

運用報告書 (全体版)

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

愛称 **三木の矢**

第99期 <決算日 2022年7月6日>
第100期 <決算日 2022年9月6日>
第101期 <決算日 2022年11月7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、「D I A Mパッシブ資産分散ファンド」は、2022年11月7日に第101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 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 投資組 比率	純資産 総額
		(分配落) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %						
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
第34作成期	99期(2022年7月6日)	10,735	20	△0.0	16.1	0.3	65.8	-	13.2	3,557
	100期(2022年9月6日)	10,823	20	1.0	17.0	0.4	67.0	-	13.4	3,541
	101期(2022年11月7日)	10,699	20	△1.0	17.5	0.4	67.6	-	12.5	3,461

(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99期	(期 首) 2022年5月6日	10,757	—	16.8	0.4	66.2	—	14.2
	5 月 末	10,705	△0.5	16.9	0.4	66.6	—	13.8
	6 月 末	10,776	0.2	16.1	0.4	68.3	—	13.6
	(期 末) 2022年7月6日	10,755	△0.0	16.1	0.3	65.8	—	13.2
第100期	(期 首) 2022年7月6日	10,735	—	16.1	0.3	65.8	—	13.2
	7 月 末	10,970	2.2	16.9	0.3	67.2	—	13.8
	8 月 末	10,859	1.2	17.2	0.4	66.4	—	13.4
	(期 末) 2022年9月6日	10,843	1.0	17.0	0.4	67.0	—	13.4
第101期	(期 首) 2022年9月6日	10,823	—	17.0	0.4	67.0	—	13.4
	9 月 末	10,469	△3.3	16.6	0.5	67.8	—	12.4
	10 月 末	10,903	0.7	17.1	0.4	67.6	—	13.3
	(期 末) 2022年11月7日	10,719	△1.0	17.5	0.4	67.6	—	12.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

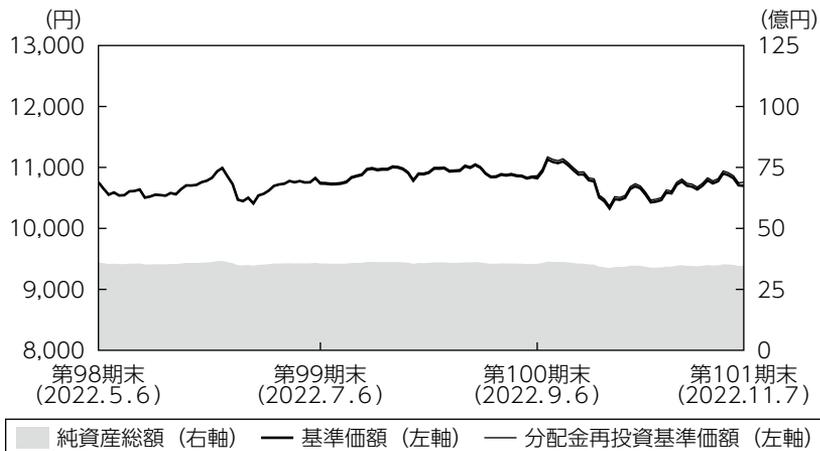
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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99期～第101期の運用経過（2022年5月7日から2022年11月7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す。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、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

高インフレへの懸念や、インフレ抑制を目的とした主要国の金融引き締め加速観測等から主要国の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、また主要国の金利上昇や金融引き締めに対する懸念から外国リート市場が下落したことがマイナスに寄与しました。一方、国内外の金融政策の方向性の違いが意識されたことや内外金利差の拡大等を背景に主要通貨に対して円安が進んだこと、円安等を背景に国内株式市場が上昇したことがプラスに寄与しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.7%
インデックス225 マザーファンド	3.0%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△8.1%

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（債券価格は下落）しました。米国債は、堅調な米雇用統計や、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを積極的に続けるとの見方、米インフレ率の上振れなどを背景に利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の利回りの上昇、E C B（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことなどを受けて利回りは上昇しました。

国内株式市場は、上昇しました。円安ドル高の進行により上昇に転じる場面もありましたが、高インフレを背景とした世界的な金融引き締めの動きが重しとなり、一進一退の展開となりました。作成期末にかけては、F R Bの利上げペースが減速に向かうとの思惑から戻りを試す展開となりました。

外国リート市場は下落しました。米国リート市場は米C P I（消費者物価指数）の伸び加速を受けてF R Bによる利上げへの警戒感が強まり、米長期金利が上昇する中で下落しました。欧州リート市場は英国の経済対策への懸念による金利急騰とそれに伴う世界的なリスク回避の動きを背景に下落しました。オーストラリアリート市場は米C P Iの上振れや英国の減税案を受けた世界的な金利上昇がオーストラリア長期金利にも波及し下落しました。

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や、米国の金利が大きく上昇し内外金利差が拡大したこと等を材料に、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、金融政策の方向性の違いが意識されたことや内外金利差の拡大等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

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

【運用状況】

○各資産のリスク量

※1 リスクウェイトはみずほ第一フィナンシャルテクノロジーが計測。

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

前作成期末

	ファン ド リ ス ク ウ ェ ィ ト	基 本 リ ス ク ウ ェ ィ ト	差
外国債券	32.6%	33.3%	△0.7%
国内株式	34.7%	33.3%	1.4%
外国リート	32.7%	33.3%	△0.6%
合計	100.0%	100.0%	0.0%

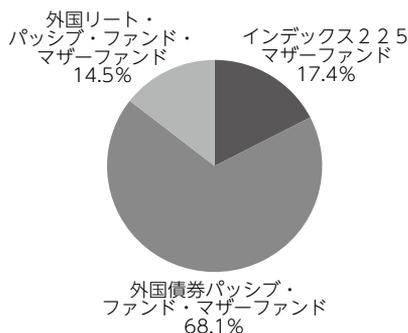
当作成期末

	ファン ド リ ス ク ウ ェ ィ ト	基 本 リ ス ク ウ ェ ィ ト	差
外国債券	35.6%	33.3%	2.2%
国内株式	34.4%	33.3%	1.0%
外国リート	30.0%	33.3%	△3.3%
合計	100.0%	100.0%	0.0%

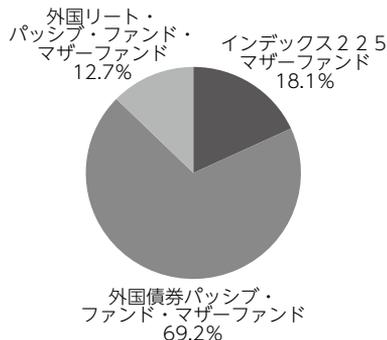
○マザーファンド組入比率

※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。

●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等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 R E I T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99期	第100期	第101期
	2022年5月7日 ～2022年7月6日	2022年7月7日 ～2022年9月6日	2022年9月7日 ～2022年11月7日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.19%	0.18%	0.19%
当期の収益	17円	20円	20円
当期の収益以外	2円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,036円	1,045円	1,056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99期～第101期 (2022年5月7日 ～2022年11月7日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	60円	
(投信会社)	(26)	(0.246)	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)	(30)	(0.279)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(4)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	1	0.006	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.005)	
(d) その他費用	1	0.012	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.010)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	62	0.578	

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

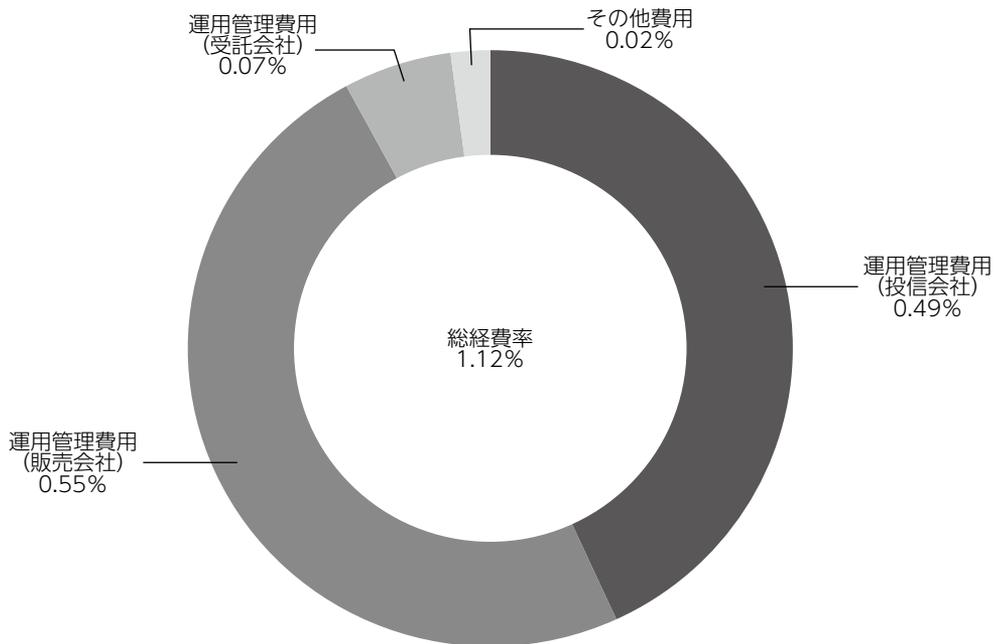
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

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



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年5月7日から2022年11月7日まで）

	第 99 期 ~ 第 101 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	-	-	47,748	100,000
インデックス225マザーファンド	-	-	8,622	20,000
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	-	-	23,237	40,000

■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 99 期 ~ 第 101 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	31,520,485千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	122,440,630千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.25

(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（2022年5月7日から2022年11月7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

決 算 期	第 99 期 ~ 第 101 期						
	区 分	買付額等	うち利害関係人	B/A	売付額等	うち利害関係人	D/C
A		との取引状況B	C		との取引状況D		
		百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託		0.004	0.004	100.0	0.004	0.004	100.0

(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 99 期 ~ 第 101 期
売買委託手数料総額 (A)	74千円
うち利害関係人への支払額 (B)	4千円
(B)/(A)	5.7%

