

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96期 <決算日 2022年1月6日>
第97期 <決算日 2022年3月7日>
第98期 <決算日 2022年5月6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、2022年5月6日に第98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	投資信託受託証券投資組入率	純資産総額
		(分配落)	税込み分配金	期中騰落率						
第29作成期	84期(2020年1月6日)	円 9,991	円 40	% △0.4	% 20.5	% 1.9	% 50.9	% -	% 24.2	百万円 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
第33作成期	96期(2022年1月6日)	10,920	20	△0.4	16.9	0.3	65.4	-	15.0	3,753
	97期(2022年3月7日)	10,295	20	△5.5	15.9	0.5	66.9	-	15.1	3,523
	98期(2022年5月6日)	10,757	20	4.7	16.8	0.4	66.2	-	14.2	3,606

(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96期	(期 首) 2021年11月8日	10,981	% -	% 17.2	% 0.4	% 65.5	% -	% 15.1
	11 月 末	10,758	△2.0	16.5	0.4	65.9	-	13.6
	12 月 末	10,965	△0.1	16.9	0.5	65.6	-	15.7
	(期 末) 2022年1月6日	10,940	△0.4	16.9	0.3	65.4	-	15.0
第97期	(期 首) 2022年1月6日	10,920	-	16.9	0.3	65.4	-	15.0
	1 月 末	10,573	△3.2	16.4	0.5	66.5	-	14.7
	2 月 末	10,406	△4.7	16.6	0.4	65.7	-	14.9
	(期 末) 2022年3月7日	10,315	△5.5	15.9	0.5	66.9	-	15.1
第98期	(期 首) 2022年3月7日	10,295	-	15.9	0.5	66.9	-	15.1
	3 月 末	10,902	5.9	16.7	0.5	64.7	-	16.0
	4 月 末	10,872	5.6	16.5	0.4	66.6	-	13.0
	(期 末) 2022年5月6日	10,777	4.7	16.8	0.4	66.2	-	14.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

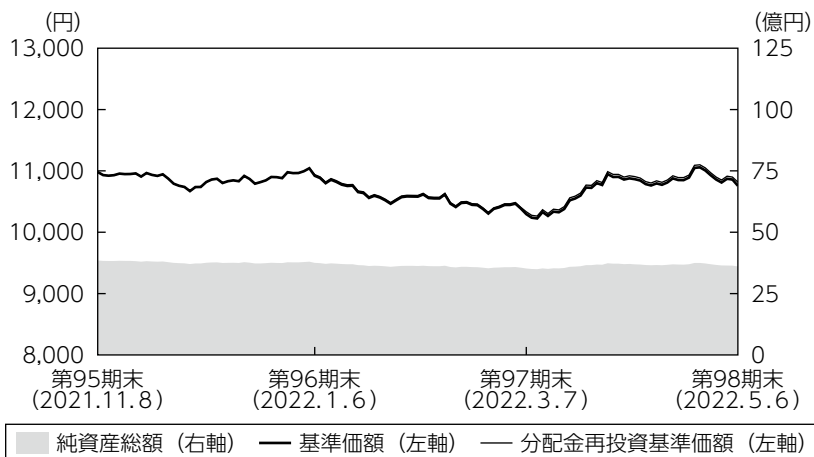
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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96期～第98期の運用経過（2021年11月9日から2022年5月6日まで）

基準価額等の推移



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

海外主要国の長期金利が大きく上昇（債券価格は下落）し内外金利差が拡大する中、主要通貨に対して円安が進んだことはプラスに影響しました。一方、インフレ懸念や主要国の金融政策の早期正常化観測等から長期金利が上昇したことやF R B（米連邦準備理事会）の積極的な金融引き締め姿勢を嫌気し外国株式市場や外国リート市場が下落したこと、外国株式市場の下落に連れて国内株式市場も下落したこと等がマイナスに影響し、基準価額は下落しました。

◆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	△1.2%
インデックス225 マザーファンド	△7.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.1%

投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに上昇（価格は下落）しました。米国債は、インフレを抑制するため、F R B高官から利上げペースを早める旨の発言が相次いだ他、ロシアのウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもロシアのウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。

国内株式市場は下落しました。作成期初から2022年3月中旬にかけては、新型コロナウイルス新規感染者数の拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻などを受けて下落基調で推移しました。3月中旬以降はロシアとウクライナの和平交渉進展期待や円安進行などから上昇しました。しかし、4月以降は、F O M C（米連邦公開市場委員会）議事要旨を受けて金融引き締めに対する懸念が強まり、米国株式が軟調に推移したことなどから、再び下落に転じました。

外国リート市場は下落しました。米国リート市場はウクライナ情勢の緊迫化やインフレ加速懸念、F R Bが金融引き締めを積極的に進めるとの見方が強まったことから下落しました。欧州リート市場は地理的に隣接しているウクライナ情勢の緊迫化に加えて、E C B（欧州中央銀行）のタカ派的な政策決定が嫌気され下落しました。オーストラリアリート市場は作成期半ばのオミクロン株の同国における急速な感染拡大等を背景に下落しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。ドル／円相場は、米国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大したことや、米国が金融政策の正常化を進める一方で日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示したことで日米の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を材料に、円安ドル高の動きとなりました。その他の主要通貨においても、海外主要国の長期金利が大きく上昇した一方で国内の長期金利の上昇が限定的となり、内外金利差が拡大したこと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	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%



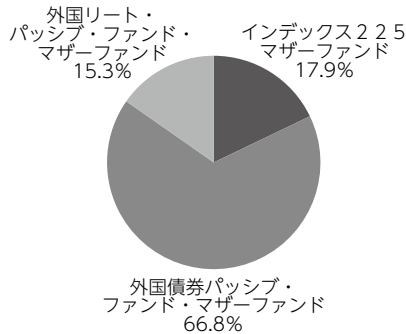
当作成期末

	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	32.6%	33.3%	33.3%	△0.7%
国内株式	34.7%	33.3%	33.3%	1.4%
外国リート	32.7%	33.3%	33.3%	△0.6%
合計	100.0%	100.0%	100.0%	0.0%

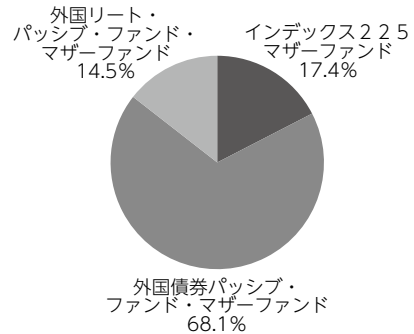
○マザーファンド組入比率

※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。

●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96期	第97期	第98期
	2021年11月9日 ～2022年1月6日	2022年1月7日 ～2022年3月7日	2022年3月8日 ～2022年5月6日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.18%	0.19%	0.19%
当期の収益	13円	8円	20円
当期の収益以外	6円	11円	-円
翌期繰越分配対象額	1,026円	1,014円	1,039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96期～第98期		項目の概要
	(2021年11月9日 ～2022年5月6日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58円	0.541%	(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10,723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)	(0.238)	
(販売会社)	(29)	(0.270)	
(受託会社)	(3)	(0.032)	
(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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	1	0.009	(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)	(0.001)	
(投資証券)	(1)	(0.009)	
(d) その他費用	2	0.016	(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)	(0.009)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(1)	(0.006)	
合計	61	0.569	

(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。

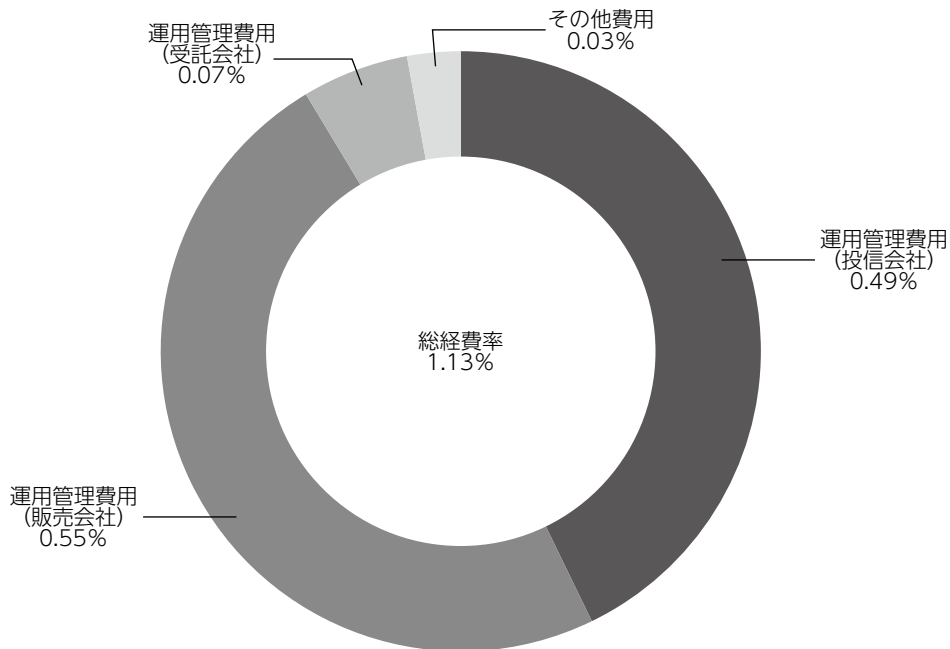
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.13%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11月9日から2022年5月6日まで）

