

## 償還 運用報告書 (全体版)

第14期 <償還日 2022年3月14日>

### D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合	
信託期間	2015年8月28日から2022年3月14日(当初無期限)までです。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。	
主要投資対象	D I A Mコア資産設計 ファンド(積極型)	以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等に投資する場合があります。
	国内債券バッシブ・ 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。
	国内株式バッシブ・ファンド (厳選化法)・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。
	外国債券バッシブ・ 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。
	外国株式バッシブ・ 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。
	エマージング債券 バッシブ・マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	エマージング株式 バッシブ・マザーファンド	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
		マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等 <sup>(※)</sup> に投資する場合があります。 (※)市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 6資産の配分比率(基本配分比率)は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(合計資産比率)を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を一定水準(下値目安値 <sup>(※)</sup> )までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。 (※)基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります)。
投資制限	各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	決算日(原則として4月、10月の各11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：まもラップ (積極型)

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)」は、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容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/>

# DIAMコア資産設計ファンド (積極型)

## ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託(受益証券)組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
(設定日) 2015年8月28日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	% -	百万円 466
1期(2015年10月13日)	9,901	0	△1.0	17.5	1.0	52.9	-	-	0.1	519
2期(2016年4月11日)	9,230	0	△6.8	5.8	0.2	53.6	-	-	0.0	418
3期(2016年10月11日)	9,286	0	0.6	56.8	1.5	35.2	-	-	0.4	404
4期(2017年4月11日)	9,691	0	4.4	23.6	1.0	15.7	-	-	0.2	368
5期(2017年10月11日)	10,451	0	7.8	58.7	1.9	36.7	-	-	0.4	312
6期(2018年4月11日)	10,571	0	1.1	7.7	0.3	5.7	-	-	0.1	297
7期(2018年10月11日)	10,089	0	△4.6	26.1	1.4	18.5	-	-	0.2	290
8期(2019年4月11日)	10,353	0	2.6	58.5	2.3	30.5	-	-	0.4	310
9期(2019年10月11日)	9,819	0	△5.2	10.7	0.7	6.4	-	-	0.1	281
10期(2020年4月13日)	10,067	0	2.5	19.7	3.4	12.3	-	-	0.1	205
11期(2020年10月12日)	10,975	0	9.0	57.0	3.7	31.1	-	-	0.4	201
12期(2021年4月12日)	12,155	0	10.8	59.6	2.7	31.5	-	-	0.4	192
13期(2021年10月11日)	11,899	0	△2.1	18.8	1.2	10.6	-	-	0.1	201
(償還日) 2022年3月14日	(償還価額) 11,538.73	0	△3.0	-	-	-	-	-	-	162

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注6) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 比	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 ( 転 換 社 債 ) 組 入 比 率	債 先 比	券 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率							
(期 首)		%	%	%	%	%	%	%	%
2021 年 10 月 11 日	11,899	—	18.8	1.2	10.6	—	—	—	0.1
10 月 末	12,069	1.4	58.3	3.4	32.9	—	—	—	0.4
11 月 末	11,766	△1.1	54.9	2.3	33.1	—	—	—	0.4
12 月 末	11,860	△0.3	37.2	2.7	21.4	—	—	—	0.2
2022 年 1 月 末	11,543	△3.0	20.2	0.9	11.7	—	—	—	0.1
2 月 末	11,544	△3.0	—	—	—	—	—	—	—
(償 還 日)	(償 還 価 額)								
2022 年 3 月 14 日	11,538.73	△3.0	—	—	—	—	—	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

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

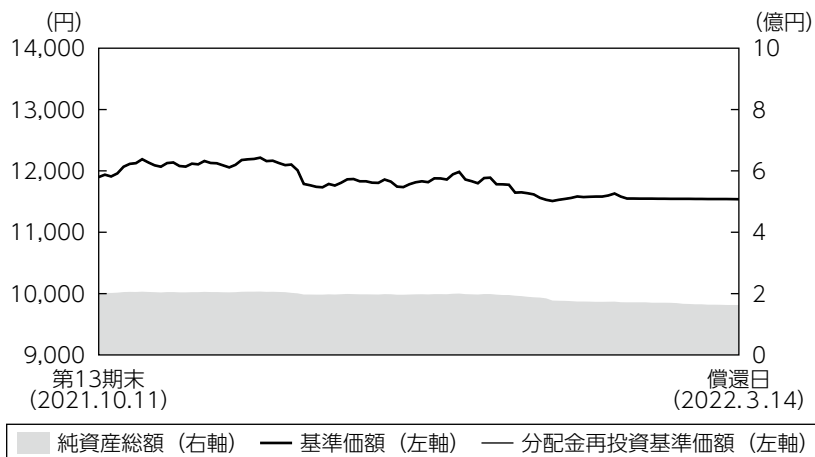
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■設定以来の運用経過（2015年8月28日から2022年3月14日まで）

### 第14期の基準価額等の推移



第14期首： 11,899円  
 償還日： 11,538.73円  
 （既払分配金0円）  
 騰落率：  $\Delta 3.0\%$   
 （分配金再投資ベース）

- （注1）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- （注2）分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- （注3）分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- （注4）当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

当期は、F R B（米連邦準備理事会）の資産買い入れ縮小の加速への警戒感や、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念に加え、ロシアのウクライナ侵攻を受けて株式市場が下落し、基準価額は下落しました。

また、当ファンドの基準価額は設定来で15.4%上昇しました。

2018年10月から12月には米中貿易摩擦の激化や、2020年2月下旬には新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から株式市場は急落しました。しかし、各国の金融当局による景気対策の導入等により2020年3月下旬から反発し、経済正常化と新型コロナウイルスのワクチン開発・接種の進展期待から堅調に推移したことなどが、基準価額にプラスに寄与しました。

### ◆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
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	$\Delta 1.4\%$
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	$\Delta 3.9\%$
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	$\Delta 1.6\%$
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.4%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	$\Delta 2.9\%$
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	$\Delta 0.0\%$

（注）組入ファンドの騰落率は、当ファンドが保有していた期間（2022年2月15日まで）の騰落率です。

## 設定来の投資環境

国内債券市場は上昇（利回りは低下）しました。2016年1月には日銀の「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の実施などを受けて利回りは低下（価格は上昇）しました。その後、2016年7月の追加金融緩和政策が市場期待を下回ったことをきっかけに利回りは低下幅を縮小しました。2018年10月には米中貿易摩擦が激化したことなどにより利回りは再び低下しました。その後は各国中央銀行の金融政策正常化観測などから利回りは上昇（価格は下落）傾向となりましたが、設定来では利回りは低下となりました。

国内株式市場は、2016年半ばから2017年末にかけて、企業業績が好調であったことなどを要因として上昇しました。しかし、2018年10月から12月には米中貿易摩擦の激化などを受けて反落しました。また、2020年初めに新型コロナウイルスの感染拡大から一時的に急落しましたが、2020年11月から2021年半ばには世界各国での低金利政策などを要因として上昇しました。2022年2月には、ロシアによるウクライナ侵攻を受けて下落しました。

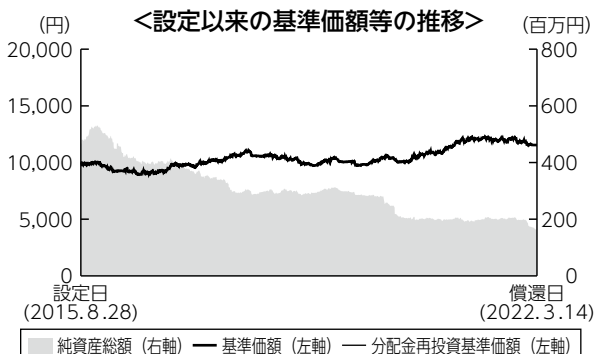
先進国債券市場では、米国債の利回りは上昇しました。一方、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債については、2018年までは景気拡大から利回りは上昇しました。その後、米中貿易交渉や景気減速懸念から利下げが始まりました。足元では新型コロナウイルスのワクチン接種やインフレ懸念から利回りは上昇しました。ドイツ債については、イギリスのEU（欧州連合）離脱を象徴とする反EU勢力の躍進や新型コロナウイルスの感染拡大を受けて利回りは低下しました。

先進国株式市場は上昇しました。2016年に入ると原油安等から軟調に推移しましたが、米国大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、経済政策に対する期待から2016年11月以降上昇基調となりました。2020年2月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から株式市場は急落しましたが、景気対策の導入等により同年3月下旬から反発し、経済正常化と新型コロナウイルスのワクチン開発・接種の進展期待から堅調に推移しました。期末にかけてはウクライナ情勢の緊迫化などから調整しました。

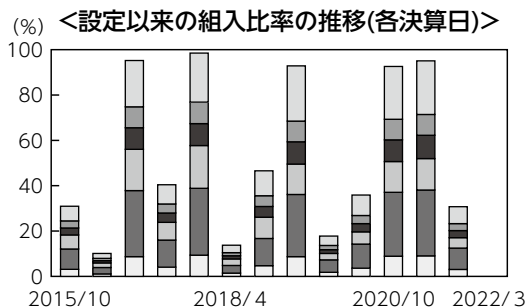
新興国債券市場は上昇しました。設定当初から2017年にかけては、米国大統領選挙による一時的な下落はあったものの、景気回復への期待感などから上昇しました。2019年には米国の利下げへの期待感などから再度上昇しました。その後は2020年の新型コロナウイルスの影響による急落・急騰を経て、感染拡大と経済状況から荒い展開となりました。期末にはロシアがウクライナに軍事侵攻を行ったことにより急落しましたが、設定来では上昇しました。対米国債スプレッドは拡大しました。

新興国株式市場は上昇しました。設定当初、原油安等から一時下落しましたが、ハイテク企業の好決算等を受け反発しました。その後、米国金利の上昇による新興国からの資金流出懸念により下落しましたが、米中通商協議の進展を受け上昇しました。2020年2月には新型コロナウイルスの世界的感染拡大から急落しましたが、中国経済の回復等により上昇基調に転じました。その後、中国不動産大手の破綻懸念やウクライナ情勢の緊迫化から不安定な展開が続く中、償還を迎えました。

為替市場では対ドル、対ユーロともに円高が進みました。米欧ともに緩和的な金融緩和政策を実施したことなどを背景にして長期金利が低下したことや、新型コロナウイルス感染拡大に伴うリスク回避的な動きが強まったことなどから、ドル、ユーロに対して円高が進みました。その後、2021年に入ると、欧米の中央銀行の金融政策正常化観測などを受けて長期金利が上昇し、ドル、ユーロに対して円安が進みました。



- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。



【国内債券】	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
【国内株式】	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
【外国債券】	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
【外国株式】	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
【新興国債券】	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
【新興国株式】	エマージング株式パッシブ・マザーファンド

(注) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

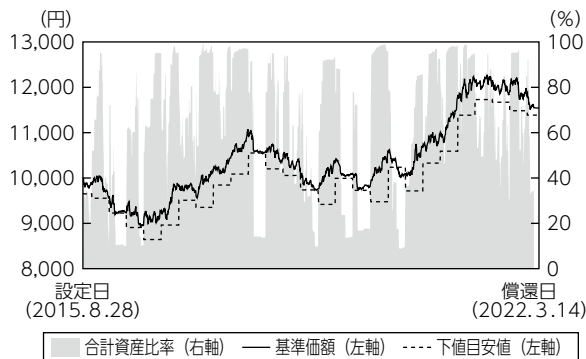
## 設定来のポートフォリオについて

### ●当ファンド

国内外の6つのマザーファンドへの分散投資を行いつつ、基準価額の下落幅を抑制する運用を行いました。基準価額の動きに応じて、合計資産比率を約10%程度から約100%程度で調整しました。株式市場の急落に伴い、基準価額が下落した局面では、合計資産比率を10%程度に引き下げ、基準価額下落の抑制を図りました。

※ 合計資産比率は純資産総額に対する各マザーファンド評価額の合計の割合です。

## ＜設定以来の基準価額と合計資産比率の推移＞



●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。

●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。

●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。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（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。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2021年10月12日 ～2022年3月14日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58円	0.487%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,817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)	(27)	(0.232)	
(販売会社)	(27)	(0.232)	
(受託会社)	( 3)	(0.023)	
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(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)	( 1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.008	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	( 1)	(0.008)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.029	(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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 1)	(0.007)	
(その他)	( 3)	(0.021)	
合計	63	0.531	

