGRO PLC	100.956	120.36	1,486	232,242	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 226.618	金額 387,213	比率 -	比率 0.1
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	3.67	4.763	530	69,212	0.0	
KLEPIERRE	17.099	17.099	404	52,819	0.0	
COVIVIO	4.663	4.663	337	44,077	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12.92	12.92	884	115,480	0.0	
小計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 38.352	金額 281,590	比率 -	比率 0.0
合計	□ 数 銘柄 数<比率>	□ 数 銘柄 数<比率>	金額 4,784.089	金額 13,808.167	比率 -	比率 2.1

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘	柄	別	当 期		末	
			買	建 額	売	建 額
外 国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T			百万円 8,545		百万円 -
	S & P / T S E 6 0 I X F U T			421		-
	S P I 2 0 0 F U T U R E S			264		-
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E			536		-
	D J E U R O S T O X X 5 0			1,772		-

(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

2022年2月15日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
株 式	千円	%		
株 式	598,417,771	92.9		
投資信託受益証券、投資証券	13,808,167	2.1		
コール・ローン等、その他	31,698,088	4.9		
投資信託財産総額	643,924,027	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、642,251,567千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.42円、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=82.31円、1香港・ドル=14.79円、1シンガポール・ドル=85.69円、1ニュージーランド・ドル=76.43円、1イギリス・ポンド=156.24円、1イスラエル・シケル=35.452円、1スイス・フラン=124.94円、1デンマーク・クローネ=17.54円、1ノルウェー・クローネ=13.00円、1スウェーデン・クローナ=12.30円、1ユーロ=130.56円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	663,074,590,376円
株 式	8,092,389,228
債 券(評価額)	598,417,771,479
信 託 受 益 証 券(評価額)	1,057,641,470
資 信 託 受 益 証 券(評価額)	12,750,525,590
未 収 入 当 金	37,918,383,393
未 差 入 収 委 託 証 当 金	461,392,808
(B) 負 債	20,432,094,210
未 払 解 約 金	20,346,719,210
未 払 金	85,375,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	642,642,496,166
元 次 期 繰 越 損 益	113,101,593,550
(D) 受 益 権 総 額(C / D)	529,540,902,616
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	113,101,593,550円
	56,820円

(注1) 期首元本額	101,430,005,374円
追加設定元本額	93,876,718,442円
一部解約元本額	82,205,130,266円
(注2) 期末における元本の内訳	
DIAM外国株式バッシブ・ファンド	3,311,871,905円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,512,255円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	13,337,563円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	57,023,138円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	20,046,091円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	11,721,611円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	11,183,927円
たわらノーロード 先進国株式	29,209,837,872円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	379,011,003円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,783,685,914円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	582,139,859円
たわらノーロード バランス (堅実型)	67,491,775円
たわらノーロード バランス (標準型)	540,044,742円
たわらノーロード バランス (積極型)	666,401,105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)	881,601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)	148,165,312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)	439,640,001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)	332,155,340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)	491,044,760円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,241,327円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	18,750,438円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,393,492円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,200,746円
たわらノーロード 全世界株式	228,421,540円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,140,481,555円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,232,942,901円
One グローバルバランス	2,978,639円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	152,382,039円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	773,961,717円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,005,264,576円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	95,122,258円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	265,971,133円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	248,725,315円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,541,627円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	686,570,224円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,940円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	172,284,428円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	172,035,194円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	304,995,876円
投資のソムリエ	4,886,217,076円
リスクコントロール	36,245,544円
投資のソムリエ<DC年金>	294,714,139円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	187,167,284円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	142,899,507円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	31,576,270円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	1,000,259円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	162,957,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,118,793,304円

ワールドアセットバランス (基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	434,831,464円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	26,209,400円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	12,968,413円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,345,477円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	39,369,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	95,606,011円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	361,901,590円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,502,748円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	25,023,763円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	11,301,608円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	9,568,065円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	29,534,589円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	622,063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)	126,295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)	83,555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)	1,732,862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)	13,744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)	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンド112021-04 (適格機関投資家限定)	557,287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	57,490,733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)	75,883円
MSC iCコア・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	958,242,351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)	63,352,968円
DIAM外国株式バッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,191,786,446円
DIAM先進国株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,189,774,417円
外国株式バッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,052,411,163円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	73,837,834円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	8,226,089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)	206,917円
リスクコントロール世界8資産(フランスファンド (FOF:用) (適格機関投資家専用)	2,898,910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)	31,546,987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)	56,354,600円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,722,727円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	22,177,017円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,568,925円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	489,870円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	3,953,136円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	28,909,778円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	204,390,999円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	306,392,875円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	998,858,127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)	86,555,947円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA.2 (適格機関投資家限定)	51,952,941円
DIAM アナ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	332,991,420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)	13,689,728円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,498,398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)	128,366,149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)	11,208,160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)	40,455,375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)	63,324,997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)	130,176,054円
期末元本合計	113,101,593,550円

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19期 (決算日 2022年2月14日)

(計算期間 2021年2月16日～2022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19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年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				
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	百万円 355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	—	553,303

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

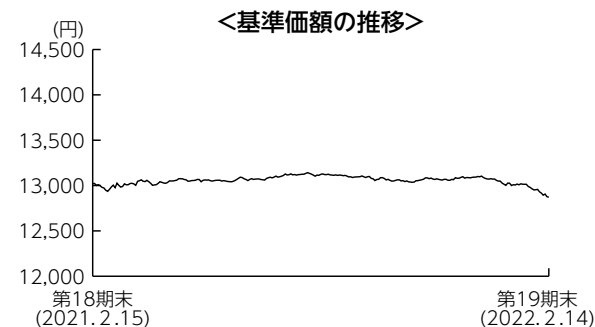
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2021年 2月15日	円 13,022	% -	ポイント 385.59	% -	% 99.2	% -	% -
2 月 末	12,936	△0.7	383.06	△0.7	99.5	-	-
3 月 末	13,025	0.0	385.72	0.0	99.7	-	-
4 月 末	13,049	0.2	386.44	0.2	99.8	-	-
5 月 末	13,054	0.2	386.62	0.3	99.9	-	-
6 月 末	13,061	0.3	386.90	0.3	99.8	-	-
7 月 末	13,125	0.8	388.81	0.8	99.7	-	-
8 月 末	13,114	0.7	388.46	0.7	99.4	-	-
9 月 末	13,069	0.4	387.12	0.4	105.3	-	-
10 月 末	13,054	0.2	386.72	0.3	100.2	-	-
11 月 末	13,086	0.5	387.65	0.5	99.6	-	-
12 月 末	13,057	0.3	386.84	0.3	100.4	-	-
2022年 1 月 末	12,964	△0.4	384.06	△0.4	99.3	-	-
(期 末) 2022年 2月14日	12,872	△1.2	381.31	△1.1	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（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

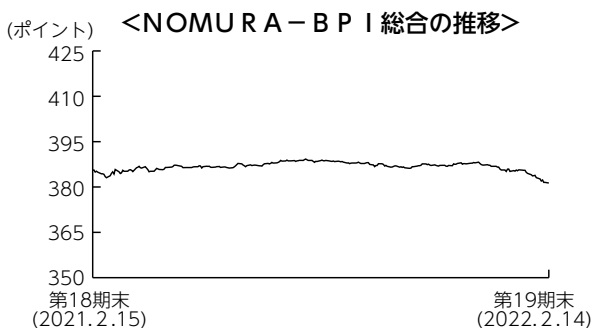


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%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。期初は株式市場の上昇などを受けて基準価額は下落しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され基準価額は上昇しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手するとの観測が広がり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。期初は株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格

は上昇）しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手するとの観測が広がり利回りは上昇しました。

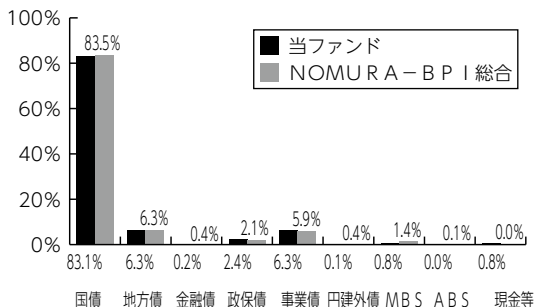
ポートフォリオについて

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

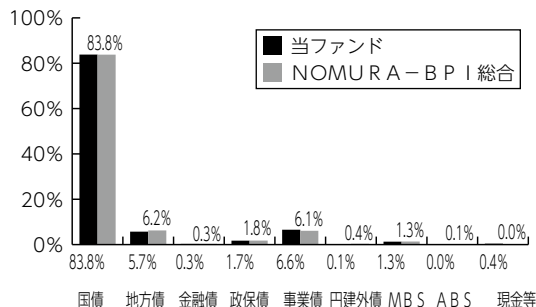
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

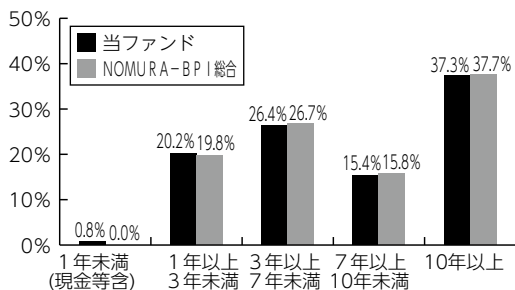


期末

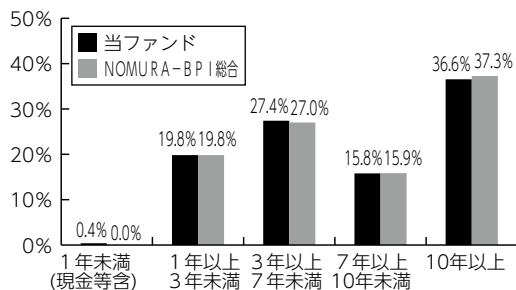


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.1%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 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
国 内		千円	千円
	国債証券	717,343,530	471,488,133 (-)
	地方債証券	18,975,569	4,218,721 (-)
	特殊債証券	14,592,716	2,073,694 (297,842)
	社債証券	19,760,179	2,338,632 (-)

(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 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			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 770,671	百万円 100,563	% 13.0	百万円 480,119	百万円 73,234	% 15.3

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 304

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	447,045,000	463,797,306	83.8	—	53.6	19.7	10.5
地 方 債 証 券	30,445,330	31,523,404	5.7	4.7	3.6	1.4	0.7
特 殊 債 証 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 証 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 証 券	27,481,000	27,644,946	5.0	0.1	2.4	1.9	0.7
合 計	531,923,315	551,087,616	99.6	4.8	63.0	24.2	12.5

