

## 運用報告書 (全体版)

### DIAMパッシブ資産分散ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

愛称 **三木の久**

第102期 <決算日 2023年1月6日>  
第103期 <決算日 2023年3月6日>  
第104期 <決算日 2023年5月8日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAMパッシブ資産分散ファンド」は、2023年5月8日に第104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、 投資証券 組入比率	純資産 総額
		(分配落) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %						
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	百万円 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
第35作成期	102期(2023年1月6日)	10,119	20	△5.2	16.6	0.3	68.6	-	12.4	3,238
	103期(2023年3月6日)	10,405	20	3.0	18.8	0.4	63.3	-	15.1	3,277
	104期(2023年5月8日)	10,671	20	2.7	18.3	0.6	64.4	-	14.1	3,328

(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102期	(期 首) 2022年11月7日	10,699	—	17.5	0.4	67.6	—	12.5
	11 月 末	10,644	△0.5	17.2	0.3	67.4	—	12.6
	12 月 末	10,070	△5.9	16.9	0.4	67.9	—	12.5
	(期 末) 2023年1月6日	10,139	△5.2	16.6	0.3	68.6	—	12.4
第103期	(期 首) 2023年1月6日	10,119	—	16.6	0.3	68.6	—	12.4
	1 月 末	10,302	1.8	18.7	0.3	63.6	—	15.4
	2 月 末	10,402	2.8	18.4	0.3	64.2	—	15.1
	(期 末) 2023年3月6日	10,425	3.0	18.8	0.4	63.3	—	15.1
第104期	(期 首) 2023年3月6日	10,405	—	18.8	0.4	63.3	—	15.1
	3 月 末	10,409	0.0	19.1	0.4	64.6	—	14.1
	4 月 末	10,543	1.3	18.8	0.4	63.9	—	14.3
	(期 末) 2023年5月8日	10,691	2.7	18.3	0.6	64.4	—	14.1

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

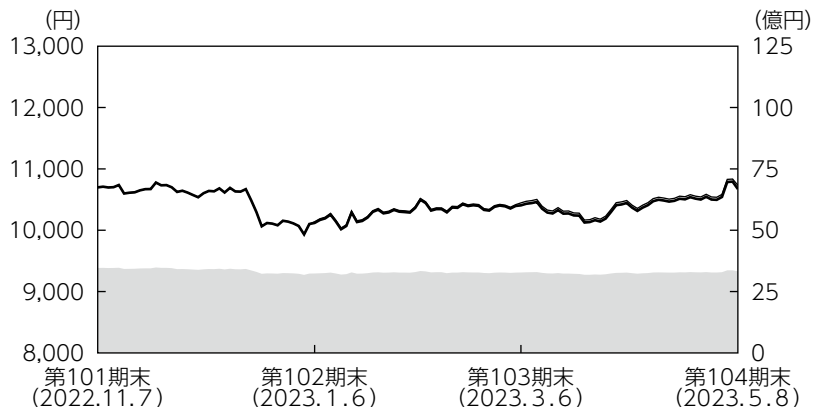
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■第102期～第104期の運用経過（2022年11月8日から2023年5月8日まで）

### 基準価額等の推移



第102期首：10,699円  
 第104期末：10,671円  
 (既払分配金60円)  
 騰落率：0.3%  
 (分配金再投資ベース)

■ 純資産総額 (右軸) — 基準価額 (左軸) — 分配金再投資基準価額 (左軸)

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

### 基準価額の主な変動要因

日銀が2022年12月の金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことや内外金利差の縮小等から主要通貨に対して円高が進んだことはマイナスに寄与しました。一方、インフレ鈍化により米国で利上げ減速観測が強まったことや、米地方銀行の破綻等から金融不安が広がったことなどを背景に主要国の長期金利が低下（債券価格は上昇）したこと、米国の利上げペース減速観測や長期金利の低下を好感したこと等から国内株式市場と外国リート市場が上昇したことはプラスに寄与しました。結果として当作成期の基準価額は小幅に上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.2%
インデックス225 マザーファンド	6.4%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△1.1%

