

運用報告書 (全体版)

DIAMパッシブ資産分散ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2005年12月28日から無期限です。	
運用方針	安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざします。	
主要投資対象	DIAMパッシブ資産分散ファンド	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、インデックス225 マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	インデックス225マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
運用方法	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 [※] を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券
	各マザーファンドへの投資に当たっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（以下、「基本リスクウェイト」といいます。）に基づき算出された資産構成比に従い、配分します。 基本リスクウェイトは、各資産の時価およびボラティリティをもとに、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社が定期的に計測します。計測の結果、原則として、基本リスクウェイトから信託財産におけるいずれかの資産のリスクウェイトが5%以上乖離した場合にはリバランスを行います。 実質組入外貨建資産については、為替ヘッジは行いません。	
組入制限	マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。	
	株式への直接投資は行いません。 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	毎決算時（原則として、奇数月の各6日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、原則として利子・配当等収益の範囲内で行います。また、毎年5月および11月の決算時には、原則として利子・配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。	

愛称 **三木の久**

第93期 <決算日 2021年7月6日>
第94期 <決算日 2021年9月6日>
第95期 <決算日 2021年11月8日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAMパッシブ資産分散ファンド」は、2021年11月8日に第95期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

DIAMパッシブ資産分散ファンド

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託 受益証券・ 投資証券 組入比率	純資産額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率						
第28作成期	81期(2019年7月8日)	円 9,827	円 40	% 0.5	% 20.5	% 2.0	% 50.5	% -	% 24.0	百万円 4,575
	82期(2019年9月6日)	9,758	40	△0.3	19.9	2.8	50.4	-	25.7	4,463
	83期(2019年11月6日)	10,075	40	3.7	21.6	1.6	50.5	-	25.1	4,493
第29作成期	84期(2020年1月6日)	9,991	40	△0.4	20.5	1.9	50.9	-	24.2	4,349
	85期(2020年3月6日)	9,712	40	△2.4	18.8	2.2	52.4	-	23.8	4,122
	86期(2020年5月7日)	8,865	40	△8.3	19.6	2.1	56.1	-	19.3	3,694
第30作成期	87期(2020年7月6日)	9,572	40	8.4	18.0	1.9	59.2	-	18.7	3,932
	88期(2020年9月7日)	9,690	40	1.7	18.0	1.6	59.2	-	18.9	3,923
	89期(2020年11月6日)	9,576	40	△0.8	19.4	1.1	58.4	-	18.6	3,825
第31作成期	90期(2021年1月6日)	9,921	40	4.0	19.7	1.5	58.2	-	18.2	3,884
	91期(2021年3月8日)	10,258	20	3.6	18.0	0.8	58.1	-	17.9	3,933
	92期(2021年5月6日)	10,521	20	2.8	17.5	1.3	61.0	-	18.1	3,939
第32作成期	93期(2021年7月6日)	10,686	20	1.8	17.8	0.6	61.9	-	17.4	3,942
	94期(2021年9月6日)	10,820	20	1.4	17.6	0.6	64.3	-	15.4	3,891
	95期(2021年11月8日)	10,981	20	1.7	17.2	0.4	65.5	-	15.1	3,849

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「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) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは、外国債券、国内株式及び外国不動産投資信託証券(リート)に投資を行い、安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざして運用しております。

上記資産を組合わせた適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率	債券組入 比 率	債券先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		円	騰 落 率					
第93期	(期 首) 2021年5月6日	10,521	—	17.5	1.3	61.0	—	18.1
	5 月 末	10,631	1.0	18.0	0.3	61.3	—	18.7
	6 月 末	10,667	1.4	17.9	0.5	60.9	—	18.3
	(期 末) 2021年7月6日	10,706	1.8	17.8	0.6	61.9	—	17.4
第94期	(期 首) 2021年7月6日	10,686	—	17.8	0.6	61.9	—	17.4
	7 月 末	10,629	△0.5	16.8	0.5	65.5	—	15.3
	8 月 末	10,705	0.2	17.1	0.6	64.8	—	15.2
	(期 末) 2021年9月6日	10,840	1.4	17.6	0.6	64.3	—	15.4
第95期	(期 首) 2021年9月6日	10,820	—	17.6	0.6	64.3	—	15.4
	9 月 末	10,697	△1.1	17.1	0.7	65.2	—	13.7
	10 月 末	10,946	1.2	16.8	0.5	65.2	—	16.2
	(期 末) 2021年11月8日	11,001	1.7	17.2	0.4	65.5	—	15.1

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

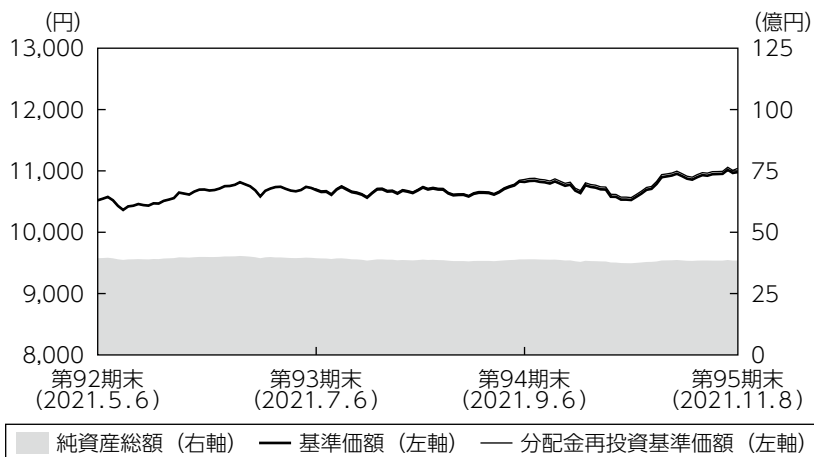
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第93期～第95期の運用経過（2021年5月7日から2021年11月8日まで）

基準価額等の推移



第93期首：10,521円
 第95期末：10,981円
 (既払分配金60円)
 騰落率：5.0%
 (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

新型コロナウイルスのワクチンの普及による経済正常化への期待等を背景に世界的に株式市場とリート市場が上昇したこと、為替市場でリスク回避姿勢が後退したこと等を背景に複数の通貨に対し円安現地通貨高となったこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.3%
インデックス225 マザーファンド	1.4%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.5%