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

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

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 99 期 ~			第 101 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
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

平均保有割合 1.3%

(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。

【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	第 99 期 ~			第 101 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 15,514	百万円 -	% -	百万円 16,005	百万円 36	% 0.2
株 式 先 物 取 引	35,654	35,654	100.0	36,420	36,420	100.0
金 銭 信 託	0.193	0.193	100.0	0.193	0.193	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 99 期 ~ 第 101 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 2	百万円 3	百万円 25

【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状況

決 算 期	第 99 期 ~			第 101 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
金 銭 信 託	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0

平均保有割合 0.7%

(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。

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、みずほ信託銀行、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 33 作 成 期 末		第 34 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	1,171,483		1,123,735	2,362,653
インデックス 2 2 5 マザーファンド	279,471		270,849	618,538
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	282,642		259,405	433,751

■投資信託財産の構成

2022年11月7日現在

項 目	第 34 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	2,362,653	68.0
インデックス 2 2 5 マザーファンド	618,538	17.8
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	433,751	12.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	59,924	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	3,474,867	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11月7日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは179,688,226千円、99.2%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは66,705,147千円、99.6%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11月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.04円、1カナダ・ドル=108.73円、1オーストラリア・ドル=94.61円、1香港・ドル=18.73円、1シンガポール・ドル=104.46円、1ニュージーランド・ドル=86.59円、1イギリス・ポンド=166.58円、1イスラエル・シケル=41.491円、1デンマーク・クローネ=19.63円、1ノルウェー・クローネ=14.29円、1スウェーデン・クローナ=13.45円、1メキシコ・ペソ=7.518円、100韓国・ウォン=10.44円、1オフショア・人民元=20.321円、1マレーシア・リンギット=30.987円、1ポーランド・ズロチ=31.128円、1ユーロ=146.05円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年7月6日)、 (2022年9月6日)、 (2022年11月7日)現在

項 目	第 99 期 末	第 100 期 末	第 101 期 末
(A) 資 産	3,570,769,017円	3,554,717,140円	3,474,867,754円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	80,781,585	62,176,778	39,924,404
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,437,917,995	2,401,415,695	2,362,653,331
インデックス225マザーファンド(評価額)	581,378,265	615,613,630	618,538,804
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	470,691,172	475,511,037	433,751,215
未 収 入 金	—	—	20,000,000
(B) 負 債	13,187,685	13,272,652	13,011,576
未 払 収 益 分 配 金	6,628,180	6,544,363	6,471,289
未 払 解 約 金	—	13,009	296
未 払 信 託 報 酬	6,538,614	6,693,895	6,519,159
そ の 他 未 払 費 用	20,891	21,385	20,832
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	3,557,581,332	3,541,444,488	3,461,856,178
元 本	3,314,090,372	3,272,181,853	3,235,644,830
次 期 繰 越 損 益 金	243,490,960	269,262,635	226,211,348
(D) 受 益 権 総 口 数	3,314,090,372口	3,272,181,853口	3,235,644,830口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	10,735円	10,823円	10,699円

(注) 第98期末における元本額は3,353,082,134円、当作成期間(第99期～第101期)中における追加設定元本額は6,582,302円、同解約元本額は124,019,606円です。

■損益の状況

〔自 2022年5月7日〕
〔至 2022年7月6日〕

〔自 2022年7月7日〕
〔至 2022年9月6日〕

〔自 2022年9月7日〕
〔至 2022年11月7日〕

項 目	第 99 期	第 100 期	第 101 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,983円	△2,044円	△4,780円
受 取 利 息	157	26	98
支 払 利 息	△3,140	△2,070	△4,878
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,912,998	42,065,021	△27,010,334
売 買 益	58,335,074	49,059,761	3,500,533
売 買 損	△52,422,076	△6,994,740	△30,510,867
(C) 信 託 報 酬 等	△6,559,505	△6,715,280	△6,539,991
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△649,490	35,347,697	△33,555,105
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	250,895,844	240,326,455	266,016,926
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△127,214	132,846	220,816
(配 当 等 相 当 額)	(17,322,232)	(17,387,225)	(17,324,346)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,449,446)	(△17,254,379)	(△17,103,530)
(G) 合 計(D + E + F)	250,119,140	275,806,998	232,682,637
(H) 収 益 分 配 金	△6,628,180	△6,544,363	△6,471,289
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	243,490,960	269,262,635	226,211,348
追 加 信 託 差 損 益 金	△127,214	132,846	220,816
(配 当 等 相 当 額)	(17,323,589)	(17,388,468)	(17,325,465)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,450,803)	(△17,255,622)	(△17,104,649)
分 配 準 備 積 立 金	326,320,760	324,710,592	324,487,319
繰 越 損 益 金	△82,702,586	△55,580,803	△98,496,787

(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 99 期	第 100 期	第 101 期
(a) 経費控除後の配当等収益	5,835,370円	9,343,374円	10,003,753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	17,323,589	17,388,468	17,325,465
(d) 分 配 準 備 積 立 金	327,113,570	321,911,581	320,954,855
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	350,272,529	348,643,423	348,284,073
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,056.92	1,065.48	1,076.40
(g) 分 配 金	6,628,180	6,544,363	6,471,289
(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 99 期	第 100 期	第 101 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。

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）。

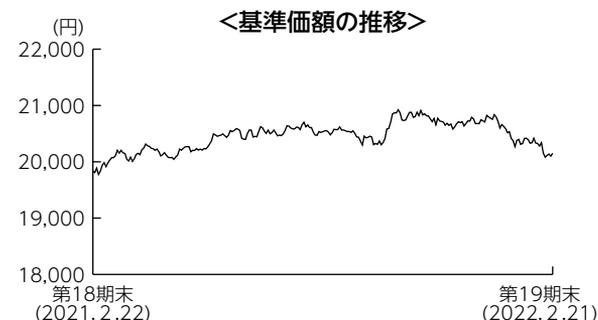
■当期中の基準価額と市況の推移

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）

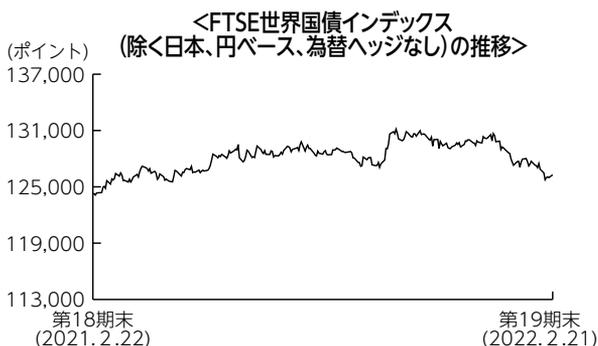


基準価額の推移

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

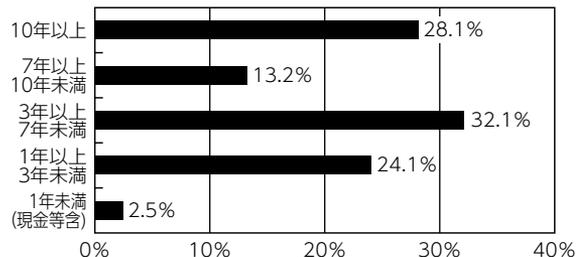
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

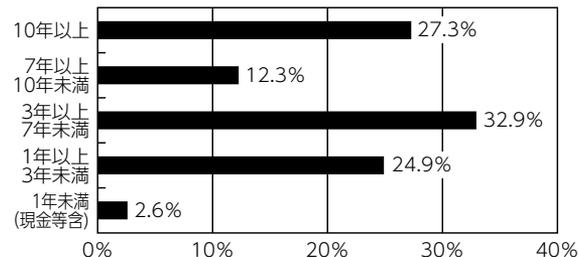
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○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	ユーロ圏	アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,107	千ユーロ 3,037
		オランダ	国債証券	8,961	7,954
		ベルギー	国債証券	8,673	9,501
		フランス	国債証券	35,154	35,216
		ドイツ	国債証券	29,446	28,519
		スペイン	国債証券	20,859	19,722
		イタリア	国債証券	34,035	34,844
		フィンランド	国債証券	1,917	1,829
オーストリア	国債証券	5,708	5,408		

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期						償還年月日	
	種類	利率	額面金額	評価額		外貨建金額		邦貨換算金額
				千ユーロ	千円			
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円			
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426		2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807		2028/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471		2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538		2025/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511		2026/07/25	
POLAND 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	種	類	利	率	額	面	金	期		末				
									評			額	償		
									外	貨				建	金
(ユーロ…フランス)					%		千	ユー	口	千	ユー	口	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	口	千	ユー	口	千	円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国	債	証	券	6.2500	840			948			123,666			2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国	債	証	券	5.6250	1,160			1,551			202,289			2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国	債	証	券	6.2500	710			1,060			138,228			2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国	債	証	券	5.5000	1,240			1,840			239,989			2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国	債	証	券	4.0000	1,640			2,539			331,104			2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国	債	証	券	0.5000	1,660			1,702			221,937			2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国	債	証	券	0.5000	1,810			1,860			242,473			2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国	債	証	券	0.2500	1,390			1,413			184,200			2029/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国	債	証	券	1.5000	920			939			122,528			2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国	債	証	券	0.5000	1,640			1,691			220,524			2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国	債	証	券	1.7500	1,750			1,830			238,578			2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国	債	証	券	0.2500	1,960			1,994			260,015			2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国	債	証	券	0.0000	1,660			1,640			213,861			2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国	債	証	券	0.0000	1,690			1,680			219,101			2030/02/15
BUNDESUBL 04/14/23	国	債	証	券	0.0000	1,030			1,037			135,296			2023/04/14
BUNDESUBL 04/05/24	国	債	証	券	0.0000	1,540			1,555			202,804			2024/04/05
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国	債	証	券	0.0000	1,250			1,261			164,486			2025/04/11
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国	債	証	券	0.0000	1,430			1,440			187,818			2026/04/10