## 投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは低下（債券価格は上昇）し、ドイツ債の利回りは上昇（債券価格は下落）しました。米国債は、米銀破綻を受けたリスク回避の動きやスイス金融大手の経営不安で欧米の金融システム不安の広がりを背景に利回りは低下しました。ドイツ債についてはECB（欧州中央銀行）の複数回の利上げや金融引き締め観測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。2022年12月、日銀の金融政策修正を受け、急速に円高ドル安が進行したことなどが嫌気され、大きく下落しました。2023年の年明け以降は、インフレ鈍化期待の高まりを受けた米株高が好感され、国内株も上昇に転じました。3月には、米地銀の破綻などをきっかけに欧米金融システム不安が拡大、急落する場面もありましたが、欧米金融当局の迅速な対応から安心感が広がり、国内株も反発、作成期末にかけて上値を追う展開となりました。

外国リート市場（現地通貨建て）は上昇しました。米国リート市場はCPI（消費者物価指数）の伸び鈍化などを受けてFRB（米連邦準備理事会）の利上げへの警戒感が後退したことから上昇しました。欧州リート市場は堅調な経済指標が好感され、イギリス、フランスなどの主要市場は上昇しました。オーストラリアリート市場は米CPIの伸び鈍化につれてオーストラリアの長期金利が低下したことなどが好感され上昇しました。

ドル/円相場は、日銀が2022年12月の金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことや、米国の利上げペース鈍化観測、内外金利差の縮小等を背景に、円高ドル安の動きとなりました。その他主要通貨においては、利上げ観測により主要通貨に対してユーロが強含む中、ユーロ/円は円安ユーロ高となるなど、通貨によってまちまちの動きとなりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

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

### 【運用状況】

#### ○各資産のリスク量

※1 リスクウェイトはみずほ第一フィナンシャルテクノロジーが計測。

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

#### 前作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 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%



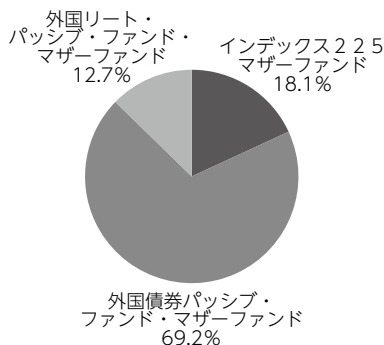
#### 当作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 差
外国債券	33.3%	33.3%	△0.0%
国内株式	36.2%	33.3%	2.8%
外国リート	30.5%	33.3%	△2.8%
合計	100.0%	100.0%	0.0%

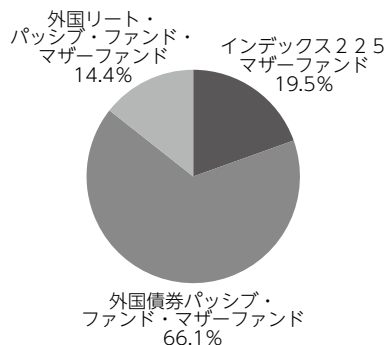
## ○マザーファンド組入比率

※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FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### ●インデックス225マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入れ替え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REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

## 分配金

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

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第102期	第103期	第104期
	2022年11月8日 ～2023年1月6日	2023年1月7日 ～2023年3月6日	2023年3月7日 ～2023年5月8日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.20%	0.19%	0.19%
当期の収益	18円	20円	20円
当期の収益以外	1円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,054円	1,063円	1,097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102期～第104期		項目の概要
	(2022年11月8日 ～2023年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	57円	0.549%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,402円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(25)	(0.242)	
(販売会社)	(29)	(0.275)	
(受託会社)	( 3)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(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)	( 0)	(0.003)	
(d) その他費用	1	0.010	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 1)	(0.008)	
(監査費用)	( 0)	(0.002)	
(その他)	( 0)	(0.001)	
合計	59	0.563	