(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 2 3 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
4 2 4 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
4 2 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
1 3 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
4 2 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
4 2 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
1 3 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
4 2 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
4 3 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
1 3 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
4 3 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
1 3 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	50,000	52,841	2024/06/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
7 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,820,000	3,863,280	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	
83回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	75,621	2025/12/20
84回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	182,998	2025/12/20
147回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,000,000	3,999,160	2026/03/20
342回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,980,000	3,994,606	2026/03/20
85回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	640,415	2026/03/20
86回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	131,235	2026/03/20
87回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	130,744	2026/03/20
148回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,900,000	3,898,284	2026/06/20
343回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,350,000	4,366,008	2026/06/20
88回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	648,504	2026/06/20
89回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,948	2026/06/20
149回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,200,000	4,196,136	2026/09/20
344回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,790,000	5,809,917	2026/09/20
90回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	516,910	2026/09/20
91回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	121,484	2026/09/20
150回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,300,000	1,298,102	2026/12/20
345回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,190,000	5,206,296	2026/12/20
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,275,826	2026/12/20
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,740,000	4,754,409	2027/03/20
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	406,837	2027/03/20
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	740,108	2027/03/20
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,030,000	5,044,737	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	550,000	616,099	2027/06/20
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	133,142	2027/06/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,990,000	5,003,872	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	660,000	739,160	2027/09/20
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	178,297	2027/09/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,430,000	4,441,606	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	750,000	839,340	2027/12/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,210,000	5,221,045	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	830,000	937,783	2028/03/20
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	230,000	262,657	2028/03/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,600,000	4,608,694	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	500,000	573,740	2028/06/20
103回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	160,000	182,587	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	124,138	2028/06/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,440,000	4,447,281	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	640,000	725,280	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	569,905	2028/09/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,810,000	4,816,541	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	600,000	682,722	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	690,000	775,739	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,060,000	4,064,263	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	350,000	394,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	502,660	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,310,000	4,311,551	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	460,000	530,794	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	740,000	848,491	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,640,000	3,637,233	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	110,000	132,286	2029/09/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,170,000	1,345,862	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,690,000	3,684,243	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	820,000	946,895	2029/12/20
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	418,510	2029/12/20
2回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	118,144	2030/02/20
358回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,550,000	3,541,444	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	530,000	618,329	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,070,000	1,239,744	2030/03/20
359回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,260,000	4,245,942	2030/06/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	555,000	640,653	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	470,000	534,775	2030/06/20
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	670,000	751,277	2030/06/20
360回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,040,000	4,022,830	2030/09/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	790,000	908,073	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	650,352	2030/09/20
4回 利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	247,670	2030/11/20
361回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,000,000	3,977,320	2030/12/20
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,050,000	1,228,164	2030/12/20
124回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	600,000	696,576	2030/12/20
362回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,750,000	4,715,990	2031/03/20
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	709,350	2031/03/20
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	510,000	593,813	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	623,905	2031/03/20
363回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,800,000	4,760,304	2031/06/20
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,370,000	1,587,227	2031/06/20
129回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	760,000	873,521	2031/06/20
364回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,400,000	4,356,528	2031/09/20
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	910,000	1,048,047	2031/09/20
131回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	790,000	902,401	2031/09/20
6回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	242,360	2031/11/20
365回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,300,000	1,285,583	2031/12/20
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	830,000	950,184	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,030,000	1,189,093	2031/12/20
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	800,000	925,224	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	640,000	733,862	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	660,000	750,274	2032/03/20
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	800,000	918,800	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,340,000	1,511,908	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	920,000	1,047,318	2032/06/20
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,290,000	2,634,072	2032/09/20
8回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	232,380	2032/11/22
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,580,000	1,819,938	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,500,000	1,743,615	2032/12/20
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,480,000	1,691,033	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,310,000	1,482,697	2033/03/20
11回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	250,000	288,867	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,350,000	2,715,354	2033/06/20
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	230,000	276,696	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,280,000	2,639,122	2033/09/20
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	150,000	179,062	2033/12/20

銘柄	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)				
147回	利付国庫債券(20年)	1.6000	2,350,000	2,696,319 2033/12/20
14回	利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	422,810 2034/03/20
148回	利付国庫債券(20年)	1.5000	2,210,000	2,512,084 2034/03/20
15回	利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	327,298 2034/06/20
149回	利付国庫債券(20年)	1.5000	2,270,000	2,583,441 2034/06/20
16回	利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	302,973 2034/09/20
150回	利付国庫債券(20年)	1.4000	2,440,000	2,750,685 2034/09/20
17回	利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	338,447 2034/12/20
151回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,460,000	2,713,675 2034/12/20
18回	利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	497,632 2035/03/20
152回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,340,000	2,582,494 2035/03/20
19回	利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	349,154 2035/06/20
153回	利付国庫債券(20年)	1.3000	2,620,000	2,926,068 2035/06/20
20回	利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	420,977 2035/09/20
154回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,690,000	2,969,356 2035/09/20
21回	利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	388,023 2035/12/20
155回	利付国庫債券(20年)	1.0000	2,460,000	2,650,133 2035/12/20
22回	利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	371,727 2036/03/20
156回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,550,000	2,538,142 2036/03/20
23回	利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	449,694 2036/06/20
157回	利付国庫債券(20年)	0.2000	2,430,000	2,346,553 2036/06/20
24回	利付国庫債券(30年)	2.5000	270,000	347,706 2036/09/20
158回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,690,000	2,706,543 2036/09/20
25回	利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	416,394 2036/12/20
159回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,480,000	2,526,475 2036/12/20
26回	利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	792,521 2037/03/20
160回	利付国庫債券(20年)	0.7000	2,010,000	2,073,676 2037/03/20
161回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,890,000	1,919,654 2037/06/20
27回	利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	805,206 2037/09/20
162回	利付国庫債券(20年)	0.6000	1,820,000	1,846,317 2037/09/20
163回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,070,000	2,097,303 2037/12/20
28回	利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	1,003,825 2038/03/20
164回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,680,000	2,668,074 2038/03/20
165回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,310,000	2,296,116 2038/06/20
29回	利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,112,083 2038/09/20
166回	利付国庫債券(20年)	0.7000	1,830,000	1,873,151 2038/09/20
167回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,970,000	1,950,300 2038/12/20
30回	利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,126,734 2039/03/20
168回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,680,000	1,632,976 2039/03/20
169回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,950,000	1,858,096 2039/06/20
31回	利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	912,038 2039/09/20
170回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,420,000	1,348,971 2039/09/20
171回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,649,206 2039/12/20
32回	利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,248,263 2040/03/20
172回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,510,000	1,453,586 2040/03/20
173回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,120,000	2,036,472 2040/06/20
33回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,462,456 2040/09/20
174回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,990,000	1,907,454 2040/09/20
175回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,930,000	1,879,820 2040/12/20
34回	利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,532,796 2041/03/20

銘柄	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)				
176回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,080,000	2,021,843 2041/03/20
177回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,300,000	2,191,785 2041/06/20
35回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,818,371 2041/09/20
178回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	2,036,391 2041/09/20
179回	利付国庫債券(20年)	0.5000	800,000	776,176 2041/12/20
36回	利付国庫債券(30年)	2.0000	2,170,000	2,712,239 2042/03/20
37回	利付国庫債券(30年)	1.9000	2,260,000	2,788,297 2042/09/20
38回	利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,885,854 2043/03/20
39回	利付国庫債券(30年)	1.9000	1,220,000	1,510,055 2043/06/20
40回	利付国庫債券(30年)	1.8000	940,000	1,145,784 2043/09/20
41回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,080,000	1,295,665 2043/12/20
42回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,344,560 2044/03/20
43回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,345,489 2044/06/20
44回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,358,395 2044/09/20
45回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,270,000	1,474,444 2044/12/20
46回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,939,404 2045/03/20
47回	利付国庫債券(30年)	1.6000	1,310,000	1,549,651 2045/06/20
48回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,640,000	1,870,567 2045/09/20
49回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,460,000	1,665,422 2045/12/20
50回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,675,222 2046/03/20
51回	利付国庫債券(30年)	0.3000	1,350,000	1,211,233 2046/06/20
52回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,510,000	1,418,358 2046/09/20
53回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,200,000	1,151,448 2046/12/20
54回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,454,553 2047/03/20
55回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,520,000	1,523,207 2047/06/20
56回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,230,000	1,231,303 2047/09/20
57回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,300,000	1,300,000 2047/12/20
1回	利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	151,087 2048/03/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,670,000	1,666,392 2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,520,000	1,478,884 2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	1,130,000	1,149,729 2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	1,102,619 2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	836,621 2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,070,000	981,050 2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,160,000	1,032,724 2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,180,000	1,048,418 2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,010,000	895,567 2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	720,835 2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,090,000	965,631 2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,550,000	1,446,615 2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,340,000	1,249,992 2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,450,000	1,388,360 2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	966,996 2051/03/20
70回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,420,000	1,359,224 2051/03/20
71回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,600,000	1,531,040 2051/06/20
72回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,500,000	1,434,915 2051/09/20
73回	利付国庫債券(30年)	0.7000	600,000	573,792 2051/12/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	1,010,000	1,311,889 2052/03/20
6回	利付国庫債券(40年)	1.9000	1,030,000	1,317,009 2053/03/20
7回	利付国庫債券(40年)	1.7000	1,190,000	1,463,473 2054/03/20