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

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

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

銘	柄	当				期		末										
		種	類	利	率	額	面	金	額		償	還	年	月	日			
									外	貨						建	金	額
(ユーロ…イタリア)					%	千	ユ	ー	口	千	ユ	ー	口	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	口	千	ユ	ー	口	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	口	千	ユ	ー	口	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	DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
追加設定元本額	27,244,251,872円	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	340,795,660円
一部解約元本額	25,881,222,855円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	412,429,256円
(注2) 期末における元本の内訳		9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	180,716,406円
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,932,936,286円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	87,293,544円
MITOラップ型ファンド(安定型)	10,339,634円	DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770円
MITOラップ型ファンド(中立型)	40,206,625円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	515,001円
MITOラップ型ファンド(積極型)	116,655,366円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	358,315円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	57,288,539円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	100,794,148円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,587,798円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	418,167円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,681,845円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	546,045円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	30,957,907円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06	461,773,967円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	294,771円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円	DIAM海苔フルレンジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,739,805,045円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円	DIAM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,636,710,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,562,881,929円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	6,482,910円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,405,812,637円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	328,688,088円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	53,529,486円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	382,425,252円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	645,235円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	74,160,647円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	421,372,128円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	250,634,953円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	364,777円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	17,641,800円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	41,091,423円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,714,858円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	681,339円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	16,361,009円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,296,983,167円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	48,455,016円
One DC 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,982,846,491円
Oneグローバルバランス	6,106,309円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,578,600,509円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	711,700,267円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,769,411,536円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,226,508,317円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	118,777,737円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,403,942,419円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	155,311,687円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	398,546,899円	DIAMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,842,758,601円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	832,352,900円	DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	419,588,655円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	708,824,350円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,247,697円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	14,028,565円	DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	357,842,695円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	469,729,710円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	352,697,590円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	33,691,463円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	479,890,739円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	134,924,668円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	57,398,790円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	124,156,154円	期末元本合計	70,448,298,510円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円		
フルーズコントロール	314,234,233円		

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

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）。

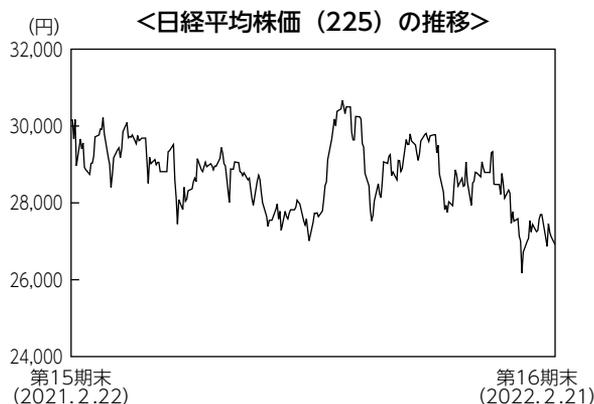
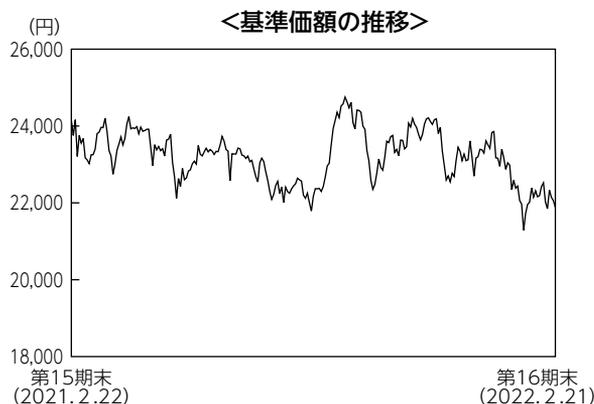
■当期中の基準価額と市況の推移

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
東洋製鋼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	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	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	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
	18,870.8	30,651.6	125,220,919	
	株 数 × 金 額	株 数 × 金 額	株 数 × 金 額	株 数 × 金 額
	225銘柄	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	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	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	
(為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募)	1,411,801,131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)	214,525,360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)	
たわらノーロード 日経225	26,279,366,204円
日経225リスクコントロールオープン	325,120,026円
DIAMバランス・インカム・オープン (毎月分配型)	20,263,421円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	279,471,590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)	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 (適格機関投資家限定)	18,367,932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)	17,741,840円
DIAM日経225インデックスファンドVA	965,773,684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)	6,987,478,197円
DIAM日経225型パッシブ・ファンド	
(適格機関投資家向け)	3,735,266,190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)	74,366,527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)	37,018,645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)	110,500,828円
MHAM日経225インデックスファンド	
[適格機関投資家限定]	8,770,290,966円
MHAMインデックス225 [適格機関投資家限定]	2,775,733,007円
期末元本合計	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15期（決算日 2022年6月22日）

（対象期間 2021年6月23日～2022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15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	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	期中騰落率 %	ポイント	期中騰落率 %		
11期(2018年6月22日)	11,979	1.8	120,101.82	2.4	99.3	百万円 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
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3	56,003

（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）。

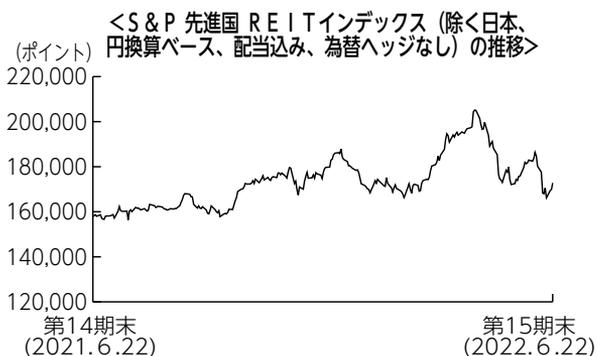
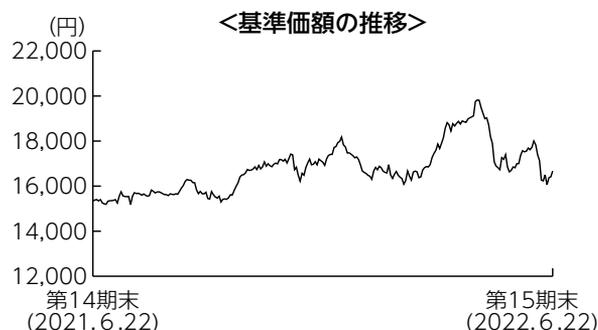
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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) 2021年 6 月 22 日	円 15,336	% -	ポイント 157,949.66	% -	% 99.4
6 月 末	15,211	△0.8	156,754.65	△0.8	99.4
7 月 末	15,595	1.7	160,838.73	1.8	99.7
8 月 末	15,916	3.8	164,194.41	4.0	99.6
9 月 末	15,552	1.4	160,446.64	1.6	90.7
10 月 末	16,916	10.3	174,463.23	10.5	99.8
11 月 末	16,840	9.8	173,578.70	9.9	89.5
12 月 末	17,934	16.9	185,199.89	17.3	100.1
2022年 1 月 末	16,668	8.7	172,188.18	9.0	99.6
2 月 末	16,669	8.7	172,409.41	9.2	99.2
3 月 末	18,724	22.1	193,705.17	22.6	98.9
4 月 末	19,029	24.1	196,763.47	24.6	85.6
5 月 末	17,570	14.6	181,951.19	15.2	99.6
(期 末) 2022年 6 月 22 日	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2021年6月23日から2022年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は16,673円となり、前期末比で8.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は利上げへの警戒感や長期金利の上昇を受けて米国やオーストラリア、欧州主要リート市場が下落し、マイナスの寄与となったものの、為替市場では日銀が緩和姿勢を継続したことを背景に多くの通貨に対して円安となったことがプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国リート市場は下落しました。米国リート市場では新型コロナウイルスに対する警戒感の後退などから期前半は堅調な値動きとなりましたが、利上げ見通しが強まる中で米長期金利が上昇したことに加え、ウクライナ紛争の長期化によるインフレ高止まりが懸念され下落しました。欧州リート市場ではウクライナ紛争を巡る不透明感や、インフレの高進、金利の引き上げなどが意識され下落しました。オーストラリアリート市場では市場予想以上の金利引き上げが嫌気され下落しました。