(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。

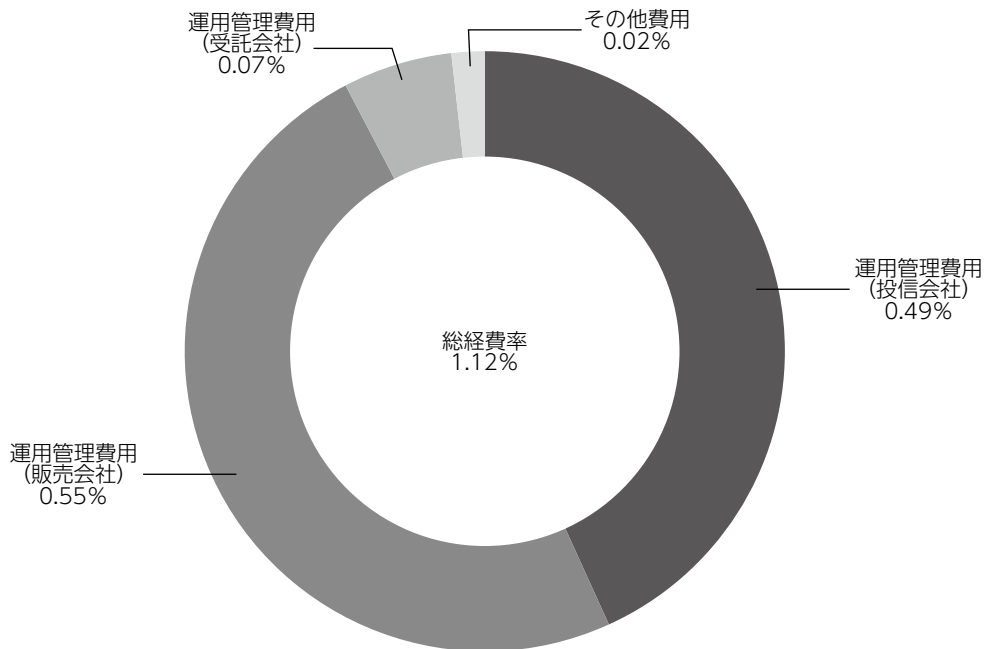
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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11月8日から2023年5月8日まで）

	第 102 期 ~ 第 104 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	—	—	92,421	186,000
インデックス225マザーファンド	20,980	46,110	28,667	66,000
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	47,790	77,941	22,497	37,000

## ■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 102 期 ~ 第 104 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	42,166,150千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	128,118,467千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.32

(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11月8日から2023年5月8日まで）

### 【D I AMパッシブ資産分散ファンドにおける利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 102 期 ~ 第 104 期
売買委託手数料総額 (A)	52千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B)/(A)	13.2%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 102 期 ~ 第 104 期			第 104 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 17,208	百万円 1,151	% 6.7	百万円 24,957	百万円 3,461	% 13.9
株 式 先 物 取 引	39,071	39,071	100.0	37,573	37,573	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 102 期 ~ 第 104 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 3	百万円 5	百万円 28

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

	第 34 作 成 期 末		第 35 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
	千□		千円	
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,123,735	1,031,313	2,164,417	
インデックス 2 2 5 マザーファンド	270,849	263,162	639,432	
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	259,405	284,697	470,719	

## ■投資信託財産の構成

2023年5月8日現在

項 目	第 35 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	2,164,417	64.8
インデックス 2 2 5 マザーファンド	639,432	19.1
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	470,719	14.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	67,232	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	3,341,801	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、2023年5月8日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは215,662,994千円、98.3%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは80,005,954千円、99.0%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、2023年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.14円、1カナダ・ドル=100.96円、1オーストラリア・ドル=91.14円、1香港・ドル=17.22円、1シンガポール・ドル=101.92円、1ニュージーランド・ドル=85.12円、1イギリス・ポンド=170.68円、1イスラエル・シケル=37.111円、1デンマーク・クローネ=19.99円、1ノルウェー・クローネ=12.79円、1スウェーデン・クローナ=13.29円、1メキシコ・ペソ=7.607円、100韓国・ウォン=10.21円、1オフショア・人民元=19.511円、1マレーシア・リンギット=30.439円、1ポーランド・ズロチ=32.562円、1ユーロ=148.92円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月6日)、 (2023年3月6日)、 (2023年5月8日)現在