(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。

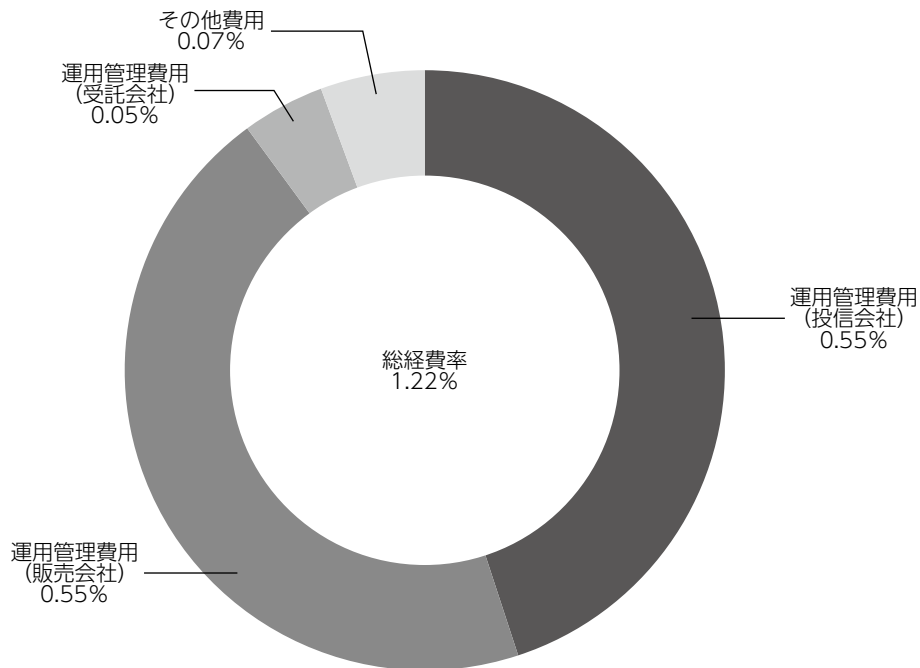
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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1.22%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10月12日から2022年3月14日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,833	27,200	25,542	33,242
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	24,672	81,700	30,454	97,885
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,061	41,400	24,580	50,312
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,852	28,300	6,000	34,683
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	10,890	24,000	13,741	29,733
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	46,660	68,000	57,092	81,872

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	586,997,494千円	399,443,512千円	63,864,295千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	410,140,457千円	639,276,350千円	69,199,416千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.43	0.62	0.92

(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10月12日から2022年3月14日まで）

### 【D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）における利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	11千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.012千円
(B) / (A)	0.1%

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

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

#### 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
公 社 債	百万円 472,436	百万円 61,720	% 13.1	百万円 360,364	百万円 56,721	% 15.7

平均保有割合 0.0%

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

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

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
株 式	百万円 267,080	百万円 142,041	% 53.2	百万円 319,917	百万円 178,129	% 55.7

平均保有割合 0.0%

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

#### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,938	百万円 2,541	百万円 2,450

(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
株 式	百万円 892

**【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。

**【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。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

**■組入資産の明細**

償還時における有価証券の組入れはありません。前期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

	期 首 (前期末)
	□ 数
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 4,708
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	5,781
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,518
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,147
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,851
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	10,431

## ■投資信託財産の構成

2022年3月14日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	163,885 千円	100.0 %
投 資 信 託 財 産 総 額	163,885	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3月14日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは167,469,118千円、99.9%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは623,143,816千円、99.9%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは56,878,360千円、83.9%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは67,676,747千円、99.5%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3月14日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=117.61円、1カナダ・ドル=92.29円、1オーストラリア・ドル=85.55円、1香港・ドル=15.02円、1シンガポール・ドル=86.25円、1ニュージーランド・ドル=79.94円、1台湾・ドル=4.143円、1イギリス・ポンド=153.40円、1イスラエル・シェケル=36.042円、1スイス・フラン=125.67円、1トルコ・リラ=7.962円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=13.07円、1スウェーデン・クローナ=12.10円、1メキシコ・ペソ=5.623円、1フィリピン・ペソ=2.249円、100チリ・ペソ=14.613円、100コロンビア・ペソ=3.078円、1クウェート・ディナール=387.90円、1カタール・リアル=32.28円、1サウジアラビア・リアル=31.40円、1インド・ルピー=1.55円、100インドネシア・ルピア=0.83円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=32.07円、1ブラジル・レアル=23.171円、1チェコ・コルナ=5.119円、100韓国・ウォン=9.52円、1オフショア・人民元=18.485円、1マレーシア・リンギット=28.017円、1南アフリカ・ランド=7.82円、1タイ・バーツ=3.52円、1ポーランド・ズロチ=26.862円、100ハンガリー・フォリント=33.703円、1ユーロ=128.48円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年3月14日)現在

項 目	償 還 時
(A) 資 産	163,885,593円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	163,885,593
(B) 負 債	937,123
未 払 信 託 報 酬	937,067
未 払 利 息	56
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	162,948,470
元 本	141,218,719
償 還 差 損 益 金	21,729,751
(D) 受 益 権 総 口 数	141,218,719口
1万口当たり償還価額(C/D)	11,538円73銭

(注) 期首における元本額は169,675,212円、当期中における追加設定元本額は1,885,251円、同解約元本額は30,341,744円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年10月12日 至2022年3月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,012円
受 取 利 息	617
支 払 利 息	△4,629
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,147,044
売 買 益	1,369,926
売 買 損	△5,516,970
(C) 信 託 報 酬 等	△937,067
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△5,088,123
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	21,697,406
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,120,468
(配 当 等 相 当 額)	(7,320,022)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,199,554)
(G) 合 計(D+E+F)	21,729,751
償 還 差 損 益 金(G)	21,729,751

(注1) (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2) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

## 《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)

## ■投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2015年8月28日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年3月14日		資産総額	163,885,593円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は 追加信託	負債総額	937,123円
				純資産総額	162,948,470円
受益権口数	466,575,487口	141,218,719口	△325,356,768口	受益権口数	141,218,719口
元本額	466,575,487円	141,218,719円	△325,356,768円	1万口当たり償還金	11,538円73銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	525,100,792円	519,897,760円	9,901円	0円	0.00%
第2期	453,746,912	418,801,644	9,230	0	0.00
第3期	435,936,301	404,799,079	9,286	0	0.00
第4期	380,235,909	368,483,929	9,691	0	0.00
第5期	299,233,986	312,728,234	10,451	0	0.00
第6期	281,225,161	297,296,736	10,571	0	0.00
第7期	288,266,653	290,846,552	10,089	0	0.00
第8期	300,150,602	310,735,210	10,353	0	0.00
第9期	286,906,788	281,717,626	9,819	0	0.00
第10期	204,592,403	205,964,312	10,067	0	0.00
第11期	183,367,275	201,252,102	10,975	0	0.00
第12期	158,587,012	192,757,151	12,155	0	0.00
第13期	169,675,212	201,903,845	11,899	0	0.00

### 償還金のお知らせ

1万口当たり償還金（税引前）	11,538円73銭
----------------	------------

#### 償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置の適用を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは取扱販売会社までお問い合わせ下さい。

# 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)。



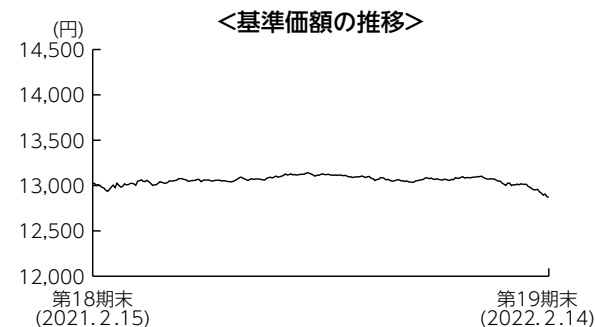
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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	債券先物率
		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）

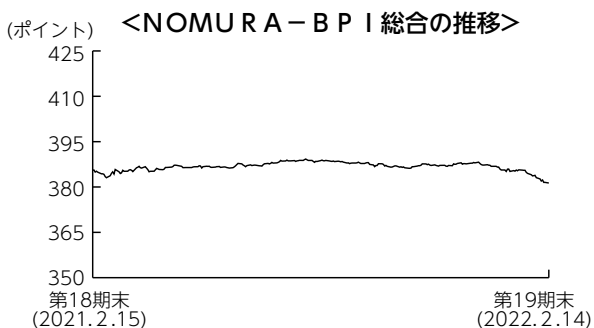


### 基準価額の推移

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。

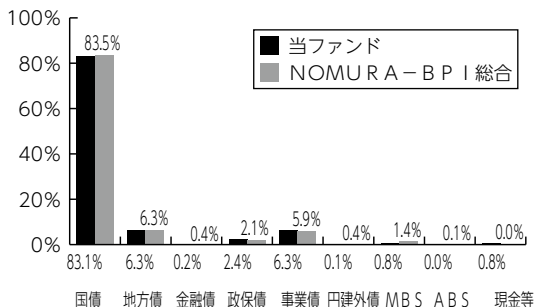
### ポートフォリオについて

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。

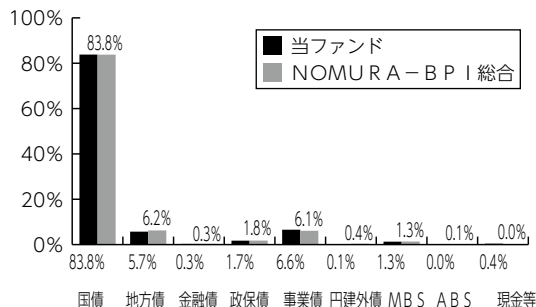
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

### ○セクター別構成比

期首 (前期末)

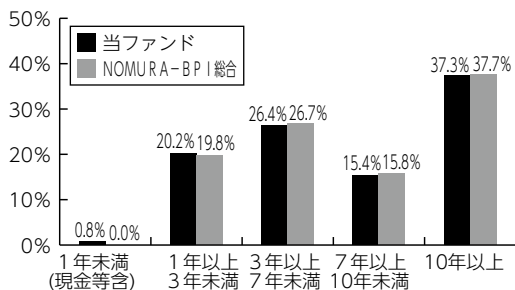


期末

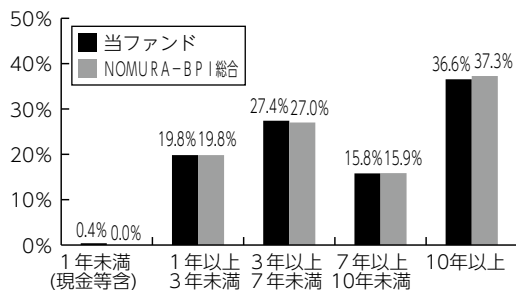


### ○残存年限別構成比

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		
	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
(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
(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	600,000	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
<b>(国債証券)</b>					
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
<b>(国債証券)</b>					
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
<b>(国債証券)</b>		%	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 -
<b>(地方債証券)</b>		%	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
<b>(地方債証券)</b>		%	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	福岡県公募公債 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	大阪市公募公債	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
3 0年度3回	堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067 2028/12/19
2 3 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	大阪市公募公債 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)	%	千円	千円	
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)	%	千円	千円	
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)	%	千円	千円	
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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	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・債務返済機構債	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
<b>(特殊債券)</b>	%	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	-
<b>(金融債券)</b>	%	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	-
<b>(普通社債券)</b>	%	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(BFCM)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
<b>(普通社債券)</b>	%	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 プリダストーン社債	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		
	千円		%
公 社 債	551,087,616		91.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	50,748,215		8.4
投 資 信 託 財 産 総 額	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 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 (中立的)	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 (中立的)	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	
	その他の収益	4,106,122	
	支払利息	△958,146	
(B)	有価証券売買損益	△10,450,257,321	
	売却益	660,402,300	
	売却損	△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)	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。