為替市場では、多くの投資通貨に対し円安となりました。ウクライナ情勢の緊迫化からユーロに対して円高に振れる場面もありましたが、景気回復やインフレの高進から欧米などで政策金利の引き上げによる内外金利差の拡大が見込まれたことが主な要因です。また、エネルギー価格の高騰などから日本の経常収支悪化が意識されたことなども円安要因となりました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で9.4%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%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 (投資信託受益証券) (投資証券)	7円 (1) (6)	0.040% (0.005) (0.034)	(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)	19 (1) (18)	0.114 (0.008) (0.106)	(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 (9) (6)	0.091 (0.054) (0.038)	(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	41	0.246	
期中の平均基準価額は16,756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6月23日から2022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	158.855 (-)	30,863 (-)	177.915 (-)	33,766 (-)
ALEXANDER'S INC.	2.05 (-)	527 (-)	2.378 (-)	596 (-)
BOSTON PROPERTIES INC	156.582 (-)	18,204 (-)	179.035 (-)	20,293 (-)
CEDAR REALTY TRUST INC	13.188 (-)	322 (-)	9.407 (-)	233 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	262.595 (-)	7,890 (-)	300.123 (-)	8,767 (-)
APARTMENT INVNT & MGMT CO-A	154.331 (-)	1,101 (-)	172.485 (-)	1,167 (-)
AGREE REALTY CORP	80.982 (-)	5,528 (-)	87.507 (-)	5,934 (-)
BRT APARTMENTS CORP	10.767 (-)	233 (-)	10.379 (-)	214 (-)
SL GREEN	72.343 (0.084)	5,274 (60)	85.8 (-)	6,083 (-)
EPR PROPERTIES	83.255 (-)	4,147 (-)	95.169 (-)	4,603 (-)
PROLOGIS INC	818.549 (-)	118,157 (-)	937.537 (-)	133,627 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	154.585 (-)	35,866 (-)	177.182 (-)	40,584 (-)
LXP INDUSTRIAL TRUST	313.011 (-)	4,441 (-)	355.629 (-)	4,842 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
CAMDEN PROPERTY TRUST	114.101	18,022	127.237	19,844
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	79.161	1,367	91.716	1,534
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	99.737	75,362	113.69	85,340
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	196.799	8,811	225.376	9,945
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	2.639	166	3.746	219
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	162.511	6,215	187.519	7,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	28.301	540	33.029	616
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	201.279	3,153	227.446	3,482
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	420.457	23,243	477.107	26,084
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	43.138	485	28.031	269
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	72.127	23,422	82.575	26,698
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	379.1	31,969	434.939	36,088
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	77.397	9,357	88.546	10,482
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	146.041	8,455	166.773	9,520
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	594.934	19,848	682.228	22,393
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	131.487	3,499	153.44	4,001
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	161.493	4,832	181.401	5,393
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	116	5,054	132.347	5,650
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	174.023	1,582	194.951	1,725
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	485.024	41,993	541.577	45,826
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	45.566	8,556	51.724	9,673
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	682.246	15,752	773.865	17,641
	(78.06)	(△121)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	116.51	7,920	134.131	8,852
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	37.57	1,341	43.553	1,480
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	200.598	601	232.534	669
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	62.974	1,258	111.145	2,252
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	194.158	2,576	224.432	2,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	321.912	15,741	368.218	17,411
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	253.283	4,034	266.867	4,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	189.867	15,052	216.131	16,956
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	88.709	1,870	104.132	2,130
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	790.713	14,017	901.597	15,719
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	128.065	25,645	146.132	28,775
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	28.468	270	35.964	328
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	50.263	2,891	57.379	3,174
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	14.129	1,378	15.148	1,452
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13.695	431	15.942	487
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	-	-	-
	(△27.137)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	40.703	1,204	44.454	1,277
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	21.502	3,641	24.658	4,208
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	82.25	1,054	94.901	1,193
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	584.127	39,839	653.082	44,164
	(78.539)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	171.045	11,811	198.104	13,458
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	328.034	17,860	375.091	20,166
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	121.783	3,354	139.582	3,723
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	10.583	523	12.187	598
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	362.903	48,983	415.796	55,867
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	91.613	11,861	101.298	12,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	169.181	57,924	193.522	65,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	130.759	24,233	145.676	26,873
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
TANGER FACTORY OUTLET	106.177	1,863	121.975	2,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	47.409	1,092	52.036	1,175
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	28.55	623	34.347	729
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10.073	573	12.287	676
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	439.274	24,263	497.685	26,335
	(5.792)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	173.513	7,268	198.638	8,069
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON REIT	91.284	2,266	106.807	2,616
	(-)	(-)	(-)	(-)
GEO GROUP INC	56.667	435	113.771	836
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEINGARTEN REALTY INVST	2.249	72	2.895	92
	(△55.441)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	155.979	8,545	177.913	9,751
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	203.121	4,330	237.77	4,935
	(61.224)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	148.735	28,506	169.96	32,134
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	84.762	476	98.234	538
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	248.858	2,905	281.805	3,222
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	246.264	12,480	271.595	13,495
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	313.291	46,748	357.633	53,438
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	225.157	2,161	263.596	2,475
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	660.812	13,574	753.532	15,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	196.573	6,295	220.349	6,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	131.563	2,409	152.251	2,715
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	136.96	2,353	156.261	2,657
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	107.883	1,018	124.997	1,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	82.201	5,770	91.032	6,357
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	54.651	1,990	62.171	2,225
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	184.183	2,567	209.54	2,858
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
AMERICOLD REALTY TRUST	297.472	9,005	334.363	10,023
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	25.471	3,900	45.824	7,385
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	76.731	3,719	73.294	3,508
	(△111.404)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	148.192	3,331	169.08	3,739
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	49.842	1,223	55.834	1,335
	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	42.333	843	66.485	1,382
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	41.619	544	46.767	608
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	242.499	3,438	270.593	3,663
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	30.051	340	31.519	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	168.856	4,237	192.685	4,688
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	193.093	7,849	213.439	8,528
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	65.179	847	71.259	900
	(△98.273)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	105.596	8,887	162.579	14,064
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	210.112	16,632	234.439	18,278
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	69.323	1,570	80.565	1,759
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	27.504	826	29.64	894
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	245.899	7,727	278.614	8,619
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	60.92	5,233	69.644	5,879
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	61.2	878	68.946	951
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	140.335	6,460	153.757	6,966
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	240.602	4,332	271.156	4,816
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	174.777	11,927	186.063	12,703
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	320.322	12,673	356.064	13,967
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	192.864	4,636	171.557	4,038
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	28.261	5,885	31.086	6,187
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
JBG SMITH PROPERTIES	125.167	3,561	143.727	3,970
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	123.05	996	136.478	1,087
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL VALUE INC	-	-	8.794	59
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	662.529	26,758	741.06	29,572
	(-)	(-)	(-)	(-)
QTS REALTY TRUST INC	6.185	480	38.531	3,002
	(-)	(-)	(-)	(-)
COREPOINT LODGING INC	17.747	276	36.853	576
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	703	523	829.9	613
	(-)	(△6)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	143.677	1,350	164.141	1,499
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	31.417	816	30.922	824
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	11.544	756	13.211	867
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	136.877	3,623	149.645	3,909
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	64.209	1,437	72.39	1,566
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	41.819	753	97.996	1,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	258.816	12,034	289.654	13,167
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	335.239	8,066	383.42	9,069
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	41.527	231	21.354	121
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	17.653	326
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	518.8	408	570.4	437
	(-)	(△4)	(-)	(-)
POSTAL REALTY TRUST INC	10.309	187	4.889	81
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	7.927	148	5.242	98
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	41.679	1,235	20.925	593
	(-)	(-)	(-)	(-)
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	-	-	8.408	70
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	28.71	624	31.016	653
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	9.908	138	11.177	159
	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	28.766	495	34.307	570
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
ORION OFFICE REIT INC	39.605 (25.252)	640 (-)	48.132 (-)	741 (-)
NETSTREIT CORP	44.288 (-)	998 (-)	40.525 (-)	872 (-)
CARETRUST REIT INC	101.179 (-)	2,066 (-)	118.155 (-)	2,325 (-)
INDUS REALTY TRUST INC	6.505 (-)	459 (-)	4.193 (-)	299 (-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	75.398 (-)	2,506 (-)	40.473 (-)	1,326 (-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	175.962 (-)	8,883 (-)	201.213 (-)	10,018 (-)
BROADSTONE NET LEASE INC	184.386 (-)	4,342 (-)	200.821 (-)	4,641 (-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	17.195 (-)	501 (-)	9.655 (-)	261 (-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	104.2 (-)	92 (-)	- (-)	- (-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	- (△37.108)	- (-)	- (-)	- (-)
STORE CAPITAL CORP	273.837 (-)	8,650 (-)	309.496 (-)	9,663 (-)
PARAMOUNT GROUP INC	170.958 (-)	1,603 (-)	196.416 (-)	1,765 (-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	58.406 (-)	904 (-)	66.316 (-)	1,002 (-)
URBAN EDGE PROPERTIES	119.903 (-)	2,211 (-)	139.674 (-)	2,506 (-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	86.651 (-)	1,831 (-)	95.154 (-)	1,961 (-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	120.487 (-)	2,167 (-)	137.758 (-)	2,426 (-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	21.491 (-)	1,635 (-)	24.993 (-)	1,892 (-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	95.075 (-)	5,565 (-)	102.268 (-)	5,919 (-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	24.167 (-)	1,037 (-)	27.658 (-)	1,164 (-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	228.907 (-)	3,733 (-)	260.4 (-)	4,186 (-)
GLOBAL NET LEASE INC	99.803 (-)	1,541 (-)	109.932 (-)	1,623 (-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,550.6 (-)	1,029 (△4)	1,682.7 (-)	1,105 (-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	262.611 (-)	4,907 (-)	300.433 (-)	5,501 (-)
VICI PROPERTIES INC	825.144 (-)	23,992 (-)	781.141 (-)	22,152 (-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	27.482 (-)	391 (-)	43.132 (-)	502 (-)