項 目	第 102 期 末	第 103 期 末	第 104 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>3,254,742,958円</b>	<b>3,289,629,833円</b>	<b>3,341,801,455円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	43,621,664	40,504,254	67,232,217
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,248,144,711	2,097,588,379	2,164,417,680
インデックス2.2.5マザーファンド(評価額)	546,748,245	632,678,655	639,432,123
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	406,228,338	498,858,545	470,719,435
未 収 入 金	10,000,000	20,000,000	—
<b>(B) 負 債</b>	<b>16,363,230</b>	<b>12,174,798</b>	<b>13,478,058</b>
未 払 収 益 分 配 金	6,400,876	6,299,971	6,237,851
未 払 解 約 金	3,833,501	48,292	1,033,738
未 払 信 託 報 酬	6,109,338	5,807,979	6,186,699
そ の 他 未 払 費 用	19,515	18,556	19,770
<b>(C) 純 資 産 総 額(A－B)</b>	<b>3,238,379,728</b>	<b>3,277,455,035</b>	<b>3,328,323,397</b>
元 本	3,200,438,149	3,149,985,689	3,118,925,798
次 期 繰 越 損 益 金	37,941,579	127,469,346	209,397,599
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>3,200,438,149口</b>	<b>3,149,985,689口</b>	<b>3,118,925,798口</b>
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,119円	10,405円	10,671円

(注) 第101期末における元本額は3,235,644,830円、当作成期間（第102期～第104期）中における追加設定元本額は4,628,156円、同解約元本額は121,347,188円です。

## ■損益の状況

〔自 2022年11月8日〕  
〔至 2023年 1月6日〕

〔自 2023年1月7日〕  
〔至 2023年3月6日〕

〔自 2023年3月7日〕  
〔至 2023年5月8日〕

項 目	第 102 期	第 103 期	第 104 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,607円	△1,412円	△2,515円
受 取 利 息	108	60	40
支 払 利 息	△5,715	△1,472	△2,555
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△173,233,992	102,231,469	95,637,396
売 買 益	1,017,074	102,953,285	108,791,160
売 買 損	△174,251,066	△721,816	△13,153,764
(C) 信 託 報 酬 等	△6,128,853	△5,826,535	△6,206,469
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△179,368,452	96,403,522	89,428,412
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	223,380,746	37,003,476	125,806,968
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	330,161	362,319	400,070
(配 当 等 相 当 額)	(17,353,450)	(17,209,364)	(17,157,273)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,023,289)	(△16,847,045)	(△16,757,203)
(G) 合 計(D + E + F)	44,342,455	133,769,317	215,635,450
(H) 収 益 分 配 金	△6,400,876	△6,299,971	△6,237,851
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	37,941,579	127,469,346	209,397,599
追 加 信 託 差 損 益 金	330,161	362,319	400,070
(配 当 等 相 当 額)	(17,355,070)	(17,210,004)	(17,158,468)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△17,024,909)	(△16,847,685)	(△16,758,398)
分 配 準 備 積 立 金	320,247,485	317,906,870	325,183,441
繰 越 損 益 金	△282,636,067	△190,799,843	△116,185,912

(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 102 期	第 103 期	第 104 期
(a) 経費控除後の配当等収益	5,908,290円	9,135,746円	16,765,994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	17,355,070	17,210,004	17,158,468
(d) 分 配 準 備 積 立 金	320,740,071	315,071,095	314,655,298
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	344,003,431	341,416,845	348,579,760
(f) 1万口当たり当期分配対象額	1,074.86	1,083.87	1,117.63
(g) 分 配 金	6,400,876	6,299,971	6,237,851
(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 102 期	第 103 期	第 104 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

### 分配金の課税上の取扱いについて

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

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「インデックス225 マザーファンド」において、第22条（信託業務の委託等）の付表「I. 外国での保管会社」を削除しました。