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
8回	利付国庫債券(40年)	1.4000	1,310,000	1,505,792 2055/03/20
9回	利付国庫債券(40年)	0.4000	1,950,000	1,675,966 2056/03/20
10回	利付国庫債券(40年)	0.9000	1,820,000	1,829,755 2057/03/20
11回	利付国庫債券(40年)	0.8000	1,480,000	1,441,638 2058/03/20
12回	利付国庫債券(40年)	0.5000	1,400,000	1,228,892 2059/03/20
13回	利付国庫債券(40年)	0.5000	1,730,000	1,512,244 2060/03/20
14回	利付国庫債券(40年)	0.7000	1,700,000	1,585,624 2061/03/20
小 計		-	447,045,000	463,797,306 -
(地方債証券)		%	千円	千円
7 1 9回	東京都公募公債	0.8600	200,000	201,858 2023/03/20
12 1回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	503,335 2023/04/25
2 5年度4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	303,270 2023/05/30
7 2 0回	東京都公募公債	0.8700	300,000	303,474 2023/06/20
1回	東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	102,059 2023/06/20
2 5年度4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	202,128 2023/06/20
2 5年度2回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	404,956 2023/07/14
3 7 4回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	304,038 2023/07/28
2 5年度5回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	202,532 2023/08/25
2 5年度6回	千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,271 2023/09/25
29回1号	宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,134 2023/10/25
1 2 7回	共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,134 2023/10/25
1 2 8回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	303,459 2023/11/24
2 5年度2回	島根県公募公債	0.6700	106,000	107,246 2023/11/27
7 2 6回	東京都公募公債	0.7300	400,000	405,316 2023/12/20
2 5年度8回	埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,289 2023/12/25
2 5年度11回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	202,736 2024/02/26
2 5年度2回	新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,322 2024/02/28
1 3 2回	共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,345 2024/03/25
2 0 8回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	303,732 2024/06/20
2 6年度4回	札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,219 2024/06/20
1回	兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	307,608 2024/06/26
2 6年度4回	神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,402 2024/07/18
2 6年度5回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	405,720 2024/07/29
4 8 8回	名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	456,633 2024/09/20
2 6年度1回	相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,295 2024/09/20
2 6年度1回	長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,361 2024/09/30
2 6年度1回	静岡市公募公債	0.5150	100,000	101,332 2024/11/25
2 6年度11回	京都府公募公債	0.4760	350,000	354,382 2024/12/19
2 6年度1回	三重県公募公債	0.4560	100,000	101,188 2024/12/25
2 6年度1回	浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,866 2025/01/23
1 4 2回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	504,480 2025/01/24
2 6年度3回	広島市公募公債	0.4290	100,000	101,177 2025/02/25
2 6年度17回	兵庫県公募公債	0.4600	200,000	202,544 2025/02/26
5回	東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	106,390 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,524 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	405,336 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	610,044 2025/05/23
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	508,730 2025/07/25
7回	東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	107,575 2025/09/19
1回	静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	107,627 2025/09/19

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
27年度15回	愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,571 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,575 2025/12/25
2 7年度9回	千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,122 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,074 2026/04/24
9回	東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	220,570 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,998 2026/06/25
1回	兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	214,114 2026/07/29
2 8年度6回	北海道公募公債	0.0700	100,000	99,977 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募公債	0.0450	100,000	99,862 2026/09/18
1 0回	東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	330,960 2026/09/18
4回	京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	111,143 2026/09/18
4 1 3回	共同発行市場公募公債 10年	0.0210	100,000	99,723 2026/10/28
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	502,335 2027/01/25
2 8年度8回	福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,725 2027/02/24
4 1 9回	大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,392 2027/04/27
2回	静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	106,848 2027/06/25
5回	兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,010 2027/07/07
2 9年度4回	大阪府公募公債	0.1500	200,000	199,998 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,972 2027/09/24
2 4年度1回	福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	106,797 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	100,471 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	502,535 2028/02/25
2 9年度6回	広島市公募公債	0.2300	300,000	301,341 2028/02/25
2 9年度13回	京都府公募公債	0.2000	109,330	109,626 2028/03/16
5回	兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	321,342 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募公債	0.2200	110,000	110,413 2028/06/20
4回	静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	107,343 2028/06/23
3 0年度7回	神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	301,740 2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募公債	0.1850	200,000	200,260 2028/09/20
7回	静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	342,096 2028/09/21
3 0年度3回	広島県公募公債	0.2540	100,000	100,581 2028/09/25
2 3 0年度3回	堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067 2028/12/19
3 0 7回	神奈川県公募公債	0.1350	200,000	199,458 2028/12/20
2 0 回 2号	福岡県公募公債	2.0500	100,000	112,685 2028/12/20
6回	大阪府公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612 2028/12/20
1 7回	横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	112,820 2028/12/20
6回	北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	112,474 2028/12/20
3 0年度6回	福岡県公募公債	0.2000	200,000	200,406 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,237 2028/12/25
3 0年度14回	北海道公募公債	0.1950	400,000	400,132 2028/12/28
1 8回	東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	114,282 2029/03/19
3 0年度19回	愛知県公募公債	0.1150	200,000	199,016 2029/03/28
3 0年度3回	岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	199,508 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	298,275 2029/05/25
6回	川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	228,986 2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募公債	0.0290	200,000	197,594 2029/06/21
9回	兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	105,986 2029/07/13
11回	神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	113,800 2029/07/20
7 9 6回	東京都公募公債	0.0400	200,000	197,530 2029/09/20
令和元年度 9回	静岡県公募公債	0.0500	200,000	197,680 2029/09/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)					
令和元年度3回	横浜市公募債	0.0500	400,000	395,316	2029/10/16
令和元年度16回	兵庫県公募債	0.0500	200,000	197,652	2029/10/23
21回	東京都公募債 20年	2.1900	100,000	115,284	2029/12/20
17回	さいたま市公募債	0.1100	200,000	198,376	2029/12/25
令和元年度第8回	埼玉県公募債	0.1350	200,000	198,670	2030/01/30
21年度2回	福岡県公募債 (20年)	2.2300	100,000	115,890	2030/02/22
203回	共同発行人市場公募地方債	0.0950	100,000	99,013	2030/02/25
802回	東京都公募債	0.1300	400,000	396,980	2030/03/19
511回	名古屋市長公募債 10年	0.0750	200,000	197,608	2030/03/27
令和2年度1回	京都府公募債	0.1350	400,000	397,116	2030/04/12
令和2年2回	大阪府公募債	0.1310	300,000	297,588	2030/05/22
9回	埼玉県公募債 20年	2.1500	100,000	115,631	2030/05/24
8回	静岡県公募債 15年	0.8280	200,000	209,836	2030/06/07
令和2年度10回	静岡県公募債	0.1350	100,000	99,073	2030/09/20
令和2年5回	福岡県公募債	0.1350	100,000	99,522	2030/10/23
36回2号	宮城県公募債 10年	0.1350	250,000	247,500	2030/10/28
令和2年度1回	福島県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
令和2年度1回	高知県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
22年度14回	愛知県公募債	2.0870	300,000	347,595	2030/12/13
9回	京都市公募債 20年	2.1430	200,000	232,738	2030/12/17
813回	東京都公募債	0.1790	300,000	297,897	2030/12/20
16回	神奈川県公募債 20年	2.0900	300,000	348,129	2031/01/24
464回	大阪府公募債 10年	0.0720	200,000	196,622	2031/01/28
令和2年度19回	北海道公募債	0.1450	100,000	98,897	2031/02/26
令和2年度14回	京都府公募債	0.2140	200,000	199,184	2031/03/12
令和2年7回	広島県公募債	0.2140	200,000	199,182	2031/03/19
251回	神奈川県公募債 10年	0.1990	200,000	198,826	2031/03/20
令和2年度14回	静岡県公募債	0.1400	200,000	197,780	2031/03/20
令和3年度1回	長野県公募債 10年	0.1900	200,000	198,682	2031/04/16
令和3年度2回	兵庫県公募債	0.1750	100,000	99,165	2031/04/25
467回	大阪府公募債 10年	0.1640	200,000	197,956	2031/04/28
469回	大阪府公募債 10年	0.1280	200,000	197,136	2031/06/27
令和3年5回	千葉県公募債	0.1050	200,000	196,712	2031/09/25
472回	大阪府公募債 10年	0.1000	200,000	196,436	2031/09/29
19回	神奈川県公募債 20年	1.8180	100,000	114,954	2032/01/30
24年度2回	福岡県公募債 (20年)	1.6350	300,000	340,239	2032/08/16
10回	大阪府公募債 20年	1.7200	200,000	228,482	2032/09/24
24年度12回	神戸市公募債	1.7110	200,000	228,902	2032/12/17
14回	千葉県公募債 20年	1.1370	100,000	108,398	2033/04/15
13回	埼玉県公募債 20年	1.5990	100,000	113,533	2033/05/20
1回	東京都公募債 30年	2.2100	200,000	240,730	2033/06/20
14回	埼玉県公募債 20年	1.5460	300,000	340,266	2034/05/08
29回	横浜市公募債 20年	1.5280	100,000	113,263	2034/05/26
16回	名古屋市公募債 20年	1.5200	100,000	113,143	2034/06/09
5回	群馬県公募債 20年	1.5290	100,000	113,268	2034/06/16
17回	北九州市公募債 20年	1.5290	100,000	113,146	2034/06/20
15回	埼玉県公募債 20年	1.1660	100,000	108,996	2035/02/16
2回	横浜市公募債 30年	2.4900	100,000	125,684	2035/03/20
18回	千葉県公募債 20年	1.1380	100,000	108,681	2035/04/13
17回	名古屋市公募債 20年	1.2030	100,000	109,504	2035/05/28

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)					
13回	大阪府公募債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回	大阪府公募債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回	千葉県公募債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回	神奈川県公募債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回	広島市公募債	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回	札幌市公募債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回	仙台市公募債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回	福岡市公募債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回	福岡市公募債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回	兵庫県公募債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回	福岡市公募債	2.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年2回	広島県公募債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回	札幌市公募債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回	川崎市公募債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回	愛知県公募債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回	東京都公募債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回	愛知県公募債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回	広島県公募債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回	埼玉県公募債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回	島根県公募債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回	京都市公募債 30年定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回	神戸市公募債 30年	0.7130	200,000	189,564	2051/06/20
小計		-	30,445,330	31,523,404	-
(特殊債券)					
19回	政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	100,742	2023/03/15
55回	鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	504,550	2023/03/20
189回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	503,365	2023/04/28
18回	国際協力機構債券	0.8680	100,000	101,155	2023/06/20
193回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回	政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	430,000	435,835	2023/07/31
116回	高速道路機構債	0.7220	100,000	101,136	2023/09/20
202回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回	政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	550,010	2024/01/19
7回	広島県・広島市折半保証広島高速道路債	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回	政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回	日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	101,219	2024/09/20
71回	鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,362	2024/11/27
21回	政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,357	2025/03/17
241回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回	政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,199	2025/04/25
21回	沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,941	2025/06/20
254回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,487	2025/08/29
127回	日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,949	2025/09/19
85回	中日本高速道路債	0.0700	300,000	299,841	2025/10/21
172回	住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,676	2025/11/20
23回	国際協力銀行債券	2.0900	100,000	107,806	2025/12/19