	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
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	86.209 (-)	2,367 (-)	99.799 (-)	2,704 (-)
DIGITALBRIDGE GROUP INC	507.857 (-)	3,628 (-)	746.406 (-)	5,083 (-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	82.001 (-)	2,538 (-)	93.831 (-)	2,852 (-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	98.869 (-)	5,540 (-)	112.949 (-)	6,224 (-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	163.1 (-)	2,404 (-)	187.431 (-)	2,674 (-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	120.497 (-)	2,118 (-)	140.726 (-)	2,433 (-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	180.005 (-)	4,146 (-)	206.404 (-)	4,636 (-)
ALLIED PROPERTIES REIT	72.475 (-)	3,100 (-)	82.519 (-)	3,455 (-)
COMINAR REAL ESTATE INV TR	45.618 (-)	491 (-)	89.864 (-)	1,009 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	25.422 (-)	627 (-)	30.075 (-)	720 (-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	21.997 (-)	1,166 (-)	25.326 (-)	1,323 (-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71.575 (-)	871 (-)	85.193 (-)	1,025 (-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	60.208 (-)	1,082 (-)	65.052 (-)	1,137 (-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	73.381 (-)	1,176 (-)	82.337 (-)	1,290 (-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	114.429 (-)	1,541 (-)	125.376 (-)	1,653 (-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7.605 (-)	140 (-)	9.73 (-)	172 (-)
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9.894 (-)	95 (-)	5.251 (-)	48 (-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	123.339 (-)	1,975 (-)	129.832 (-)	2,030 (-)
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	55.971 (-)	230 (-)	40.548 (-)	161 (-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	99.256 (-)	2,162 (-)	109.602 (-)	2,325 (-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37.522 (-)	3,550 (-)	42.255 (-)	3,931 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	36.59 (-)	263 (-)	41.806 (-)	293 (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	188.86 (-)	2,812 (-)	214.484 (-)	3,137 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20.446 (-)	429 (-)	24.011 (-)	490 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54.846	954	61.879	1,060
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLAZA RETAIL REIT	19.973	97	24.208	111
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31.114	144	20.998	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3.678	101	22.823	602
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE GROCERY REIT	24.906	375	27.594	406
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXUS INDUSTRIAL REIT	25.992	323	18.534	221
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARIS REIT	27.937	409	30.815	432
	(16.822)	(-)	(-)	(-)
SLATE OFFICE REIT	13.763	69	9.662	47
	(-)	(-)	(-)	(-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19.151	257	18.758	251
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56.911	1,224	63.719	1,353
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	487.34	2,006	567.653	2,296
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	4,433.852	11,968	5,063.359	13,566
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,623.195	1,367	2,021.448	1,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	588.821	2,446	667.187	2,724
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	2,122.435	10,629	2,441.97	12,145
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	667.191	1,992	706.835	2,074
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS PROPERTY GROUP	389.68	1,307	459.942	1,545
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	374.896	1,412	431.125	1,596
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	2,676.734	11,481	3,068.152	12,943
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	396.075	2,214	421.207	2,294
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	1,187.661	12,724	1,360.328	14,489
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	1,877.623	42,634	2,143.587	48,201
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	4,277.345	7,548	4,910.399	8,384
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	516.531	8,756	591.78	9,827
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	316.124 (-)	1,315 (-)	355.879 (-)	1,454 (-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	1,270.733 (-)	3,623 (-)	1,443.294 (-)	4,068 (-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	502.755 (-)	1,892 (-)	553.307 (-)	2,038 (-)
ARENA REIT	331.702 (-)	1,507 (-)	387.191 (-)	1,736 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	685.451 (-)	3,464 (-)	760.017 (-)	3,767 (-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	182.33 (-)	613 (-)	191.542 (-)	615 (-)
NATIONAL STORAGE REIT	1,263.971 (-)	3,102 (-)	1,450.937 (-)	3,490 (-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	157.555 (-)	578 (-)	165.859 (-)	602 (-)
GDI PROPERTY GROUP	528.845 (-)	601 (-)	597.735 (-)	656 (-)
HOME CONSORTIUM LTD	86.906 (-)	617 (-)	101.174 (-)	713 (-)
RURAL FUNDS GROUP	482.295 (-)	1,393 (-)	516.198 (-)	1,466 (-)
IRONGATE GROUP	634.385 (-)	1,088 (-)	709.339 (-)	1,201 (-)
SCENTRE GROUP	5,803.8 (-)	17,298 (-)	6,635.014 (-)	19,248 (-)
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	220.813 (-)	203 (-)	80.47 (-)	73 (-)
HOME CONSORTIUM LTD	116.968 (6.46)	765 (42)	141.533 (-)	877 (-)
HOME CO DAILY NEEDS REIT	759.24 (374.004)	1,082 (530)	906.771 (-)	1,216 (-)
HEALTHCO REIT	159.265 (-)	293 (-)	87.778 (-)	138 (-)
CENTURIA OFFICE REIT	437.602 (-)	1,003 (-)	488.986 (-)	1,095 (-)
AVENTUS GROUP	226.775 (△170.002)	774 (△572)	233.236 (-)	774 (-)
WAYPOINT REIT LTD	806.09 (△21.228)	2,178 (△58)	954.977 (-)	2,531 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	2,297.2 (-)	157,065 (-)	2,626.3 (-)	177,032 (-)
PROSPERITY REIT	982 (-)	2,883 (-)	1,226 (-)	3,547 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,369 (-)	8,026 (0.21457)	2,448 (-)	8,162 (-)
CHAMPION REIT	1,925 (-)	7,538 (-)	2,230 (-)	8,597 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,122 (-)	4,751 (-)	1,231 (-)	5,219 (-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,628 (-)	12,412 (-)	1,872 (-)	14,300 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	- (305.25)	- (△0.21457)	305.25 (-)	3 (-)
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	5,835.4 (-)	12,379 (-)	6,430.8 (-)	13,626 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	3,817.6 (-)	11,202 (△31)	4,324.4 (-)	12,585 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	2,479.8 (-)	3,906 (△1)	2,818.3 (-)	4,420 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	3,586 (-)	6,671 (△26)	3,970.8 (-)	7,346 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	1,526.6 (-)	939 (-)	1,771 (-)	1,081 (-)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	2,078.5 (-)	2,174 (△4)	2,382 (-)	2,473 (-)
KEPPEL REIT	2,247.6 (-)	2,576 (-)	2,600.2 (-)	2,947 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	1,279 (-)	2,967 (-)	1,575.3 (-)	3,629 (-)
ESR LOGOS REIT	3,408.8 (1,069.91)	1,506 (458)	4,069.2 (-)	1,766 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	849.4 (-)	1,023 (△3)	937.5 (-)	1,103 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	1,144.8 (-)	1,373 (-)	1,256.8 (-)	1,488 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	715.6 (-)	216 (△9)	996.7 (-)	293 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	451.7 (-)	647 (△3)	504.8 (-)	715 (-)
PARKWAY LIFE REIT	387.3 (-)	1,859 (△2)	448.9 (-)	2,164 (-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	- (-)	- (△2)	2,759.1 (-)	130 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	2,173.1 (-)	5,826 (△0.68061)	2,488.6 (-)	6,606 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,461.2 (-)	4,840 (△5)	2,816.3 (-)	5,479 (-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	1,195 (△603.48)	1,047 (△517)	1,179.4 (-)	1,040 (-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	- (-)	- (-)	313.2 (-)	131 (-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	2,360.4 (-)	2,600 (△33)	3,255 (-)	3,558 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	1,074.8 (-)	665 (-)	1,262.5 (-)	767 (-)

	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
SPH REIT	968.7	937	1,127.6	1,080
	(-)	(-)	(-)	(-)
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	209.3	147	224.3	157
	(-)	(△0.00001)	(-)	(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	510	439	523.6	449
	(-)	(-)	(-)	(-)
OUÉ COMMERCIAL REIT	2,366.1	996	2,698.5	1,135
	(-)	(△2)	(-)	(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	1,194.9	978	1,044.1	852
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST	-	-	377.1	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	103.9	74	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
IREIT GLOBAL	369.8	235	415.7	261
	(-)	(△2)	(-)	(-)
KEPPEL DC REIT	1,490.3	3,454	1,678.3	3,828
	(-)	(△7)	(-)	(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	3,272.5	4,773	3,692.7	5,352
	(-)	(△15)	(-)	(-)
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	1,380.504	2,161	1,498.848	2,319
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	407.484	1,269	445.327	1,348
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	1,177.028	2,864	1,379.893	3,328
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,667.156	1,864	1,942.429	2,154
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	975.321	1,430	1,073.46	1,561
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	1,072.95	5,611	1,222.357	6,288
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	125.389	4,157	143.656	4,719
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	192.7	2,890	217.342	3,169
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	4,584.197	1,514	5,513.049	1,763
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	862.339	6,480	987.714	7,287
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	138.79	1,096	160.203	1,247
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	444.964	4,967	507.935	5,528
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	1,505.98	2,276	1,715.62	2,532
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	321.302	1,959	377.658	2,287
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
SEGRO PLC	1,340.273	17,188	1,534.87	19,450
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	287.251	2,072	328.823	2,355
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	3,335.879	2,348	3,675.459	2,521
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	257.64	212	321.322	256
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	421.073	227	515.379	276
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	617.37	608	695.399	685
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	877.238	709	969.076	786
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	233.808	2,887	266.972	3,216
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,067.091	2,817	1,190.237	3,070
	(-)	(-)	(-)	(-)
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	785.572	845	916.961	978
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	959.617	1,598	1,098.079	1,806
	(-)	(-)	(-)	(-)
GCP STUDENT LIVING PLC	204.051	435	414.247	877
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	121.045	109	147.303	129
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	564.808	522	675.904	619
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRS REIT PLC/THE	723.891	778	542.722	569
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	384.572	372	456.276	429
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	996.24	1,244	986.42	1,207
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,062.787	4,738	2,297.396	5,221
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUSTODIAN REIT PLC	394.227	406	468.275	478
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME REIT PLC	468.725	566	383.46	457
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	682.508	613	766.56	673
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK REIT PLC	80.881	95	106.184	118
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	820.716	1,204	835.877	1,208
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	414.619	370	470.723	416
	(-)	(-)	(-)	(-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	313.459	370	330.806	388
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イスラエル	千□	千イスラエル・シケル	千□	千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	157.562	3,177	181.198	3,740
	(-)	(-)	(-)	(-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	87.076	876	23.453	219
	(-)	(-)	(-)	(-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	43.051	283,114	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	90.636	429,991	101.644	481,155
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	49.557	393,982	49.672	389,405
	(-)	(3)	(-)	(-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18.615	109,358	17.541	101,772
	(-)	(-)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD	141.664	805,920	156.57	877,855
	(-)	(-)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17.79	115,758	24.498	153,062
	(-)	(△8)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD-RTS	-	-	23.41	-
	(23.41)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	4.123	21,978	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
JR REIT XXVII	143.27	781,151	154.298	831,650
	(-)	(-)	(-)	(-)
SK REITS CO LTD	32.243	213,040	14.552	98,881
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	-	-	7.141	-
	(7.141)	(△3)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	143.555	943,970	189.413	1,225,635
	(-)	(-)	(-)	(-)
D&D PLATFORM REIT CO LTD	38.018	204,291	23.689	126,041
	(-)	(-)	(-)	(-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	11.162	59,530	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT-RTS	-	-	3.188	-
	(3.188)	(8)	(-)	(-)
ユーロ (シンガポール)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	313.4	747	343.8	820
	(-)	(△3)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HIBERNIA REIT PLC	670.655	908	977.503	1,366
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	425.258	652	513.785	772
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4.781	105	4.387	96
	(△18.604)	(-)	(-)	(-)
VASTNED RETAIL	19.064	466	22.698	543
	(-)	(-)	(-)	(-)
WERELDHAVE NV	40.773	586	46.515	641
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
NSI NV	19.909	706	22.325	781
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	33.552	707	40.321	820
	(18.761)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	25.803	1,020	30.753	1,198
	(-)	(-)	(-)	(-)
COFINIMMO SA	32.746	4,266	37.41	4,889
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	9.371	662	11.04	768
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	24.855	649	28.305	741
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	160.242	5,965	180.812	6,657
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	9.915	1,166	11.58	1,340
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	41.877	4,645	46.408	5,123
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	30.116	760	33.301	842
	(-)	(-)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	20.671	1,030	21.96	1,075
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	60.455	7,020	69.268	7,984
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	33.864	2,105	38.571	2,397
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALTAREA	3.947	632	4.342	671
	(-)	(△18)	(-)	(-)
KLEPIERRE	216.142	4,605	249.876	5,274
	(-)	(△70)	(-)	(-)
COVIVIO	52.496	3,782	60.831	4,338
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	40.088	352	41.163	360
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	39.205	546	47.86	660
	(-)	(△9)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	134.349	8,772	163.439	10,582
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALTAREA SCA-RTS	-	-	1.672	4
	(1.672)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	61.156	580	69.728	653
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	108.844	1,916	189.799	3,435
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	293.908	2,399	330.438	2,652
	(-)	(△25)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	36.39 (-)	182 (△4)	45.091 (-)	223 (-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	368.517 (-)	3,654 (△16)	424.548 (-)	4,130 (-)
ユーロ (イタリア)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	44.176 (-)	178 (-)	55.103 (-)	218 (-)
COIMA RES SPA	18.292 (-)	139 (-)	10.696 (-)	84 (-)