# 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

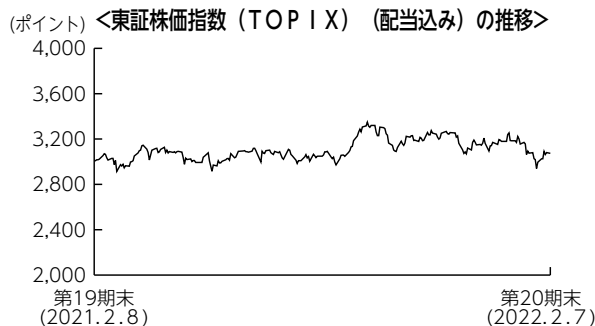
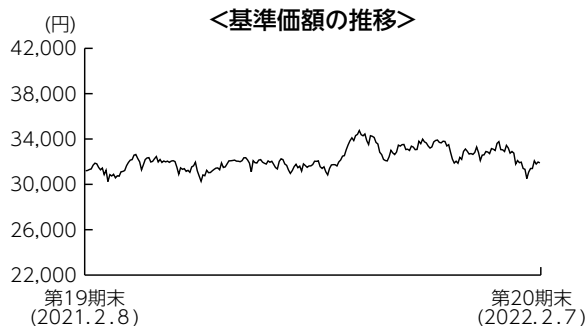
年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 8日	円 31,202	% -	ポイント 3,006.47	% -	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	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 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																								
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																						
日本たばこ産業	636.5	791.4	1,851,876	共和レザー	6.8	9.2	6,127	トリケミカル研究所	9.8	14.9	44,342	ケンコーマヨネーズ	7.3	8.5	11,517	昭和電工	87.9	124.8	297,398	ADEKA	53.3	66.3	167,473	くわばや日洋ホールディングス	7.8	9.6	18,240	住友化学	911.2	1,057.7	619,812	日油	43.6	49.2	252,888	などり	6.9	8.1	16,200	住友精化	5.7	6.4	21,184	新日本理化学	19	23.6	5,923	イフジ産業	2.3	2.5	2,350	日産化学	63.9	78.4	516,656	ハリマ化成グループ	8.7	11	8,987	ビッパルスコポーレーション	2.8	7.2	11,419	ラサ工業	3.8	5	8,095	花王	283.1	325.3	1,709,126	ファーマフーズ	-	14	22,848	クレハ	9.9	11.5	103,960	第一工業製薬	3.9	5.4	15,660	ユーグレナ	51.2	75	54,750	多木化学	4.5	5.6	29,400	石原ケミカル	3	7.5	9,915	紀文食品	-	8.6	8,187	テイカ	8.4	10.8	14,850	日華化学	4.3	5	4,015	ミヨシ油脂	4.4	6.2	6,869	石原産業	20.6	23.8	27,631	ニイタカ	2.4	3	6,849	理研ビタミン	11.2	15.4	26,257	片倉コープアグリ	2.4	2.5	2,875	三洋化成工業	6.9	8.6	44,118	繊維製品 (0.5%)	片倉工業	15.6	13.8	33,992	東ソー	178.9	207.7	396,083	有機合成薬品工業	9.2	10.3	2,811	片倉ゼン	8.5	9.6	37,008	トクヤマ	34.3	46	90,666	大日本塗料	13.2	17.8	14,453	東洋紡	45.8	56.9	74,254	セントラル硝子	22	23.5	49,514	日本ペイントホールディングス	95.5	541.2	459,478	ユニチカ	33.8	39.2	11,956	東亜合成	70.7	80.1	90,352	関西ペイント	130.1	149.3	342,792	富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	大阪ソーダ	11.9	13.5	40,567	神東塗料	9.3	10	1,540	倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	関西電化工業	27.3	31.6	34,033	中国塗料	27.9	34	30,668	シキボウ	6.6	7.9	7,244	デンカ	42.2	52.4	190,474	日本特殊塗料	8.7	10.9	9,156	日本毛織	38.1	43.4	38,929	信越化学工業	214.1	247.4	4,693,178	藤倉化成	16	18.3	8,820	ダイトウボウ	19.3	23.8	2,118	日本カーバイド工業	4.2	5.2	7,082	太陽ホールディングス	8.5	21.2	68,158	トア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	堺化学工業	8.1	10	20,310	ＤＩＣ	48.9	60.9	182,517	ダイドーミテッド	16.6	20.5	2,870	第一稀元素化学工業	11.7	13.4	15,276	サカタククス	25.3	28.7	28,183	帝国繊維	13	16.3	32,811	エア・ウォーター	118.1	136.2	238,350	東キョーケイホールディングス	9.4	30.5	58,712	帯人	109	135.4	187,393	日本薬品ホールディングス	95.3	138.5	316,195	T&K TOKA	24.1	11.7	10,120	東レ	838.4	1,042.5	699,309	日本化学工業	3.2	4.6	12,134	富士フィルムホールディングス	207.8	258.5	1,967,702	サカイオーベックス	3.1	-	-	資生堂	235	273.9	1,642,578	住江織物	2.1	3.4	6,504	東邦アセチレン	1.9	2.6	3,302	ライオン	153.7	177.6	268,708	日本フェルト	5.5	5.9	2,643	日本パーカライジング	58.4	72.6	74,632	高砂香料工業	7.4	10.3	28,953	イチカワ	1.3	1.4	1,937	高圧ガス工業	18.5	23.1	17,278	マンダム	24.7	30.9	39,644	日東製網	1.3	1.7	2,459	チタン工業	1.5	1.7	2,774	ミルボン	15.8	18.3	99,735	アツギ	9.3	11.5	6,704	四国化成工業	15.5	19	26,600	ファンケル	43	59.6	185,356	ダイニック	3.6	3.8	2,728	戸田工業	2.4	3.2	9,968	コーセー	22.2	27.7	304,146	セーレン	28.5	29.6	61,952	ステラ ケミファ	6.3	7.2	17,978	コタ	7	9.4	14,720	ソト	4	6.2	5,139	保土独化学工業	3.4	4.6	24,012	シーボン	1.3	1.4	2,525	東海染工	1.3	1.4	1,605	日本触媒	21	24.2	144,716	ポレラ・オルビスホールディングス	50.5	62.8	108,895	小松マテール	19.1	23.6	29,877	大日精化工業	9.6	12	27,108	ノビアホールディングス	10	12.6	63,252	ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	カナカ	30	37.3	145,843	アジパルホールディングス	3	3.5	3,846	ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	三菱瓦斯化学	116	133.8	285,529	新日本製薬	2.4	4	5,300	クラウディアホールディングス	2.4	2.5	590	三井化学	100	130.8	397,632	エステー	7.7	9.5	14,601	T S Jホールディングス	34.7	47.9	15,807	J S R	116.2	134.4	463,680	アグロ カネショウ	4.5	5	6,515	マツカコーポレーション	3.7	4.6	5,409	東京応化工業	19.9	23.3	147,955	コニシ	19.5	24.1	38,222	ワールド	15.1	18.9	22,264	大阪有機化学工業	10.7	12.2	36,429	長谷川香料	20.5	25.5	61,786	三陽商会	6	6.9	5,954	三菱ケミカルホールディングス	774.1	962.6	807,910	星光PMC	6.9	8.6	5,633	ナイガイ	3.8	4.1	1,160	K Hネオケム	19.1	23.7	72,640	小林製薬	33.1	41.3	391,111	オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	ダイセル	155.5	207.2	181,507	荒川化学工業	9.9	12.3	13,849	ルックホールディングス	4	4.6	6,076	住友ベークライト	18.2	22.8	121,752	メック	8.1	11	33,880	キムラタン	68.3	79.9	1,518	積水化学工業	244.9	301.3	583,618	日本高純度化学	3.3	4.1	10,569	ゴールドウイン	19.1	26	158,340	日本ゼオン	104.5	129.8	175,489	タカラバイオ	31	38.5	88,280	デサント	19.8	28.1	97,085	アイカ工業	32.2	40.1	127,317	JCU	13.3	16.6	75,613	キング	4.6	6.7	3,463	宇部興産	58.4	67.8	147,058	新田セラチン	7.7	9.3	6,045	ヤマインターナショナル	10.6	13.3	3,790	積水樹脂	19.1	21.9	43,843	OA Tアグリオ	2.3	3.2	6,425	パルプ・紙 (0.2%)	王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	タキロンシーアイ	25.2	31.4	17,552	デクセラアルズ	33	38.2	118,420	日本製紙	51.1	69	81,213	旭有機材	6.6	8.1	17,528	アース製薬	8.9	12.1	71,027	三菱製紙	17.1	21.3	6,794	ニチバン	6.2	8.6	14,852	北興化学工業	10.9	13.8	10,874	北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	リケンテクノス	28.2	35.4	16,142	大成ラミック	3.7	4.6	12,962	中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	大倉工業	5.5	7.5	15,037	クミアイ化学工業	48.8	54.8	44,223	巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	積水化成工業	15.6	19.6	8,800	日本農業	21.2	26.4	14,018	大王製紙	56	69.6	133,284	群栄化学工業	2.2	3.5	12,075	アキレス	8.2	9.4	11,637	阿波製紙	3	4	1,324	タイガースポリマー	6.7	8.5	3,714	有沢製作所	16.5	21.5	21,414	レンゴ	119.4	136.3	117,763	ミライアル	3.7	4.7	6,974	日東電工	75.7	89	775,190	トーモク	7.2	9	15,849	ダイキアクシス	4.3	5.6	3,925	レック	14	19.1	18,106	ザ・パック	8.7	11	29,931	ダイキョーニシカワ	24.5	30.7	18,696	三光合成	12.4	15.5	5,766	化学 (6.6%)	北の達人コーポレーション	41.4	51.4	11,205	竹本容器	4.2	5.3	4,202	きもと	18.9	22.9	4,854	クラレ	182.3	210.4	217,764	森六ホールディングス	6.3	7.9	15,634	藤森工業	10.6	13.2	54,978	旭化成	767.5	954.1	1,064,775	恵和	1.7	3.6	18,504	前澤成工業	7.8	9.5	11,789	未来工業	4.3	5.5	8,475	扶桑化学工業	9.1	12.9	61,081	ウェーブテックホールディングス	4	5.6	3,931	エフピコ	21.8	27	91,125



銘柄		当期			銘柄		当期			銘柄		当期		
株数		株数	評価	金額	株数		株数	評価	金額	株数		株数	評価	金額
		千株	千円	千円			千株	千円	千円			千株	千株	千円
三浦工業	50.6	63	207,585	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	4.3	—	—	IHI	79.5	91.8	214,353				
ツガミ	24.2	31.9	41,629	28.2	32.6	22,689	サノリスホールディングス	15.5	17	2,227				
オークマ	13.6	16.9	81,458	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	20.5	21.7	17,967	電気機器 (18.0%)							
アマダ	171.2	229.4	251,651	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	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	1.9	2.4	4,524	コニカミノルタ		239.4	320.9	159,808			
FUJII	46.6	67	168,103	6	6	1,578	ブラザー工業		144.3	179.5	398,490			
牧野フライス製作所	13.7	16	60,320	1.9	2.7	7,641	ミネベアミツミ		203.7	253.4	676,831			
オーエスジー	57.6	67.3	136,551	49	61.1	338,494	日立製作所		568.4	707.2	4,163,993			
ダイジェット工業	1	1.1	1,083	1.2	1.2	3,584	東芝		—	256.9	1,233,120			
旭ダイヤモンド工業	31	38.3	23,133	12.2	13.5	12,433	三菱電機		1,182.4	1,470.1	2,072,841			
DMG森精機	73.9	86.3	149,557	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	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	3.8	4.2	32,550	安川電機		127.3	158.4	760,320			
日東工器	5.7	8.1	13,024	4.4	5.5	14,069	シンフオンテクノロジー		15.4	17.7	22,319			
日進工具	4.6	11.6	16,576	64	79.7	379,770	明電舎		20	24.9	61,104			
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	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	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	9.8	12.2	9,064	デンヨー		10.1	12.6	21,092			
OKK	4.8	5.6	4,244	20	23	18,653	PfCホールディングス		—	16.9	27,124			
石川製作所	3	3.9	5,752	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	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	6.4	6.9	5,837	マブチモーター		32.7	34.1	122,760			
エンシュウ	2.4	3.5	2,289	1.7	1.8	3,117	日本電産		284.6	381.1	3,803,759			
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	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	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	3.4	4.3	8,931	東光高岳		6	8.2	11,783			
イワキ	7.6	9.4	9,428	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	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	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	28	31.8	96,513	JVCケンウッド		101.9	119.5	22,346			
やまびこ	22.6	28.3	29,941	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	7.6	9.4	15,199	イー・P・E・X		5.5	6.9	11,854			
平田機工	5.5	6.9	39,054	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	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	5.6	6.9	8,583	オムロン		98.4	122.4	1,006,984			
タツモ	4.9	6.9	9,694	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	31	38.5	84,199	I D E C		15.9	18.3	42,639			
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	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	16.5	20.4	3,957	不二電機工業		2.3	3.4	3,672			
S M C	34.6	43.1	2,754,521	10.6	12.5	9,062	ジー・エス・ユア 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	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	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	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	19	21.2	23,977	ダイオモンドエレクトロニクスホールディングス		3.4	4.1	4,374			
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	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	4.5	5.4	7,225	富士通		106.4	132.4	2,133,626			
日本エアテック	3.8	6.8	7,459	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	16	19.9	29,631	岩崎通信機		4.4	6.3	5,134			
日精樹脂工業	9.2	10.4	10,649	22.5	32.2	46,657	電気興業		5.7	7.9	18,264			
オカダアイオン	3.8	4.7	6,909	37.2	43	373,240	サンケン電気		13.8	13.8	65,274			
ワイエイシイホールディングス	4.6	5.7	7,022	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	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	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			
日立建機	55.3	58.9	172,577	113.3	140.9	147,663	セイコーエプソン		146.6	182.4	335,980			
日工	17.6	20.4	12,444	—	11	12.6	ウコム		85.5	114	101,688			
巴工業	4.8	5.9	13,044	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	73.7	83	233,977	アクセル		4.9	6.3	6,545			
TOWA	11	12.6	30,769	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	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	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	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	12.1	14.9	46,190	能美防炎		15.7	19.5	40,540			
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	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	154.2	179	711,883	星和電機		5.9	7.2	3,916			
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	45.7	53	19,610	エレコム		13.5	33.7	46,000			
月島機械	21.8	27.3	28,310	93.7	124.3	92,354	パナソニック		1,260.9	1,568.1	1,884,072			