	第 96 期 ~ 第 98 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	-	-	43,754	90,000
インデックス225マザーファンド	-	-	4,146	10,000
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	-	-	59,645	110,000

■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 96 期 ~ 第 98 期
	インデックス225マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	35,585,139千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	124,144,655千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.28

(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11月9日から2022年5月6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 96 期 ~ 第 98 期
売買委託手数料総額 (A)	135千円
うち利害関係人への支払額 (B)	5千円
(B) / (A)	4.1%

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

【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。

【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 96 期 ~ 第 98 期			第 96 期 ~ 第 98 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 先 物 取 引	百万円 47,380	百万円 47,380	% 100.0	百万円 47,178	百万円 47,178	% 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 96 期 ~ 第 98 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 3	百万円 2	百万円 25

(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 96 期 ~ 第 98 期	
	買 付 額	
株 式	百万円 3	

【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 32 作 成 期 末		第 33 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	1,215,237		1,171,483	2,420,870
インデックス 2 2 5 マザーファンド	283,618		279,471	619,392
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	342,287		282,642	514,239

■投資信託財産の構成

2022年5月6日現在

項 目	第 33 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	2,420,870	66.9
インデックス 2 2 5 マザーファンド	619,392	17.1
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	514,239	14.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	65,636	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	3,620,139	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年5月6日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは178,882,093千円、98.8%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは73,095,755千円、85.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年5月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.52円、1カナダ・ドル=101.73円、1オーストラリア・ドル=93.01円、1香港・ドル=16.63円、1シンガポール・ドル=94.27円、1ニューージーランド・ドル=83.99円、1イギリス・ポンド=161.51円、1イスラエル・シケル=38.201円、1デンマーク・クローネ=18.50円、1ノルウェー・クローネ=13.79円、1スウェーデン・クローナ=13.13円、1メキシコ・ペソ=6.456円、100韓国・ウォン=10.27円、1オフショア・人民元=19.51円、1マレーシア・リンギット=29.904円、1ポーランド・ズロチ=29.33円、1ユーロ=137.65円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年1月6日)、 (2022年3月7日)、 (2022年5月6日)現在

項 目	第 96 期 末	第 97 期 末	第 98 期 末
(A) 資 産	3,772,080,877円	3,536,432,303円	3,620,139,329円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	67,927,319	58,310,964	30,636,920
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,482,061,161	2,368,691,577	2,420,870,258
インデックス225マザーファンド(評価額)	647,563,621	573,503,649	619,392,884
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	574,528,776	535,926,113	514,239,267
未 収 入 金	—	—	35,000,000
(B) 負 債	18,458,878	13,423,005	13,320,159
未 払 収 益 分 配 金	6,874,914	6,844,201	6,706,164
未 払 解 約 金	4,847,345	—	1,010
未 払 信 託 報 酬	6,715,163	6,557,852	6,591,914
そ の 他 未 払 費 用	21,456	20,952	21,071
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	3,753,621,999	3,523,009,298	3,606,819,170
元 本	3,437,457,383	3,422,100,987	3,353,082,134
次 期 繰 越 損 益 金	316,164,616	100,908,311	253,737,036
(D) 受 益 権 総 口 数	3,437,457,383口	3,422,100,987口	3,353,082,134口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,920円	10,295円	10,757円

(注) 第95期末における元本額は3,505,802,612円、当作成期間（第96期～第98期）中における追加設定元本額は6,375,187円、同解約元本額は159,095,665円です。

■損益の状況

〔自 2021年11月9日〕
〔至 2022年 1月6日〕

〔自 2022年1月7日〕
〔至 2022年3月7日〕

〔自 2022年3月8日〕
〔至 2022年5月6日〕

項 目	第 96 期	第 97 期	第 98 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,949円	△1,108円	△887円
受 取 利 息	94	31	8
そ の 他 収 益 金	25	-	-
支 払 利 息	△2,068	△1,139	△895
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△7,469,712	△200,347,071	168,093,690
売 買 益	28,614,231	609,930	171,431,806
売 買 損	△36,083,943	△200,957,001	△3,338,116
(C) 信 託 報 酬 等	△6,736,619	△6,578,804	△6,612,985
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△14,208,280	△206,926,983	161,479,818
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	337,886,190	315,124,615	99,255,477
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△638,380	△445,120	△292,095
(配 当 等 相 当 額)	(17,260,800)	(17,463,482)	(17,287,358)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,899,180)	(△17,908,602)	(△17,579,453)
(G) 合 計(D + E + F)	323,039,530	107,752,512	260,443,200
(H) 収 益 分 配 金	△6,874,914	△6,844,201	△6,706,164
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	316,164,616	100,908,311	253,737,036
追 加 信 託 差 損 益 金	△638,380	△445,120	△292,095
(配 当 等 相 当 額)	(17,261,875)	(17,464,508)	(17,289,563)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,900,255)	(△17,909,628)	(△17,581,658)
分 配 準 備 積 立 金	335,563,248	329,753,332	331,198,694
繰 越 損 益 金	△18,760,252	△228,399,901	△77,169,563

(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 96 期	第 97 期	第 98 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,551,972円	2,812,054円	14,977,219円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	17,261,875	17,464,508	17,289,563
(d) 分 配 準 備 積 立 金	337,886,190	333,785,479	322,927,639
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	359,700,037	354,062,041	355,194,421
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,046.41	1,034.63	1,059.31
(g) 分 配 金	6,874,914	6,844,201	6,706,164
(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 96 期	第 97 期	第 98 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》

■当ファンドが主要投資対象とする「インデックス225 マザーファンド」の約款において主要投資対象を「わが国の株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。また、日経225銘柄への投資に当たっては「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」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、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銘柄以上に同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資」に変更しました。

なお、上記約款変更は東京証券取引所の市場区分の再編と日経平均株価の算出要領の改訂に伴うもので商品としての同一性が失われるものではありません。

(2022年2月9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19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	ポイント	%	%	%	百万円
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

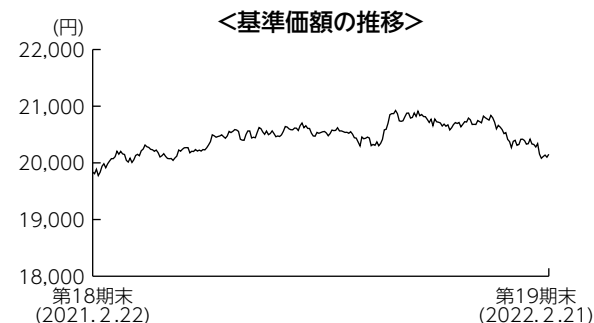
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

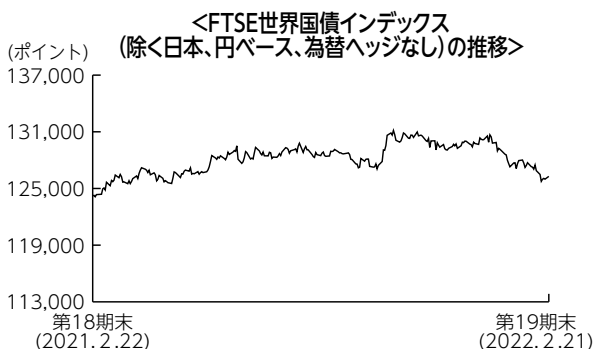


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

F O M C（米連邦公開市場委員会）による2022年複数回の利上げ示唆やインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもF O M Cによる早期テーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）や2022年複数回の利上げとの見方から円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから基準価額は上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化リスクが高くない可能性があるという報告やインフレ懸念、F O M Cの早期利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についてもE C B（欧州中央銀行）がパンデ

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

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

ポートフォリオについて

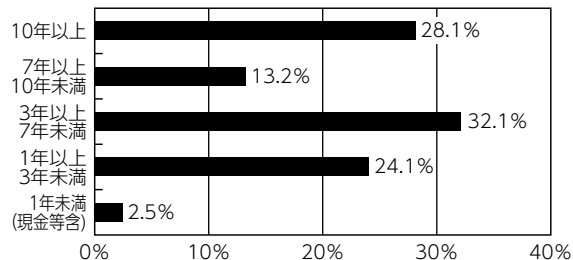
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