(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 (2021年6月23日から2022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	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	227.5	154	21,115		0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0		0.0
PRIME US REIT		211.4	159.8	107	14,613		0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		-	104.2	93	12,728		0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		658.4	526.3	302	41,304		0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		64.515	45.455	5,982	816,590		1.5
ALEXANDER'S INC.		0.989	0.661	143	19,630		0.0
BOSTON PROPERTIES INC		66.493	44.04	3,963	540,991		1.0
CEDAR REALTY TRUST INC		-	3.781	101	13,830		0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		109.6	72.072	1,982	270,618		0.5
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		68.881	50.727	297	40,642		0.1
AGREE REALTY CORP		29.676	23.151	1,606	219,295		0.4
BRT APARTMENTS CORP		3.832	4.22	93	12,746		0.0
SL GREEN		33.08	19.707	951	129,837		0.2
EPR PROPERTIES		34.918	23.004	1,042	142,327		0.3
PROLOGIS INC		346.969	227.981	25,615	3,496,320		6.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		65.657	43.06	8,241	1,124,907		2.0
LXP INDUSTRIAL TRUST		129.482	86.864	904	123,421		0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		45.941	32.805	4,276	583,738		1.0
VERIS RESIDENTIAL INC		39.452	26.897	371	50,698		0.1
EQUINIX INC		42.011	28.058	17,962	2,451,656		4.4
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		82.875	54.298	2,245	306,450		0.5
CTO REALTY GROUTH INC		2.965	1.858	111	15,155		0.0
COUSINS PROPERTIES INC		70.851	45.843	1,340	182,957		0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		14.44	9.712	155	21,209		0.0
SITE CENTERS CORP		81.132	54.965	711	97,078		0.2
DUKE REALTY TRUST		175.583	118.933	6,254	853,702		1.5
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		-	15.107	86	11,814		0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		30.569	20.121	5,140	701,601		1.3
EQUITY RESIDENTIAL		161.226	105.387	7,509	1,025,023		1.8
FEDERAL REALTY INVS TRUST		33.02	21.871	2,072	282,874		0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		60.986	40.254	1,869	255,153		0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		253.462	166.168	4,134	564,285		1.0
EQUITY COMMONWEALTH		56.714	34.761	964	131,660		0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		65.332	45.424	1,201	163,925		0.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC		48.629	32.282	1,089	148,664		0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST		76.025	55.097	278	38,052		0.1
WELLTOWER INC		196.362	139.809	11,000	1,501,413		2.7
EAST GROUP		18.728	12.57	1,902	259,719		0.5
KIMCO REALTY		204.567	191.008	3,632	495,864		0.9
KILROY REALTY CORP		50.045	32.424	1,659	226,543		0.4
LTC PROPERTIES INC		17.932	11.949	451	61,632		0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		112.836	80.9	152	20,759		0.0
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A		48.171	-	-	-		-
BRANDYWINE REALTY TRUST		83.055	52.781	503	68,654		0.1
IRON MOUNTAIN INC		135.791	89.485	4,222	576,369		1.0
THE MACERICH COMPANY		78.672	65.088	581	79,421		0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		79.741	53.477	3,719	507,723		0.9
ACADIA REALTY TRUST		42.275	26.852	422	57,687		0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC		332.075	221.191	3,643	497,235		0.9
MID AMERICA		53.615	35.548	5,818	794,166		1.4

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	%
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16.618		9.122		85	11,728	0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	21.18		14.064		826	112,872	0.2
CENTERSPACE	6.06		5.041		391	53,495	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7.856		5.609		142	19,414	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29.075		1.938		7	1,031	0.0
GETTY REALTY CORP	16.951		13.2		340	46,537	0.1
PS BUSINESS PARKS	9.349		6.193		1,151	157,222	0.3
RPT REALTY	37.794		25.143		239	32,704	0.1
REALTY INCOME CORP	175.691		185.275		12,129	1,655,617	3.0
REGENCY CENTERS CORP	74.742		47.683		2,783	379,886	0.7
UDR INC	139.707		92.65		4,085	557,679	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	52.297		34.498		914	124,778	0.2
SAUL CENTERS INC	6.198		4.594		199	27,294	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	154.013		101.12		9,767	1,333,122	2.4
LIFE STORAGE INC	35.667		25.982		2,759	376,615	0.7
PUBLIC STORAGE	71.371		47.03		14,207	1,939,153	3.5
SUN COMMUNITIES INC	52.37		37.453		5,792	790,564	1.4
TANGER FACTORY OUTLET	47.408		31.61		444	60,704	0.1
UMH PROPERTIES INC	18.196		13.569		227	31,058	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16.822		11.025		201	27,447	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5.995		3.781		191	26,128	0.0
VENTAS INC	175.714		123.095		5,976	815,700	1.5
VORNADO REALTY TRUST	74.163		49.038		1,386	189,216	0.3
WASHINGTON REIT	41.358		25.835		553	75,566	0.1
GEO GROUP INC	57.104		—		—	—	—
WEINGARTEN REALTY INVST	56.087		—		—	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	65		43.066		2,760	376,843	0.7
KITE REALTY GROUP TRUST	40.874		67.449		1,180	161,106	0.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	62.579		41.354		6,691	913,378	1.6
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46.648		33.176		138	18,927	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100.104		67.157		671	91,662	0.2
CUBESMART	94.451		69.12		2,799	382,084	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	132.013		87.671		11,234	1,533,350	2.7
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	102.73		64.291		538	73,447	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	277.416		184.696		2,707	369,566	0.7
DOUGLAS EMMETT INC	77.84		54.064		1,200	163,818	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	57.754		37.066		577	78,821	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	57.283		37.982		494	67,445	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	48.846		31.732		225	30,837	0.1
TERRENO REALTY CORP	32.097		23.266		1,300	177,546	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	23.736		16.216		473	64,651	0.1
RLJ LODGING TRUST	76.242		50.885		560	76,537	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	119.402		82.511		2,331	318,262	0.6
CORESITE REALTY CORP	20.353		—		—	—	—
VEREIT INC	107.967		—		—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	61.175		40.287		705	96,283	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	22.164		16.172		310	42,424	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES	24.152		—		—	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	22.362		17.214		176	24,106	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	98.359		70.265		971	132,636	0.2
WHITESTONE REIT	17.85		16.382		175	23,992	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	70.573		46.744		739	100,996	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	74.75		54.404		1,662	226,926	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	104.353		—		—	—	—
CYRUSONE INC	56.983		—		—	—	—

銘	柄	期 首(前期末)		当		期		末
		□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
(アメリカ)			千口		千口	千アメリカ・ドル	千円	%
WP CAREY INC			83.879		59.552	4,998	682,285	1.2
ALEXANDER & BALDWIN INC			33.22		21.978	394	53,875	0.1
GLADSTONE LAND CORP			11.352		9.216	211	28,830	0.1
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC			103.264		70.549	1,954	266,729	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES			25.702		16.978	1,293	176,603	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC			27.874		20.128	257	35,192	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC			54.785		41.363	1,544	210,864	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST			98.37		67.816	1,139	155,504	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC			62.108		50.822	2,901	396,015	0.7
AMERICAN HOMES 4 RENT			127.151		91.409	3,038	414,716	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC			46.758		68.065	1,398	190,820	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES			11.187		8.362	907	123,914	0.2
JBG SMITH PROPERTIES			51.608		33.048	795	108,618	0.2
THE NECESSITY RETAIL REIT INC			50.312		36.884	257	35,139	0.1
RETAIL VALUE INC			8.794		—	—	—	—
INVITATION HOMES INC			266.492		187.961	6,396	873,032	1.6
QTS REALTY TRUST INC			32.346		—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC			19.106		—	—	—	—
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC			67.709		47.245	325	44,494	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC			13.046		13.541	242	33,082	0.1
SAFEHOLD INC			6.652		4.985	169	23,174	0.0
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS			53.159		40.391	845	115,386	0.2
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES			29.984		21.803	290	39,668	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC			56.177		—	—	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN			103.548		72.71	3,293	449,466	0.8
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC			140.188		92.007	1,810	247,142	0.4
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC			—		20.173	95	13,023	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC			17.653		—	—	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC			—		5.42	77	10,615	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC			—		2.685	47	6,438	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP			—		20.754	551	75,265	0.1
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST			12.476		4.068	30	4,119	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT			10.643		8.337	216	29,574	0.1
FARMLAND PARTNERS INC			11.176		9.907	144	19,715	0.0
CITY OFFICE REIT INC			20.935		15.394	182	24,856	0.0
ORION OFFICE REIT INC			—		16.725	196	26,822	0.0
NETSTREIT CORP			10.996		14.759	276	37,750	0.1
CARETRUST REIT INC			46.858		29.882	522	71,293	0.1
INDUS REALTY TRUST INC			—		2.312	138	18,886	0.0
PHILLIPS EDISON & CO INC			—		34.925	1,147	156,593	0.3
APARTMENT INCOME REIT CORP			73.756		48.505	1,959	267,466	0.5
BROADSTONE NET LEASE INC			68.576		52.141	1,066	145,608	0.3
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC			—		7.54	195	26,716	0.0
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC			37.108		—	—	—	—
STORE CAPITAL CORP			113.425		77.766	2,005	273,742	0.5
PARAMOUNT GROUP INC			80.717		55.259	406	55,435	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC			25.732		17.822	196	26,806	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES			53.765		33.994	508	69,412	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I			37.693		29.19	540	73,826	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC			52.488		35.217	503	68,784	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC			10.397		6.895	401	54,828	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS			32.425		25.232	1,174	160,314	0.3
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC			10.481		6.99	234	32,056	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC			96.779		65.286	968	132,237	0.2
GLOBAL NET LEASE INC			41.546		31.417	422	57,675	0.1