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)		%	千円	千円
6 1 回	住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	2025/12/19
4 0 回	政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	2026/03/13
1 1 回	独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	2026/03/20
1 8 7 回	住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	2026/04/20
8 3 回	地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	2026/04/28
8 0 回	住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	2026/09/18
3 2 1 回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	2026/09/18
7 9 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	2026/11/06
9 1 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	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	2027/01/29
F 1 4 7 回	地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	2027/03/19
7 8 回	日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	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	2027/04/30
7 2 回	東日本高速道路社債	0.1200	200,000	2027/06/18
9 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	2027/07/16
2 2 2 回	住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	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	2027/12/17
1 2 4 回	住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	2027/12/20
7 7 回	東日本高速道路社債	0.1100	300,000	2027/12/20
2 3 0 回	住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	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	2028/10/16
9 回	新関西国際空港社債	1.2310	200,000	2028/12/20
1 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	2028/12/20
9 3 回	都市再生債券	1.1020	100,000	2029/06/28
1 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	2029/06/28
2 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	2029/08/28
1 2 回	新関西国際空港社債	1.0670	200,000	2029/09/20
3 9 回	住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	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	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	2030/05/28
1 0 9 回	都市再生機構債券	0.9180	200,000	2030/06/20
1 5 回	日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	2030/10/29
1 2 1 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	2030/10/31
1 3 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	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	2031/05/30
7 5 回	住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	2031/06/13
7 9 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	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	2031/12/26
1 9 回	地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	2031/12/26
2 3 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	2032/07/28
1 1 5 回	住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	2032/09/14
1 5 回	国際協力機構債券	1.7240	100,000	2032/09/17
2 4 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	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	2033/04/28
2 8 回	日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	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	2034/03/17
3 6 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	2034/04/28
2 3 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	2035/02/28
1 5 9 回	住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	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	2035/06/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)		%	千円	千円
4 4 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	2023/06/28
2 5 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	2035/06/29
1 7 2 回	高速道路機構債	0.2880	200,000	2036/06/20
5 9 回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	2037/04/28
6 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	2037/05/10
8 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	2037/05/10
9 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	31,623	2037/05/10
3 1 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	2037/07/31
2 6 回	高速道路機構債	2.6700	200,000	2037/09/18
2 回	貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	33,411	2037/11/10
3 3 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	2038/01/29
2 3 3 回	住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	2038/04/20
2 1 0 回	高速道路機構債	0.6770	100,000	2038/09/17
2 8 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	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	2040/08/31
4 0 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	2041/03/10
4 3 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	2041/06/10
4 4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	2041/07/10
5 1 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	2042/02/10
1 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	53,085	2042/05/10
4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	10,979	2042/08/10
1 4 8 回	住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	2043/12/18
2 7 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	18,671	2044/08/10
2 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	112,585	2044/10/10
3 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	173,976	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	2045/06/20
3 8 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	24,221	2045/07/10
2 6 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	2045/10/31
1 6 9 回	高速道路機構債	1.2000	100,000	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	2046/01/31
4 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	21,048	2046/06/10
5 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	25,107	2046/09/10
5 3 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	26,331	2046/10/10
1 9 回	高速道路機構債	2.7500	150,000	2047/03/20
6 0 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	35,764	2047/05/10
6 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	80,552	2047/09/10
7 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	34,953	2048/09/10
8 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,074	2049/03/10
8 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	41,755	2049/05/10
8 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	45,545	2049/07/10
9 0 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	47,705	2049/11/10
9 3 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	52,914	2050/02/10
9 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	59,393	2050/05/10
1 3 1 回	日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	2050/06/20
1 6 5 回	都市再生機構債券	0.7090	200,000	2050/06/20
9 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	61,621	2050/08/10
4 1 8 回	高速道路機構債	0.6300	200,000	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	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	228,276	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	77,473	2052/02/10

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	77,103	77,288	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,191	77,317	2052/04/10
120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	241,122	240,948	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	241,002	240,671	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	163,316	163,084	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,409	244,643	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,211	244,521	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	424,330	425,004	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	84,346	84,415	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	87,002	86,223	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	276,159	273,005	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	122,990	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	369,132	366,160	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	283,044	281,119	2055/09/10
168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,907	289,478	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	881,010	873,486	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	183,480	2061/02/28
小計	-	25,151,985	26,325,307	-
(金融債券)	%	千円	千円	
342回 利附信金中金債(5年)	0.1100	100,000	100,077	2023/05/26
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,101	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	100,002	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,584	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	299,247	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	299,247	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	299,070	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	199,324	2026/08/27
小計	-	1,800,000	1,796,652	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	201,960	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	100,813	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	201,714	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	101,144	2023/03/24
5回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	100,014	2023/06/06
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	303,507	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	200,000	202,124	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	202,312	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	101,399	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	406,036	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	309,228	2023/09/20
26回 フランス銀行東京支店銀行(BF)CMJ 円貸付債(2018)	0.4430	100,000	100,225	2023/10/12
48回 クレディ・アグリコル社債	1.0380	100,000	101,521	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,166	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	203,762	2023/11/24
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	101,345	2023/12/20
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	206,906	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	304,485	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	407,364	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	407,084	2024/02/23
13回 新生銀行社債	0.1500	200,000	199,664	2024/03/12

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	
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	202,226	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,259	2024/03/19
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	101,598	2024/04/25
2回 BPCE SA円貸付債(ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,964	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	101,795	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,123	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,909	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	105,384	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,361	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	202,522	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,794	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸付債	0.8650	200,000	202,624	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	202,578	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	202,466	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	265,865	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,257	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,738	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,822	2025/06/11
12回 セン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,975	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	318,549	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	102,562	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	212,108	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
27回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
42回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
14回 セン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,792	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	199,146	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,840	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,565	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,954	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	298,170	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,520	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,410	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,954	2026/06/03
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,434	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,050	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸付債(2016)	0.4000	100,000	99,418	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	100,064	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	299,349	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	199,566	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	298,221	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	131,178	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	103,449	2026/06/25
90回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	199,556	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	299,763	2026/07/27
91回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
62回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,801	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,999	2026/10/23
33回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
3 4 回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16
1 2 回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24
25回 フランス信託証券(銀行 (RF C/M) 円社債 (2017))	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	100,062	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	300,276	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	200,934	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	100,028	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	113,448	2029/03/21
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12
1 4 回 プリダストン社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	99,435	2030/06/25
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	198,448	2030/08/09
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	300,510	2030/12/13

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	201,890	2032/01/23
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	99,513	2036/06/02
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	93,516	2060/12/17
小 計	-	27,481,000	27,644,946	-
合 計	-	531,923,315	551,087,616	-

■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

項 目	当	期	末
	評	価	率
	額		
公 社 債	千円		%
コー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	551,087,616		91.6
投 資 信 託 財 産 総 額	50,748,215		8.4
	601,835,832		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

(2022年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	601,835,832,511円
コ ー ー ル ・ 公 司 未 前 負 未 純 資 産 元 次 受 取 払 解 約 総 額(A-B) 期 繰 越 損 益 受 益 権 総 額(C/D)	49,696,366,967 551,087,616,706 809,631,617 242,217,221 48,532,656,000 48,532,656,000 553,303,176,511 429,840,166,151 123,463,010,360 429,840,166,151円 12,872円

(注1) 期首元本額	209,919,027,595円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	37,377,953円
追加設定元本額	611,239,283,321円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	15,418,280円
一部解約元本額	391,318,144,765円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	12,877,158円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	327,852,051円
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,682,506,030円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	851,076円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	83,095,931円	DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	153,860,446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)	1,570,192,380円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	119,506,919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)	1,607,821,940円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	687,384,295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)	1,368,128,834円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	133,587,952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)	982,094,880円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893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)	1,551,466,786円
たわらノーロード 国内債券	15,834,399,947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)	2,239,773,338円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,521,507,162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	1,216,964,056円
たわらノーロード バランス (堅実型)	886,604,365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)	1,398,783,514円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,507,222,733円	DIAM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	8,901,727,961円
たわらノーロード バランス (積極型)	189,908,936円	Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	463,351,202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)	74,774,735円	投資のソムリエ・私費 (適格機関投資家限定)	2,068,944,514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)	1,322,091,006円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略 (債券動的アロケーション)	379,250,637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)	1,225,069,364円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	276,996,912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)	327,185,576円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	3,244,504,751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)	22,506,242円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	3,251,938,545円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	17,145,320円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	3,223,328,742円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,611,444円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	2,685,868,185円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	90,707,115円	リスクコントロール世界8資産(バランスファンド) (FoF 用) (適格機関投資家専用)	51,300,165円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,060,786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)	165,802,939円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	414,272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)	98,585,137円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,277,651,015円	DIAM国際分散(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,788,034円
Oneグローバルバランス	8,911,633円	DIAM国際分散(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	97,096,530円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,982,923,753円	DIAM国内重視(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	34,365,367円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,483,500,015円	DIAM国内重視(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,318,042円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,178,995,984円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	25,972,068円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	2,189,166,701円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	126,573,725円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	2,329,357,704円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,587,635,563円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	390,282,840円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,301,884,615円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	87,660,620円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,374,149,034円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	3,040,981,442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)	113,717,847円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	11,707,847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)	190,263,848円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,303,883,102円	DIAM アスク グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,187,734,764円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,576,117,456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)	180,904,488円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	340,130,669円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,231,460円
投資のソムリエ	86,470,476,048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)	2,254,611,473円
クルーズコントロール	331,216,116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)	49,059,889円
投資のソムリエ<DC年金>	5,215,918,149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)	354,407,860円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,612,393,810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)	558,346,963円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	738,611,977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)	950,183,773円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,459,012円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	298,351,041円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,619,684円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	101,646,068円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,424,858,123円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	1,043,766,370円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	44,101,884,740円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	382,409,178円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	35,684,515円	動的パッケージファンド<DC年金>	333,573,020円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	17,735,957円	コア資産形成ファンド	227,460,602円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	53,072,038円	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	42,573,117,520円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	176,635,602円	MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	46,106,741,798円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,233,253,084円	MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	14,232,766,343円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,448,159,838円	MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,641,455,600円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,330,495,531円	期末元本合計	429,840,166,151円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益	2,936,984,033	円
受	取 利 息	2,933,836,057	
そ	の 他 収 益	4,106,122	
支	払 利 息	△958,146	
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△10,450,257,321	
売	買 益	660,402,300	
売	買 損	△11,110,659,621	
(C) 当	期 損 益 金(A+B)	△7,513,273,288	
(D) 前	期 繰 越 損 益 金	63,427,095,992	
(E) 解	約 差 損 益 金	△119,188,902,023	
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金	186,738,089,679	
(G) 合	計(C+D+E+F)	123,463,010,360	
次	期 繰 越 損 益 金(G)	123,463,010,360	

(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19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022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19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円ベース、為替ヘッジなし（ベンチマーク）	騰落率			
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	—	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	—	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	—	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—	141,964