(2023年2月11日)

# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2023年2月21日）

（計算期間 2022年2月22日～2023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20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年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			
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	ポイント 113,733.36	% 1.7	% 98.1	% -	百万円 197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
20期（2023年2月21日）	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822

（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）。



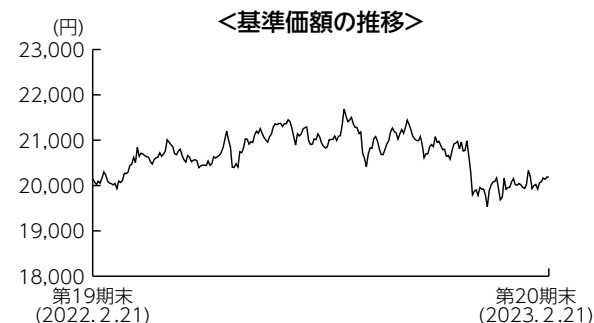
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2022 年 2 月 21 日	円 20,152	% -	ポイント 126,280.23	% -	% 98.9	% -
2 月 末	20,052	△0.5	125,907.80	△0.3	98.8	-
3 月 末	20,713	2.8	129,775.21	2.8	98.3	-
4 月 末	20,758	3.0	129,955.37	2.9	99.0	-
5 月 末	20,634	2.4	129,451.47	2.5	98.7	-
6 月 末	21,122	4.8	132,579.22	5.0	99.0	-
7 月 末	21,267	5.5	133,117.57	5.4	98.9	-
8 月 末	21,015	4.3	131,430.25	4.1	98.7	-
9 月 末	20,830	3.4	130,076.63	3.0	99.0	-
10 月 末	21,443	6.4	134,355.57	6.4	99.0	-
11 月 末	20,802	3.2	130,450.40	3.3	98.7	-
12 月 末	19,782	△1.8	123,946.23	△1.8	98.6	-
2023 年 1 月 末	20,018	△0.7	125,559.33	△0.6	98.8	-
(期 末) 2023 年 2 月 21 日	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-

(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（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

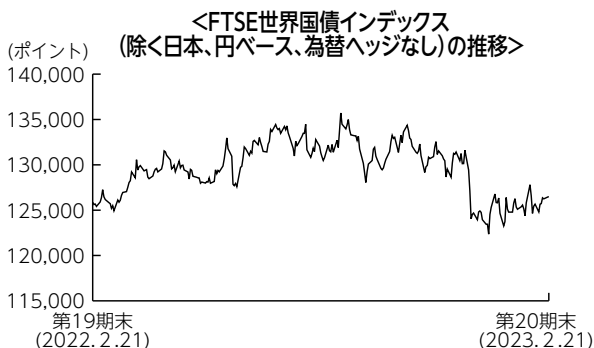


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は20,182円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

FOMC（米連邦公開市場委員会）による複数回の利上げ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FOMCによる複数回の利上げと日銀の金融緩和策を堅持する姿勢から、日米金利差拡大が意識されて円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも大きく為替が円安に動いたことから、基準価額は若干上昇しました。



### 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、インフレ率が加速する中でFOMCの複数回の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米国債の金利上昇やECB（欧州中央銀行）の複数回の利上げ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、FOMCにおいて複数回の利上げを実施しましたが、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

## ポートフォリオについて

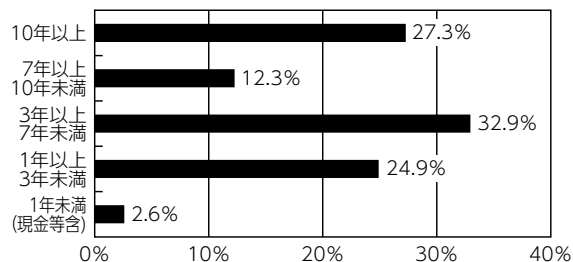
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