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	エーアイディー	7.2	8.8	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	内外トランスライン	4.1	5.4	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	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	プロネクサス	10.3	11.5	12,443	鴻池運輸	19	23.5	27,518	クロスキャスト	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	ウッドワン	3.4	4.6	4,950	ハマキョウワレックス	9.1	10.6	30,390	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	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	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	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	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	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	TAKARA & COMPANY	5.8	7.4	13,912	名古屋鉄道	92.1	114.5	209,420	ソフトウエアホールディングス	4.5	6.4	24,128	アシックス	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	ツツミ	3	3.8	7,079	アルプス物流	-	9.9	10,038	J N S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	-	-	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	グリナー	71.1	65.7	55,647	ヤマハ	70.3	85.5	459,135	丸連	7.6	8.3	2,008	GMOペパボ	0.8	1.5	3,427	河合楽器製作所	3.3	4.1	12,209	丸全昭和運輸	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	クリナップ	11.4	14	7,462	セコグループホールディングス	61.9	69.9	64,587	三菱総合研究所	5	6.3	24,223	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	オリバー	2.4	-	-	ニッコンホールディングス	37.6	46.8	99,216	兼松サステック	0.6	0.6	990	日本石油輸送	0.9	1.1	2,905	キングジム	10.2	12.3	10,750	福山通運	14.4	23	83,950	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	イトーキ	23.3	26.8	9,326	エスライン	3	3.2	2,870	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836	任天堂	67.7	83	4,854,670	神奈川中央交通	2.5	3.4	11,424	K l a b	21.2	26.3	11,440	三菱鉛筆	19.5	24.2	29,741	日立物流	24.7	26.9	144,184	ネットウイングス	15.4	20.9	20,628	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	イーブイクイニシアティブジャパン	1.9	-	-	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	ネクソン	293.1	325.4	761,110	ナカバヤシ	12.1	14	7,224	九州旅客鉄道	86.4	107.8	262,277	アイスタイル	35.3	43.7	8,871	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	EMアークホールディングス	3	16.4	12,956	オカムラ	45.4	50.6	60,517	N I P P O N E X P R E S S ホールディングス	-	48.2	325,350	エイチーム	8	9.9	7,365	美津濃	11.7	14.7	33,236	海運業 (0.6%)				エニジモ	10.9	15.5	9,935	東京電力ホールディングス	1,002.3	1,100.2	392,771	日本郵船	93.6	116.4	1,080,192	テクノスジャパン	8.9	11.2	5,084	中部電力	361.8	449.8	504,675	商船三井	66.4	77.1	669,999	e n i s h	5.9	8.8	3,176	関西電力	448	557	595,990	川崎汽船	34.5	42.9	288,717	コロプラ	38	47.3	32,069	中国電力	170.7	229.8	200,615	N Sユナイテッド海運	5.4	7.7	27,373	オルトプラス	6.8	11.2	3,550	北陸電力	108.1	134.6	71,607	明治海運	12.3	16.5	13,447	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,953	東北電力	276.8	343.8	249,255	飯野海運	52.4	64.5	35,668	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644	四国電力	98.2	132.5	103,880	共栄タンカー	2.2	2.5	2,310	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046	九州電力	261	303	249,369	乾汽船	5.9	9.4	22,800	システム情報	8.5	10.9	10,235	北海道電力	110.3	127.8	64,283	日本航空	272.7	319.2	730,968	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984	沖縄電力	23	31.4	44,117	ANAホールディングス	302.1	353.8	914,926	じげん	28.2	40.6	12,504	電源開発	94	125.2	246,644	パスコ	2.2	2.8	3,687	アイキューブ	6.3	14.7	11,848	エフオン	7.2	8.9	4,823	倉庫・運輸関連業 (0.2%)				エンカレッジ・テクノロジー	2.2	3.4	1,846	イーレックス	17.3	21.7	31,877	トランコム	3.4	4	29,680	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248	レノバ	19.9	28.7	42,906	日新	9	11.3	18,825	ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140	東京瓦斯	227.3	281.8	647,858	フィックスターズ	12.2	15.4	11,180	大阪瓦斯	214.1	266.1	542,045	CARTA HOLDINGS	4.7	5.7	11,052	東邦瓦斯	58.1	67.5	212,625	三菱倉庫	38.7	44.1	123,921	オプティム	8.1	10	10,030	北海道瓦斯	6.6	7.6	11,384	三井倉庫ホールディングス	11.9	14.9	35,298	セレス	3.8	5.3	10,054	広島ガス	25.4	29.1	10,417	住友倉庫	40.3	49.2	102,483	S H I F T	5.2	7.3	149,650	西部ガスホールディングス	13.3	16.6	36,188	滋澤倉庫	6.3	8.5	18,122	ティアーガイア	12.3	12.7	21,272	静岡ガス	33.5	38.4	38,246	東陽倉庫	16.8	22.8	7,204	セック	1.7	2.3	5,101	メタウォーター	13.4	15.3	30,890	日本トランスシティ	25.1	30.8	19,681	ケイビシ	1.7	2.8	3,875	日本アジアグループ	11.2	-	-	陸運業 (3.0%)				中央倉庫	6.4	8.8	8,544	テクマトリックス	17.9	24.3	38,102	S B Sホールディングス	8.7	11	35,970	川西倉庫	2.1	2.9	3,169	プロシッパ	3.4	4.9	6,615	東武鉄道	123.2	143.6	407,680	安田倉庫	9.6	12	11,520	ガホー・オオラシ・エンターテイメント	27.9	37.5	91,612	相鉄ホールディングス	40.5	47	100,298	ファイブホールディングス	2	2.9	1,771	GMOペイメントゲートウェイ	24.6	28	278,880	東急	298.1	370.8	579,931	東洋埠頭	3	3.2	4,678	ザッパラス	4.6	5.6	2,671	京浜急行電鉄	151.8	188.7	223,609	宇徳	8.5	-	-	システムリサーチ	3.4	4	7,040	小田急電鉄	189.4	218.7	444,398	上組	62.4	76.7	171,961	インターネットインシアティブ	30.9	38.5	149,765	京王電鉄	66	76.3	392,945	サンリツ	2.3	4	3,360	ざくらインターネット	12.2	15.4	7,792	京成電鉄	88.6	102.5	328,000	キムラユニティー	3.5	4	5,436	ウインクス	3.2	4.2	3,465	富士急行	16.1	17.6	68,552	キューソー流通システム	2.9	7.3	6,570	GMOのびネットホールディングス	2.5	3.3	11,715	新京成電鉄	3	3.4	6,810	近鉄エクスプレス	21.2	26.3	78,374	S R Aホールディングス	6.2	7.2	21,124



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
TOKAIホールディングス		千株	千円		千株	千円	OUGホールディングス		千株	千円		千株	千円	J Kホールディングス		千株	千円		千株	千円
黒谷	56.6	70.4	63,219	1.8	2.3	6,175	スターゼン	4.3	10.9	22,868	日伝	10.7	11.7	11,629						
Cominix	3.3	4	2,548	4.3	10.9	22,868	山善	45.5	60.9	60,839	北沢産業	9.7	12.1	26,111						
三洋貿易	1.7	1.8	1,317	1.7	2.3	9,487	椿本興業	1.7	2.3	9,487	杉本商事	7.3	7.6	1,725						
ビューティガレージ	11.6	14.7	15,199	734.9	913.9	1,678,377	住友商事	1.7	2.3	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242						
ワイン・パートナーズ	1.9	2.5	7,800	内田洋行	4.6	6.3	28,948	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	東テック	31.1	38.7	99,962					
ミタチ産業	8.5	10.9	10,823	第一実業	5.3	6.7	28,542	ミスミグループ本社	3.9	4.6	11,145									
シッパヘルスカフホールディングス	3	4	3,604	キャノンマーケティングジャパン	28.9	35.9	89,821	アルテック	146	181.7	630,499									
明治電機工業	20.6	46.5	119,551	西華産業	6.2	7.9	12,687	タキヒヨー	8.8	10.3	3,162									
デリカフーズホールディングス	3.1	4.7	5,757	佐藤商事	10	12.1	14,023	戴玉産業	4	4.1	5,781									
スターティアホールディングス	5.2	6	3,222	三菱エレクトロ	8.8	8.6	17,397	スズケン	1.9	2.2	4,037									
コマダホールディングス	2.3	3.4	2,590	東京産業	11	13.2	9,438	ジェコス	49.3	56.6	200,647									
コマダホールディングス	25.4	31.6	67,782	ユアサ商事	12	13.8	40,020	グローセル	8.2	10.8	8,640									
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	小売業 (4.2%)	12.9	17.1	7,609									
アセンテック	2.9	4.9	3,474	トルク	5.8	6	1,272	ローソン	29.5	32.1	154,240									
富士興産	3.5	3.8	3,689	阪和興業	23.2	28.9	95,370	サンエー	8.8	11	44,935									
協栄産業	1.5	1.7	2,618	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577									
フルサト・マルカホールディングス	-	14	30,716	カナデン	9.6	12	12,060	イービーシー・マート	18.1	22.7	118,040									
ヤマエグループホールディングス	-	9.8	10,201	三菱商事	8.4	11.6	20,218	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319									
小野建	10.7	14.3	24,238	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	アスクル	10.1	32.7	54,249									
南陽	2.1	2.3	4,473	ナイス	4.7	5.1	9,205	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445									
佐島電機	7.4	9.1	8,399	昭光通商	3.4	-	-	アダストリア	16.1	15.5	27,125									
エコトレーディング	2.6	2.9	1,722	ニチモウ	1.6	2.4	6,182	ジーフット	7.6	10	3,170									
伯東	7.1	8.7	19,783	極東貿易	3	4.1	10,893	シー・ワイ・エス・バイエリア	2	2.3	869									
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	アズテナホールディングス	15.2	20.3	8,363	くら寿司	6.9	15.1	55,115									
中山福	7.1	7.6	3,108	三菱石油	28.7	35.6	32,716	キャンドウ	5.6	5.3	10,780									
ナガイレーベン	15.5	19.3	40,916	稲畑産業	27.9	31.8	64,617	アイケイ	2.5	4	1,544									
三菱食品	12.9	14.2	45,298	G S Iクレオス	2.8	6.9	7,741	バルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878									
松田産業	8.5	10.7	25,209	明和産業	10.8	13.3	14,856	エディオン	29.3	66.3	73,924									
第一興商	17.3	27.5	91,850	クワザホールディングス	4.4	4.6	2,865	サウロコーポレーション	49.9	29.6	18,766									
メディアバルホールディングス	116.7	156.2	339,266	ヤママク工業	8.5	-	-	ワッツ	5.2	7.2	4,960									
S P K	5.2	6	7,668	ワキタ	22.9	31	31,434	ハロース	4.4	6.7	18,900									
視原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	フジオールドグループ本社	9.8	12.3	16,605									
アズワン	8.3	21.1	129,132	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	あみやき亭	2.5	3.4	9,860									
スズデン	3.5	5.3	10,732	ミツロコグループホールディングス	17.1	21.3	21,917	ひらまつ	21.9	30.8	5,821									
尾家産業	3	3.2	3,184	シオネンホールディングス	4.3	5.4	17,685	大黒天物産	2.7	4.7	22,419									
シモジマ	6.5	9	9,117	伊藤忠エネクス	26	32.1	33,448	ハニースホールディングス	9.1	11.5	11,879									
ドウシシャ	11	13.8	20,920	サンリオ	32.6	44.9	105,290	フーマライホールディングス	3.3	4	2,860									
小津産業	2.3	2.5	4,920	サンワテクノス	7.6	8.8	11,915	アルペン	8.9	11.2	23,990									
高速	6.3	8.8	12,944	リョーサン	12.8	16	36,576	ハブ	3.6	4.8	2,836									
たけびし	3.5	5.6	8,092	新光商事	15.9	22	19,162	クオールホールディングス	15.7	17.8	23,745									
リックス	2.2	2.5	3,875	トーホー	5.4	6.8	7,289	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528									
丸文	10.6	12.7	9,258	三信電気	6.4	6.8	11,131	ビックカメラ	69	85.7	88,271									
ハピネット	9.7	12.1	18,452	東陽テクニカ	12.2	14.3	15,015	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,578									
橋本総業ホールディングス	2	3	6,027	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	ペッパーフードサービス	13.2	19.7	6,934									
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	加賀電子	10.5	13.1	42,837	MonotaRO	82.8	183.1	337,087									
タカショー	7.4	11	7,271	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	東京一番フーズ	2.6	4	2,372									
マルカ	3.8	-	-	立花エレクトック	8.7	11.7	18,532	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365									
I DOM	39.3	43.9	29,544	フォーバル	4.3	6.6	6,177	きちりホールディングス	3.4	4.1	1,455									
進和	7	8.7	17,748	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	アークロイヤルホールディングス	9.7	10.8	23,727									
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	三谷産業	15.6	17.1	5,232	J. フロント リテイリング	139	172.8	185,932									
グイトロン	5	6.3	12,814	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	トール・Bレスホールディングス	18.4	25	40,125									
シークス	14.8	20.6	27,047	B*W i s m e t t a cホールディングス	2.6	3.4	10,642	マツエクコカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528									
田中商事	3.1	3.3	2,128	ヤマシタヘルスカフホールディングス	1.1	1.2	2,354	ブロンコビルリー	6.1	8.3	18,467									
オーハンテックニカ	6.2	8.2	11,693	コア商事ホールディングス	3.3	10.9	6,714	ZOZO	68.7	99.8	306,386									
白鋼	3.6	4.7	12,502	国際紙パルプ商事	25.5	30	9,450	トリジャー・ファクトリー	3.4	4.3	4,089									
ダイコー通産	1.1	1.7	2,012	ヤマダネ	5.3	6.9	11,102	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216									
伊藤忠商事	814.6	1,012.8	3,766,603	丸紅建材リース	0.9	1.1	1,967	ココカラファイン	10.4	-	-									
丸紅	1,148.1	1,428.3	1,684,679	日鉄物産	8.3	10.4	55,224	三越伊勢丹ホールディングス	203.4	253.3	236,582									
高島	1.6	2.3	5,444	泉州物産	3.3	4.1	25,953	H a m e	2.9	3.8	4,111									
長瀬産業	65.5	79.6	144,872	トラスコ中山	26.7	30.2	75,349	マーケットエンタープライズ	-	1.1	860									
蝶理	7.5	8.2	14,678	オートバックセブン	43.2	48.8	68,954	ウエルシアホールディングス	61.5	76.6	239,758									
豊田通商	116.9	145.3	717,782	モリト	9	10.9	7,957	クワイエットSDホールディングス	17.1	21.3	66,988									
三共生興	18	19.6	11,074	加藤産業	16.9	21	69,090	丸善CH Iホールディングス	15.4	18.9	6,898									
兼松	46.5	53.9	69,800	北恵	3.2	4	3,472	ミサワ	2.5	3	1,965									
ツカモトコーポレーション	1.7	1.8	2,354	イノテック	6.6	8.7	12,815	ティーライフ	1.7	2	2,630									
三井物産	945.5	1,124.4	3,333,846	イエローハット	21.9	25.1	42,017	イー・ピーホールディングス	1.9	2.2	965									
日本紙パルプ商事	6.1	7.7	30,684					チムニー	3.5	4.6	5,349									
カメイ	15.2	17.1	17,698					シュッピン	7.9	12	12,948									
東都水産	1.4	0.6	2,361																	