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

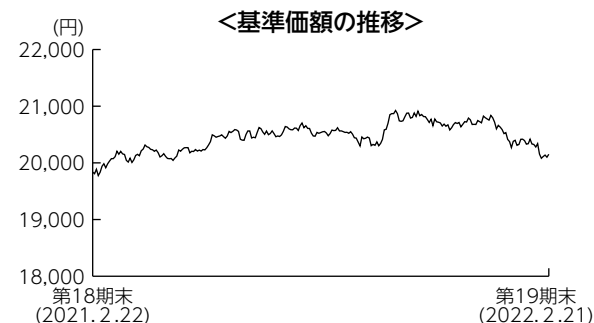
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 22 日	円 19,836	% -	ポイント 124,229.95	% -	% 98.4	% -
2 月 末	19,776	△0.3	124,359.44	0.1	99.0	-
3 月 末	20,213	1.9	126,595.03	1.9	95.3	-
4 月 末	20,206	1.9	126,569.17	1.9	97.6	-
5 月 末	20,477	3.2	128,227.80	3.2	98.9	-
6 月 末	20,443	3.1	128,117.08	3.1	97.7	-
7 月 末	20,584	3.8	128,989.36	3.8	98.8	-
8 月 末	20,579	3.7	128,937.19	3.8	98.7	-
9 月 末	20,439	3.0	128,115.00	3.1	98.8	-
10 月 末	20,879	5.3	130,788.36	5.3	98.8	-
11 月 末	20,647	4.1	129,217.14	4.0	98.6	-
12 月 末	20,775	4.7	130,157.13	4.8	99.3	-
2022 年 1 月 末	20,418	2.9	128,015.91	3.0	99.0	-
(期 末) 2022 年 2 月 21 日	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

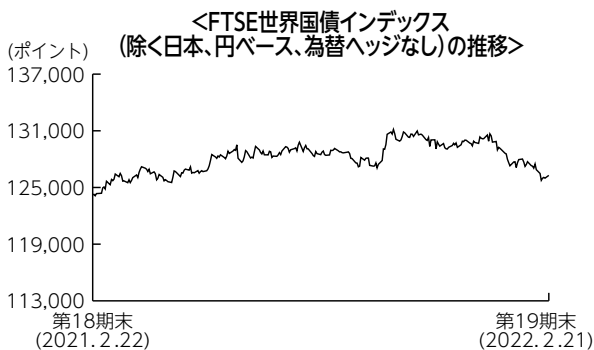


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

F O M C（米連邦公開市場委員会）による2022年複数回の利上げ示唆やインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもF O M Cによる早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）や2022年複数回の利上げとの見方から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、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもE C B（欧州中央銀行）がパンデ

ミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて円安ドル高が進みました。ユーロ／円は、E C Bがパンデミック緊急購入プログラムを予定通り2022年3月末で終了すること等を受けて円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

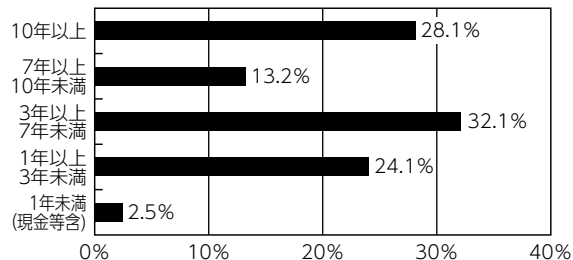
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

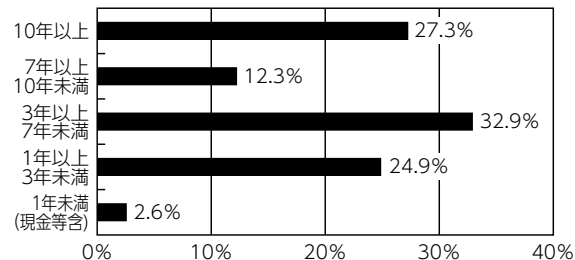
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

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

期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	47.3%	48.0%	△0.7%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	49.3%	50.0%	△0.7%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.7%	△0.0%
計	0.7%	0.7%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	△0.0%
ベルギー	2.2%	2.2%	△0.0%
フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
フランス	9.7%	9.8%	△0.1%
ドイツ	7.2%	7.2%	△0.0%
アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
イタリア	8.5%	8.7%	△0.2%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.0%
スペイン	5.7%	5.7%	0.0%
ユーロ計	37.8%	38.2%	△0.4%
デンマーク	0.4%	0.4%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	△0.0%
英国	5.8%	5.5%	0.3%
ポーランド	0.5%	0.5%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	△0.0%
計	45.0%	45.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.5%	1.6%	△0.0%
中国	0.9%	1.2%	△0.3%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.4%	3.7%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	△0.0%
計	0.4%	0.4%	△0.0%
現金など	1.1%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.013%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(2)	(0.012)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は20,455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 (2021年2月23日から2022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 268,986	千アメリカ・ドル 208,086	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,930	千カナダ・ドル 11,930	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 9,151	千オーストラリア・ドル 25,829	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,943	千シンガポール・ドル 1,051	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 17,354	千イギリス・ポンド 23,217	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2,356	千イスラエル・シケル 2,830	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 7,060	千デンマーク・クローネ 8,562	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,563	千ノルウェー・クローネ 1,066	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 8,059	千スウェーデン・クローナ 9,098	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 34,009	千メキシコ・ペソ 31,722	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 69,942	千オフショア・人民元 -	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 8,092	千マレーシア・リンギット 3,048	
	国	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 6,845	千ポーランド・ズロチ 10,987
ユーロ圏		アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,107	千ユーロ 3,037
		オランダ	国債証券	8,961	7,954
		ベルギー	国債証券	8,673	9,501
		フランス	国債証券	35,154	35,216
		ドイツ	国債証券	29,446	28,519
		スペイン	国債証券	20,859	19,722
		イタリア	国債証券	34,035	34,844
		フィンランド	国債証券	1,917	1,829
		オーストリア	国債証券	5,708	5,408

(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 (2021年2月23日から2022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 584,890	千アメリカ・ドル 583,959	千円 67,190,361	% 47.3	% -	% 21.3	% 16.7	% 9.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 30,950	千カナダ・ドル 31,321	千円 2,828,620	2.0	-	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 26,270	千オーストラリア・ドル 26,417	千円 2,185,214	1.5	-	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,070	千シンガポール・ドル 7,353	千円 629,080	0.4	-	0.3	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 45,350	千イギリス・ポンド 52,558	千円 8,228,549	5.8	-	4.4	0.8	0.6
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,260	千イスラエル・シケル 16,525	千円 593,263	0.4	-	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 29,720	千デンマーク・クローネ 34,886	千円 611,555	0.4	-	0.4	0.1	-
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 26,720	千ノルウェー・クローネ 26,440	千円 339,233	0.2	-	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,060	千スウェーデン・クローナ 31,703	千円 388,054	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 182,626	千メキシコ・ペソ 183,799	千円 1,043,651	0.7	-	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 69,550	千オフショア・人民元 70,200	千円 1,277,451	0.9	-	0.4	0.3	0.2
マレーシア	千マレーシア・リングギット 26,830	千マレーシア・リングギット 27,661	千円 759,920	0.5	-	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 24,380	千ポーランド・ズロチ 23,028	千円 662,640	0.5	-	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	8,040	8,505	1,108,814	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	17,350	19,673	2,564,646	1.8	-	1.2	0.4	0.2
ベルギー	21,000	23,852	3,109,389	2.2	-	1.6	0.4	0.1
フランス	95,460	106,041	13,823,543	9.7	-	6.2	2.6	0.9
ドイツ	69,560	78,033	10,172,441	7.2	-	4.3	1.9	1.0
スペイン	55,960	61,598	8,030,031	5.7	-	3.6	1.5	0.6
イタリア	85,330	92,683	12,082,236	8.5	-	5.0	2.4	1.0
フィンランド	6,020	6,268	817,158	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストリア	13,495	14,981	1,952,943	1.4	-	0.9	0.3	0.2
合 計	-	-	千円 140,398,802	98.9	-	53.9	30.0	15.0

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当 期	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		末 償還年月日
					額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.625 01/31/26		国債証券	2.6250	2,180	2,246	258,512	2026/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24		国債証券	2.2500	350	355	40,862	2024/01/31
US T N/B 1.75 01/31/23		国債証券	1.7500	4,980	5,012	576,759	2023/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24		国債証券	2.5000	3,890	3,965	456,290	2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24		国債証券	0.1250	5,000	4,874	560,850	2024/01/15
US T N/B 1.5 01/31/27		国債証券	1.5000	2,490	2,452	282,145	2027/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25		国債証券	1.3750	3,280	3,250	373,976	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28		国債証券	0.7500	3,390	3,174	365,233	2028/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26		国債証券	0.3750	1,500	1,418	163,164	2026/01/31
US T N/B 6.0 02/15/26		国債証券	6.0000	840	976	112,356	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42		国債証券	3.1250	680	768	88,430	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43		国債証券	3.1250	1,440	1,624	186,902	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46		国債証券	2.5000	1,770	1,816	208,954	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39		国債証券	3.5000	900	1,068	122,986	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31		国債証券	5.3750	700	902	103,811	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36		国債証券	4.5000	630	824	94,919	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41		国債証券	4.7500	1,200	1,659	190,943	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44		国債証券	3.6250	1,630	1,984	228,383	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49		国債証券	3.0000	3,070	3,512	404,149	2049/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38		国債証券	4.3750	550	719	82,811	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40		国債証券	4.6250	750	1,018	117,206	2040/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51		国債証券	1.8750	4,770	4,360	501,670	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26		国債証券	1.6250	2,180	2,165	249,125	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45		国債証券	2.5000	2,080	2,127	244,840	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47		国債証券	3.0000	1,640	1,845	212,366	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48		国債証券	3.0000	2,540	2,886	332,094	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24		国債証券	2.7500	5,320	5,450	627,135	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25		国債証券	2.0000	4,300	4,338	499,241	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29		国債証券	2.6250	4,110	4,301	494,897	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28		国債証券	2.7500	2,370	2,484	285,836	2028/02/15
US T N/B 2.0 02/15/23		国債証券	2.0000	4,370	4,410	507,447	2023/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27		国債証券	2.2500	3,550	3,622	416,791	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24		国債証券	2.1250	1,300	1,316	151,436	2024/02/29
US T N/B 1.5 02/28/23		国債証券	1.5000	1,000	1,003	115,513	2023/02/28
US T N/B 2.5 02/28/26		国債証券	2.5000	2,550	2,616	301,058	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25		国債証券	2.7500	1,660	1,710	196,774	2025/02/28
US T N/B 2.625 02/28/23		国債証券	2.6250	1,800	1,827	210,279	2023/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31		国債証券	1.1250	6,860	6,409	737,420	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41		国債証券	1.8750	4,110	3,824	440,015	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50		国債証券	2.0000	3,270	3,079	354,288	2050/02/15
US T N/B 1.375 02/15/23		国債証券	1.3750	4,000	4,012	461,696	2023/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27		国債証券	1.1250	1,100	1,063	122,319	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30		国債証券	1.5000	2,970	2,881	331,543	2030/02/15
US T N/B 0.125 02/15/24		国債証券	0.1250	4,000	3,894	448,050	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25		国債証券	1.1250	1,000	983	113,136	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28		国債証券	1.1250	3,020	2,889	332,523	2028/02/29
US T N/B 0.5 02/28/26		国債証券	0.5000	2,500	2,372	273,020	2026/02/28
US T N/B 2.125 03/31/24		国債証券	2.1250	4,080	4,130	475,221	2024/03/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	2,000	2,007	231,000	2023/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,209	254,220	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	2,260	2,297	264,403	2026/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	3,020	3,065	352,693	2023/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	1,800	1,694	195,021	2027/03/31	
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	4,810	4,686	539,213	2024/03/15	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	1,300	1,252	144,149	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	2,910	2,801	322,294	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	2,570	2,461	283,275	2026/03/31	
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	2,000	1,986	228,603	2023/03/15	
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	3,000	3,014	346,892	2023/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,798	206,967	2026/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,534	291,636	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,350	385,452	2024/04/30	
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	2,000	1,978	227,648	2023/04/15	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	3,170	3,049	350,891	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	5,000	4,880	561,546	2024/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,000	1,868	215,027	2027/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	3,000	2,871	330,348	2026/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,000	1,916	220,510	2025/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	945	108,785	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	800	1,058	121,762	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,378	158,590	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,087	125,135	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,051	121,019	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	1,900	2,061	237,247	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	4,300	4,403	506,624	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,530	1,799	207,027	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	500	556	64,083	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,290	1,455	167,456	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,810	1,857	213,700	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	1,630	1,896	218,229	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	2,100	1,727	198,775	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,090	3,463	398,477	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	540	717	82,505	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	3,890	3,839	441,813	2041/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	2,620	2,636	303,364	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	4,240	4,328	497,992	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,320	3,361	386,804	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	4,683	538,845	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,810	2,899	333,573	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,700	4,824	555,104	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	692	79,692	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,090	3,067	352,896	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,913	335,277	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	4,816	554,195	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	3,780	2,961	340,805	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,075	238,821	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	6,740	6,567	755,601	2031/05/15	
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,331	383,330	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,620	301,472	2025/05/31	