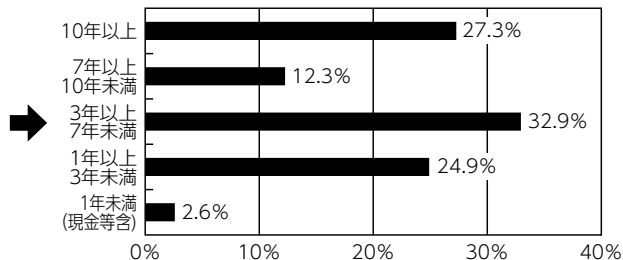
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.013%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(2)	(0.012)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は20,455円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■売買及び取引の状況 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 268,986	千アメリカ・ドル 208,086	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12,930	千カナダ・ドル 11,930	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 9,151	千オーストラリア・ドル 25,829	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,943	千シンガポール・ドル 1,051	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 17,354	千イギリス・ポンド 23,217	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2,356	千イスラエル・シケル 2,830	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 7,060	千デンマーク・クローネ 8,562	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,563	千ノルウェー・クローネ 1,066	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 8,059	千スウェーデン・クローナ 9,098	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 34,009	千メキシコ・ペソ 31,722	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 69,942	千オフショア・人民元 -	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 8,092	千マレーシア・リンギット 3,048	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 6,845	千ポーランド・ズロチ 10,987	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,107	千ユーロ 3,037
		オランダ	国債証券	8,961	7,954
		ベルギー	国債証券	8,673	9,501
		フランス	国債証券	35,154	35,216
		ドイツ	国債証券	29,446	28,519
		スペイン	国債証券	20,859	19,722
		イタリア	国債証券	34,035	34,844
		フィンランド	国債証券	1,917	1,829
	オーストリア	国債証券	5,708	5,408	

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 584,890	千アメリカ・ドル 583,959	千円 67,190,361	% 47.3	% -	% 21.3	% 16.7	% 9.3
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 30,950	千カナダ・ドル 31,321	千円 2,828,620	2.0	-	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 26,270	千オーストラリア・ドル 26,417	千円 2,185,214	1.5	-	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 7,070	千シンガポール・ドル 7,353	千円 629,080	0.4	-	0.3	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 45,350	千イギリス・ポンド 52,558	千円 8,228,549	5.8	-	4.4	0.8	0.6
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,260	千イスラエル・シケル 16,525	千円 593,263	0.4	-	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 29,720	千デンマーク・クローネ 34,886	千円 611,555	0.4	-	0.4	0.1	-
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 26,720	千ノルウェー・クローネ 26,440	千円 339,233	0.2	-	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,060	千スウェーデン・クローナ 31,703	千円 388,054	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 182,626	千メキシコ・ペソ 183,799	千円 1,043,651	0.7	-	0.4	0.2	0.1
中 国	千オフショア・人民元 69,550	千オフショア・人民元 70,200	千円 1,277,451	0.9	-	0.4	0.3	0.2
マレーシア	千マレーシア・リングギット 26,830	千マレーシア・リングギット 27,661	千円 759,920	0.5	-	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 24,380	千ポーランド・ズロチ 23,028	千円 662,640	0.5	-	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	8,040	8,505	1,108,814	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	17,350	19,673	2,564,646	1.8	-	1.2	0.4	0.2
ベルギー	21,000	23,852	3,109,389	2.2	-	1.6	0.4	0.1
フランス	95,460	106,041	13,823,543	9.7	-	6.2	2.6	0.9
ドイツ	69,560	78,033	10,172,441	7.2	-	4.3	1.9	1.0
スペイン	55,960	61,598	8,030,031	5.7	-	3.6	1.5	0.6
イタリア	85,330	92,683	12,082,236	8.5	-	5.0	2.4	1.0
フィンランド	6,020	6,268	817,158	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストリア	13,495	14,981	1,952,943	1.4	-	0.9	0.3	0.2
合 計	-	-	千円 140,398,802	98.9	-	53.9	30.0	15.0

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	額	期		末		
										評			額	償
										外	貨			
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.5 03/31/23		国	債	証	券	1.5000	2,000			2,007		231,000	2023/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25		国	債	証	券	2.6250	2,150			2,209		254,220	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26		国	債	証	券	2.2500	2,260			2,297		264,403	2026/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/23		国	債	証	券	2.5000	3,020			3,065		352,693	2023/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27		国	債	証	券	0.6250	1,800			1,694		195,021	2027/03/31	
US T N/B 0.25 03/15/24		国	債	証	券	0.2500	4,810			4,686		539,213	2024/03/15	
US T N/B 0.5 03/31/25		国	債	証	券	0.5000	1,300			1,252		144,149	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28		国	債	証	券	1.2500	2,910			2,801		322,294	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26		国	債	証	券	0.7500	2,570			2,461		283,275	2026/03/31	
US T N/B 0.5 03/15/23		国	債	証	券	0.5000	2,000			1,986		228,603	2023/03/15	
US T N/B 1.625 04/30/23		国	債	証	券	1.6250	3,000			3,014		346,892	2023/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26		国	債	証	券	2.3750	1,760			1,798		206,967	2026/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/23		国	債	証	券	2.7500	2,490			2,534		291,636	2023/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24		国	債	証	券	2.2500	3,300			3,350		385,452	2024/04/30	
US T N/B 0.25 04/15/23		国	債	証	券	0.2500	2,000			1,978		227,648	2023/04/15	
US T N/B 1.25 04/30/28		国	債	証	券	1.2500	3,170			3,049		350,891	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/15/24		国	債	証	券	0.3750	5,000			4,880		561,546	2024/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27		国	債	証	券	0.5000	2,000			1,868		215,027	2027/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26		国	債	証	券	0.7500	3,000			2,871		330,348	2026/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25		国	債	証	券	0.3750	2,000			1,916		220,510	2025/04/30	
US T N/B 6.25 05/15/30		国	債	証	券	6.2500	710			945		108,785	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40		国	債	証	券	4.3750	800			1,058		121,762	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41		国	債	証	券	4.3750	1,040			1,378		158,590	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42		国	債	証	券	3.0000	980			1,087		125,135	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39		国	債	証	券	4.2500	810			1,051		121,019	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43		国	債	証	券	2.8750	1,900			2,061		237,247	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51		国	債	証	券	2.3750	4,300			4,403		506,624	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44		国	債	証	券	3.3750	1,530			1,799		207,027	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45		国	債	証	券	3.0000	500			556		64,083	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47		国	債	証	券	3.0000	1,290			1,455		167,456	2047/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46		国	債	証	券	2.5000	1,810			1,857		213,700	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48		国	債	証	券	3.1250	1,630			1,896		218,229	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40		国	債	証	券	1.1250	2,100			1,727		198,775	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49		国	債	証	券	2.8750	3,090			3,463		398,477	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38		国	債	証	券	4.5000	540			717		82,505	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41		国	債	証	券	2.2500	3,890			3,839		441,813	2041/05/15	
US T N/B 1.75 05/15/23		国	債	証	券	1.7500	2,620			2,636		303,364	2023/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24		国	債	証	券	2.5000	4,240			4,328		497,992	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25		国	債	証	券	2.1250	3,320			3,361		386,804	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28		国	債	証	券	2.8750	4,430			4,683		538,845	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29		国	債	証	券	2.3750	2,810			2,899		333,573	2029/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/27		国	債	証	券	2.3750	4,700			4,824		555,104	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37		国	債	証	券	5.0000	500			692		79,692	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26		国	債	証	券	1.6250	3,090			3,067		352,896	2026/05/15	
US T N/B 1.625 05/31/23		国	債	証	券	1.6250	2,900			2,913		335,277	2023/05/31	
US T N/B 2.0 05/31/24		国	債	証	券	2.0000	4,770			4,816		554,195	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50		国	債	証	券	1.2500	3,780			2,961		340,805	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26		国	債	証	券	2.1250	2,050			2,075		238,821	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31		国	債	証	券	1.6250	6,740			6,567		755,601	2031/05/15	
US T N/B 2.75 05/31/23		国	債	証	券	2.7500	3,270			3,331		383,330	2023/05/31	
US T N/B 2.875 05/31/25		国	債	証	券	2.8750	2,530			2,620		301,472	2025/05/31	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,398	160,926	2027/05/31
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,960	340,582	2023/05/15
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,000	3,844	442,351	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	2,000	1,943	223,611	2024/05/15
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,220	3,807	438,060	2030/05/15
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,000	2,868	330,051	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,257	489,888	2025/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,461	398,325	2023/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	815	93,823	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,450	1,453	167,188	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,851	213,090	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,345	154,794	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,540	1,434	165,079	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,000	2,881	331,507	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,762	317,851	2023/06/15
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,852	328,217	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,666	421,912	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	3,180	365,912	2026/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	1,928	221,936	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,375	273,331	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,704	426,196	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,336	383,859	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,573	181,003	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23	国債証券	0.1250	2,640	2,594	298,501	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,000	2,833	326,019	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,500	3,234	372,176	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	949	109,262	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,200	3,037	349,465	2026/07/31
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,072	123,419	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	871	100,296	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,379	158,727	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	430	458	52,757	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	1,982	228,144	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,056	121,546	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,170	1,420	163,489	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	3,690	3,475	399,893	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	740	809	93,126	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	2,680	2,700	310,769	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,034	234,124	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	1,490	1,479	170,247	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,405	506,928	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	3,993	459,456	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	1,710	1,675	192,809	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,710	3,085	355,027	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,530	2,583	297,208	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,047	350,619	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,730	3,948	454,270	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,694	194,934	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,380	3,316	381,610	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	825	94,960	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,214	254,829	2023/08/31