銘柄	期首(前期末)		当		期		末
	□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(アメリカ)		千口		千口	千アメリカ・ドル	千円	%
CLIPPER REALTY INC		5.086		5.086	38	5,261	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC		110.619		72.797	1,036	141,489	0.3
VICI PROPERTIES INC		252.573		296.576	8,855	1,208,722	2.2
SERITAGE GROWTH PROPERTIES		15.65		—	—	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC		37.21		23.62	609	83,240	0.1
DIGITALBRIDGE GROUP INC		238.549		—	—	—	—
小計	□	11,651.995	□	7,979.351	311,730	42,548,156	—
	銘柄数<比率>	156銘柄<74.6%>		151銘柄<76.0%>	—	—	76.0
(カナダ)		千口		千口	千カナダ・ドル	千円	%
SMARTCENTRES REIT		33.365		21.535	588	62,039	0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT		40.179		26.099	1,153	121,625	0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT		67.209		42.878	533	56,225	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST		52.733		32.504	483	50,982	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		72.829		46.43	947	99,841	0.2
ALLIED PROPERTIES REIT		29.143		19.099	657	69,315	0.1
COMINAR REAL ESTATE INVNT TR		44.246		—	—	—	—
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU		12.866		8.213	161	17,011	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		10.875		7.546	321	33,861	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU		31.111		17.493	213	22,477	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV		21.592		16.748	267	28,158	0.1
INTERWEST REAL ESTATE INVEST		31.544		22.588	275	29,048	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES		43.997		33.05	403	42,572	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT		8.583		6.458	106	11,211	0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT		—		4.643	35	3,700	0.0
DREAM INDUSTRIAL REIT		42.899		36.406	445	46,971	0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		—		15.423	56	5,917	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT		37.879		27.533	459	48,409	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T		14.568		9.835	780	82,304	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT		22.019		16.803	106	11,194	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		74.537		48.913	672	70,893	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE		8.825		5.26	76	8,028	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		24.18		17.147	274	28,919	0.1
PLAZA RETAIL REIT		20.611		16.376	70	7,388	0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE		—		10.116	39	4,126	0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES		19.145		—	—	—	—
SLATE GROCERY REIT		10.657		7.969	112	11,902	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT		—		7.458	76	8,018	0.0
PRIMARIS REIT		—		13.944	176	18,637	0.0
SLATE OFFICE REIT		11.634		15.735	73	7,795	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT		7.088		7.481	97	10,314	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		24.752		17.944	306	32,344	0.1
小計	□	819.066	□	579.627	9,972	1,051,238	—
	銘柄数<比率>	27銘柄<2.0%>		30銘柄<1.9%>	—	—	1.9
(オーストラリア)		千口		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
BWP TRUST		224.791		144.478	562	53,228	0.1
MIRVAC GROUP		1,846.984		1,217.477	2,483	235,226	0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP		865.185		466.932	333	31,619	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		236.221		157.855	612	58,007	0.1
GPT GROUP		911.007		591.472	2,484	235,276	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP		229.128		189.484	365	34,635	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP		196.651		126.389	338	32,080	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU		154.369		98.14	316	30,022	0.1
STOCKLAND		1,128.82		737.402	2,691	254,913	0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP		134.675		109.543	422	40,046	0.1
DEXUS		505.128		332.461	3,042	288,109	0.5

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		
	□数	金額	□数	金額	比率	比率	
(オーストラリア)	千□	千円	千□	千円		%	
GOODMAN GROUP	789.54	523.576	9,178	869,275		1.6	
VICINITY CENTRES	1,826.547	1,193.493	2,243	212,507		0.4	
CHARTER HALL GROUP	220.887	145.638	1,625	153,934		0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	136.67	96.915	332	31,483		0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	513.792	341.231	934	88,551		0.2	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	212.974	162.422	469	44,456		0.1	
ARENA REIT	159.242	103.753	422	39,993		0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	260.875	186.309	806	76,404		0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	73.145	63.933	172	16,348		0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	516.215	329.249	740	70,162		0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73.965	65.661	206	19,589		0.0	
GDI PROPERTY GROUP	247.876	178.986	170	16,104		0.0	
HOME CONSORTIUM LTD	85.98	-	-	-		-	
RURAL FUNDS GROUP	160.193	126.29	334	31,696		0.1	
IRONGATE GROUP	256.148	181.194	341	32,348		0.1	
SCENTRE GROUP	2,437.607	1,606.393	4,208	398,610		0.7	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	-	140.343	115	10,899		0.0	
HOME CONSORTIUM LTD	-	53.607	241	22,847		0.0	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	213.11	439.583	580	54,955		0.1	
HEALTHCO REIT	-	71.487	105	10,020		0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	179.274	127.89	225	21,317		0.0	
AVENTUS GROUP	176.463	-	-	-		-	
WAYPOINT REIT LTD	382.777	212.662	480	45,519		0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	15,356.239 31銘柄<6.9%>	10,522.248 32銘柄<6.4%>	37,590	3,560,193	-	6.4
(香港)	千□	千円	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	977.72	648.62	41,835	727,527		1.3	
PROSPERITY REIT	597	353	843	14,671		0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	761	682	2,066	35,935		0.1	
CHAMPION REIT	937.07	632.07	2,218	38,580		0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	451	342	1,231	21,410		0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	680	436	2,816	48,979		0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	4,403.79 6銘柄<1.7%>	3,093.69 6銘柄<1.6%>	51,012	887,106	-	1.6
(シンガポール)	千□	千円	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,169.309	1,573.909	3,368	331,393		0.6	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,544.76	1,037.96	2,854	280,843		0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,006.99	668.49	1,076	105,894		0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,370.62	985.82	1,616	159,071		0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	656.8	412.4	239	23,534		0.0	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	891.616	588.116	670	65,965		0.1	
KEPPEL REIT	951.5	598.9	676	66,586		0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	622.9	326.6	728	71,659		0.1	
ESR LOGOS REIT	1,148.73	1,558.24	638	62,859		0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	365.2	277.1	357	35,170		0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST	450.18	338.18	388	38,264		0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	608.8	327.7	91	9,027		0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	216.895	163.795	221	21,756		0.0	
PARKWAY LIFE REIT	179	117.4	564	55,560		0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	2,759.1	-	-	-		-	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	913.12	597.62	1,500	147,587		0.3	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,028.2	673.1	1,204	118,545		0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	587.88	-	-	-		-	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313.2	-	-	-		-	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,019	124.4	149	14,687		0.0	

銘柄	期首(前期末)		当期			末
	口数	金額	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(シンガポール)	千口	千円	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	491.5	303.8	191	191	18,831	0.0
SPH REIT	471.9	313	294	294	28,948	0.1
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	127.4	112.4	62	62	6,193	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	208.1	194.5	146	146	14,448	0.0
OUÉ COMMERCIAL REIT	1,120.355	787,955	303	303	29,847	0.1
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	422.2	573	449	449	44,256	0.1
FRASERS HOSPITALITY TRUST	377.1	—	—	—	—	—
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	103.9	72	72	7,104	0.0
IREIT GLOBAL	214.5	168.6	104	104	10,284	0.0
KEPPEL DC REIT	591.5	403.5	778	778	76,621	0.1
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	1,314.964	894.764	1,207	1,207	118,848	0.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	24,143.319 30銘柄<3.3%>	14,225.149 27銘柄<3.5%>	19,959 —	1,963,791 —	— 3.5
(ニュージーランド)	千口	千円	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
PRECINCT PROPERTIES	510.038	391.694	524	524	45,117	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	180.112	142,269	382	382	32,897	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	520.345	317.48	628	628	54,035	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	742.461	467.188	455	455	39,155	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	388.009	289.87	343	343	29,526	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,340.965 5銘柄<0.4%>	1,608.501 5銘柄<0.4%>	2,335 —	200,732 —	— 0.4
(イギリス)	千口	千円	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC	437.522	288.115	1,452	1,452	242,674	0.4
DERWENT LONDON PLC	52.817	34.55	945	945	157,976	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	77.686	53.044	668	668	111,784	0.2
HAMMERSON PLC	1,976.821	1,047,969	222	222	37,128	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	355.626	230.251	1,655	1,655	276,744	0.5
WORKSPACE GROUP PLC	63.229	41.816	261	261	43,711	0.1
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	0	0	0	0.0
UNITE GROUP PLC	186.15	123.179	1,326	1,326	221,707	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	617.519	407,879	567	567	94,817	0.2
SHAFTESBURY PLC	144.406	88.05	492	492	82,329	0.1
SEGRO PLC	564.915	370.318	3,647	3,647	609,592	1.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119.078	77.506	477	477	79,789	0.1
ASSURA PLC	1,242.776	903.196	602	602	100,678	0.2
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	179.591	115.909	90	90	15,147	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	255.156	160.85	86	86	14,462	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	257.572	179,543	168	168	28,174	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	347.914	256,076	201	201	33,637	0.1
SAFESTORE HOLDINGS LTD	97.821	64.657	679	679	113,565	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	423.479	300,333	697	697	116,545	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT	370.408	239,019	274	274	45,856	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL	397.993	259,531	390	390	65,232	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC	210.196	—	—	—	—	—
NEWRIVER REIT PLC	139.604	113,346	103	103	17,313	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	294.033	182,937	146	146	24,488	0.0
PRS REIT PLC/THE	—	181,169	195	195	32,699	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	177.39	105,686	92	92	15,401	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	371.767	381,587	492	492	82,264	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	810.128	575,519	1,083	1,083	181,012	0.3
CUSTODIAN REIT PLC	202.92	128,872	133	133	22,355	0.0
HOME REIT PLC	100.813	186,078	210	210	35,202	0.1
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	281.997	197,945	168	168	28,118	0.1
AEW UK REIT PLC	83.963	58.66	69	69	11,607	0.0
LXI REIT PLC	292.448	277,287	380	380	63,671	0.1