(注) インデックス225 マザーファンドは2021年6月3日より組入れております。

投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、ドイツ債の利回りは、低下（価格は上昇）しました。米国債は、新型コロナウイルスのワクチン普及や追加経済対策により米景気回復が加速するとの見方や、FOMC（米連邦公開市場委員会）で早期にテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）が開始される可能性が示されたことを受けて利回りは上昇しました。ドイツ債については、新型コロナウイルス感染者が増加していることやインフレ期待の低下、長期見通しの不透明感を受けて利回りは低下しました。

国内株式市場は上昇しました。新型コロナウイルスの国内での感染再拡大に伴い、緊急事態宣言の発出・解除が繰り返されたことや米長期金利上昇により米インフレ加速懸念が強く意識されたことなどから、下落基調で推移しました。2021年9月には、菅首相の自民党総裁選不出馬表明により、衆院選での与党大敗が回避されるとの期待などから上昇しましたが、作成期末にかけては、中国不動産大手の信用懸念拡大などを受けて乱高下する展開となりました。

外国リート市場は上昇しました。米国リート市場は新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化への期待や米国株の好決算に伴うリスク選好の動きなどから堅調に推移しました。欧州リート市場は中国不動産大手を巡る懸念から大きく下落する局面がありましたが、ワクチン接種の進展などが支援材料となり上昇しました。オーストラリアリート市場は好調な経済指標の発表や主要都市におけるロックダウン解除などから上昇しました。

為替市場ではまちまちの動きとなりました。ドル/円相場は、米国で金融政策の早期正常化観測が高まったこと、リスク回避姿勢が後退したこと等を背景に円安ドル高の動きとなりました。またその他の主要通貨においては、内外金利差が概ね横ばいとなったユーロに対しては円は横ばいになった一方、カナダドルや英ポンドに対しては内外金利差拡大等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

マザーファンドへの投資を通じ、外国債券、国内株式、外国リーートの3資産に投資を行いました。各マザーファンドへの投資にあたっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（基本リスクウェイト：各々約33%）に基づき算出された資産構成比に従い分散投資を行いました。

【運用状況】

○各資産のリスク量

※1 リスクウェイトはみずほ第一フィナンシャルテクノロジーが計測。

※2 リスクウェイトの乖離につきましては、基本リスクウェイトへ近づけるオペレーションを実施します。

前作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 リスクウェイト	差
外国債券	31.7%	33.3%	33.3%	△1.6%
国内株式	33.2%	33.3%	33.3%	△0.2%
外国リート	35.1%	33.3%	33.3%	1.8%
合計	100.0%	100.0%	100.0%	0.0%



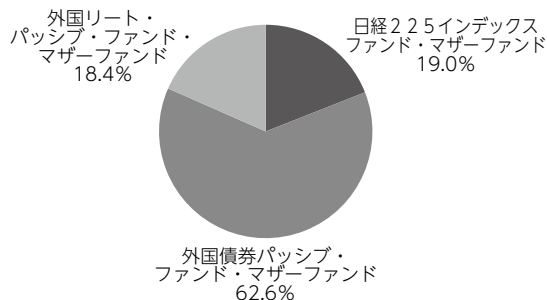
当作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 リスクウェイト	差
外国債券	33.5%	33.3%	33.3%	0.2%
国内株式	33.6%	33.3%	33.3%	0.3%
外国リート	32.9%	33.3%	33.3%	△0.5%
合計	100.0%	100.0%	100.0%	0.0%

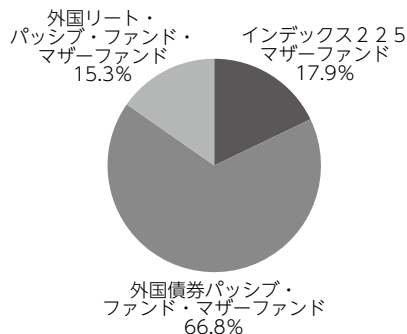
○マザーファンド組入比率

※比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

前作成期末



当作成期末



●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。

●日経225インデックスファンド・マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどにも適宜対応しました。

2021年6月3日に現物株式を全て売却し、以降は株価指数先物を中心とした運用に切り替え、9月17日に繰上償還しました。

●インデックス225マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入れ替えなどにも適宜対応しました。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるS&P先進国REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

分配金

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第93期	第94期	第95期
	2021年5月7日 ～2021年7月6日	2021年7月7日 ～2021年9月6日	2021年9月7日 ～2021年11月8日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.19%	0.18%	0.18%
当期の収益	20円	20円	20円
当期の収益以外	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	737円	871円	1,033円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

今後も各資産のリスク量が均等になるよう、各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率についても、高位を維持する方針です。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●インデックス225マザーファンド

引き続き、財務リスク等を考慮しつつ、日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果をめざします。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしてパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第93期～第95期		項目の概要
	(2021年5月7日 ～2021年11月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	60円	0.562%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,695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)	(26)	(0.247)	
(販売会社)	(30)	(0.281)	
(受託会社)	(4)	(0.034)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	1	0.007	(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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.007)	
(d) その他費用	1	0.010	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.008)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	62	0.582	

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

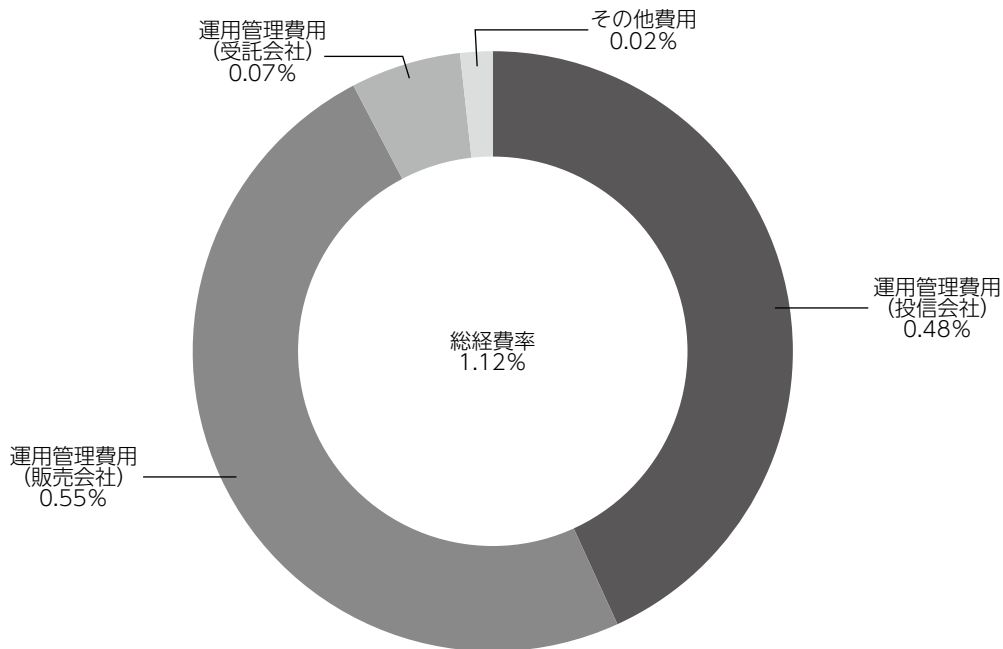
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.12%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5月7日から2021年11月8日まで）