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 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,398	160,926	2027/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,960	340,582	2023/05/15
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,000	3,844	442,351	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	2,000	1,943	223,611	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,220	3,807	438,060	2030/05/15
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,000	2,868	330,051	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,257	489,888	2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,461	398,325	2023/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	815	93,823	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,450	1,453	167,188	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,851	213,090	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,345	154,794	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,540	1,434	165,079	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,881	331,507	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,762	317,851	2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,852	328,217	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,666	421,912	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	3,180	365,912	2026/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	1,928	221,936	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,375	273,331	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,704	426,196	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,336	383,859	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,573	181,003	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国債証券	0.1250	2,640	2,594	298,501	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,000	2,833	326,019	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,500	3,234	372,176	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	949	109,262	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,200	3,037	349,465	2026/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,072	123,419	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	871	100,296	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,379	158,727	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	430	458	52,757	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	1,982	228,144	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,056	121,546	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,170	1,420	163,489	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	3,690	3,475	399,893	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	740	809	93,126	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	2,680	2,700	310,769	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,034	234,124	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	1,490	1,479	170,247	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,405	506,928	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	3,993	459,456	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	1,710	1,675	192,809	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,710	3,085	355,027	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,530	2,583	297,208	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,047	350,619	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,730	3,948	454,270	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,694	194,934	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,380	3,316	381,610	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	825	94,960	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,214	254,829	2023/08/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	3,570	3,241	372,977	2041/08/15	
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,500	2,867	329,970	2040/08/15	
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,040	3,267	375,941	2050/08/15	
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	7,160	6,739	775,493	2031/08/15	
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	5,920	5,322	612,401	2030/08/15	
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,079	124,173	2026/08/31	
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,417	278,180	2024/08/31	
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,000	947	109,055	2025/08/31	
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	3,500	3,396	390,848	2024/08/15	
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,963	225,931	2023/08/15	
US T N/B 0.125 08/31/23	国債証券	0.1250	530	520	59,850	2023/08/31	
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,000	2,853	328,352	2028/08/31	
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	4,340	4,030	463,722	2027/08/31	
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,000	3,814	438,917	2026/08/31	
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,470	169,205	2025/09/30	
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	2,966	341,339	2024/09/30	
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	1,500	1,499	172,549	2023/09/30	
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	859	98,938	2023/09/30	
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,961	225,697	2023/09/15	
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	1,050	967	111,270	2027/09/30	
US T N/B 0.25 09/30/23	国債証券	0.2500	2,500	2,455	282,514	2023/09/30	
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,900	1,883	216,718	2026/09/30	
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,875	330,846	2028/09/30	
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,840	326,815	2025/09/30	
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	2,370	2,270	261,294	2026/09/30	
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,937	222,946	2024/09/15	
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,000	2,031	233,787	2024/10/31	
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,002	230,442	2025/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	4,500	4,514	519,388	2023/10/31	
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,779	434,853	2023/10/31	
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,350	1,338	153,996	2026/10/31	
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,000	3,862	444,455	2028/10/31	
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,200	2,191	252,123	2024/10/31	
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,778	319,655	2027/10/31	
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	2,000	1,937	222,892	2026/10/31	
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	3,500	3,410	392,359	2024/10/15	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,890	217,463	2025/10/31	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,030	118,560	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,108	127,573	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,790	1,990	229,031	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	510	663	76,330	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,220	1,300	149,607	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	857	98,608	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,360	1,682	193,639	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,140	2,316	266,523	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,400	3,786	435,703	2050/11/15	
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	3,700	3,389	389,951	2051/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	650	726	83,611	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	920	1,011	116,391	2046/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	4,768	548,611	2024/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	910	1,199	138,021	2039/11/15	

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 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,242	373,069	2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,827	325,339	2049/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	4,690	4,767	548,526	2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	3,670	3,949	454,385	2028/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,642	649,272	2023/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,140	2,157	248,248	2026/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,335	383,829	2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,023	232,852	2023/11/30	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,810	2,401	276,361	2040/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	1,770	1,678	193,091	2041/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,794	206,452	2026/11/30	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	1,919	220,879	2029/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	3,520	3,344	384,823	2031/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,000	5,497	632,515	2030/11/15	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,862	214,326	2027/11/30	
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	2,000	1,948	224,196	2026/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	2,000	1,946	223,971	2028/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	1,991	229,167	2024/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,456	282,592	2025/11/30	
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	1,490	1,454	167,340	2024/11/15	
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,124	359,482	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,361	271,659	2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,048	350,735	2024/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	1,740	1,735	199,641	2026/12/31	
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,952	224,672	2023/12/15	
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	1,390	1,353	155,753	2026/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,603	184,484	2024/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	1,500	1,447	166,596	2028/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,841	326,950	2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	2,430	2,260	260,078	2027/12/31	
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	3,710	3,643	419,185	2024/12/15	
小 計	—	—	584,890	583,959	67,190,361	—	
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	500	495	44,751	2023/02/01	
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	197	17,807	2024/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	537	48,581	2024/03/01	
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	460	462	41,759	2023/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	692	62,548	2025/03/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,300	1,228	110,932	2026/03/01	
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	400	390	35,242	2027/03/01	
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,461	131,967	2024/04/01	
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	1,000	988	89,230	2023/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	695	62,790	2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,271	114,826	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	520	715	64,624	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	535	48,333	2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,550	1,583	143,008	2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	540	695	62,770	2041/06/01	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,212	109,543	2023/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	420	426	38,543	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	900	918	82,937	2025/06/01	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	675	60,979	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	630	56,956	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,734	156,601	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	1,970	1,907	172,277	2031/06/01
CANADA 0.25 08/01/23	国債証券	0.2500	700	689	62,232	2023/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	439	39,675	2024/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	880	888	80,238	2023/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,550	1,488	134,402	2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,070	1,036	93,644	2026/09/01
CANADA 0.5 11/01/23	国債証券	0.5000	620	610	55,141	2023/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	610	759	68,622	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	580	648	58,602	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,430	2,348	212,098	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	710	639	57,733	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	400	36,137	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,500	1,338	120,867	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	600	578	52,208	2031/12/01
小計	—	—	30,950	31,321	2,828,620	—
(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	760	785	64,983	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	190	199	16,492	2025/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,480	1,528	126,464	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,810	1,985	164,228	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	1,120	1,181	97,774	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,000	1,075	88,946	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	880	1,073	88,815	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	879	72,734	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	800	810	67,006	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,550	1,587	131,338	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	743	61,485	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	990	900	74,452	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	672	55,650	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,300	1,221	101,046	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	550	45,578	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	930	736	60,943	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	310	291	24,079	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,160	1,208	99,940	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,697	140,408	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,260	1,316	108,875	2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	900	855	70,797	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,427	118,110	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,450	1,370	113,335	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	940	908	75,142	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,560	1,409	116,583	2030/12/21
小計	—	—	26,270	26,417	2,185,214	—
(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 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	280	284	24,320	2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	200	201	17,243	2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	730	789	67,560	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	465	39,811	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	440	412	35,308	2050/03/01

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		
(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 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	418	35,777	2042/04/01		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	380	396	33,923	2028/05/01		
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	350	29,947	2025/06/01		
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	420	428	36,631	2026/06/01		
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	470	500	42,793	2029/07/01		
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	180	185	15,907	2039/07/01		
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	715	61,239	2023/07/01		
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	200	193	16,586	2031/07/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	486	41,584	2036/08/01		
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	572	48,948	2024/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	395	33,869	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	280	316	27,103	2033/09/01		
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	50	47	4,041	2051/10/01		
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	200	192	16,482	2025/11/01		
小計	-	-	7,070	7,353	629,080	-		
(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	910	1,198	187,615	2044/01/22		
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,080	1,487	232,834	2045/01/22		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	770	1,369	214,476	2060/01/22		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	510	537	84,226	2049/01/22		
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	760	657	102,874	2046/01/31		
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	390	365	57,179	2039/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,760	275,652	2024/01/31		
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	400	378	59,298	2029/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	500	468	73,305	2028/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,486	232,735	2023/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	800	766	119,924	2026/01/30		
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,310	1,455	227,867	2025/03/07		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	890	1,197	187,505	2036/03/07		
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,470	1,462	229,020	2024/04/22		
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,010	1,283	200,906	2032/06/07		
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	750	735	115,172	2025/06/07		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,030	1,025	160,497	2047/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	390	367	57,480	2051/07/31		
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	870	1,352	211,735	2052/07/22		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,210	1,322	207,050	2057/07/22		
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,365	213,801	2065/07/22		
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,692	264,929	2068/07/22		
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	800	809	126,754	2026/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	700	701	109,749	2027/07/22		
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	960	954	149,441	2023/07/22		
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	450	423	66,261	2033/07/31		
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,600	1,440	225,486	2031/07/31		
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	711	111,373	2035/07/31		
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	720	1,022	160,094	2039/09/07		
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	980	994	155,756	2023/09/07		
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	497	77,913	2024/09/07		
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	810	126,909	2025/09/07		
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	860	1,154	180,758	2034/09/07		
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,140	1,171	183,379	2037/09/07		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	540	564	88,306	2054/10/22		