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額
(イギリス)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
REGIONAL REIT LTD	206.337	150,233	150.233	115	19,332	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	153.417	136.07	136.07	166	27,879	0.0
小計	11,724.532	8,148.22	8,148.22	18,267	3,052,903	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		34銘柄<5.6%>	34銘柄<5.5%>	-	5.5
(イスラエル)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
REIT 1 LTD	85.363	61.727	61.727	1,132	44,721	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	-	63.623	63.623	613	24,241	0.0
小計	85.363	125.35	125.35	1,745	68,963	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		1銘柄<0.1%>	2銘柄<0.1%>	-	0.1
(韓国)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	39.843	28,835	28,835	129,757	13,689	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19.635	19.52	19.52	151,670	16,001	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9.958	11.032	11.032	60,124	6,343	0.0
LOTTE REIT CO LTD	54.509	39.603	39.603	224,152	23,648	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17.86	11.152	11.152	66,688	7,035	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	-	4.123	4.123	21,315	2,248	0.0
JR REIT XXVII	56.222	45.194	45.194	239,076	25,222	0.0
SK REITS CO LTD	-	17.691	17.691	109,861	11,590	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	46.423	43.616	43.616	244,249	25,768	0.0
D&D PLATFORM REIT CO LTD	-	14.329	14.329	71,286	7,520	0.0
NH ALL-ONE REIT CO LTD	-	11.162	11.162	57,261	6,041	0.0
小計	244.45	246.257	246.257	1,375,444	145,109	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		7銘柄<0.2%>	11銘柄<0.3%>	-	0.3
(ユーロ…シンガポール)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
CROMWELL REIT EUR	131.74	101.34	101.34	198	28,494	0.1
小計	131.74	101.34	101.34	198	28,494	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	-	0.1
(ユーロ…アイルランド)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
HIBERNIA REIT PLC	306.848	-	-	-	-	-
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	214.307	125.78	125.78	158	22,808	0.0
小計	521.155	125.78	125.78	158	22,808	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		2銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	-	0.0
(ユーロ…オランダ)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.21	-	-	-	-	-
VASTNED RETAIL	8.822	5.188	5.188	115	16,634	0.0
WERELDHAVE NV	18.894	13.152	13.152	192	27,565	0.0
NSI NV	8.112	5.696	5.696	195	27,987	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	-	11.992	11.992	263	37,779	0.1
小計	54.038	36.028	36.028	766	109,967	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		4銘柄<0.2%>	4銘柄<0.2%>	-	0.2
(ユーロ…ベルギー)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
BEFIMMO	12.281	7.331	7.331	346	49,640	0.1
COFINIMMO SA	13.734	9.07	9.07	1,028	147,554	0.3
RETAIL ESTATES	5.045	3.376	3.376	218	31,287	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10.415	6.965	6.965	179	25,679	0.0
WAREHOUSES DE PAUW	64.409	43.839	43.839	1,386	198,862	0.4
MONTEA SCA	4.725	3.06	3.06	283	40,606	0.1
AEDIFICA	15.707	11.176	11.176	1,058	151,913	0.3
CARE PROPERTY INVEST NV	12.034	8.849	8.849	213	30,657	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	8.239	6.95	6.95	287	41,178	0.1
小計	146.589	100.616	100.616	5,000	717,379	-
	口数・金額 銘柄数<比率>		9銘柄<1.3%>	9銘柄<1.3%>	-	1.3
(ユーロ…フランス)	千口	千円	千口	千円	千口	千円
GECINA SA	25.599	16.786	16.786	1,636	234,791	0.4
ICADE	14.526	9.819	9.819	478	68,656	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
(ユーロ…フランス)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
ALTAREA	1,643	1,248	160	160	23,095	0.0
KLEPIERRE	93.81	60,076	1,241	1,241	178,144	0.3
COVIVIO	22,853	14,518	829	829	119,029	0.2
MERCIALYS	19,022	17,947	151	151	21,678	0.0
CARMILA SA	21,853	13,198	196	196	28,135	0.1
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	64,946	35,856	1,946	1,946	279,210	0.5
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	264,252 8銘柄<2.4%>	169,448 8銘柄<1.7%>	6,641 -	952,743 -	- 1.7
(ユーロ…ドイツ)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG	32,106	23,534	200	200	28,697	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	84,625	3,67	44	44	6,391	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	116,731 2銘柄<0.3%>	27,204 2銘柄<0.1%>	244 -	35,089 -	- 0.1
(ユーロ…スペイン)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	119,135	82,605	530	530	76,139	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,656	18,955	93	93	13,474	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	15,863	102,599	998	998	143,214	0.3
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	305,421 3銘柄<0.4%>	204,159 3銘柄<0.4%>	1,622 -	232,828 -	- 0.4
(ユーロ…イタリア)	千口	千円	千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,287	14,36	51	51	7,323	0.0
COIMA RES SPA	-	7,596	75	75	10,777	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	25,287 1銘柄<0.0%>	21,956 2銘柄<0.0%>	126 -	18,100 -	- 0.0
合計	口数・金額 銘柄数<比率>	72,334,932 327銘柄<99.4%>	47,314,924 328銘柄<99.3%>	-	55,595,607 -	- 99.3

(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

2022年6月22日現在

項目	当期		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	%	千円	%
コール・ローン等、その他	55,595,607	98.5	842,071	1.5
投資信託財産総額	56,437,679	100.0	56,437,679	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、55,938,040千円、99.1%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.49円、1カナダ・ドル=105.41円、1オーストラリア・ドル=94.71円、1香港・ドル=17.39円、1シンガポール・ドル=98.39円、1ニュージーランド・ドル=85.96円、1イギリス・ポンド=167.12円、1イスラエル・シケル=39.504円、100韓国・ウォン=10.55円、1ユーロ=143.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	56,437,679,196円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	288,322,757
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	5,691,222,488
投 資 証 券(評価額)	49,904,384,713
未 収 入 金	369,386,292
未 収 配 当 金	184,362,946
(B) 負 債	434,601,501
未 払 金	431,473,501
未 払 解 約 金	3,128,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	56,003,077,695
元 本	33,589,773,063
次 期 繰 越 損 益 金	22,413,304,632
(D) 受 益 権 総 口 数	33,589,773,063口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	16,673円

(注1) 期首元本額 51,487,595,373円
 追加設定元本額 123,561,181,960円
 一部解約元本額 141,459,004,270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)	89,931,914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)	50,563,654円
MITOラップ型ファンド (安定型)	6,720,407円
MITOラップ型ファンド (中立型)	23,507,005円
MITOラップ型ファンド (積極型)	124,969,213円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	31,704,221円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,648,722円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,738,279円
たわらノーロード 先進国リート	12,630,933,969円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,109,201,766円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	313,831,478円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,325,859,048円
たわらノーロード バランス (堅実型)	21,585,836円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,429,232円
たわらノーロード バランス (積極型)	783,248,768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)	5,559,853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)	92,995,102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)	219,476,091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)	5,370,883円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,144,625円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,960,422円
One DC先進国リートインデックスファンド	1,184,878,273円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	497,283,471円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10)	179,983,530円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20)	232,723,605円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30)	466,414,247円
投資のソムリエ	6,257,726,433円
投資のソムリエ<DC年金>	394,192,597円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	192,368,902円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	358,133,162円

リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,813,208,729円
ワールドアセットバランス (基本コース)	355,965,633円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	243,707,293円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	36,458,019円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	18,413,243円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,367,743円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	82,448,556円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	319,237,578円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	147,067,136円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	42,933,275円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	19,741,762円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	12,168,821円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	2,125,847円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	276,893,448円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	252,886,121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)	983,915円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用品) 20-4	53,121,417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)	656,048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)	459,027円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用品) 21-03	56,379,915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)	583,400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)	826,526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)	692,408円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	153,285,243円
AMOneマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定)	8,623,168円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	1,380,735円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用)	7,212,770円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	31,286,199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)	80,722,535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)	194,641,132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)	823,557,498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)	436,383,528円
期末元本合計	33,589,773,063円

■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,249,560,788	円
	受取配当金	2,170,878,662	
	受取利息	1,204,472	
	その他の収益	77,775,326	
	支払利息	△297,672	
(B)	有価証券売買損益	1,466,080,453	
	売買益	20,774,196,674	
	売買損	△19,308,116,221	
(C)	その他の費用	△65,480,614	
(D)	当期損益金(A+B+C)	3,650,160,627	
(E)	前期繰越損益金	27,471,618,273	
(F)	解約差損益金	△94,232,927,308	
(G)	追加信託差損益金	85,524,453,040	
(H)	計(D+E+F+G)	22,413,304,632	
	次期繰越損益金(H)	22,413,304,632	

(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。