	第 93 期 ~ 第 95 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	38,995	80,000	26,844	55,000
日経225インデックスファンド・マザーファンド	-	-	311,095	730,962
インデックス225マザーファンド	313,182	730,961	29,564	70,000
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	-	-	161,260	252,000

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 93 期 ~ 第 95 期	
	日経225インデックスファンド・マザーファンド	インデックス225マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	49,753,725千円	137,944,617千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	44,077,641千円	114,629,780千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.12	1.20

(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5月7日から2021年11月8日まで）

【D I AMパッシブ資産分散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

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 93 期 ~ 第 95 期
売買委託手数料総額 (A)	118千円
うち利害関係人への支払額 (B)	5千円
(B)/(A)	4.8%

(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。

【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。

【日経225インデックスファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 93 期 ~ 第 95 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 0.998	百万円 9	百万円 -

【インデックス225 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	第 93 期 ~ 第 95 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 96,212	百万円 -	% -	百万円 41,731	百万円 4,980	% 11.9
株 式 先 物 取 引	59,651	59,651	100.0	57,860	57,860	100.0

平均保有割合 0.5%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 93 期 ~ 第 95 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 19	百万円 8	百万円 23

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 93 期 ~ 第 95 期	
	買 付 額	
株 式	百万円 5	

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第 31 作 成 期 末		第 32 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
		千□	千□	千円
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,203,086		1,215,237	2,541,183
日経 2 2 5 インデックスファンド・マザーファンド	311,095		—	—
インデックス 2 2 5 マザーファンド	—		283,618	679,719
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	503,548		342,287	581,615

■投資信託財産の構成

2021年11月8日現在

項 目	第 32 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,541,183	65.7
インデックス 2 2 5 マザーファンド	679,719	17.6
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	581,615	15.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	66,519	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	3,869,038	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年11月8日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは152,410,305千円、99.0％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは83,446,347千円、99.8％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年11月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.62円、1カナダ・ドル=91.20円、1オーストラリア・ドル=84.00円、1香港・ドル=14.60円、1シンガポール・ドル=84.14円、1ニュージーランド・ドル=80.78円、1イギリス・ポンド=153.19円、1イスラエル・シケル=36.513円、1デンマーク・クローネ=17.66円、1ノルウェー・クローネ=13.29円、1スウェーデン・クローナ=13.25円、1メキシコ・ペソ=5.58円、100韓国・ウォン=9.60円、1オフショア・人民元=17.761円、1マレーシア・リンギット=27.34円、1ポーランド・ズロチ=28.556円、1ユーロ=131.33円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年7月6日)、 (2021年9月6日)、 (2021年11月8日)現在

項 目	第 93 期 末	第 94 期 末	第 95 期 末
(A) 資 産	3,959,777,340円	3,906,552,716円	3,869,038,435円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	72,426,145	59,091,168	66,519,505
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,471,741,216	2,529,112,667	2,541,183,976
日経225インデックスファンド・マザーファンド(評価額)	7,785,228	8,077,672	—
インデックス225マザーファンド(評価額)	715,871,041	709,771,339	679,719,414
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	691,953,710	600,499,870	581,615,540
(B) 負 債	16,785,435	14,582,729	19,261,893
未 払 収 益 分 配 金	7,380,049	7,194,251	7,011,605
未 払 解 約 金	2,103,897	134,045	4,953,408
未 払 信 託 報 酬	7,278,234	7,231,322	7,273,638
そ の 他 未 払 費 用	23,255	23,111	23,242
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	3,942,991,905	3,891,969,987	3,849,776,542
元 本	3,690,024,568	3,597,125,583	3,505,802,612
次 期 繰 越 損 益 金	252,967,337	294,844,404	343,973,930
(D) 受 益 権 総 口 数	3,690,024,568口	3,597,125,583口	3,505,802,612口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,686円	10,820円	10,981円

(注) 第92期末における元本額は3,744,374,012円、当作成期間(第93期~第95期)中における追加設定元本額は16,974,756円、同解約元本額は255,546,156円です。

■損益の状況

〔自 2021年5月7日〕
〔至 2021年7月6日〕

〔自 2021年7月7日〕
〔至 2021年9月6日〕

〔自 2021年9月7日〕
〔至 2021年11月8日〕

項 目	第 93 期	第 94 期	第 95 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,624円	△2,916円	△1,291円
受 取 利 息	14	101	21
支 払 利 息	△1,638	△3,017	△1,312
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	75,253,498	62,701,546	70,951,055
売 買 益	92,461,773	63,207,880	71,133,441
売 買 損	△17,208,275	△506,334	△182,386
(C) 信 託 報 酬 等	△7,301,489	△7,254,433	△7,296,880
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	67,950,385	55,444,197	63,652,884
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	193,768,628	247,767,422	288,128,661
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,371,627	△1,172,964	△796,010
(配 当 等 相 当 額)	(17,775,654)	(17,503,776)	(17,434,223)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△19,147,281)	(△18,676,740)	(△18,230,233)
(G) 合 計(D+E+F)	260,347,386	302,038,655	350,985,535
(H) 収 益 分 配 金	△7,380,049	△7,194,251	△7,011,605
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	252,967,337	294,844,404	343,973,930
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,371,627	△1,172,964	△796,010
(配 当 等 相 当 額)	(17,783,123)	(17,505,179)	(17,438,293)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△19,154,750)	(△18,678,143)	(△18,234,303)
分 配 準 備 積 立 金	254,338,964	296,017,368	344,769,940