## (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 株 式 (評 価 額)	11,420,891,042
株 未 取 入 式 (評 価 額)	387,140,847,090
株 未 取 入 式 (評 価 額)	11,243,540
株 未 取 入 式 (評 価 額)	655,237,202
株 未 取 入 式 (評 価 額)	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 総 額 (A - B)	397,336,615,454
元 本	124,570,625,521
次 期 繰 越 損 益	272,765,989,933
(D) 受 益 権 総 額	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 102,105,610,506円  
 追加設定元本額 163,179,331,486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 (中立的)	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 (中立的)	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 (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/トランスファンド (FOF 5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/トランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,956,036円
D I AM国際分散/トランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	26,722,846円
D I AM国内重視/トランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,712,676円
D I AM国内重視/トランスファンド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 アサ グローバル トランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	301,727,248円
D I AM世界アセット/トランスファンドVA (適格機関投資家限定)	74,733,048円
D I AM世界/トランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,406,645円
D I AM世界アセット/トランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	349,638,985円
D I AM世界アセット/トランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,826,409円
D I AM世界アセット/トランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	73,311,471円
D I AM世界アセット/トランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	173,199,524円
D I AM世界アセット/トランスファンド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/トランスファンド7VA (121) (適格機関投資家限定)	291,737,796円
D I AM世界アセット/トランスファンド7VA (130) (適格機関投資家限定)	936,557,239円
D I AM世界アセット/トランスファンド7VA (130) (適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
D I AM世界アセット/トランスファンド7VA (130) (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トピックスファンド	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	（除く日本、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	ポイント	%	%	%	百万円
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
			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）。

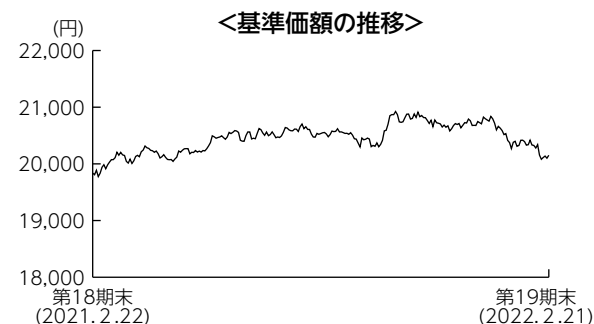
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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）

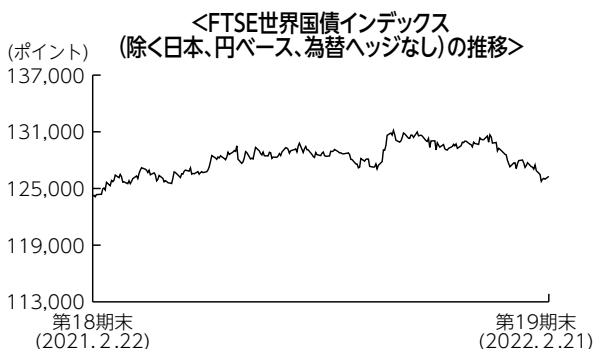


### 基準価額の推移

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

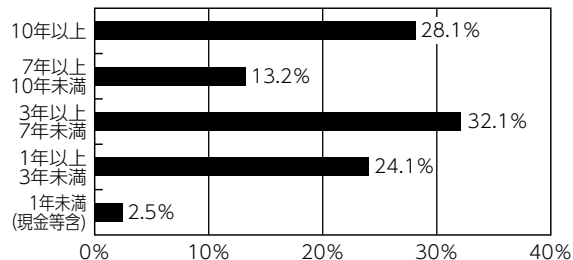
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

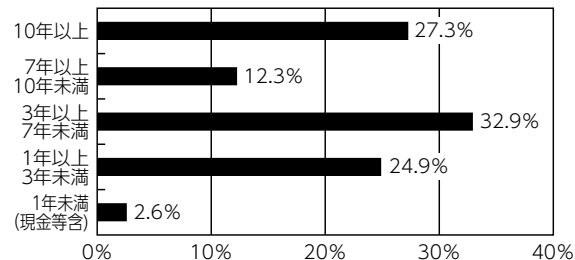
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○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）	(2)	(0.012)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
（そ の 他）	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	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	
	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	
国	ユーロ	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
					外貨建金額	邦貨換算金額	
					千アメリカ・ドル	千円	
(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
<b>(アメリカ)</b>			%	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	-		
<b>(カナダ)</b>			%	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	
<b>(カナダ)</b>		%	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	—
<b>(オーストラリア)</b>		%	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	—
<b>(シンガポール)</b>		%	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	
<b>(シンガポール)</b>			%	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	-	
<b>(イギリス)</b>			%	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 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		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(イギリス)</b>		%	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	-
<b>(イスラエル)</b>		%	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	-
<b>(デンマーク)</b>		%	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	-
<b>(ノルウェー)</b>		%	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	-
<b>(スウェーデン)</b>		%	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	
<b>(スウェーデン)</b>			%	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	—	
<b>(メキシコ)</b>			%	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	—	
<b>(中国)</b>			%	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	—	
<b>(マレーシア)</b>			%	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			
<b>(ポーランド)</b>		%	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		-	
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>		%	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		-	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>		%	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	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	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)		%	千ユーロ	千ユーロ	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)		%	千ユーロ	千ユーロ	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
<b>(ユーロ…フランス)</b>			%	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	—		
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	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	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		
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>		%	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	-	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	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	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	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	-
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	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					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	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	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	-	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>			%	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	-	
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>			%	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・リングgit=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	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)	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 (適格機関投資家向け)	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。

# 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	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565
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

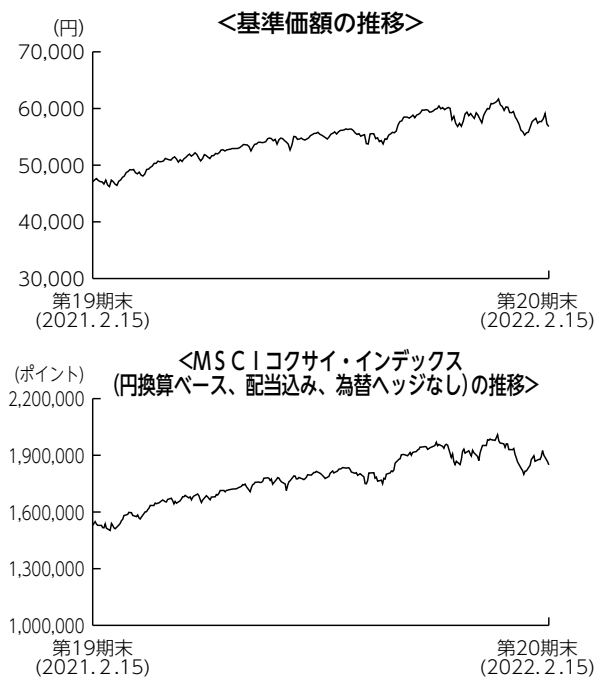
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2021年 2月 15日	47,083	% -	1,529,401.79	% -	% 95.5	% 2.5
2 月 末	46,501	△1.2	1,513,956.06	△1.0	95.5	2.4
3 月 末	49,621	5.4	1,611,609.95	5.4	94.8	3.1
4 月 末	51,949	10.3	1,687,947.89	10.4	94.9	3.0
5 月 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、組入価値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
<b>アメリカ</b>		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 (18.05)	2,829 (-)	35.88 (-)	2,454 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>カナダ</b>	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	4.337	241	4.071	223
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>オーストラリア</b>	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
<b>香港</b>	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	212.6 (-)	14,716 (-)	213.1 (-)	14,405 (-)
<b>シンガポール</b>	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)	- (-)	- (-)
<b>イギリス</b>	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 (-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	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		コンピュータ・周辺機器
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		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		
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		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		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		
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
PELOTON 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	
<b>(アメリカ)</b>	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%>
<b>(カナダ)</b>	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	
<b>(カナダ)</b>	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%>
<b>(オーストラリア)</b>	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	
<b>(オーストラリア)</b>	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%>
<b>(香港)</b>	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 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(香港)</b>	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	コンプロマリット
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 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 比 率	金 額 比 率	
	76,797.49 33銘柄	82,613.53 30銘柄	350,582 —	5,185,109 <0.8%>	
<b>(シンガポール)</b>	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	コンプロマリット
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 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 比 率	金 額 比 率	
	27,111.4 14銘柄	32,069.4 14銘柄	23,033 —	1,973,722 <0.3%>	
<b>(ニュージーランド)</b>	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 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 比 率	金 額 比 率	
	5,897.74 7銘柄	6,659.02 6銘柄	4,988 —	381,252 <0.1%>	
<b>(イギリス)</b>	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
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	
<b>(イギリス)</b>	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	コングロマリット
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%>
<b>(イスラエル)</b>	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%>
<b>(スイス)</b>	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 FINANCIERICHMONT	474.14	508.16	6,654	831,395	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	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		業種等
	株数	株数	期末		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(デンマーク)</b>	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・金額 銘柄数<比率>	3,845.94 19銘柄	5,086.83 18銘柄	257,006 —	4,507,892 <0.7%>
<b>(ノルウェー)</b>	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・金額 銘柄数<比率>	5,338.75 11銘柄	5,901.56 12銘柄	102,317 —	1,330,132 <0.2%>
<b>(スウェーデン)</b>	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	
<b>(スウェーデン)</b>	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%>
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>	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%>
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	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	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	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%>
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>	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%>
<b>(ユーロ…ルクセンブルグ)</b>	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%>
<b>(ユーロ…フランス)</b>	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		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	コングロマリット
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	期末			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>	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%>	
<b>(ユーロ…ポルトガル)</b>	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%>	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>	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	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>	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%>
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>	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%>
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>	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 銘柄数<比率>	87,844	-	-	-		<- %>
		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中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 (アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
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				末
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	1,135.78 37銘柄<1.8%>	1,233.442 35銘柄<1.8%>	102,365	11,814,981	-	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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	21.421 2銘柄<0.0%>	21.687 2銘柄<0.0%>	775	70,328	-	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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	1,730.976 7銘柄<0.1%>	1,975.372 7銘柄<0.1%>	9,718	799,936	-	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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	200.2 1銘柄<0.0%>	199.7 1銘柄<0.0%>	13,280	196,411	-	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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	1,430.742 5銘柄<0.1%>	1,470.583 4銘柄<0.0%>	3,007	257,705	-	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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	226.618 3銘柄<0.1%>	270.158 3銘柄<0.1%>	2,478	387,213	-	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 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	38.352 4銘柄<0.0%>	39.445 4銘柄<0.0%>	2,156	281,590	-	0.0
合 計	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	□ 数 銘柄	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
	4,784.089 59銘柄<2.1%>	5,210.387 56銘柄<2.1%>	-	13,808,167	-	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	%		
	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
一 般 株 券 等	8,092,389,228
株 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 入 委 託 証 当 金	461,392,808
(B) 負 債	20,432,094,210
未 払 約 金	20,346,719,210
未 払 解 約 金	85,375,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	642,642,496,166
元 本	113,101,593,550
次 期 繰 越 損 益	529,540,902,616
(D) 受 取 益 権 総 額	113,101,593,550円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	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	133,496,490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VA2 (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