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

銘	柄	当 期					末
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,242	373,069	2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,827	325,339	2049/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	4,690	4,767	548,526	2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	3,670	3,949	454,385	2028/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,642	649,272	2023/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,140	2,157	248,248	2026/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,335	383,829	2027/11/15	
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,023	232,852	2023/11/30	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,810	2,401	276,361	2040/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	1,770	1,678	193,091	2041/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,794	206,452	2026/11/30	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	1,919	220,879	2029/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	3,520	3,344	384,823	2031/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,000	5,497	632,515	2030/11/15	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,862	214,326	2027/11/30	
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	2,000	1,948	224,196	2026/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	2,000	1,946	223,971	2028/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	1,991	229,167	2024/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,456	282,592	2025/11/30	
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	1,490	1,454	167,340	2024/11/15	
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,124	359,482	2023/12/31	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,361	271,659	2025/12/31	
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,048	350,735	2024/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	1,740	1,735	199,641	2026/12/31	
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,952	224,672	2023/12/15	
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	1,390	1,353	155,753	2026/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,603	184,484	2024/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	1,500	1,447	166,596	2028/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,841	326,950	2025/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	2,430	2,260	260,078	2027/12/31	
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	3,710	3,643	419,185	2024/12/15	
小 計	-	-	584,890	583,959	67,190,361	-	
(カナダ)			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.25 02/01/23	国債証券	0.2500	500	495	44,751	2023/02/01	
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	197	17,807	2024/02/01	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	537	48,581	2024/03/01	
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	460	462	41,759	2023/03/01	
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	692	62,548	2025/03/01	
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,300	1,228	110,932	2026/03/01	
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	400	390	35,242	2027/03/01	
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,461	131,967	2024/04/01	
CANADA 0.25 05/01/23	国債証券	0.2500	1,000	988	89,230	2023/05/01	
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	695	62,790	2026/06/01	
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,271	114,826	2029/06/01	
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	520	715	64,624	2033/06/01	
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	535	48,333	2037/06/01	
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,550	1,583	143,008	2024/06/01	
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	540	695	62,770	2041/06/01	
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,212	109,543	2023/06/01	
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	420	426	38,543	2028/06/01	
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	900	918	82,937	2025/06/01	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	675	60,979	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	630	56,956	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,734	156,601	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	1,970	1,907	172,277	2031/06/01
CANADA 0.25 08/01/23	国債証券	0.2500	700	689	62,232	2023/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	439	39,675	2024/09/01
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	880	888	80,238	2023/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,550	1,488	134,402	2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,070	1,036	93,644	2026/09/01
CANADA 0.5 11/01/23	国債証券	0.5000	620	610	55,141	2023/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	610	759	68,622	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	580	648	58,602	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,430	2,348	212,098	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	710	639	57,733	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	400	36,137	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,500	1,338	120,867	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	600	578	52,208	2031/12/01
小計	—	—	30,950	31,321	2,828,620	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	760	785	64,983	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	190	199	16,492	2025/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,480	1,528	126,464	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,810	1,985	164,228	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	1,120	1,181	97,774	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,000	1,075	88,946	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	880	1,073	88,815	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	879	72,734	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	800	810	67,006	2028/05/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,550	1,587	131,338	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	743	61,485	2041/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	990	900	74,452	2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	672	55,650	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,300	1,221	101,046	2031/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	550	45,578	2035/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	930	736	60,943	2051/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	310	291	24,079	2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,160	1,208	99,940	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,697	140,408	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,260	1,316	108,875	2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	900	855	70,797	2032/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,427	118,110	2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,450	1,370	113,335	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	940	908	75,142	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,560	1,409	116,583	2030/12/21
小計	—	—	26,270	26,417	2,185,214	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	280	284	24,320	2024/02/01
SINGAPORE 1.75 02/01/23	国債証券	1.7500	200	201	17,243	2023/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	730	789	67,560	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	465	39,811	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	440	412	35,308	2050/03/01

銘	柄	当期					末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	418	35,777	2042/04/01		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	380	396	33,923	2028/05/01		
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	350	29,947	2025/06/01		
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	420	428	36,631	2026/06/01		
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	470	500	42,793	2029/07/01		
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	180	185	15,907	2039/07/01		
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	715	61,239	2023/07/01		
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	200	193	16,586	2031/07/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	486	41,584	2036/08/01		
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	572	48,948	2024/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	395	33,869	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	280	316	27,103	2033/09/01		
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	50	47	4,041	2051/10/01		
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	200	192	16,482	2025/11/01		
小計	-	-	7,070	7,353	629,080	-		
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	910	1,198	187,615	2044/01/22		
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,080	1,487	232,834	2045/01/22		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	770	1,369	214,476	2060/01/22		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	510	537	84,226	2049/01/22		
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	760	657	102,874	2046/01/31		
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	390	365	57,179	2039/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,760	275,652	2024/01/31		
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	400	378	59,298	2029/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	500	468	73,305	2028/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,486	232,735	2023/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	800	766	119,924	2026/01/30		
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,310	1,455	227,867	2025/03/07		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	890	1,197	187,505	2036/03/07		
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,470	1,462	229,020	2024/04/22		
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,010	1,283	200,906	2032/06/07		
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	750	735	115,172	2025/06/07		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,030	1,025	160,497	2047/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	390	367	57,480	2051/07/31		
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	870	1,352	211,735	2052/07/22		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,210	1,322	207,050	2057/07/22		
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,365	213,801	2065/07/22		
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,692	264,929	2068/07/22		
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	800	809	126,754	2026/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	700	701	109,749	2027/07/22		
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	960	954	149,441	2023/07/22		
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	450	423	66,261	2033/07/31		
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,600	1,440	225,486	2031/07/31		
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	711	111,373	2035/07/31		
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	720	1,022	160,094	2039/09/07		
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	980	994	155,756	2023/09/07		
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	497	77,913	2024/09/07		
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	810	126,909	2025/09/07		
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	860	1,154	180,758	2034/09/07		
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,140	1,171	183,379	2037/09/07		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	540	564	88,306	2054/10/22		

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

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)			%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	7,980	8,544	104,583	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,150	2,061	25,236	2031/05/12	
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	3,147	38,531	2032/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	4,700	4,821	59,017	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	3,250	3,330	40,769	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,170	3,213	39,335	2029/11/12	
小計	—	—	29,060	31,703	388,054	—	
(メキシコ)			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	22,143	20,617	117,071	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	8,000	7,945	45,118	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	17,831	101,253	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	17,000	16,945	96,218	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	17,883	101,546	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	18,000	18,103	102,793	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	11,643	11,266	63,973	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	12,654	12,543	71,223	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	13,125	13,738	78,010	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,085	6,015	34,156	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	6,000	5,948	33,775	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	19,796	20,900	118,678	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	14,059	79,832	2023/12/07	
小計	—	—	182,626	183,799	1,043,651	—	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	1,100	1,166	21,228	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,000	5,914	107,628	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	17,000	17,130	311,720	2026/08/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	5,000	5,024	91,437	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	4,950	5,121	93,188	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	14,500	14,631	266,248	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国債証券	2.5600	15,000	15,083	274,470	2023/10/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	3,000	3,023	55,026	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,000	3,104	56,500	2027/12/03	
小計	—	—	69,550	70,200	1,277,451	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	817	22,469	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,239	34,042	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,208	88,140	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	1,898	52,164	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,204	33,102	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,400	1,518	41,716	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	917	25,192	2031/04/15	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,015	55,366	2028/06/15	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,016	27,921	2024/06/14	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,505	68,829	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,700	2,849	78,268	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,700	1,666	45,788	2034/07/05	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,700	2,785	76,521	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,153	59,172	2043/09/30	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	500	513	14,096	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	800	819	22,508	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	500	532	14,619	2033/11/07	
小計	—	—	26,830	27,661	759,920	—	