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	第 93 期	第 94 期	第 95 期
(a) 経費控除後の配当等収益	11,567,474円	8,524,287円	13,763,821円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	56,382,911	46,919,910	49,889,063
(c) 収 益 調 整 金	17,783,123	17,505,179	17,438,293
(d) 分 配 準 備 積 立 金	193,768,628	247,767,422	288,128,661
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	279,502,136	320,716,798	369,219,838
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	757.45	891.59	1,053.17
(g) 分 配 金	7,380,049	7,194,251	7,011,605
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	20	20	20

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 93 期	第 94 期	第 95 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

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

《お知らせ》

■主要投資対象に「インデックス225 マザーファンド」を追加するため、約款に所要の変更を行いました。
(2021年6月2日)

■主要投資対象から「日経225インデックスファンド・マザーファンド」を削除するため、約款に所要の変更を行いました。
(2021年9月17日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	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			
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	ポイント 108,792.68	% △2.7	% 97.9	% -	百万円 248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

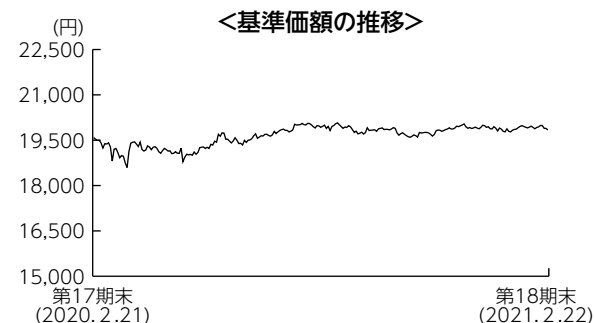
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月22日から2021年2月22日まで）

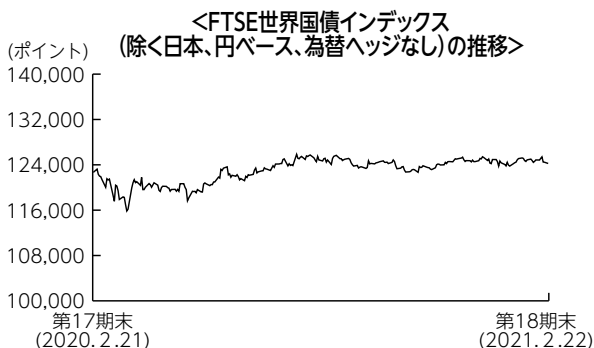


基準価額の推移

当期末の基準価額は19,836円となり、前期末比で1.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

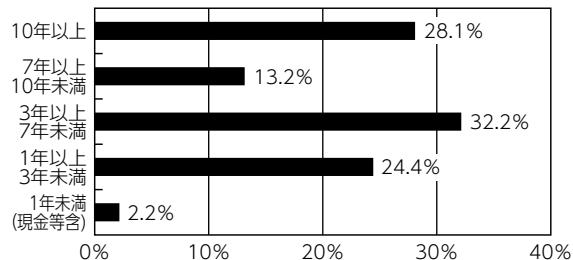
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（19,648円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については7ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

公社債

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

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)								
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券		3.5000	3,270	4,838	61,740	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券		0.7500	1,540	1,613	20,589	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券		2.5000	6,180	6,890	87,926	2031/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券		0.1250	2,200	2,155	27,505	2022/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券		3.5000	3,000	3,146	40,153	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券		1.5000	8,200	8,604	109,789	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券		1.0000	4,250	4,506	57,505	2029/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券		0.7500	1,970	2,062	26,313	2029/11/12	
小計	-	-	-	30,610	33,818	431,523	-	
(メキシコ)								
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 0.375 03/09/23	国債証券		5.7500	14,859	15,407	79,350	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券		6.7500	20,000	21,027	108,292	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券		8.5000	17,109	20,314	104,618	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券		7.7500	10,000	11,329	58,346	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券		7.5000	18,071	20,262	104,352	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券		6.5000	7,830	8,066	41,542	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券		8.0000	10,000	11,134	57,343	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券		7.7500	13,643	14,895	76,713	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券		8.0000	9,254	10,313	53,112	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券		8.5000	8,125	9,596	49,422	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券		10.0000	8,085	10,834	55,799	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券		7.7500	7,000	7,917	40,776	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券		10.0000	22,596	26,847	138,264	2023/12/07	
小計	-	-	-	180,572	203,320	1,047,101	-	
(マレーシア)								
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券		3.8920	800	858	22,423	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券		3.4800	1,220	1,258	32,867	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券		4.3920	3,070	3,362	87,826	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券		4.4980	1,800	2,008	52,448	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券		3.8440	1,210	1,234	32,232	2037/04/07	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券		4.7620	1,200	1,349	35,236	2028/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券		3.7330	2,000	2,133	55,725	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券		4.1810	2,430	2,595	67,806	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券		4.9210	2,600	2,934	76,659	2034/07/05	
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券		3.8280	600	605	15,815	2022/08/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券		3.4180	3,000	3,067	80,122	2043/09/30	
小計	-	-	-	21,930	23,693	618,878	-	
(ポーランド)								
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券		2.5000	2,850	2,981	85,062	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券		5.7500	1,440	1,968	56,166	2028/04/25	
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券		2.7500	3,010	3,373	96,231	2022/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券		2.2500	1,500	1,539	43,927	2024/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券		2.5000	2,290	2,447	69,821	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券		2.5000	2,080	2,277	64,976	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券		3.2500	2,380	2,662	75,948	2027/07/25	
POLAND 07/25/22	国債証券		2.5000	2,280	2,511	71,645	2022/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券		-	1,200	1,199	34,226	2022/09/23	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券		5.7500	1,720	1,876	53,528	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券		4.0000	3,940	4,340	123,836	2029/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券		2.7500	210	236	6,758	2029/10/25	

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

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

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

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	率
公社債	千円		%
コール・ローン等、その他	134,816,915		97.7
投資信託財産総額	3,110,505		2.3
	137,927,421		100.0