## ■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月15日

項	目	当	期
(A)	配当 受取 受取 支の 支の 払他 取他 取利 取利	等配 取利 取利	収当 当金 息金 息金 利
			益
(B)	有価 売証 売証 買券 買券 買券 買券	損益 損益 損益 損益	損益 損益 損益 損益
(C)	先物 取引 取引 取引 取引	等取 取引 取引 取引	引損 引損 引損 引損
(D)	そ の の の	他 他 他 他	費 用 用 用
(E)	当 期 損 益	損 益	金(A + B + C + D)
(F)	前 期 繰 越	繰 越	損 益 金
(G)	解 約 差 損	差 損	益 金
(H)	追 加 信 託	信 託	差 損 益 金
(I)	合 次 期 繰 越	繰 越	計(E + F + G + H)
			損 益 金(I)
			9,113,239,420円
			9,080,104,798
			12,472
			33,540,265
			△418,115
			89,816,332,579
			130,353,926,209
			△40,537,593,630
			1,292,545,584
			2,927,958,743
			△1,635,413,159
			△203,677,815
			100,018,439,768
			376,135,937,658
			△371,018,562,768
			424,405,087,958
			529,540,902,616
			529,540,902,616

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

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

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

## 《お知らせ》

■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)

# エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第13期 (決算日 2021年4月19日)

(計算期間 2020年4月21日～2021年4月19日)

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年3月6日から無期限です。
運用方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
9期 (2017年4月18日)	17,917	4.7%	88,609.40	8.4%	96.8%	-	80,269
10期 (2018年4月18日)	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4%	-	111,615
11期 (2019年4月18日)	19,206	7.8	93,647.60	6.8	97.5%	-	108,066
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5%	-	78,076
13期 (2021年4月19日)	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4%	-	152,776

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ. P. モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します (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)。

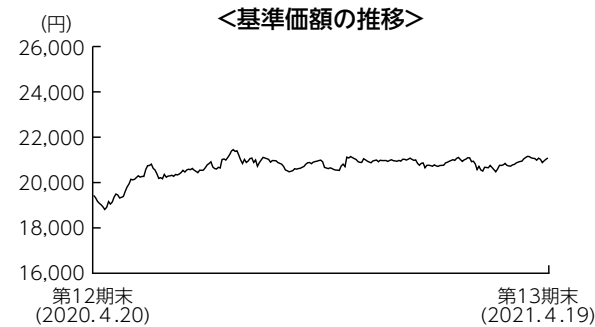
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 4 月 20 日	円 19,435	% -	ポイント 88,952.63	% -	% 96.5	% -
4 月 末	18,910	△2.7	87,054.07	△2.1	98.8	-
5 月 末	20,242	4.2	93,802.25	5.5	97.4	-
6 月 末	20,439	5.2	95,583.81	7.5	97.2	-
7 月 末	20,642	6.2	95,671.24	7.6	97.4	-
8 月 末	20,718	6.6	96,896.67	8.9	98.4	-
9 月 末	20,610	6.0	95,218.27	7.0	98.2	-
10 月 末	20,553	5.8	94,180.51	5.9	88.4	-
11 月 末	20,873	7.4	97,409.57	9.5	102.4	-
12 月 末	21,026	8.2	98,538.93	10.8	97.4	-
2021 年 1 月 末	20,895	7.5	97,840.34	10.0	105.2	-
2 月 末	20,553	5.8	96,320.68	8.3	93.8	-
3 月 末	21,040	8.3	97,550.06	9.7	97.9	-
(期 末) 2021 年 4 月 19 日	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年4月21日から2021年4月19日まで）



### 基準価額の推移

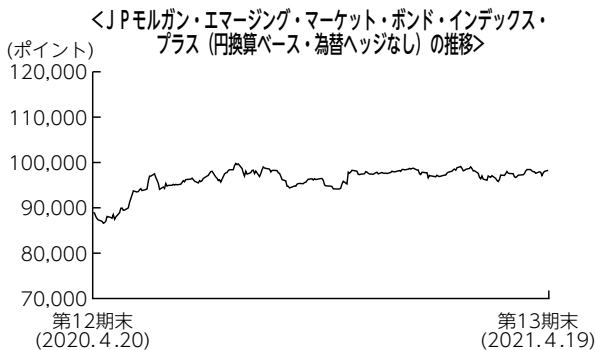
当期末の基準価額は21,087円となり、前期末比で8.5%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

対米国債スプレッドの縮小や米ドルが対円で上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

新興国債券市場は上昇しました。期初から2020年8月にかけては、欧米での経済活動再開に伴う景気回復期待や、欧州復興基金の創設でEU（欧州連合）首脳が合意したことなどが上昇要因となりました。その後は新型コロナウイルスの感染再拡大、米国大統領選挙でのバイデン氏勝利や新型コロナウイルスのワクチンへの期待感などにより一進一退の展開となりました。2021年2月中旬以降は、財政出動や景気回復によって過度なインフレが生じるとの懸念が台頭し弱含みましたが、期を通じては上昇しました。



為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。期初から一進一退で推移した後、2020年7月には米金融緩和の長期化観測や景気先行きの不透明感などから下落しました。その後も年内は軟調に推移しましたが、年明け以降は追加経済対策への期待感や新型コロナウイルスワクチン接種の進行などを好感し、大幅に上昇しました。期末にかけては米金利上昇の一服などから下落しましたが、期を通じては上昇しました。



## ポートフォリオについて

ベンチマークである J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

### 【運用状況】

#### ○国別構成比 期首 (前期末)

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	0.0%	4.9%	△4.9%
	ブラジル	10.0%	8.6%	1.4%
	メキシコ	15.3%	13.4%	1.9%
	パナマ	5.7%	3.9%	1.8%
	ペルー	4.6%	2.9%	1.7%
	コロンビア	9.2%	8.4%	0.8%
計	44.7%	42.1%	2.7%	
欧州	ハンガリー	4.1%	2.5%	1.6%
	ロシア	14.2%	11.6%	2.6%
	トルコ	0.0%	12.6%	△12.6%
	ウクライナ	0.0%	4.3%	△4.3%
	クロアチア	1.8%	1.1%	0.7%
	ルーマニア	3.5%	2.3%	1.2%
計	23.6%	34.4%	△10.8%	
アジア・オセアニア	インドネシア	13.8%	11.8%	2.1%
	フィリピン	8.8%	8.0%	0.8%
	計	22.6%	19.7%	2.9%
アフリカ	南アフリカ	5.6%	3.8%	1.8%
	計	5.6%	3.8%	1.8%
現金など	3.5%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	

#### 期末

国	ファンド	ベンチマーク	差	
中南米	アルゼンチン	0.0%	6.0%	△6.0%
	ブラジル	10.4%	8.5%	1.9%
	メキシコ	15.7%	13.1%	2.6%
	パナマ	5.9%	4.1%	1.8%
	ペルー	5.6%	3.9%	1.7%
	コロンビア	9.4%	7.6%	1.8%
計	47.0%	43.2%	3.8%	
欧州	ハンガリー	4.1%	2.3%	1.8%
	ロシア	12.9%	10.4%	2.6%
	トルコ	0.0%	14.1%	△14.1%
	ウクライナ	0.0%	4.2%	△4.2%
	クロアチア	2.1%	1.0%	1.0%
	ルーマニア	3.6%	2.0%	1.5%
計	22.7%	34.1%	△11.4%	
アジア・オセアニア	インドネシア	13.5%	11.2%	2.3%
	フィリピン	9.0%	7.1%	1.8%
	計	22.4%	18.3%	4.1%
アフリカ	南アフリカ	6.3%	4.4%	1.9%
	計	6.3%	4.4%	1.9%
現金など	1.6%	-	-	
合計	100.0%	100.0%	-	



(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) ベンチマークは、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.5%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを2.0%下回りました。これは、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	2円	0.010%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	2	0.010	
期中の平均基準価額は20,679円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

### 公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
			2,511,941	1,836,789 (4,612)

(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。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

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 1,211,303	千アメリカ・ドル 1,383,333	千円 150,313,001	% 98.4	% 16.7	% 75.2	% 20.3	% 2.9	
合 計	-	-	150,313,001	98.4	16.7	75.2	20.3	2.9	

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

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

(B) 個別銘柄開示

外国 (外貨建) 公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末								
	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				
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	6.0500	16,900	20,798	2,259,991	2040/01/11			
BRAZIL 5.625 01/07/41	国債証券	5.6250	12,100	12,928	1,404,848	2041/01/07			
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国債証券	4.6000	11,000	11,538	1,253,762	2046/01/23			
PANAMA 7.125 01/29/26	国債証券	7.1250	6,800	8,480	921,445	2026/01/29			
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国債証券	7.7500	8,100	11,924	1,295,729	2031/01/14			
ROMANIA 6.125 01/22/44	国債証券	6.1250	8,400	10,904	1,184,929	2044/01/22			
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	国債証券	5.5500	14,400	16,957	1,842,548	2045/01/21			
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	国債証券	6.3750	5,600	7,612	827,140	2032/01/15			
COLOMBIA 6.125 01/18/41	国債証券	6.1250	13,000	15,863	1,723,714	2041/01/18			
INDONESIA 5.25 01/17/42	国債証券	5.2500	10,300	12,694	1,379,429	2042/01/17			
INDONESIA 6.75 01/15/44	国債証券	6.7500	8,500	12,337	1,340,558	2044/01/15			
BRAZIL 5.0 01/27/45	国債証券	5.0000	14,800	14,507	1,576,334	2045/01/27			
INDONESIA 5.125 01/15/45	国債証券	5.1250	9,400	11,470	1,246,332	2045/01/15			
INDONESIA 4.35 01/11/48	国債証券	4.3500	7,000	7,855	853,622	2048/01/11			
BRAZIL 8.25 01/20/34	国債証券	8.2500	9,200	12,500	1,358,254	2034/01/20			
PANAMA 6.7 01/26/36	国債証券	6.7000	12,900	17,467	1,898,060	2036/01/26			
BRAZIL 7.125 01/20/37	国債証券	7.1250	8,300	10,456	1,136,253	2037/01/20			
INDONESIA 7.75 01/17/38	国債証券	7.7500	10,500	15,718	1,707,929	2038/01/17			
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国債証券	3.9500	8,800	9,703	1,054,386	2040/01/20			
INDONESIA 5.95 01/08/46	国債証券	5.9500	6,200	8,371	909,644	2046/01/08			
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国債証券	3.6000	9,200	10,080	1,095,340	2025/01/30			
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	国債証券	5.0000	6,800	8,530	926,929	2037/01/13			
INDONESIA 4.125 01/15/25	国債証券	4.1250	10,800	11,887	1,291,713	2025/01/15			
INDONESIA 4.35 01/08/27	国債証券	4.3500	5,000	5,647	613,659	2027/01/08			
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国債証券	3.7500	10,000	11,242	1,221,651	2029/01/14			
ROMANIA 4.875 01/22/24	国債証券	4.8750	5,600	6,224	676,379	2024/01/22			
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国債証券	4.5000	10,000	11,073	1,203,251	2026/01/28			
CROATIA 6.0 01/26/24	国債証券	6.0000	13,400	15,327	1,665,532	2024/01/26			
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国債証券	4.1250	10,000	11,208	1,217,883	2026/01/21			
INDONESIA 5.875 01/15/24	国債証券	5.8750	9,200	10,437	1,134,143	2024/01/15			
INDONESIA 4.75 01/08/26	国債証券	4.7500	11,800	13,472	1,463,895	2026/01/08			
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国債証券	4.2000	7,800	8,575	931,843	2024/01/21			
BRAZIL 4.625 01/13/28	国債証券	4.6250	13,800	14,799	1,608,139	2028/01/13			