銘	柄	当 期				末	
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807	2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538	2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511	2026/07/25	
POLAND 2.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,343	67,436	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,250	2,097	60,362	2027/07/25	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,740	2,760	79,430	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	194	5,590	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	1,000	967	27,838	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,900	2,362	67,981	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,400	1,190	34,246	2026/10/25	
小 計	-	-	24,380	23,028	662,640	-	
(ユーロ…アイルランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	600	715	93,311	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	270	289	37,710	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	320	344	44,947	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	710	831	108,340	2025/03/13	
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	596	77,813	2023/03/20	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	220	201	26,216	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	420	448	58,429	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	358	46,691	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	729	95,067	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	390	405	52,905	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	520	544	71,027	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	640	666	86,860	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	390	431	56,310	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	350	327	42,749	2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	560	560	73,123	2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	660	616	80,393	2031/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	450	436	56,912	2030/10/18	
小 計	-	-	8,040	8,505	1,108,814	-	
(ユーロ…オランダ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,130	1,820	237,294	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,140	1,731	225,699	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	610	507	66,184	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,107	144,358	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,060	1,590	207,300	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	980	1,197	156,063	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	400	366	47,727	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	630	628	81,879	2040/01/15	
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	1,310	1,321	172,313	2024/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	270	265	34,662	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	920	918	119,747	2027/01/15	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	450	464	60,613	2023/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,130	1,155	150,680	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,130	1,194	155,728	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,280	1,298	169,317	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	980	1,019	132,861	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	1,038	135,341	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	792	103,283	2029/07/15	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	750	732	95,503	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	540	522	68,087	2031/07/15
小 計	—	—	17,350	19,673	2,564,646	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,190	1,579	205,883	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,110	1,726	225,101	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	430	511	66,618	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	730	975	127,215	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	890	1,356	176,852	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	710	757	98,749	2033/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	520	802	104,603	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	670	730	95,183	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	670	742	96,847	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	350	442	57,642	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	420	528	68,887	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	330	239	31,190	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,110	1,156	150,786	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,020	1,089	142,056	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	930	967	126,153	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	830	860	112,180	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	670	692	90,232	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	430	384	50,166	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,050	1,091	142,303	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	590	745	97,225	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	520	597	77,842	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,140	1,175	153,216	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	840	869	113,351	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	440	473	61,703	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	800	774	101,002	2030/06/22
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	670	684	89,179	2024/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	770	724	94,451	2031/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	667	86,984	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	510	504	65,775	2027/10/22
小 計	—	—	21,000	23,852	3,109,389	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	900	905	118,033	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	900	893	116,427	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	2,460	2,459	320,568	2026/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	1,150	1,158	151,067	2024/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,520	2,538	330,929	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	2,970	2,982	388,857	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	2,200	2,214	288,740	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,139	148,583	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,520	2,885	376,190	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,250	3,645	475,175	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,260	2,208	287,887	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	730	1,332	173,752	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,473	452,785	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,550	2,325	303,111	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,600	2,317	302,054	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,690	2,027	264,241	2048/05/25

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

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,950	2,035	265,395	2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,693	220,794	2023/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,200	1,150	149,983	2035/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,350	1,282	167,216	2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	962	125,497	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,100	1,438	187,564	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	940	1,571	204,821	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	890	1,406	183,381	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,588	337,393	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,140	2,048	267,093	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,660	2,590	337,716	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,890	2,844	370,749	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	340	293	38,310	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,820	2,202	287,112	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,470	1,534	200,020	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,000	2,061	268,687	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,691	220,559	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,810	1,840	239,894	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	2,930	3,045	397,055	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,387	180,840	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,610	1,605	209,236	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,720	1,515	197,499	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	700	688	89,817	2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	400	354	46,263	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	1,983	258,522	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	497	64,872	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	450	444	57,879	2031/08/15
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,141	148,776	2024/10/18
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,292	168,527	2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,050	1,056	137,737	2026/10/09
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,400	1,412	184,079	2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	670	677	88,267	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,200	1,202	156,812	2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	500	499	65,155	2028/11/15
小計	-	-	69,560	78,033	10,172,441	-
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,146	279,779	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,239	161,636	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,100	1,516	197,750	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,160	1,224	159,683	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,397	182,120	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	350	340	44,369	2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	1,113	145,100	2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	800	789	102,872	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,519	198,019	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,190	1,293	168,562	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,240	1,300	169,567	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,353	176,490	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,440	1,504	196,136	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,223	159,528	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	610	580	75,615	2032/04/30

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,850	1,793	233,770	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,190	1,087	141,787	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	995	129,797	2023/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	860	860	112,236	2024/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,370	1,703	222,091	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	970	1,494	194,794	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,250	1,907	248,683	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	920	1,238	161,501	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,577	205,608	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,580	206,074	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,220	1,776	231,601	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,383	180,316	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,310	1,367	178,225	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,200	1,268	165,354	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,240	1,249	162,917	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,434	187,009	2023/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	544	70,953	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	130	115	15,067	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,211	157,965	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,655	215,832	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,030	1,326	172,940	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	910	1,514	197,484	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,060	1,310	170,797	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	930	1,112	145,026	2048/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	300	227	29,687	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,170	950	123,969	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,475	192,408	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,500	1,570	204,667	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,460	1,520	198,168	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,180	1,159	151,089	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	1,110	1,198	156,228	2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,100	1,036	135,128	2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,080	1,005	131,124	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,370	1,399	182,486	2030/10/31
小計	-	-	55,960	61,598	8,030,031	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,300	1,291	168,400	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	998	130,164	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	1,783	232,520	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,072	270,150	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,430	1,497	195,200	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,075	140,225	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,400	1,386	180,688	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,120	1,190	155,201	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,227	159,980	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,390	1,512	197,148	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	597	77,858	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	320	272	35,457	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,031	264,838	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,872	244,062	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,320	1,307	170,477	2032/03/01

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	820	929	121,160	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,010	1,168	152,264	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,540	1,774	231,373	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,084	141,403	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	932	121,560	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	900	839	109,392	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	770	715	93,310	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	900	771	100,534	2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,080	1,017	132,594	2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	590	504	65,821	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,110	1,093	142,518	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,000	930	121,342	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,000	994	129,643	2024/04/15
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	990	956	124,655	2026/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	1,470	2,019	263,279	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,480	192,978	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	810	839	109,403	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,340	1,378	179,643	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,100	1,135	148,013	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,504	196,073	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	920	974	127,019	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	240	220	28,724	2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	国債証券	0.6000	500	505	65,929	2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	680	716	93,373	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,239	161,638	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	500	475	61,960	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	900	937	122,157	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,160	281,700	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	1,875	244,464	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,034	265,239	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,040	1,092	142,411	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,330	1,478	192,718	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,610	1,450	189,092	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,170	1,107	144,315	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	1,000	1,006	131,207	2023/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	600	576	75,134	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,041	135,760	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,387	180,919	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,153	150,425	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	2,044	266,502	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,390	1,982	258,409	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	970	968	126,221	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	900	761	99,299	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,140	1,209	157,653	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	400	371	48,394	2052/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,210	1,313	171,238	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	570	731	95,390	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	690	707	92,242	2036/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,430	1,417	184,755	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	991	129,249	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	930	967	126,187	2023/10/01