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

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

(注1) 期首元本額 66,784,593,799円
 追加設定元本額 22,324,176,727円
 一部解約元本額 20,023,501,033円

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM外国債券パッシブ・ファンド	7,285,630,090円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,005,013円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	17,901,375円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,109,682円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	58,667,541円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,579,939円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,987,271円
たわらノーロード 先進国債券	9,989,838,812円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,647,242円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	971,663,519円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,728,812円
たわらノーロード バランス (標準型)	121,338,758円
たわらノーロード バランス (積極型)	25,135,439円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	4,073,309円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	220,889,452円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	214,665,752円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	46,211,416円
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
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	275,405円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,559,857円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,960,740円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,185,878円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,140,370円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,996,521,601円
One D C 先進国債券インデックスファンド	286,853,098円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	632,089,833円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,993,683,959円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	361,021,755円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	767,057,750円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	628,680,822円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	16,652,719円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	516,637,062円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	28,446,399円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	125,346,778円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	95,961,436円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	160,485,652円

グループコントロール	2,047,605,074円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	112,880,979円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	216,614,702円
D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	7,184,218円
D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	13,602,076円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,987,588円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,862,427円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,708,262円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,153,273,300円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	288,411,930円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	353,533,881円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	161,736,477円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	179,290,591円
D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,015,406,638円
D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,819,894,345円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,325,976,349円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,699,054,337円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	61,358,370円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	471,072,165円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	503,573,522円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	298,873,925円
D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,070,483円
D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,781,571円
D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	12,259,425円
D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,487,646円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	41,773,382円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	62,816,454円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,343,965,366円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,733,964,005円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,001,729,443円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	553,039,600円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	192,002,729円
D I AMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,181,197,557円
D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家向け)	541,945,752円
D I AM世界アセット/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,548,316円
D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	456,033,204円
D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	467,152,429円
D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	632,499,155円
D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	66,775,811円
期末元本合計	69,085,269,493円

■損益の状況

当期 自2020年2月22日 至2021年2月22日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

インデックス225 マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月21日～2021年2月22日）

インデックス225 マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限です。
運用方針	日経平均株価（225種・東証）の動きに連動する投資成果をめざした運用を行います。
主要投資対象	主として東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、原則として、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄の中から200銘柄以上に等株数投資を行います。
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		日経平均株価（225）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	(ベンチマーク) 円	期中騰落率			
11期（2017年2月20日）	14,254	21.8	19,251.08	19.5	95.6	9.5	26,482
12期（2018年2月20日）	16,536	16.0	21,925.10	13.9	94.8	5.1	42,372
13期（2019年2月20日）	16,485	△0.3	21,431.49	△2.3	97.4	5.3	34,447
14期（2020年2月20日）	18,448	11.9	23,479.15	9.6	93.3	6.6	25,144
15期（2021年2月22日）	24,143	30.9	30,156.03	28.4	97.8	2.2	89,076

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、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）。

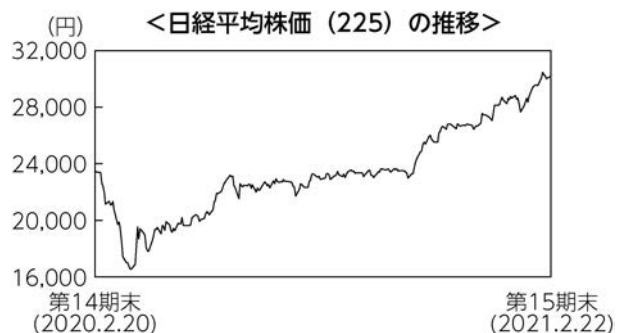
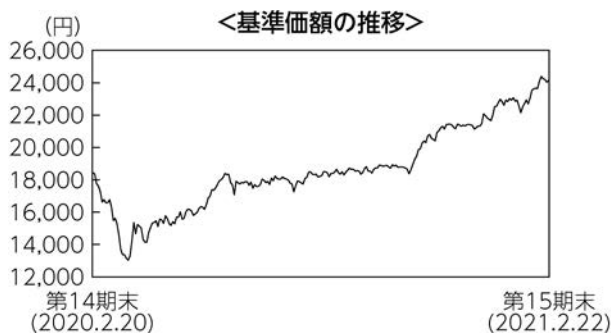
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価 (225)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首)	円	%	円	%	%	%
2020年 2月20日	18,448	-	23,479.15	-	93.3	6.6
2月 末	16,621	△9.9	21,142.96	△10.0	95.1	4.8
3月 末	15,013	△18.6	18,917.01	△19.4	93.1	6.9
4月 末	16,020	△13.2	20,193.69	△14.0	89.2	4.5
5月 末	17,355	△5.9	21,877.89	△6.8	93.5	6.4
6月 末	17,710	△4.0	22,288.14	△5.1	95.9	4.0
7月 末	17,254	△6.5	21,710.00	△7.5	93.2	6.7
8月 末	18,392	△0.3	23,139.76	△1.4	98.2	1.6
9月 末	18,539	0.5	23,185.12	△1.3	94.6	5.3
10月 末	18,372	△0.4	22,977.13	△2.1	94.4	5.5
11月 末	21,137	14.6	26,433.62	12.6	97.0	3.3
12月 末	21,971	19.1	27,444.17	16.9	97.7	2.3
2021年 1月 末	22,146	20.0	27,663.39	17.8	97.0	2.9
(期 末)						
2021年 2月22日	24,143	30.9	30,156.03	28.4	97.8	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月21日から2021年2月22日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は24,143円となり、前期末比で30.9%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初、新型コロナウイルス感染拡大を受け、大幅下落となりました。その後は、各国政府による財政出動や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待の高まりを受け、戻り歩調を辿りました。2020年11月以降は、米大統領選という大きな政治日程を通過したことや、米経済対策法案成立、米英におけるワクチン接種開始などが好感され、日経平均株価は大きく上昇、期末にかけ、3万円の大台を回復しました。

ポートフォリオについて

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で28.4%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.5%程度上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因によるものです。

今後の運用方針

今後の運用につきましても、財務リスク等を考慮しつつ、日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

■ 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	1円	0.005%	(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
(株式)	(0)	(0.002)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
合計	1	0.005	
期中の平均基準価額は18,650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2月21日から2021年2月22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
		23,347.8 (58)	84,234,456 (-)	10,998.8	40,788,637

(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		百万円	百万円	百万円	百万円
	株式先物取引	39,344	39,729	898	898