銘柄	種別	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				期		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	970	724	113,407	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	500	571	89,527	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	1,040	985	154,333	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	360	289	45,252	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	930	953	149,261	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	910	883	138,310	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	600	553	86,710	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国債証券	0.3750	1,130	1,083	169,622	2026/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	560	732	114,725	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	880	1,302	203,854	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	980	1,496	234,327	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,000	1,557	243,803	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,020	1,784	279,345	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	780	910	142,526	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	860	1,240	194,254	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	870	1,118	175,105	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	850	1,379	215,906	2049/12/07
小計	—	—	45,350	52,558	8,228,549	—
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,300	1,939	69,626	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,390	1,668	59,882	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,610	2,729	97,979	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	2,100	2,237	80,332	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	1,350	1,299	46,637	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	2,320	2,422	86,951	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	1,000	906	32,543	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,030	2,091	75,096	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	1,160	1,231	44,214	2028/09/28
小計	—	—	15,260	16,525	593,263	—
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	2,020	1,812	31,777	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,580	12,594	220,783	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	5,320	5,663	99,274	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	7,130	7,244	126,993	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	4,370	4,426	77,595	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	3,300	3,144	55,131	2031/11/15
小計	—	—	29,720	34,886	611,555	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,770	3,706	47,558	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,900	1,878	24,102	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	5,800	5,950	76,342	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,784	48,551	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	2,064	26,486	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,800	1,814	23,276	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	3,730	3,529	45,283	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,750	2,691	34,538	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	1,100	1,020	13,095	2031/09/17
小計	—	—	26,720	26,440	339,233	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,270	4,718	57,750	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,840	1,865	22,828	2028/05/12

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	
(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 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	7,980	8,544	104,583	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,150	2,061	25,236	2031/05/12	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	3,147	38,531	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	4,700	4,821	59,017	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	3,250	3,330	40,769	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,170	3,213	39,335	2029/11/12	
小計	—	—	29,060	31,703	388,054	—	
(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	22,143	20,617	117,071	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	8,000	7,945	45,118	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	17,831	101,253	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	17,000	16,945	96,218	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	17,883	101,546	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	18,000	18,103	102,793	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	11,643	11,266	63,973	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	12,654	12,543	71,223	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	13,125	13,738	78,010	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,085	6,015	34,156	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	6,000	5,948	33,775	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	19,796	20,900	118,678	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,059	79,832	2023/12/07	
小計	—	—	182,626	183,799	1,043,651	—	
(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 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	1,100	1,166	21,228	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,000	5,914	107,628	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	17,000	17,130	311,720	2026/08/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	5,000	5,024	91,437	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	4,950	5,121	93,188	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	14,500	14,631	266,248	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国債証券	2.5600	15,000	15,083	274,470	2023/10/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	3,000	3,023	55,026	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,000	3,104	56,500	2027/12/03	
小計	—	—	69,550	70,200	1,277,451	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	817	22,469	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,239	34,042	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,208	88,140	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,898	52,164	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,204	33,102	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,400	1,518	41,716	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	917	25,192	2031/04/15	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,015	55,366	2028/06/15	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,016	27,921	2024/06/14	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,505	68,829	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,700	2,849	78,268	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,700	1,666	45,788	2034/07/05	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,700	2,785	76,521	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,153	59,172	2043/09/30	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	500	513	14,096	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	800	819	22,508	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	500	532	14,619	2033/11/07	
小計	—	—	26,830	27,661	759,920	—	

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
				千ユーロ	千円			
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円			
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426		2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807		2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471		2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538		2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511		2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,343	67,436		2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,250	2,097	60,362		2027/07/25	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,740	2,760	79,430		2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	194	5,590		2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	1,000	967	27,838		2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,900	2,362	67,981		2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,400	1,190	34,246		2026/10/25	
小計	-	-	24,380	23,028	662,640		-	
(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	600	715	93,311		2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	270	289	37,710		2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	320	344	44,947		2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	710	831	108,340		2025/03/13	
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	596	77,813		2023/03/20	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	220	201	26,216		2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	420	448	58,429		2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	358	46,691		2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	729	95,067		2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	390	405	52,905		2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	520	544	71,027		2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	640	666	86,860		2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	390	431	56,310		2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	350	327	42,749		2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	560	560	73,123		2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	660	616	80,393		2031/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	450	436	56,912		2030/10/18	
小計	-	-	8,040	8,505	1,108,814		-	
(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	1,130	1,820	237,294		2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,140	1,731	225,699		2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	610	507	66,184		2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,107	144,358		2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,060	1,590	207,300		2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	980	1,197	156,063		2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	400	366	47,727		2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	630	628	81,879		2040/01/15	
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	1,310	1,321	172,313		2024/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	270	265	34,662		2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	920	918	119,747		2027/01/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	450	464	60,613		2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,130	1,155	150,680		2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,130	1,194	155,728		2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,280	1,298	169,317		2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	980	1,019	132,861		2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	1,038	135,341		2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	792	103,283		2029/07/15	

銘	柄	当				期		末										
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日			
									外	貨						建	金	額
(ユーロ…オランダ)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	千	円			
NETHERLANDS 0.0 07/15/30		国	債	証	券	0.0000	750			732			95,503					2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31		国	債	証	券	0.0000	540			522			68,087					2031/07/15
小計		-			-		17,350			19,673			2,564,646					-
(ユーロ…ベルギー)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	千	円			
BELGIUM 5.5 03/28/28		国	債	証	券	5.5000	1,190			1,579			205,883					2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41		国	債	証	券	4.2500	1,110			1,726			225,101					2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26		国	債	証	券	4.5000	430			511			66,618					2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32		国	債	証	券	4.0000	730			975			127,215					2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35		国	債	証	券	5.0000	890			1,356			176,852					2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33		国	債	証	券	1.2500	710			757			98,749					2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45		国	債	証	券	3.7500	520			802			104,603					2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47		国	債	証	券	1.6000	670			730			95,183					2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50		国	債	証	券	1.7000	670			742			96,847					2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57		国	債	証	券	2.2500	350			442			57,642					2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66		国	債	証	券	2.1500	420			528			68,887					2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71		国	債	証	券	0.6500	330			239			31,190					2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26		国	債	証	券	1.0000	1,110			1,156			150,786					2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24		国	債	証	券	2.6000	1,020			1,089			142,056					2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31		国	債	証	券	1.0000	930			967			126,153					2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23		国	債	証	券	2.2500	830			860			112,180					2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28		国	債	証	券	0.8000	670			692			90,232					2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40		国	債	証	券	0.4000	430			384			50,166					2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29		国	債	証	券	0.9000	1,050			1,091			142,303					2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34		国	債	証	券	3.0000	590			745			97,225					2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38		国	債	証	券	1.9000	520			597			77,842					2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25		国	債	証	券	0.8000	1,140			1,175			153,216					2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27		国	債	証	券	0.8000	840			869			113,351					2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37		国	債	証	券	1.4500	440			473			61,703					2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30		国	債	証	券	0.1000	800			774			101,002					2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24		国	債	証	券	0.5000	670			684			89,179					2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31		国	債	証	券	0.0000	770			724			94,451					2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23		国	債	証	券	0.2000	660			667			86,984					2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27		国	債	証	券	0.0000	510			504			65,775					2027/10/22
小計		-			-		21,000			23,852			3,109,389					-
(ユーロ…フランス)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	千	円			
FRANCE OAT 0.0 02/25/23		国	債	証	券	0.0000	900			905			118,033					2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/27		国	債	証	券	0.0000	900			893			116,427					2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26		国	債	証	券	0.0000	2,460			2,459			320,568					2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24		国	債	証	券	0.0000	1,150			1,158			151,067					2024/02/25
FRANCE OAT 03/25/24		国	債	証	券	0.0000	2,520			2,538			330,929					2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25		国	債	証	券	0.0000	2,970			2,982			388,857					2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23		国	債	証	券	0.0000	2,200			2,214			288,740					2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23		国	債	証	券	8.5000	1,030			1,139			148,583					2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26		国	債	証	券	3.5000	2,520			2,885			376,190					2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41		国	債	証	券	4.5000	2,250			3,645			475,175					2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55		国	債	証	券	4.0000	1,260			2,208			287,887					2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60		国	債	証	券	4.0000	730			1,332			173,752					2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29		国	債	証	券	5.5000	2,540			3,473			452,785					2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35		国	債	証	券	4.7500	1,550			2,325			303,111					2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45		国	債	証	券	3.2500	1,600			2,317			302,054					2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48		国	債	証	券	2.0000	1,690			2,027			264,241					2048/05/25