銘	柄	当				期		末									
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日		
									外	貨						建	金
(ユーロ…イタリア)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
ITALY	BTPS	9.0	11/01/23	国	債	証	券	9.0000	1,190	1,370	178,690			2023/11/01			
ITALY	BTPS	7.25	11/01/26	国	債	証	券	7.2500	350	452	58,980			2026/11/01			
ITALY	BTPS	6.5	11/01/27	国	債	証	券	6.5000	1,790	2,321	302,647			2027/11/01			
ITALY	BTPS	5.25	11/01/29	国	債	証	券	5.2500	2,050	2,626	342,385			2029/11/01			
ITALY	BTPS	1.45	11/15/24	国	債	証	券	1.4500	1,040	1,068	139,252			2024/11/15			
ITALY	BTPS	2.5	11/15/25	国	債	証	券	2.5000	550	586	76,490			2025/11/15			
ITALY	BTPS	2.0	12/01/25	国	債	証	券	2.0000	970	1,017	132,608			2025/12/01			
ITALY	BTPS	1.25	12/01/26	国	債	証	券	1.2500	1,230	1,249	162,836			2026/12/01			
ITALY	BTPS	2.5	12/01/24	国	債	証	券	2.5000	1,170	1,236	161,223			2024/12/01			
ITALY	BTPS	2.8	12/01/28	国	債	証	券	2.8000	1,000	1,096	142,937			2028/12/01			
ITALY	BTPS	0.95	12/01/31	国	債	証	券	0.9500	1,180	1,093	142,509			2031/12/01			
ITALY	BTPS	1.65	12/01/30	国	債	証	券	1.6500	1,480	1,477	192,595			2030/12/01			
小	計	-	-	-	-	-	-	-	85,330	92,683	12,082,236			-			
(ユーロ…フィンランド)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
FINLAND	0.125	04/15/52	国	債	証	券	0.1250	220	177	23,186			2052/04/15				
FINLAND	2.0	04/15/24	国	債	証	券	2.0000	260	273	35,684			2024/04/15				
FINLAND	0.75	04/15/31	国	債	証	券	0.7500	250	256	33,383			2031/04/15				
FINLAND	1.375	04/15/47	国	債	証	券	1.3750	280	318	41,553			2047/04/15				
FINLAND	0.5	04/15/26	国	債	証	券	0.5000	490	500	65,291			2026/04/15				
FINLAND	1.125	04/15/34	国	債	証	券	1.1250	290	306	39,982			2034/04/15				
FINLAND	1.5	04/15/23	国	債	証	券	1.5000	470	481	62,729			2023/04/15				
FINLAND	0.125	04/15/36	国	債	証	券	0.1250	260	238	31,114			2036/04/15				
FINLAND	4.0	07/04/25	国	債	証	券	4.0000	430	491	64,026			2025/07/04				
FINLAND	2.75	07/04/28	国	債	証	券	2.7500	420	488	63,688			2028/07/04				
FINLAND	2.625	07/04/42	国	債	証	券	2.6250	250	339	44,288			2042/07/04				
FINLAND	0.5	09/15/29	国	債	証	券	0.5000	370	374	48,819			2029/09/15				
FINLAND	0.875	09/15/25	国	債	証	券	0.8750	330	341	44,573			2025/09/15				
FINLAND	0.5	09/15/28	国	債	証	券	0.5000	100	101	13,230			2028/09/15				
FINLAND	0.5	09/15/27	国	債	証	券	0.5000	500	510	66,608			2027/09/15				
FINLAND	09/15/23	国	債	証	券	0.0000	280	282	36,810			2023/09/15					
FINLAND	0.25	09/15/40	国	債	証	券	0.2500	230	208	27,147			2040/09/15				
FINLAND	0.125	09/15/31	国	債	証	券	0.1250	240	230	30,093			2031/09/15				
FINLAND	0.0	09/15/30	国	債	証	券	0.0000	170	163	21,288			2030/09/15				
FINLAND	0.0	09/15/24	国	債	証	券	0.0000	180	181	23,654			2024/09/15				
小	計	-	-	-	-	-	-	-	6,020	6,268	817,158			-			
(ユーロ…オーストリア)					%	千	ユー	ロ	千	ユー	ロ	千	円				
AUSTRIA	3.8	01/26/62	国	債	証	券	3.8000	210	398	51,885			2062/01/26				
AUSTRIA	1.5	02/20/47	国	債	証	券	1.5000	430	490	63,891			2047/02/20				
AUSTRIA	0.5	02/20/29	国	債	証	券	0.5000	770	778	101,527			2029/02/20				
AUSTRIA	0.75	02/20/28	国	債	証	券	0.7500	775	799	104,275			2028/02/20				
AUSTRIA	0.0	02/20/31	国	債	証	券	0.0000	530	505	65,876			2031/02/20				
AUSTRIA	0.0	02/20/30	国	債	証	券	0.0000	690	666	86,824			2030/02/20				
AUSTRIA	4.85	03/15/26	国	債	証	券	4.8500	740	890	116,106			2026/03/15				
AUSTRIA	4.15	03/15/37	国	債	証	券	4.1500	890	1,328	173,218			2037/03/15				
AUSTRIA	0.75	03/20/51	国	債	証	券	0.7500	290	274	35,831			2051/03/20				
AUSTRIA	0.7	04/20/71	国	債	証	券	0.7000	250	203	26,524			2071/04/20				
AUSTRIA	0.5	04/20/27	国	債	証	券	0.5000	650	664	86,564			2027/04/20				
AUSTRIA	0.0	04/20/23	国	債	証	券	0.0000	200	201	26,239			2023/04/20				
AUSTRIA	0.0	04/20/25	国	債	証	券	0.0000	70	70	9,164			2025/04/20				
AUSTRIA	2.4	05/23/34	国	債	証	券	2.4000	680	821	107,048			2034/05/23				
AUSTRIA	0.85	06/30/20	国	債	証	券	0.8500	250	183	23,878			2120/06/30				

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

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
	140,398,802		98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,603,315		1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	142,002,117		100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、141,683,656千円、99.8%です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

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

(注1) 期首元本額 69,085,269,493円
 追加設定元本額 27,244,251,872円
 一部解約元本額 25,881,222,855円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M 外国債券パッシブ・ファンド	7,932,936,286円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	10,339,634円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	40,206,625円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	116,655,366円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	57,288,539円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	34,587,798円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,681,845円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	6,482,910円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	328,688,088円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	382,425,252円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	74,160,647円
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)	364,777円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円
D I A M 外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,296,983,167円
One DC 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円
One グローバルバランス	6,106,309円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	711,700,267円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定型	2,226,508,317円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,403,942,419円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	398,546,899円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	832,352,900円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	708,824,350円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,028,565円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	469,729,710円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	33,691,463円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	134,924,668円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	124,156,154円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	214,713,670円
フルーズコントロール	314,234,233円

D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,795,660円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	412,429,256円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	180,716,406円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	87,293,544円
D I A M パッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	515,001円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	358,315円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	100,794,148円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	418,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	546,045円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04 (適格機関投資家限定)	30,957,907円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	461,773,967円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	294,771円
D I A M 海替フルレンジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家限定)	5,739,805,045円
D I A M 外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,636,710,982円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,562,881,929円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,405,812,637円
D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	53,529,486円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	645,235円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	421,372,128円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,634,953円
D I A M 国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	17,641,800円
D I A M 国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	41,091,423円
D I A M 国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,714,858円
D I A M 国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	681,339円
D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,361,009円
D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	48,455,016円
D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,982,846,491円
D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,769,411,536円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	118,777,737円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	155,311,687円
D I A M アクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,842,758,601円
D I A M 世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	419,588,655円
D I A M 世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,247,697円
D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	357,842,695円
D I A M 世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	352,697,590円
D I A M 世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	479,890,739円
D I A M 世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	57,398,790円
期末元本合計	70,448,298,510円

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

インデックス225 マザーファンド

運用報告書

第16期 (決算日 2022年2月21日)

(計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日)

インデックス225 マザーファンドの第16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	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、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銘柄以上に同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行います。
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)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(ベンチマーク)	期騰落率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
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
16期(2022年2月21日)	21,886	△9.3	26,910.87	△10.8	98.3	1.6	127,373

(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）。

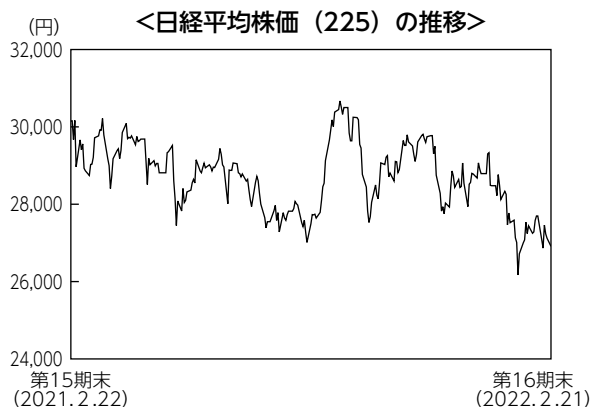
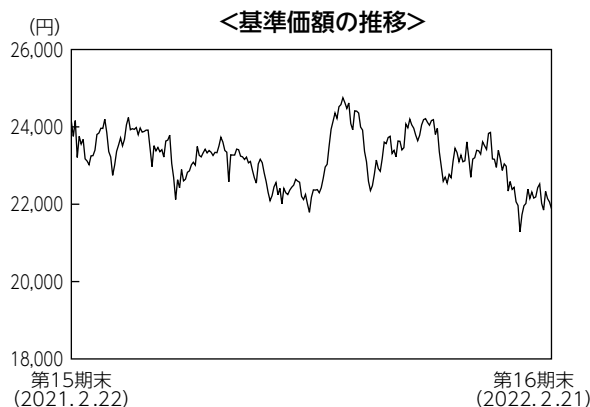
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	円	騰 落 率 %		
(期 首) 2021年 2 月 22 日	24,143	—	30,156.03	—	97.8	2.2
2 月 末	23,209	△3.9	28,966.01	△3.9	97.5	4.5
3 月 末	23,509	△2.6	29,178.80	△3.2	96.6	3.2
4 月 末	23,219	△3.8	28,812.63	△4.5	96.3	3.7
5 月 末	23,264	△3.6	28,860.08	△4.3	97.4	2.6
6 月 末	23,226	△3.8	28,791.53	△4.5	98.2	1.8
7 月 末	22,009	△8.8	27,283.59	△9.5	98.1	2.0
8 月 末	22,670	△6.1	28,089.54	△6.9	98.0	2.4
9 月 末	23,917	△0.9	29,452.66	△2.3	95.9	4.1
10 月 末	23,462	△2.8	28,892.69	△4.2	97.2	2.7
11 月 末	22,595	△6.4	27,821.76	△7.7	97.4	2.5
12 月 末	23,418	△3.0	28,791.71	△4.5	97.4	3.0
2022年 1 月 末	21,959	△9.0	27,001.98	△10.5	97.1	2.9
(期 末) 2022年 2 月 21 日	21,886	△9.3	26,910.87	△10.8	98.3	1.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は21,886円（1万口あたり）となり、前期末比で9.3%下落しました。