(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	125,023,093千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	34,749,519千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.59

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月21日から2021年2月22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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	84,234	2,553	3.0	40,788	1,237	3.0
株 式 先 物 取 引	40,242	40,242	100.0	40,627	40,627	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
	百万円	百万円	百万円
株 式	17	8	16

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期	
	買 付 額	期
		百万円
株 式		35

(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)	1,625千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1,063千円
(B) / (A)	65.4%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	36	104	52,208
マルハニチロ	3.6	10.4	25,792
鉱業 (0.0%)			
国際石油開発帝石	14.4	41.6	32,281
建設業 (1.6%)			
コムシスホールディングス	36	104	338,000
大成建設	7.2	20.8	78,832
大林組	36	104	97,344
清水建設	36	104	84,968
長谷工コーポレーション	7.2	20.8	28,163
鹿島建設	18	52	73,892
大和ハウス工業	36	104	332,800
積水ハウス	36	104	216,424
日揮ホールディングス	36	104	140,920
食料品 (3.2%)			
日清製粉グループ本社	36	104	179,608
明治ホールディングス	7.2	20.8	144,976
日本ハム	18	52	242,580
サッポロホールディングス	7.2	20.8	46,675
アサヒグループホールディングス	36	104	472,992
キリンホールディングス	36	104	219,960
宝ホールディングス	36	104	155,896
キッコーマン	36	104	769,600
味の素	36	104	235,820
ニチレイ	18	52	145,964
日本たばこ産業	36	104	201,396
繊維製品 (0.2%)			
東洋紡	3.6	10.4	13,956
ユニチカ	3.6	10.4	4,638
帝人	7.2	20.8	38,958
東レ	36	104	73,507

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	36	104	73,736
日本製紙	3.6	10.4	14,622
化学 (7.5%)			
クラレ	36	104	124,384
旭化成	36	104	119,340
昭和電工	3.6	10.4	26,956
住友化学	36	104	54,288
日産化学	36	104	648,960
東ソー	18	52	103,428
トクヤマ	7.2	20.8	55,785
デンカ	7.2	20.8	85,696
信越化学工業	36	104	1,948,960
三井化学	7.2	20.8	67,392
三菱ケミカルホールディングス	18	52	38,038
宇部興産	3.6	10.4	22,266
日本化薬	36	-	-
花王	36	104	756,080
D I C	3.6	10.4	29,744
富士フィルムホールディングス	36	104	658,632
資生堂	36	104	847,600
日東電工	36	104	980,720
医薬品 (7.3%)			
協和キリン	36	104	320,840
武田薬品工業	36	104	383,448
アステラス製薬	180	520	925,080
大日本住友製薬	36	104	176,904
塩野義製薬	36	104	604,344
中外製薬	36	312	1,638,000
エーザイ	36	104	793,000
第一三共	36	312	1,017,432
大塚ホールディングス	36	104	464,776

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	14.4	41.6	114,067
ENEOSホールディングス	36	104	48,141
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	18	52	101,972
ブリヂストン	36	104	436,696
ガラス・土石製品 (1.1%)			
AGC	7.2	20.8	81,224
日本板硝子	3.6	10.4	5,740
日本電気硝子	10.8	31.2	78,062
住友大阪セメント	3.6	10.4	37,024
太平洋セメント	3.6	10.4	28,579
東海カーボン	36	104	157,560
TOTO	18	52	356,200
日本碍子	36	104	195,624
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	3.6	10.4	16,135
神戸製鋼所	3.6	10.4	6,614
ジェイ エフ イー ホールディングス	3.6	10.4	11,575
大太平洋金属	3.6	10.4	26,000
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	36	104	22,536
三井金属鉱業	3.6	10.4	40,404
東邦亜鉛	3.6	10.4	25,116
三菱マテリアル	3.6	10.4	27,019
住友金属鉱山	18	52	290,056
DOWAホールディングス	7.2	20.8	86,840
古河電気工業	3.6	10.4	29,858
住友電気工業	36	104	161,148
フジクラ	36	104	54,600
金属製品 (0.2%)			
SUMCO	3.6	10.4	26,208
東洋製罐グループホールディングス	36	104	141,544
機械 (4.6%)			
日本製鋼所	7.2	20.8	60,049

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オークマ	7.2	20.8	124,176
アマダ	36	104	134,056
小松製作所	36	104	338,312
住友重機械工業	7.2	20.8	60,340
日立建機	36	104	345,800
クボタ	36	104	257,036
荏原製作所	7.2	20.8	85,488
ダイキン工業	36	104	2,298,400
日本精工	36	104	105,456
NTN	36	104	32,760
ジェイテクト	36	104	119,184
日立造船	7.2	20.8	14,705
三菱重工業	3.6	10.4	31,772
I H I	3.6	10.4	19,749
電気機器 (22.2%)			
日清紡ホールディングス	36	104	83,616
コニカミノルタ	36	104	57,200
ミネベアミツミ	36	104	277,680
日立製作所	7.2	20.8	102,627
三菱電機	36	104	166,556
富士電機	7.2	20.8	97,032
安川電機	36	104	589,680
オムロン	36	104	979,680
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.2	20.8	70,096
日本電気	3.6	10.4	65,416
富士通	3.6	10.4	165,412
沖電気工業	3.6	10.4	10,920
セイコーエプソン	72	208	367,744
パナソニック	36	104	149,916
シャープ	—	104	222,560
ソニー	36	104	1,245,920
T D K	36	104	1,691,040
アルプスアルパイン	36	104	149,448
横河電機	36	104	222,872
アドバンテスト	72	208	2,011,360

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カシオ計算機	36	104	213,720
ファナック	36	104	2,868,840
京セラ	72	208	1,444,352
太陽誘電	36	104	607,360
SCREENホールディングス	7.2	20.8	194,896
キャノン	54	156	364,806
リコー	36	104	98,592
東京エレクトロン	36	104	4,815,200
輸送用機器 (3.9%)			
デンソー	36	104	693,888
三井E&Sホールディングス	3.6	10.4	4,586
川崎重工業	3.6	10.4	23,992
日産自動車	36	104	61,068
いすゞ自動車	18	52	58,448
トヨタ自動車	36	104	838,240
日野自動車	36	104	105,768
三菱自動車工業	3.6	10.4	3,047
マツダ	7.2	20.8	17,867
本田技研工業	72	208	619,320
スズキ	36	104	511,472
SUBARU	36	104	211,640
ヤマハ発動機	36	104	250,640
精密機器 (3.3%)			
テルモ	144	416	1,779,648
ニコン	36	104	95,576
オリンパス	144	416	932,048
シチズン時計	36	104	40,352
その他製品 (1.9%)			
バンダイナムコホールディングス	36	104	909,376
凸版印刷	18	52	87,412
大日本印刷	18	52	101,036
ヤマハ	36	104	600,080
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	3.6	10.4	3,723
中部電力	3.6	10.4	13,754