銘柄	当期				期末		償還年月日
	種類	利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国債証券	3.7500	10,200	11,050	1,200,783	2028/01/11	
INDONESIA 3.5 01/11/28	国債証券	3.5000	7,200	7,823	850,048	2028/01/11	
PANAMA 3.16 01/23/30	国債証券	3.1600	9,000	9,420	1,023,609	2030/01/23	
BRAZIL 4.75 01/14/50	国債証券	4.7500	13,000	12,175	1,323,008	2050/01/14	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国債証券	4.5000	10,000	10,440	1,134,410	2050/01/31	
PERU 2.783 01/23/31	国債証券	2.7830	17,000	17,140	1,862,478	2031/01/23	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国債証券	3.0000	9,000	9,023	980,526	2030/01/30	
PERU 2.392 01/23/26	国債証券	2.3920	9,000	9,294	1,009,947	2026/01/23	
BRAZIL 8.75 02/04/25	国債証券	8.7500	5,800	7,079	769,256	2025/02/04	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国債証券	3.7000	9,000	9,649	1,048,546	2042/02/02	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国債証券	4.6000	10,400	10,934	1,188,109	2048/02/10	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国債証券	9.5000	7,800	12,240	1,330,105	2030/02/02	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国債証券	5.6250	11,000	12,825	1,393,613	2044/02/26	
INDONESIA 5.35 02/11/49	国債証券	5.3500	4,000	5,106	554,863	2049/02/11	
ROMANIA 4.0 02/14/51	国債証券	4.0000	10,000	9,977	1,084,133	2051/02/14	
BRAZIL 5.625 02/21/47	国債証券	5.6250	11,600	12,170	1,322,489	2047/02/21	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	国債証券	4.0000	9,100	9,731	1,057,404	2024/02/26	
INDONESIA 4.75 02/11/29	国債証券	4.7500	7,000	8,205	891,562	2029/02/11	
HUNGARY 5.375 02/21/23	国債証券	5.3750	10,358	11,298	1,227,701	2023/02/21	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国債証券	3.0000	10,000	10,725	1,165,383	2028/02/01	
ROMANIA 3.0 02/14/31	国債証券	3.0000	13,000	13,211	1,435,534	2031/02/14	
INDONESIA 2.85 02/14/30	国債証券	2.8500	6,000	6,228	676,773	2030/02/14	
PANAMA 3.875 03/17/28	国債証券	3.8750	8,100	8,939	971,333	2028/03/17	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	7.5000	9,765	11,262	1,223,832	2030/03/31	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	4.3750	16,400	18,242	1,982,234	2029/03/21	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国債証券	4.5000	10,000	11,095	1,205,669	2029/03/15	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	国債証券	5.5000	7,600	9,223	1,002,267	2026/03/30	
PERU 6.55 03/14/37	国債証券	6.5500	8,000	10,967	1,191,695	2037/03/14	
HUNGARY 7.625 03/29/41	国債証券	7.6250	10,000	16,346	1,776,168	2041/03/29	
HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	5.3750	16,380	18,613	2,022,569	2024/03/25	
PANAMA 3.75 03/16/25	国債証券	3.7500	7,200	7,874	855,623	2025/03/16	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	国債証券	4.1500	12,400	13,898	1,510,262	2027/03/28	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	5.1000	22,000	25,951	2,819,866	2035/03/28	
PANAMA 4.5 04/16/50	国債証券	4.5000	10,300	11,611	1,261,660	2050/04/16	
PANAMA 4.5 04/01/56	国債証券	4.5000	11,000	12,303	1,336,922	2056/04/01	
INDONESIA 4.45 04/15/70	国債証券	4.4500	5,000	5,641	613,018	2070/04/15	
PANAMA 9.375 04/01/29	国債証券	9.3750	4,900	7,233	786,042	2029/04/01	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	5.6250	16,000	20,304	2,206,336	2042/04/04	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	国債証券	5.0000	10,000	11,165	1,213,243	2051/04/27	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	国債証券	4.5000	17,000	19,148	2,080,680	2029/04/22	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	国債証券	4.5000	5,800	5,999	651,907	2022/04/04	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	国債証券	4.7500	14,000	15,848	1,722,043	2032/04/27	
CROATIA 5.5 04/04/23	国債証券	5.5000	12,400	13,583	1,476,020	2023/04/04	
INDONESIA 3.375 04/15/23	国債証券	3.3750	6,700	7,062	767,385	2023/04/15	
INDONESIA 4.1 04/24/28	国債証券	4.1000	5,000	5,613	609,949	2028/04/24	
BRAZIL 6.0 04/07/26	国債証券	6.0000	10,800	12,534	1,362,002	2026/04/07	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	国債証券	4.8750	11,400	12,226	1,328,531	2026/04/14	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	国債証券	3.2500	11,000	11,279	1,225,607	2030/04/16	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	国債証券	3.1250	16,000	16,040	1,742,993	2031/04/15	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	国債証券	3.9000	7,000	7,752	842,371	2025/04/27	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	国債証券	4.1250	7,000	6,882	747,833	2051/05/15	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	国債証券	5.8750	3,000	3,171	344,614	2022/05/30	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	8,000	9,063	984,807	2049/05/15	

銘柄	当 期				末	
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	4.7500	16,400	18,444	2,004,153	2026/05/27
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	国債証券	2.9500	6,000	5,799	630,211	2045/05/05
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	11,000	11,518	1,251,556	2029/05/30
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	国債証券	2.4570	8,000	8,187	889,668	2030/05/05
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	8,400	9,372	1,018,445	2030/06/22
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	18,000	19,845	2,156,357	2045/06/15
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	8,600	9,976	1,084,066	2048/06/15
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	4,000	4,172	453,338	2048/06/22
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	5.2500	29,000	36,000	3,911,822	2047/06/23
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	国債証券	4.2500	13,400	14,838	1,612,388	2027/06/23
PERU 2.844 06/20/30	国債証券	2.8440	5,000	5,128	557,300	2030/06/20
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	16,000	15,855	1,722,860	2030/06/12
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	9,000	9,199	999,660	2025/06/06
PERU 7.35 07/21/25	国債証券	7.3500	9,300	11,498	1,249,429	2025/07/21
INDONESIA 3.85 07/18/27	国債証券	3.8500	5,600	6,195	673,179	2027/07/18
PERU 4.125 08/25/27	国債証券	4.1250	6,300	7,062	767,437	2027/08/25
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	16,200	18,121	1,969,133	2025/09/16
COLOMBIA 7.375 09/18/37	国債証券	7.3750	8,400	11,369	1,235,399	2037/09/18
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	国債証券	6.7500	10,200	13,173	1,431,410	2034/09/27
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	7,200	7,086	770,029	2047/09/27
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	国債証券	5.8750	8,200	10,754	1,168,611	2043/09/16
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	国債証券	4.8750	18,400	20,082	2,182,164	2023/09/16
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	6,000	6,459	701,912	2029/09/18
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	12,000	11,714	1,272,886	2049/09/30
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	11,000	11,502	1,249,890	2029/09/30
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	9,800	11,325	1,230,598	2110/10/12
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	9,000	12,540	1,362,602	2034/10/23
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	11,200	11,374	1,235,952	2028/10/12
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	7,000	7,854	853,509	2050/10/15
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	国債証券	4.0000	12,500	13,585	1,476,152	2023/10/02
INDONESIA 3.7 10/30/49	国債証券	3.7000	4,000	4,163	452,388	2049/10/30
INDONESIA 3.85 10/15/30	国債証券	3.8500	8,000	8,922	969,571	2030/10/15
PERU 5.625 11/18/50	国債証券	5.6250	13,000	17,648	1,917,683	2050/11/18
HUNGARY 5.75 11/22/23	国債証券	5.7500	10,000	11,321	1,230,159	2023/11/22
合 計	-	-	1,211,303	1,383,333	150,313,001	-

## ■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
公 社 債	150,313,001		98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,111,370		2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	153,424,372		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、151,969,377千円、99.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年4月19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=108.66円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月19日)現在

項	目	当	期	末
(A)	資 産	153,874,159,660	円	
	コ ー ン 等	1,721,510,452		
	公 社 債(評価額)	150,313,001,877		
	未 収 入 金	449,787,645		
	未 収 利 息	944,560,040		
	未 払 費 用	445,299,646		
(B)	負 債	1,097,433,577		
	未 払 金	1,079,463,577		
	未 払 解 約 金	17,970,000		
(C)	純 資 産 総 額(A-B)	152,776,726,083		
	元 本	72,451,871,684		
	次 期 繰 越 損 益 金	80,324,854,399		
(D)	受 益 権 総 口 数	72,451,871,684	口	
	1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	21,087	円	

(注1) 期首元本額 40,172,815,072円  
追加設定元本額 132,587,338,214円  
一部解約元本額 100,308,281,602円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	109,169,616円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,029,331,801円
たわらノーロード バランス (堅実型)	75,372,953円
たわらノーロード バランス (標準型)	201,288,849円
たわらノーロード バランス (積極型)	80,498,643円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	721,873円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,437,876円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,895,559円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	921,239円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,273,850円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,470,886円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)	202,138,086円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)	251,403,543円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30)	513,559,739円
投資のソムリエ	16,959,937,084円
グルーズコントロール	404,057,660円
投資のソムリエ<DC年金>	932,236,669円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	183,350,267円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	2,849,283円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	6,148,787円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	637,131,511円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,883,910,522円
ワールドアセットバランス (基本コース)	669,422,645円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	2,191,812,586円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	16,532,675円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	7,813,459円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	6,238,125円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	37,137,407円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,339,044,090円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	194,682,417円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	9,262,711円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	4,755,318円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	4,789,602円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	24,501,127,196円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	387,668,845円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド (適格機関投資家限定)	3,950,327,719円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,054,444,736円
エマージング債券バンプアップファンドVA (適格機関投資家専用)	11,621,866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)	216,802,719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)	111,545,581円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	5,343,676,386円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	854,059,305円
期末元本合計	72,451,871,684円

## ■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

項	目	当	期
(A)	配 当 等 収 益	5,556,665,779	円
	受 取 利 息	5,557,323,992	
	支 払 利 息	△658,213	
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	3,739,982,844	
	売 買 益	13,133,820,690	
	売 買 損	△9,393,837,846	
(C)	そ の 他 費 用	△13,426,667	
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	9,283,221,956	
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	37,903,682,683	
(F)	解 約 差 損 益 金	△106,290,754,926	
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	139,428,704,686	
(H)	合 計(D+E+F+G)	80,324,854,399	
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	80,324,854,399	

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

# エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第13期（決算日 2021年4月19日）

（計算期間 2020年4月21日～2021年4月19日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

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

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

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

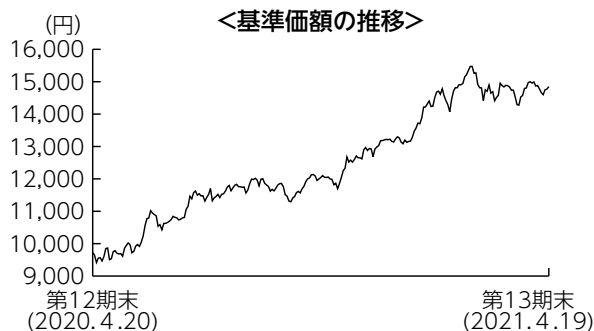
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



## ■当期の運用経過（2020年4月21日から2021年4月19日まで）

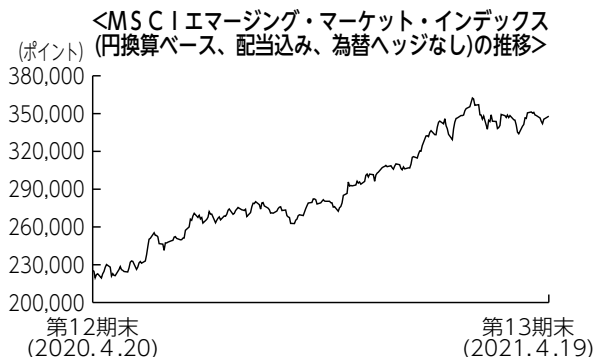


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は14,848円となり、前期末比で52.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