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,000	2,153	280,743	2050/05/25		
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	1,890	1,661	216,658	2052/05/25		
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	650	564	73,560	2053/05/25		
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	820	934	121,829	2066/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	600	409	53,334	2072/05/25		
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,095	273,231	2024/05/25		
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	3,240	3,783	493,197	2030/05/25		
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	3,270	3,369	439,218	2028/05/25		
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,090	3,351	436,918	2031/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,490	2,541	331,291	2025/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,220	2,240	292,119	2029/05/25		
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,540	2,676	348,849	2034/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,770	2,823	368,124	2026/05/25		
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,460	2,568	334,893	2027/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,270	1,168	152,287	2040/05/25		
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	2,530	2,604	339,501	2023/05/25		
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,590	2,716	354,108	2036/05/25		
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,690	1,931	251,834	2039/06/25		
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	740	658	85,778	2044/06/25		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	3,130	3,379	440,558	2023/10/25		
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,207	287,769	2025/10/25		
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,840	3,255	424,434	2027/10/25		
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,630	2,424	315,993	2038/10/25		
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,100	3,213	418,890	2032/10/25		
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,511	327,439	2024/11/25		
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,220	2,306	300,662	2025/11/25		
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,150	2,164	282,208	2026/11/25		
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,420	2,490	324,648	2028/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	2,330	2,190	285,531	2031/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	2,800	2,670	348,092	2030/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,550	2,465	321,428	2029/11/25		
小計	—	—	95,460	106,041	13,823,543	—		
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千円			
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	948	123,666	2024/01/04		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,160	1,551	202,289	2028/01/04		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,060	138,228	2030/01/04		
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	1,840	239,989	2031/01/04		
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,640	2,539	331,104	2037/01/04		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,660	1,702	221,937	2025/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,810	1,860	242,473	2026/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,390	1,413	184,200	2029/02/15		
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	920	939	122,528	2023/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,640	1,691	220,524	2028/02/15		
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,750	1,830	238,578	2024/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,960	1,994	260,015	2027/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,660	1,640	213,861	2031/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,690	1,680	219,101	2030/02/15		
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,030	1,037	135,296	2023/04/14		
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,540	1,555	202,804	2024/04/05		
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,250	1,261	164,486	2025/04/11		
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	1,430	1,440	187,818	2026/04/10		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,950	2,035	265,395	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,693	220,794	2023/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,200	1,150	149,983	2035/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,350	1,282	167,216	2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	962	125,497	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,100	1,438	187,564	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	940	1,571	204,821	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	890	1,406	183,381	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,588	337,393	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,140	2,048	267,093	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,660	2,590	337,716	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,890	2,844	370,749	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	340	293	38,310	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,820	2,202	287,112	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,470	1,534	200,020	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,000	2,061	268,687	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,691	220,559	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,810	1,840	239,894	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	2,930	3,045	397,055	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,387	180,840	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,610	1,605	209,236	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,720	1,515	197,499	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	700	688	89,817	2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	400	354	46,263	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	1,983	258,522	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	497	64,872	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	450	444	57,879	2031/08/15
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,141	148,776	2024/10/18
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,292	168,527	2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,050	1,056	137,737	2026/10/09
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,400	1,412	184,079	2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	670	677	88,267	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,200	1,202	156,812	2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	500	499	65,155	2028/11/15
小 計	-	-	69,560	78,033	10,172,441	-
(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	1,580	2,146	279,779	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,239	161,636	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,100	1,516	197,750	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,160	1,224	159,683	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,397	182,120	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	350	340	44,369	2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	1,113	145,100	2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	800	789	102,872	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,519	198,019	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,190	1,293	168,562	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,240	1,300	169,567	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,353	176,490	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,440	1,504	196,136	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,223	159,528	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	610	580	75,615	2032/04/30

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	1,850	1,793	233,770	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,190	1,087	141,787	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	995	129,797	2023/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	860	860	112,236	2024/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,370	1,703	222,091	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	970	1,494	194,794	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,250	1,907	248,683	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	920	1,238	161,501	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,577	205,608	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,580	206,074	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,220	1,776	231,601	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,383	180,316	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,310	1,367	178,225	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,200	1,268	165,354	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,240	1,249	162,917	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,434	187,009	2023/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	544	70,953	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	130	115	15,067	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,211	157,965	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,655	215,832	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,030	1,326	172,940	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	910	1,514	197,484	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,060	1,310	170,797	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	930	1,112	145,026	2048/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	300	227	29,687	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,170	950	123,969	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,475	192,408	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,500	1,570	204,667	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,460	1,520	198,168	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,180	1,159	151,089	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,110	1,198	156,228	2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,100	1,036	135,128	2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,080	1,005	131,124	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,370	1,399	182,486	2030/10/31
小計	-	-	55,960	61,598	8,030,031	-
(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	1,300	1,291	168,400	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	998	130,164	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	1,783	232,520	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,072	270,150	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,430	1,497	195,200	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,075	140,225	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,400	1,386	180,688	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,120	1,190	155,201	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,227	159,980	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,390	1,512	197,148	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	597	77,858	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	320	272	35,457	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,031	264,838	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,872	244,062	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,320	1,307	170,477	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	820	929	121,160	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,010	1,168	152,264	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,540	1,774	231,373	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,084	141,403	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	932	121,560	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	900	839	109,392	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	770	715	93,310	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	900	771	100,534	2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,080	1,017	132,594	2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	590	504	65,821	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,110	1,093	142,518	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,000	930	121,342	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,000	994	129,643	2024/04/15
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	990	956	124,655	2026/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	1,470	2,019	263,279	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,480	192,978	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	810	839	109,403	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,340	1,378	179,643	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,100	1,135	148,013	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,504	196,073	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	920	974	127,019	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	240	220	28,724	2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	500	505	65,929	2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	680	716	93,373	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,239	161,638	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	500	475	61,960	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	900	937	122,157	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,160	281,700	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	1,875	244,464	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,034	265,239	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,040	1,092	142,411	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,330	1,478	192,718	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,610	1,450	189,092	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,170	1,107	144,315	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	1,000	1,006	131,207	2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	600	576	75,134	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,041	135,760	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,387	180,919	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,153	150,425	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	2,044	266,502	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,390	1,982	258,409	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	970	968	126,221	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	900	761	99,299	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,140	1,209	157,653	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	400	371	48,394	2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,210	1,313	171,238	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	570	731	95,390	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	690	707	92,242	2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,430	1,417	184,755	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	991	129,249	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	930	967	126,187	2023/10/01

銘	柄	当期					末 償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,190	1,370	178,690	2023/11/01	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	350	452	58,980	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,790	2,321	302,647	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,050	2,626	342,385	2029/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,040	1,068	139,252	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	550	586	76,490	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	970	1,017	132,608	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,230	1,249	162,836	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,170	1,236	161,223	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,000	1,096	142,937	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,180	1,093	142,509	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,480	1,477	192,595	2030/12/01	
小計	-	-	85,330	92,683	12,082,236	-	
(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	220	177	23,186	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	260	273	35,684	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	250	256	33,383	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	280	318	41,553	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	490	500	65,291	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	290	306	39,982	2034/04/15	
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	470	481	62,729	2023/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	260	238	31,114	2036/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	430	491	64,026	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	420	488	63,688	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	250	339	44,288	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	370	374	48,819	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	330	341	44,573	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	100	101	13,230	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	500	510	66,608	2027/09/15	
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	280	282	36,810	2023/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	230	208	27,147	2040/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	240	230	30,093	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	170	163	21,288	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	180	181	23,654	2024/09/15	
小計	-	-	6,020	6,268	817,158	-	
(ユーロ…オーストリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	210	398	51,885	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	430	490	63,891	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	770	778	101,527	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	775	799	104,275	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	530	505	65,876	2031/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	690	666	86,824	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	740	890	116,106	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	890	1,328	173,218	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	290	274	35,831	2051/03/20	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	250	203	26,524	2071/04/20	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	650	664	86,564	2027/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/23	国債証券	0.0000	200	201	26,239	2023/04/20	
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	70	70	9,164	2025/04/20	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	680	821	107,048	2034/05/23	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	250	183	23,878	2120/06/30	

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…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	470	695	90,658	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	670	894	116,617	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	650	654	85,320	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	800	806	105,126	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	350	469	61,196	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	450	473	61,744	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	480	495	64,647	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	640	670	87,454	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	140	128	16,772	2036/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	780	808	105,434	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	300	254	33,233	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	190	186	24,248	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	150	165	21,628	2086/11/02
小 計	—	—	13,495	14,981	1,952,943	—
合 計	—	—	—	—	140,398,802	—

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
公 社 債	140,398,802		98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,603,315		1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	142,002,117		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、141,683,656千円、99.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.06円、1カナダ・ドル=90.31円、1オーストラリア・ドル=82.72円、1シンガポール・ドル=85.55円、1イギリス・ポンド=156.56円、1イスラエル・シェケル=35.899円、1デンマーク・クローネ=17.53円、1ノルウェー・クローネ=12.83円、1スウェーデン・クローナ=12.24円、1メキシコ・ペソ=5.678円、1オフショア・人民元=18.197円、1マレーシア・リンギット=27.471円、1ポーランド・ズロチ=28.774円、1ユーロ=130.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	142,002,117,999円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	794,768,295
公 社 債(評価額)	140,398,802,240
未 収 利 息	769,298,727
前 払 費 用	39,248,737
(B) 負 債	37,199,000
未 払 解 約	37,199,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	141,964,918,999
元 本	70,448,298,510
次 期 繰 越 損 益	71,516,620,489
(D) 受 益 権 総 口 数	70,448,298,510口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,152円

(注1) 期首元本額	69,085,269,493円	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
追加設定元本額	27,244,251,872円	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,795,660円
一部解約元本額	25,881,222,855円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	412,429,256円
(注2) 期末における元本の内訳		9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	180,716,406円
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,932,936,286円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	87,293,544円
MITOラップ型ファンド(安定型)	10,339,634円	DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770円
MITOラップ型ファンド(中立型)	40,206,625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)	515,001円
MITOラップ型ファンド(積極型)	116,655,366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)	358,315円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	57,288,539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)	100,794,148円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,587,798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)	418,167円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,681,845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)	546,045円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381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)	30,957,907円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433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	461,773,967円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145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)	294,771円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円	DIAM海苔フルレン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)	5,739,805,045円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円	DIAM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,636,710,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,562,881,929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)	6,482,910円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,405,812,637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)	328,688,088円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	53,529,486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)	382,425,252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)	645,235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)	74,160,647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)	421,372,128円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,634,953円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	364,777円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	17,641,800円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	41,091,423円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,714,858円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	681,339円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,361,009円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,296,983,167円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	48,455,016円
One DC 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,982,846,491円
Oneグローバルバランス	6,106,309円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	711,700,267円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,769,411,536円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,226,508,317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)	118,777,737円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,403,942,419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)	155,311,687円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	398,546,899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)	1,842,758,601円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	832,352,900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)	419,588,655円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	708,824,350円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,247,697円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	14,028,565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)	357,842,695円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	469,729,710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)	352,697,590円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	33,691,463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)	479,890,739円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	134,924,668円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	57,398,790円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	124,156,154円	期末元本合計	70,448,298,510円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円		
フルーズコントロール	314,234,233円		

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,669,252,055	円
	受取利息	2,669,419,651	
	支払利息	△167,596	
(B)	有価証券売買損益	△631,639,253	
	売却益	7,707,170,489	
	売却損	△8,338,809,742	
(C)	その他の費用	△18,689,995	
(D)	当期損益金(A+B+C)	2,018,922,807	
(E)	前期繰越損益金	67,952,264,861	
(F)	解約差損益金	△26,936,052,307	
(G)	追加信託差損益金	28,481,485,128	
(H)	計(D+E+F+G)	71,516,620,489	
	次期繰越損益金(H)	71,516,620,489	

(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。