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
関西電力	3.6	10.4	11,154
東京瓦斯	7.2	20.8	48,110
大阪瓦斯	7.2	20.8	40,851
陸運業 (1.6%)			
東武鉄道	7.2	20.8	63,232
東急	18	52	75,556
小田急電鉄	18	52	167,700
京王電鉄	7.2	20.8	174,304
京成電鉄	18	52	197,080
東日本旅客鉄道	3.6	10.4	79,300
西日本旅客鉄道	3.6	10.4	65,644
東海旅客鉄道	3.6	10.4	183,040
日本通運	3.6	10.4	83,096
ヤマトホールディングス	36	104	296,816
海運業 (0.1%)			
日本郵船	3.6	10.4	31,772
商船三井	3.6	10.4	34,892
川崎汽船	3.6	10.4	21,476
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	3.6	10.4	26,525
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	18	52	176,280
情報・通信業 (13.7%)			
ネクソン	—	208	725,920
Zホールディングス	14.4	41.6	27,497
トレンドマイクロ	36	104	586,560
スカパーJ SATホールディングス	3.6	10.4	4,784
日本電信電話	14.4	41.6	117,249
KDDI	21.6	62.4	2,115,984
ソフトバンク	—	104	150,592
NTTドコモ	3.6	—	—
東宝	3.6	10.4	43,992
エヌ・ティ・ティ・データ	180	520	840,840
コナミホールディングス	36	104	775,840
ソフトバンクグループ	21.6	62.4	6,570,720

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
卸売業 (1.8%)			
双日	3.6	10.4	2,922
伊藤忠商事	36	104	338,000
丸紅	36	104	81,806
豊田通商	36	104	478,920
三井物産	36	104	230,308
住友商事	36	104	162,812
三菱商事	36	104	310,180
小売業 (13.9%)			
J. フロント リテイリング	18	52	52,624
三越伊勢丹ホールディングス	36	104	76,128
セブン&アイ・ホールディングス	36	104	437,008
ファミリーマート	144	-	-
高島屋	18	52	54,704
丸井グループ	36	104	214,448
イオン	36	104	369,200
ファーストリテイリング	36	104	10,909,600
銀行業 (0.5%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	36	104	44,304
新生銀行	3.6	10.4	16,026
あおぞら銀行	3.6	10.4	23,930
三菱UFJフィナンシャル・グループ	36	104	58,583
りそなホールディングス	3.6	10.4	4,537
三井住友トラスト・ホールディングス	3.6	10.4	37,575
三井住友フィナンシャルグループ	3.6	10.4	39,135
千葉銀行	36	104	73,944
ふくおかフィナンシャルグループ	7.2	20.8	42,182
静岡銀行	36	104	82,992
みずほフィナンシャルグループ	36	10.4	16,520
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	36	104	55,016
野村ホールディングス	36	104	65,738

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
松井証券	36	104	96,304	
保険業 (0.6%)				
SOMP Oホールディングス	9	26	107,224	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	10.8	31.2	97,749	
ソニーフィナンシャルホールディングス	7.2	-	-	
第一生命ホールディングス	3.6	10.4	19,780	
東京海上ホールディングス	18	52	278,252	
T & Dホールディングス	7.2	20.8	30,513	
その他金融業 (0.4%)				
クレディセゾン	36	104	137,592	
日本取引所グループ	-	104	250,172	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	36	104	70,512	
三井不動産	36	104	249,080	
三菱地所	36	104	192,348	
東京建物	18	52	81,120	
住友不動産	36	104	382,200	
サービス業 (6.6%)				
エムスリー	86.4	249.6	2,196,480	
ディー・エヌ・エー	10.8	31.2	70,293	
電通グループ	36	104	381,680	
サイバーエージェント	7.2	20.8	145,392	
楽天	36	104	119,080	
リクルートホールディングス	108	312	1,708,200	
日本郵政	36	104	93,600	
セコム	36	104	1,006,408	
合 計	株 数 ・ 金 額	株 数	株 数	千 円
	銘柄数 < 比率 >	225 銘柄	225 銘柄	87,089,899
				< 97.8% >

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期	
		買 建 額	売 建 額
国内	日 経 平 均	百万円 1,961	百万円 -

■投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 87,089,899	% 97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,005,091	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	89,094,990	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	89,094,183,513円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,766,569,493
株 式(評価額)	87,089,899,520
未 収 配 当 金	113,594,500
差 入 委 託 証 拠 金	124,120,000
(B) 負 債	17,812,450
未 払 金	6,491,450
未 払 解 約 金	11,321,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	89,076,371,063
元 本	36,894,690,609
次 期 繰 越 損 益 金	52,181,680,454
(D) 受 益 権 総 口 数	36,894,690,609口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,143円

(注1) 期首元本額 13,630,101,966円
追加設定元本額 46,210,956,930円
一部解約元本額 22,946,368,287円

(注2) 期末における元本の内訳

(適格機関投資家私募) インデックス225 (3ヵ月決算型)	3,284,141,061円
(適格機関投資家私募) インデックス225	1,052,839,868円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンド	
(為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募)	2,226,779,582円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII	
(為替バリエーションヘッジ型) (適格機関投資家限定)	548,461,099円
日米資産配分戦略ファンド (為替ヘッジ比率調整型)	
2017-03 (適格機関投資家限定)	234,258,577円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建日本政府保証償活用型)	
(適格機関投資家限定)	219,823,964円
DIAM日経225インデックスファンドV A	1,183,260,268円
国内株式バシブ・ファンド-日経225型- (適格機関投資家向け)	7,234,035,916円
DIAM日経225型バシブ・ファンド (適格機関投資家向け)	7,437,745,315円
日米独マルチアセットアロケーションファンド (適格機関投資家限定)	59,251,815円
MHAM日経225インデックスファンド [適格機関投資家限定]	11,211,676,690円
MHAMインデックス225 [適格機関投資家限定]	2,202,416,454円
期末元本合計	36,894,690,609円