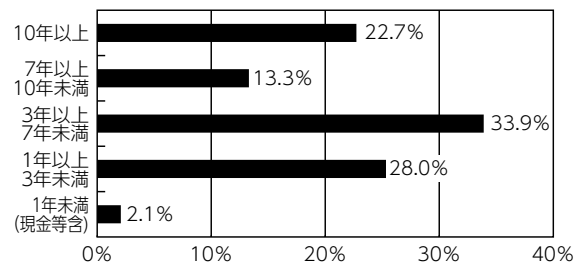
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○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	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%	—

#### 期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	49.5%	50.0%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
計	51.6%	52.0%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.9%	1.9%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.4%	8.4%	0.0%
ドイツ	6.5%	6.4%	0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.5%	7.6%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	5.0%	5.0%	△0.0%
ユーロ計	33.1%	33.2%	△0.1%
デンマーク	0.3%	0.3%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	4.8%	4.7%	0.1%
ポーランド	0.4%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	39.0%	39.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.6%	1.6%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	4.4%	4.8%	△0.4%
シンガポール	0.5%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.6%	△0.0%
計	7.2%	7.6%	△0.4%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.0%	—	—
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0.2%上昇しました。

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

## 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.016%	(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)	(3)	(0.015)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は20,688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 (2022年2月22日から2023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 536,386	千アメリカ・ドル 350,573	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 26,736	千カナダ・ドル 16,227	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,961	千オーストラリア・ドル 11,123	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 4,947	千シンガポール・ドル 3,149	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 4,867	千ニュージーランド・ドル -	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 42,306	千イギリス・ポンド 23,277	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 9,417	千イスラエル・シケル 7,354	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 15,932	千デンマーク・クローネ 12,094	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 16,915	千ノルウェー・クローネ 14,888	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 13,712	千スウェーデン・クローナ 12,914	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 111,333	千メキシコ・ペソ 63,692	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 369,093	千オフショア・人民元 18,682	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,418	千マレーシア・リンギット 8,762	
ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,489	千ポーランド・ズロチ 7,291		
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 5,238	千ユーロ 3,823
		オランダ	国債証券	15,082	10,731
		ベルギー	国債証券	17,985	11,988
		フランス	国債証券	79,108	52,916
		ドイツ	国債証券	67,768	45,631
		スペイン	国債証券	46,170	31,229
		イタリア	国債証券	74,616	52,932
		フィンランド	国債証券	4,741	3,163
オーストラリア	国債証券	12,167	8,398		

(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（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行です。

## ■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 774,590	千アメリカ・ドル 689,046	千円 92,552,791	% 49.5	% -	% 21.4	% 18.2	% 9.9	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 41,990	千カナダ・ドル 38,354	千円 3,827,785	2.0	-	1.1	0.6	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 35,405	千オーストラリア・ドル 31,922	千円 2,963,084	1.6	-	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,895	千シンガポール・ドル 8,486	千円 853,411	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 5,560	千ニュージーランド・ドル 4,858	千円 408,149	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 65,284	千イギリス・ポンド 55,908	千円 9,037,014	4.8	-	3.4	0.9	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 17,540	千イスラエル・シケル 16,376	千円 614,774	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 33,220	千デンマーク・クローネ 31,156	千円 600,381	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 29,010	千ノルウェー・クローネ 27,010	千円 354,646	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 29,770	千スウェーデン・クローナ 28,193	千円 366,227	0.2	-	0.1	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 234,607	千メキシコ・ペソ 217,394	千円 1,589,526	0.9	-	0.4	0.3	0.1	
中 国	千オフショア・人民元 419,720	千オフショア・人民元 419,249	千円 8,205,585	4.4	-	1.9	2.0	0.4	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,550	千マレーシア・リンギット 34,072	千円 1,032,254	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 32,170	千ポーランド・ズロチ 27,310	千円 826,099	0.4	-	0.1	0.2	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	9,450	8,192	1,175,166	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オランダ	21,490	19,601	2,811,844	1.5	-	0.9	0.5	0.1	
ベルギー	26,630	24,128	3,461,253	1.9	-	1.3	0.4	0.1	
フランス	120,130	109,930	15,769,556	8.4	-	5.2	2.6	0.7	
ドイツ	91,020	84,475	12,118,072	6.5	-	3.4	2.0	1.1	
スペイン	69,860	64,753	9,288,912	5.0	-	2.8	1.5	0.7	
イタリア	106,807	97,750	14,022,270	7.5	-	4.2	2.3	1.0	
フィンランド	7,640	6,508	933,600	0.5	-	0.3	0.2	0.1	
オーストラリア	17,370	15,259	2,188,922	1.2	-	0.6	0.4	0.1	
合 計	-	-	千円 185,001,333	99.0	-	50.1	33.3	15.7	