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



### 投資環境

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

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

## ポートフォリオについて

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

### 【運用状況】

#### ○組入上位10業種

##### 期首（前期末）

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

##### 期末

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



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で54.3%上昇しました。

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

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

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

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

### (1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## (2) 新株予約権証券

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## (3) 投資信託受益証券、投資証券

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## (4) 先物取引の種類別取引状況

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

(注) 金額は受渡代金です。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

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

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



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

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

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

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

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

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

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

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(コロンビア)</b>	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	216.75	231.25	523,550	15,789	電力
ECOPETROL SA	2,603.36	2,812.3	647,110	19,515	石油・ガス・消耗燃料
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	1,960.73	—	—	—	銀行
GRUPO ARGOS SA	148.97	—	—	—	建設資材
BANCOLOMBIA SA	67.47	129.5	392,903	11,849	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	275.34	309.57	943,878	28,465	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	92.36	228.2	467,810	14,108	各種金融サービス
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 7 銘 柄 5 銘 柄	2,975,252	89,727	
			—	<0.2%>	
<b>(クウェート)</b>	百株	百株	千クウェート・ディナール	千円	
KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	—	2,546.84	183	66,219	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	—	1,262.48	76	27,491	無線通信サービス
GULF BANK KSCP	—	1,426.6	30	10,973	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	—	4,183.85	345	124,798	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	—	532.37	40	14,572	航空貨物・物流サービス
MABANEV CO KPSC	—	532.93	37	13,587	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK KSCP	—	839.09	52	19,089	銀行
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 7 銘 柄	11,324.16	276,731	
			—	<0.5%>	
<b>(カタール)</b>	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR INSURANCE CO SAQ	822.82	—	—	—	保険
QATAR NATIONAL BANK	2,186.04	2,728.04	4,858	143,572	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	758.09	902.99	472	13,976	銀行
OOREDOO QSC	534.59	400.49	281	8,317	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	292.53	284.78	509	15,063	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	326.18	246.05	419	12,382	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	286.75	510.28	464	13,721	銀行
INDUSTRIES QATAR QSC	940.11	1,233.12	1,542	45,584	コンプロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	589.69	758.19	1,357	40,104	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	—	1,389.61	445	13,160	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	1,604.22	2,423.81	1,079	31,908	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	1,000.55	1,384.49	449	13,292	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	1,769.57	2,519.21	466	13,771	化学
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数 金 額 12 銘 柄	14,781.06	364,855	
			12,347	<0.6%>	
<b>(サウジアラビア)</b>	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	124.66	154.78	1,105	32,059	化学
JARIR MARKETING CO	21.89	40.04	764	22,185	専門小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	20.3	41.55	329	9,546	保険
ETIHAD ETISALAT CO	207.81	185	566	16,422	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	365.42	445.2	1,271	36,873	銀行
AL RAJHI BANK	578.93	746.13	7,050	204,547	銀行
ARAB NATIONAL BANK	303.9	344.64	743	21,575	銀行
BANK ALBILAD	210.92	264.91	943	27,358	銀行
BANK AL-JAZIRA	294.76	354.4	589	17,087	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	273.61	371.02	1,320	38,317	銀行
RIYAD BANK	594.73	739.24	1,840	53,398	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP	487.48	—	—	—	銀行
SAUDI TELECOM CO	190.84	362.86	4,455	129,266	各種電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	86.58	120.5	1,286	37,334	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	353.28	551.48	6,452	187,181	化学
SAUDI CEMENT CO	27.73	64.77	414	12,025	建設資材
SAUDI ELECTRICITY CO	407.14	459.63	1,151	33,401	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	76.5	186.28	642	18,643	化学
SAVOLA GROUP	140.14	145.38	610	17,713	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	284.89	225.28	385	11,188	化学
ALMARAI CO JSC	130.48	165.75	860	24,955	食品



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

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

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(インド)</b>	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BERGER PAINTS INDIA LTD	79.54	125.56	9,232	13,571	化学
AVENUE SUPERMARTS LTD	65.1	88.1	25,724	37,814	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	79.31	115.17	16,321	23,992	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	115.66	190.44	8,589	12,627	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	36.35	48.93	7,745	11,385	旅客航空輸送業
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	149.7	240.46	21,982	32,314	保険
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	30,432.72 85銘柄	50,386.72 96銘柄	3,477,282 -	5,111,604 <8.8%>
<b>(パキスタン)</b>	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
MCB BANK LTD	124	124	2,154	1,529	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	218.68	218.68	2,166	1,538	石油・ガス・消耗燃料
HABIB BANK LTD	193	193	2,287	1,624	銀行
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	535.68 3銘柄	535.68 3銘柄	6,608 -	4,691 <0.0%>
<b>(インドネシア)</b>	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ANEKA TAMBANG TBK PT	-	5,717	1,366,363	10,247	金属・鉱業
BARITO PACIFIC TBK PT	14,625	14,709	1,434,127	10,755	化学
UNITED TRACTORS TBK PT	1,039.01	848.01	1,871,982	14,039	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	2,769	3,529	2,364,430	17,733	食品
UNILEVER INDONESIA TBK PT	3,608	4,805	3,039,162	22,793	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	10,655	13,067	6,860,175	51,451	自動車
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	24,831	31,399	10,550,064	79,125	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	2,440	3,868	2,988,030	22,410	食品
GUDANG GARAM TBK PT	158	324	1,179,360	8,845	タバコ
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	4,563	-	-	-	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	1,098	678	883,095	6,623	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	1,428	1,908	1,893,690	14,202	紙製品・林産品
BUKIT ASAM TBK PT	2,300	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
BANK MANDIRI	9,617	11,831	7,453,530	55,901	銀行
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	868	-	-	-	紙製品・林産品
BANK RAKYAT INDONESIA	27,728	34,221	14,851,914	111,389	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	4,772	8,222	966,085	7,245	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	4,400	3,443	2,048,585	15,364	銀行
KALBE FARMA TBK PT	13,344	10,057	1,503,521	11,276	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	1,009	1,498	1,595,370	11,965	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	4,753	6,028	18,912,850	141,846	銀行
XL AXIATA TBK PT	355	-	-	-	無線通信サービス
JASA MARGA PERSERO TBK PT	416.25	-	-	-	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,631	-	-	-	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT	6,845	9,341	1,106,908	8,301	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK	2,185	-	-	-	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	774	1,650	1,476,750	11,075	食品
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	1,579	-	-	-	銀行
ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	1,104	-	-	-	専門小売り
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	-	17,183	1,950,270	14,627	各種電気通信サービス
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	-	4,256	1,034,208	7,756	金属・鉱業
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	155,894.26 28銘柄	188,582.01 22銘柄	87,330,471 -	654,978 <1.1%>
<b>(アラブ首長国連邦)</b>	百株	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	千円	
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	-	1,142.69	562	16,658	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	630.16	942.96	427	12,656	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	876.04	1,071.47	2,348	69,590	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	1,545.32	1,764.04	1,102	32,667	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,363.91	1,680.85	2,430	72,015	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	2,271.65	1,873.97	740	21,932	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	1,419.95	2,243.84	816	24,200	不動産管理・開発
EMIRATES NBD BANK PJSC	-	1,385.97	1,621	48,047	銀行

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

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ブラジル)</b>	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
AMBEV SA	2,326.95	2,925.95	4,623	89,886	飲料
NATURA & CO HOLDING SA	345	571	2,864	55,688	パーソナル用品
TIM SA	-	622	763	14,839	無線通信サービス
RUMO SA	571	797	1,674	32,557	陸運・鉄道
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	250	-	-	-	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 銘柄	121,969	2,371,483	
			-	<4.1%>	
<b>(チェコ)</b>	百株	百株	千チェコ・コルナ	千円	
KOMERCNI BANKA AS	46.48	62.5	4,237	21,257	銀行
CEZ	80.01	98.49	5,870	29,447	電力
MONETA MONEY BANK AS	209.73	269.89	2,163	10,851	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数 銘柄	12,270	61,557	
			-	<0.1%>	
<b>(韓国)</b>	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
CHEIL WORLDWIDE INC	33.54	73	162,790	15,839	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	15.15	20.68	221,276	21,530	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	13.75	18.56	354,496	34,492	保険
DB INSURANCE CO LTD	16.28	38.43	174,664	16,994	保険
COWAY CO LTD	27.6	23.34	155,677	15,147	家庭用耐久財
KT&G CORP	59.33	64.55	534,474	52,004	タバコ
S-1 CORPORATION	4.87	7.94	64,790	6,304	商業サービス・用品
KOREA GAS CORP	26.07	13.03	43,324	4,215	ガス
CJ CORP	3.09	10.01	97,497	9,486	コングロマリット
KAKAO CORP	25.98	175.75	2,091,425	203,495	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CJ ENM CO LTD	5.63	2.99	42,936	4,177	インターネット販売・通信販売
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	31.83	24.97	70,914	6,900	機械
KMW CO LTD	8.63	13.34	81,774	7,956	通信機器
SK TELECOM CO LTD	10.13	25.24	762,248	74,166	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO	16.47	-	-	-	建設・土木
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	223.72	215.11	215,110	20,930	資本市場
NCSOFT CORPORATION	8.24	10.26	935,712	91,044	娯楽
LG UPLUS CORP	115.51	156.81	206,205	20,063	各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	-	152.61	213,654	20,788	電気設備
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	50.23	-	-	-	建設・土木
POSCO INTERNATIONAL CORP	16.34	-	-	-	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	4.74	5.62	876,720	85,304	パーソナル用品
LG CHEM LTD	22.58	28.06	2,516,982	244,902	化学
LG CHEM LTD	3.54	4.99	202,344	19,688	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	0.78	2.03	137,228	13,352	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	225.41	273.94	1,010,838	98,354	銀行
S-OIL CORP	25.95	24.6	194,832	18,957	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	32.34	65.26	330,215	32,129	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	134.12	202.52	94,475	9,192	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	25.6	52.63	218,940	21,302	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	6.83	13.38	227,460	22,131	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	8.37	10.44	298,584	29,052	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	10.53	16.75	140,700	13,690	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	18.35	22.28	305,236	29,699	機械
HYUNDAI MOBIS	32.73	41.29	1,263,474	122,936	自動車部品
SK HYNIX INC	267.27	333.67	4,587,962	446,408	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	42.68	45.34	213,778	20,800	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	7.44	15.15	168,922	16,436	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	76.24	92.1	2,132,115	207,454	自動車
HYUNDAI STEEL CO	44.76	45.33	222,117	21,611	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	158.08	211.14	193,193	18,797	銀行
KCC CORP	4.02	-	-	-	化学
KIA CORPORATION	132.1	163.27	1,418,816	138,050	自動車

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ポーランド) POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA DINO POLSKA SA AMREST HOLDINGS SE ALLEGRO.EU SA	百株 309.05 17.97 44 -	百株 363.09 34.34 -	千ポーランド・ズロチ 1,178 900 -	千円 33,679 25,728 -	保険 食品・生活必需品小売り ホテル・レストラン・レジャー インターネット販売・通信販売	
小計	株数・金額 2,961.83 銘柄数<比率> 18銘柄	株数 3,461.2	外貨建金額 12,437	邦貨換算金額 355,526 <0.6%>		
(ハンガリー) RICHTER GEDEON NYRT MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT OTP BANK NYRT	百株 75.42 179.55 115.07	百株 83.93 307.03 137.82	千ハンガリー・フォリント 72,725 63,616 181,853	千円 26,184 22,904 65,474	医薬品 石油・ガス・消耗燃料 銀行	
小計	株数・金額 370.04 銘柄数<比率> 3銘柄	株数 528.78	外貨建金額 318,195	邦貨換算金額 114,563 <0.2%>		
(ユーロ圏・ベルギー) TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	百株 27	百株 -	千ユーロ -	千円 -	建設資材	
小計	株数・金額 27 銘柄数<比率> 1銘柄	株数 -	外貨建金額 -	邦貨換算金額 -<-%>		
(ユーロ圏・ギリシャ) ALPHA BANK A.E. NATIONAL BANK OF GREECE HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA FF GROUP EUROBANK ERGASIAS SERVICES MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN OPAP SA JUMBO SA	百株 383.28 263.48 145.18 31.3 748.45 22.65 91.84 54.3	百株 - 131.62 31.3 - - 112.46 81.43	千ユーロ - 186 0 - - 139 125	千円 - - 24,295 0 - - 18,068 16,311	銀行 銀行 各種電気通信サービス 繊維・アパレル・贅沢品 銀行 石油・ガス・消耗燃料 ホテル・レストラン・レジャー 専門小売り	
小計	株数・金額 1,740.48 銘柄数<比率> 8銘柄	株数 356.81	外貨建金額 451	邦貨換算金額 58,675 <0.1%>		
合計	株数・金額 1,249,512.59 銘柄数<比率> 1,180銘柄	株数 1,493,200.07	外貨建金額 -	邦貨換算金額 54,202,063 <93.2%>		

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

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

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

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

## (2) 外国新株予約権証券

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
		証 券 数	証 券 数	評 価 額
				外 貨 建 金 額
(タイ) MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	証券 9,465	証券 9,465	千タイ・パーツ 6	千円 22
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	9,465 1銘柄	9,465 1銘柄	— <0.0%>

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

## (3) 外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

## (4) 先物取引の銘柄別期末残高

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

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

## ■投資信託財産の構成

2021年4月19日現在

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

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

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

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

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年4月19日)現在

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

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

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

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

## ■損益の状況

当期 自2020年4月21日 至2021年4月19日

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

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

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

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