■損益の状況

当期 自2020年2月21日 至2021年2月22日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	439,688,453円
受 取 配 当 金	439,648,908
受 取 利 息	2,091
そ の 他 収 益 金	590,045
支 払 利 息	△552,591
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	20,179,960,327
売 買 益	22,159,755,604
売 買 損	△1,979,795,277
(C) 先 物 取 引 等 損 益	677,328,140
取 引 益	1,021,565,410
取 引 損	△344,237,270
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	21,296,976,920
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,514,620,127
(F) 解 約 差 損 益 金	△21,620,784,613
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	40,990,868,020
(H) 合 計(D + E + F + G)	52,181,680,454
次 期 繰 越 損 益 金(H)	52,181,680,454

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

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

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

《お知らせ》

■つみたてNISA等の要件を満たすため、約款に所要の変更を行いました。

(変更年月日 2020年10月26日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第14期（決算日 2021年6月22日）

（対象期間 2020年6月23日～2021年6月22日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

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

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

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

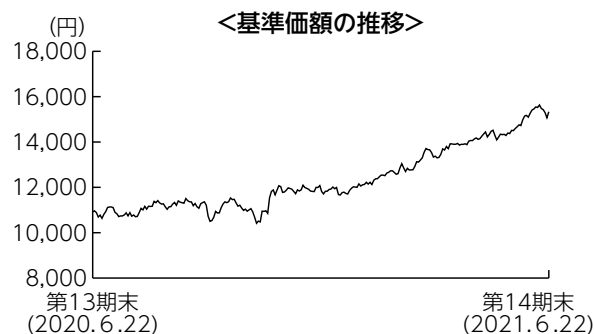
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年6月23日から2021年6月22日まで）

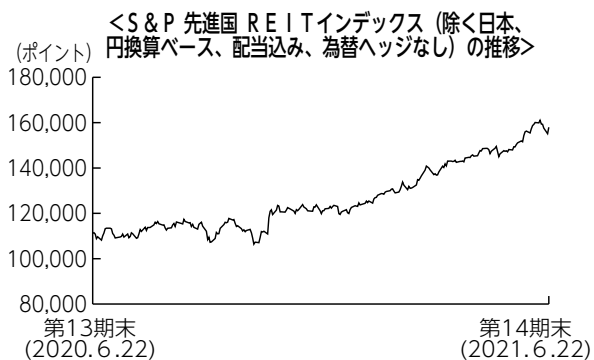


基準価額の推移

当期末の基準価額は15,336円となり、前期末比で40.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

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

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■利害関係人との取引状況等 (2020年6月23日から2021年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	口数	金額	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(オーストラリア)	千口	千円	千口	千オーストラリア・ドル	千円		%
ARENA REIT	93.469		159,242	547	45,439		0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	123.086		260,875	1,254	104,086		0.1
APN INDUSTRIA REIT	41.907		73,145	234	19,415		0.0
NATIONAL STORAGE REIT	280.409		516,215	1,047	86,924		0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	50.661		73,965	241	20,062		0.0
GDI PROPERTY GROUP	137.85		247,876	280	23,234		0.0
HOME CONSORTIUM LTD	-		85.98	498	41,365		0.1
RURAL FUNDS GROUP	101.989		160,193	397	32,954		0.0
IRONGATE GROUP	-		256,148	371	30,808		0.0
SCENTRE GROUP	1,543.922		2,437.607	6,874	570,202		0.7
HOMECO DAILY NEEDS REIT	-		213.11	303	25,190		0.0
CENTURIA OFFICE REIT	115.908		179,274	419	34,797		0.0
AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	-		176,463	538	44,644		0.1
WAYPOINT REIT LTD	208.852		382,777	1,014	84,141		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	8,802.655	15,356.239	65,264	5,413,690		-
		25銘柄<6.6%>	31銘柄<6.9%>	-	-		6.9
(香港)	千口	千円	千口	千香港・ドル	千円		%
LINK REIT	608.02		977.72	76,066	1,080,145		1.4
PROSPERITY REIT	361		597	1,779	25,262		0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	448		761	3,135	44,521		0.1
CHAMPION REIT	602.07		937.07	4,216	59,878		0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	313		451	2,056	29,203		0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	405		680	5,712	81,110		0.1
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	2,737.09	4,403.79	92,966	1,320,122		-
		6銘柄<1.9%>	6銘柄<1.7%>	-	-		1.7
(シンガポール)	千口	千円	千口	千シンガポール・ドル	千円		%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	839.66		2,169,309	4,555	373,509		0.5
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	881.66		1,544.76	4,526	371,098		0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	840.979		-	-	-		-
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	698.59		1,006.99	1,470	120,542		0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	880.12		1,370.62	2,768	227,001		0.3
STARHILL GLOBAL REIT	374.2		656.8	361	29,618		0.0
ASCOTT TRUST	530.116		891.616	891	73,103		0.1
KEPPEL REIT	553.6		951.5	1,094	89,715		0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	208.3		622.9	1,501	123,082		0.2
ESR REIT	636.53		1,148.73	470	38,615		0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	250.9		365.2	452	37,129		0.0
CAPITALAND CHINA TRUST	232.58		450.18	621	50,936		0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	180.1		608.8	167	13,726		0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	140.595		216.895	307	25,252		0.0
PARKWAY LIFE REIT	119.3		179	789	64,722		0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	615		2,759.1	176	14,477		0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	455.82		913.12	2,556	209,626		0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	644.6		1,028.2	2,200	180,406		0.2
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	310.78		587.88	485	39,765		0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	286.2		313.2	134	11,042		0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	614.2		1,019	1,080	88,560		0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	271.3		491.5	289	23,775		0.0
SPH REIT	237		471.9	410	33,661		0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	275		-	-	-		-
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	-		127.4	102	8,408		0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	165.2		208.1	193	15,867		0.0
QUE COMMERCIAL REIT	773.055		1,120.355	448	36,743		0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	203.6		422.2	339	27,866		0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	235.7		377.1	197	16,232		0.0

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

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

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2021年6月22日現在

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

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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