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、市況が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2021年8月にかけて、新型コロナウイルスの国内での感染再拡大や米インフレ加速懸念などから、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、期末にかけては、中国不動産大手の信用懸念拡大やオミクロン株の感染急拡大への警戒感などから、下落基調での推移となりました。

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10.8%下落しました。当ファンドはベンチマークを1.5%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 (株 式) (先物・オプション)	1円 (0) (1)	0.004% (0.001) (0.002)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	1	0.004	
期中の平均基準価額は23,188円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年2月23日から2022年2月21日まで)

(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
		27,464.6 (911.2)	121,952,850 (-)	16,595	72,958,579

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
		110,414	110,089	5,755	5,707

(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	194,911,430千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	106,500,228千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.83

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 121,952	百万円 -	% -	百万円 72,958	百万円 4,980	% 6.8
株 式 先 物 取 引	116,121	116,121	100.0	115,844	115,844	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 24	百万円 14	百万円 26

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 9

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,151千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2,666千円
(B)/(A)	64.2%

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	評 価 額
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	104	164	90,200	
マルハニチロ	10.4	16.4	42,295	
鉱業 (0.1%)				
I N P E X	41.6	65.6	73,931	
建設業 (1.7%)				
コムシスホールディングス	104	164	459,200	
大成建設	20.8	32.8	124,804	
大林組	104	164	158,916	
清水建設	104	164	127,920	
長谷工コーポレーション	20.8	32.8	49,593	
鹿島建設	52	82	128,330	
大和ハウス工業	104	164	549,728	
積水ハウス	104	164	389,254	
日揮ホールディングス	104	164	179,252	
食料品 (3.9%)				
日清製粉グループ本社	104	164	271,256	
明治ホールディングス	20.8	32.8	225,336	
日本ハム	52	82	360,800	
サッポロホールディングス	20.8	32.8	78,982	
アサヒグループホールディングス	104	164	838,860	
キリンホールディングス	104	164	329,968	
宝ホールディングス	104	164	192,864	
キッコーマン	104	164	1,474,360	
味の素	104	164	545,136	
ニチレイ	52	82	211,478	
日本たばこ産業	104	164	380,972	
繊維製品 (0.1%)				
東洋紡	10.4	16.4	20,516	
ユニチカ	10.4	16.4	5,067	
帝人	20.8	32.8	46,510	
東レ	104	164	108,240	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	104	164	99,384	
日本製紙	10.4	16.4	18,827	
化学 (7.6%)				
クラレ	104	164	177,776	
旭化成	104	164	178,760	
昭和電工	10.4	16.4	36,719	
住友化学	104	164	90,036	
日産化学	104	164	1,064,360	
東ソー	52	82	150,060	
トクヤマ	20.8	32.8	60,089	
デンカ	20.8	32.8	115,620	
信越化学工業	104	164	2,871,640	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
三井化学	20.8	32.8	97,678	
三菱ケミカルホールディングス	52	82	67,797	
宇部興産	10.4	16.4	35,702	
花王	104	164	873,628	
D I C	10.4	16.4	43,574	
富士フィルムホールディングス	104	164	1,235,084	
資生堂	104	164	1,106,344	
日東電工	104	164	1,354,640	
医薬品 (7.1%)				
協和キリン	104	164	500,200	
武田薬品工業	104	164	573,016	
アステラス製薬	520	820	1,632,210	
大日本住友製薬	104	164	204,508	
塩野義製薬	104	164	1,243,940	
中外製薬	312	492	1,923,228	
エーザイ	104	164	946,772	
第一三共	312	492	1,254,354	
大塚ホールディングス	104	164	660,920	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	41.6	65.6	197,784	
E N E O Sホールディングス	104	164	74,505	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	52	82	144,730	
ブリヂストン	104	164	841,976	
ガラス・土石製品 (1.1%)				
A G C	20.8	32.8	183,680	
日本板硝子	10.4	16.4	8,347	
日本電気硝子	31.2	49.2	138,940	
住友大阪セメント	10.4	16.4	58,138	
太平洋セメント	10.4	16.4	38,064	
東海カーボン	104	164	186,468	
T O T O	52	82	415,740	
日本碍子	104	164	304,548	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	10.4	16.4	34,013	
神戸製鋼所	10.4	16.4	10,069	
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.4	16.4	27,994	
大平洋金属	10.4	16.4	55,022	
非鉄金属 (0.9%)				
日本軽金属ホールディングス	10.4	16.4	29,913	
三井金属鉱業	10.4	16.4	54,530	
東邦亜鉛	10.4	16.4	44,181	
三菱マテリアル	10.4	16.4	34,259	
住友金属鉱山	52	82	445,998	
D O W Aホールディングス	20.8	32.8	160,720	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
古河電気工業	10.4	16.4	39,392
住友電気工業	104	164	259,120
フジクラ	104	164	107,420
金属製品 (0.0%)			
SUMCO	10.4	16.4	32,111
東洋製罐グループホールディングス	104	—	—
機械 (4.8%)			
日本製鋼所	20.8	32.8	120,540
オークマ	20.8	32.8	155,964
アマダ	104	164	170,232
小松製作所	104	164	446,982
住友重機械工業	20.8	32.8	90,101
日立建機	104	164	479,044
クボタ	104	164	337,512
荏原製作所	20.8	32.8	185,320
ダイキン工業	104	164	3,517,800
日本精工	104	164	121,032
NTN	104	164	37,064
ジェイテクト	104	164	168,756
三井E&Sホールディングス	10.4	16.4	5,887
日立造船	20.8	32.8	25,354
三菱重工業	10.4	16.4	54,759
IHI	10.4	16.4	43,919
電気機器 (25.2%)			
日清紡ホールディングス	104	—	—
コニカミノルタ	104	164	82,164
ミネベアミツミ	104	164	412,624
日立製作所	20.8	32.8	197,095
三菱電機	104	164	233,700
富士電機	20.8	32.8	198,768
安川電機	104	164	765,060
オムロン	104	164	1,290,188
ジーエス・ユアサ コーポレーション	20.8	32.8	78,556
日本電気	10.4	16.4	83,968
富士通	10.4	16.4	264,860
沖電気工業	10.4	16.4	14,546
セイコーエプソン	208	328	602,864
パナソニック	104	164	198,276
シャープ	104	164	193,684
ソニーグループ	104	164	1,949,960
TDK	104	492	2,341,920
アルプスアルパイン	104	164	198,276
横河電機	104	164	297,660
アドバンテスト	208	328	3,076,640
キーエンス	—	16.4	861,000
カシオ計算機	104	164	212,544
ファナック	104	164	3,530,100

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京セラ	208	328	2,248,112
太陽誘電	104	164	844,600
村田製作所	—	131.2	1,041,465
SCREENホールディングス	20.8	32.8	379,168
キャノン	156	246	694,458
リコー	104	164	171,872
東京エレクトロン	104	164	9,042,960
輸送用機器 (5.1%)			
デンソー	104	164	1,382,684
川崎重工業	10.4	16.4	34,177
日産自動車	104	164	98,088
いすゞ自動車	52	82	134,316
トヨタ自動車	104	820	1,781,860
日野自動車	104	164	179,580
三菱自動車工業	10.4	16.4	5,330
マツダ	20.8	32.8	30,536
本田技研工業	208	328	1,201,136
スズキ	104	164	797,696
SUBARU	104	164	323,982
ヤマハ発動機	104	164	433,944
精密機器 (3.3%)			
テルモ	416	656	2,385,216
ニコン	104	164	205,000
オリンパス	416	656	1,520,280
シチズン時計	104	164	82,984
その他製品 (2.8%)			
パンダイナムコホールディングス	104	164	1,277,560
凸版印刷	52	82	186,386
大日本印刷	52	82	242,064
ヤマハ	104	164	895,440
任天堂	—	16.4	963,828
電気・ガス業 (0.2%)			
東京電力ホールディングス	10.4	16.4	6,018
中部電力	10.4	16.4	18,630
関西電力	10.4	16.4	19,024
東京瓦斯	20.8	32.8	76,194
大阪瓦斯	20.8	32.8	69,240
陸運業 (1.4%)			
東武鉄道	20.8	32.8	95,874
東急	52	82	129,806
小田急電鉄	52	82	174,414
京王電鉄	20.8	32.8	173,184
京成電鉄	52	82	278,800
東日本旅客鉄道	10.4	16.4	117,637
西日本旅客鉄道	10.4	16.4	83,492
東海旅客鉄道	10.4	16.4	261,252
日本通運	10.4	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマトホールディングス	104	164	358,504
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	16.4	120,212
海運業 (0.4%)			
日本郵船	10.4	16.4	167,116
商船三井	10.4	16.4	150,224
川崎汽船	10.4	16.4	124,968
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	10.4	16.4	42,845
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	52	82	226,648
情報・通信業 (11.2%)			
ネクソン	208	328	822,624
Zホールディングス	41.6	65.6	36,591
トレンドマイクロ	104	164	965,960
スカパーJ S A Tホールディングス	10.4	—	—
日本電信電話	41.6	65.6	218,448
KDD I	624	984	3,732,312
ソフトバンク	104	164	241,408
東宝	10.4	16.4	78,310
エヌ・ティ・ティ・データ	520	820	1,749,060
コナミホールディングス	104	164	1,118,480
ソフトバンクグループ	624	984	5,077,440
卸売業 (2.5%)			
双日	10.4	16.4	32,111
伊藤忠商事	104	164	628,776
丸紅	104	164	202,786
豊田通商	104	164	826,560
三井物産	104	164	504,300
住友商事	104	164	311,436
三菱商事	104	164	666,004
小売業 (10.1%)			
J. フロント リテイリング	52	82	84,460
三越伊勢丹ホールディングス	104	164	158,588
セブン&アイ・ホールディングス	104	164	939,064
高島屋	52	82	95,202
丸井グループ	104	164	376,216
イオン	104	164	428,696
ファーストリテイリング	104	164	10,563,240
銀行業 (0.6%)			
コンコディア・フィナンシャルグループ	104	164	80,360
新生銀行	10.4	16.4	35,456
あおぞら銀行	10.4	16.4	44,427
三菱UFJフィナンシャル・グループ	104	164	121,212
りそなホールディングス	10.4	16.4	8,801
三井住友トラスト・ホールディングス	10.4	16.4	68,191
三井住友フィナンシャルグループ	10.4	16.4	70,142
千葉銀行	104	164	126,936

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ふくおかフィナンシャルグループ	20.8	32.8	78,162
静岡銀行	104	164	147,600
みずほフィナンシャルグループ	10.4	16.4	26,108
証券・商品先物取引業 (0.3%)			
大和証券グループ本社	104	164	113,389
野村ホールディングス	104	164	88,281
松井証券	104	164	133,988
保険業 (0.8%)			
S O M P Oホールディングス	26	32.8	175,119
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	31.2	49.2	195,914
第一生命ホールディングス	10.4	16.4	43,271
東京海上ホールディングス	52	82	576,706
T & Dホールディングス	20.8	32.8	58,088
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	104	164	222,548
日本取引所グループ	104	164	359,570
不動産業 (1.3%)			
東急不動産ホールディングス	104	164	108,896
三井不動産	104	164	425,170
三菱地所	104	164	297,414
東京建物	52	82	148,912
住友不動産	104	164	596,796
サービス業 (5.3%)			
エムスリー	249.6	393.6	1,574,793
ディー・エヌ・エー	31.2	49.2	85,312
電通グループ	104	164	788,020
サイバーエージェント	20.8	131.2	195,619
楽天グループ	104	164	158,424
リクルートホールディングス	312	492	2,284,356
日本郵政	104	164	158,998
セコム	104	164	1,434,016
合 計	株 数	株 数	千円
	18,870.8	30,651.6	125,220,919
	銘柄数 < 比率 >	225銘柄	< 98.3% >

(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		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	日 経 平 均	百万円 2,101		百万円 -

■投資信託財産の構成

2022年2月21日現在

項 目		当 期		末
		評 価 額	比	率
株 式		千円 125,220,919		% 97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		3,727,834		2.9
投 資 信 託 財 産 総 額		128,948,753		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	128,940,598,825円
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,443,662,065
	株 式(評価額)	125,220,919,160
	未 収 配 当 金	190,527,600
	差 入 委 託 証 拠 金	85,490,000
(B) 負	債	1,567,066,626
	未 払 金	1,540,635,626
	未 払 解 約 金	26,431,000
(C) 純	資 産 総 額(A-B)	127,373,532,199
	元 本	58,198,132,946
	次 期 繰 越 損 益 金	69,175,399,253
(D) 受	益 権 総 口 数	58,198,132,946口
	1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	21,886円

(注1) 期首元本額 36,894,690,609円
追加設定元本額 61,292,303,205円
一部解約元本額 39,988,860,868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)	3,413,116,287円
(適格機関投資家私募) インデックス225 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)	2,346,432,822円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII (為替バリアブルヘッジ型) (適格機関投資家限定)	1,411,801,131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)	214,525,360円
たわらノーロード 日経225	191,779,508円
日経225リスクコントロールオープン	26,279,366,204円
DIAMバランス・インカム・オープン (毎月分配型)	325,120,026円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	20,263,421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)	279,471,590円
低リスク・損失抑制型マルチアセット 戦略ファンド (適格機関投資家限定)	223,718,781円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド 2021-09 (適格機関投資家限定)	18,367,932円
DIAM日経225インデックスファンドVA	17,741,840円
国内株式パッシブ・ファンダー日経 225型- (適格機関投資家向け)	965,773,684円
DIAM日経225型パッシブ・ファンド (適格機関投資家向け)	6,987,478,197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)	3,735,266,190円
日米英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)	74,366,527円
日米資産配分戦略ファンド (TIPS活用型) (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家限定)	37,018,645円
MHAM日経225インデックスファンド [適格機関投資家限定]	110,500,828円
MHAM日経225インデックスファンド	8,770,290,966円
[適格機関投資家限定]	
MHAMインデックス225 [適格機関投資家限定]	8,770,290,966円
期末元本合計	2,775,733,007円
	58,198,132,946円

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項	目	当 期
(A) 配	当 等 収 益	1,671,940,281円
	受 取 配 当 金	1,671,028,432
	受 取 利 息	12,095
	そ の 他 収 益 金	1,591,127
	支 払 利 息	△691,373
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△10,863,250,835
	売 買 損 益	8,375,904,155
	売 買 損 益	△19,239,154,990
(C) 先	物 取 引 等 取 引 損 益	△136,931,310
	取 引 損 益	1,217,703,050
	取 引 損 益	△1,354,634,360
(D) 当	期 損 益 金(A+B+C)	△9,328,241,864
(E) 前	期 繰 越 損 益 金	52,181,680,454
(F) 解	約 差 損 益 金	△54,088,001,132
(G) 追	加 信 託 差 損 益 金	80,409,961,795
(H) 合	計(D+E+F+G)	69,175,399,253
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	69,175,399,253

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

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

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

《お知らせ》

- 約款において主要投資対象を「わが国の株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。また、日経225銘柄への投資に当たっては「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」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、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銘柄以上に同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資」に変更しました。
- なお、上記約款変更は東京証券取引所の市場区分の再編と日経平均株価の算出要領の改定に伴うもので商品としての同一性が失われるものではありません。

(2022年2月9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）。

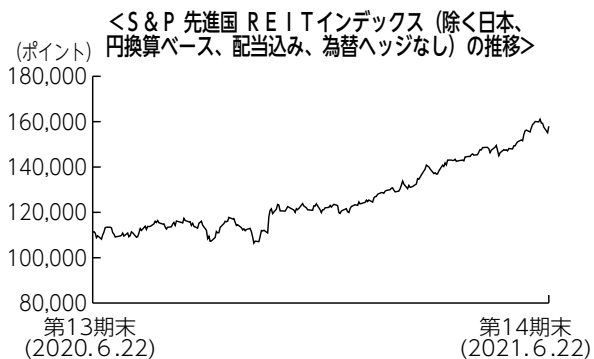
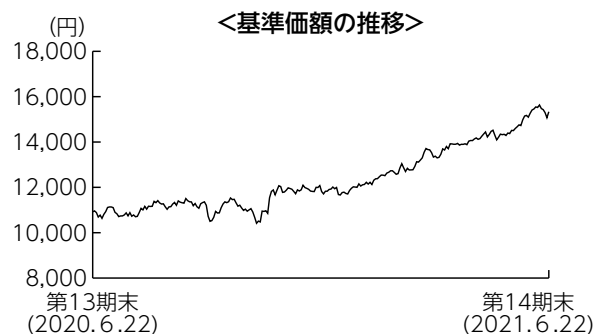
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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 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 INVT	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
MAPLE TREE 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
	(-)	(-)	(-)	(-)
QUE 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	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千円	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	千口	千円	千口	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	千口	千円	千口	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	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
(オーストラリア)	千口	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	□数・金額 銘柄数<比率>	8,802.655 25銘柄<6.6%>	15,356.239 31銘柄<6.9%>	65,264 -	5,413,690 -	- 6.9	
(香港)	千口	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	□数・金額 銘柄数<比率>	2,737.09 6銘柄<1.9%>	4,403.79 6銘柄<1.7%>	92,966 -	1,320,122 -	- 1.7	
(シンガポール)	千口	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	
OUÉ 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	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率
(シンガポール)	千口	千口	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 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)	千口	千口	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 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)	千口	千口	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 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)	千口	千口	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 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	
	売買益	20,186,684,133	
	売買損	△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。