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

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

(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当	期	末	評 価 額			償還年月日		
				種 類	利 率	額 面 金 額		額	
								外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円				
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,460	2,346	315,144	2026/01/31			
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	500	480	64,520	2025/01/31			
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	710	691	92,923	2024/01/31			
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	2,550	2,490	334,501	2024/01/31			
US T N/B 0.875 01/31/24	国債証券	0.8750	200	192	25,837	2024/01/31			
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	4,940	4,463	599,597	2027/01/31			
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	3,969	533,182	2029/01/31			
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	705	94,711	2025/01/31			
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,739	502,279	2028/01/31			
US T N/B 1.125 01/15/25	国債証券	1.1250	4,880	4,570	613,950	2025/01/15			
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	3,700	3,302	443,558	2026/01/31			
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	800	790	106,129	2026/01/15			
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	400	418	56,275	2026/02/15			
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,860	1,635	219,679	2042/02/15			
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,740	1,516	203,634	2043/02/15			
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,358	182,433	2046/02/15			
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	500	476	64,069	2039/02/15			
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	860	947	127,274	2031/02/15			
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	400	431	57,917	2036/02/15			
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	830	918	123,374	2041/02/15			
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,527	205,189	2044/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,310	2,790	374,852	2049/02/15			
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	4,300	3,071	412,560	2052/02/15			
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	636	85,440	2038/02/15			
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	890	969	130,285	2040/02/15			
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,807	377,043	2042/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,920	3,221	432,653	2051/02/15			
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,890	2,674	359,252	2026/02/15			
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,310	1,781	239,230	2045/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,960	1,644	220,856	2047/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,223	298,606	2048/02/15			
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	2,090	2,043	274,533	2024/02/15			
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,939	260,547	2025/02/15			
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,330	4,011	538,848	2029/02/15			
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	3,370	3,174	426,418	2028/02/15			
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,518	472,624	2027/02/15			
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,650	1,602	215,212	2024/02/29			
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,164	290,721	2026/02/28			
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,891	254,052	2025/02/28			
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	7,890	6,465	868,443	2031/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,700	3,401	456,856	2041/02/15			
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,720	2,528	339,658	2050/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	7,280	6,208	833,960	2032/02/15			
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	979	131,533	2027/02/28			
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,730	3,194	429,149	2030/02/15			
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	3,610	3,306	444,114	2027/02/28			
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,800	4,574	614,488	2024/02/15			
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,782	373,724	2025/02/28			



銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.5 02/29/24	国債証券	1.5000	4,000	3,860	518,517	2024/02/29	
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	3,860	3,351	450,202	2028/02/29	
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,000	3,551	477,024	2029/02/28	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,618	620,325	2026/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,282	575,202	2025/02/15	
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	3,340	3,241	435,345	2024/03/31	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,721	231,172	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	1,300	1,224	164,418	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	2,200	1,912	256,880	2027/03/31	
US T N/B 0.25 03/15/24	国債証券	0.2500	3,910	3,720	499,752	2024/03/15	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,630	353,302	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	3,610	3,148	422,881	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	3,220	2,894	388,853	2026/03/31	
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	3,000	2,736	367,590	2029/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/24	国債証券	2.2500	4,750	4,609	619,178	2024/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	2,650	2,486	333,923	2027/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,777	507,456	2025/03/15	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,931	259,405	2025/04/30	
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	4,720	4,567	613,484	2024/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,260	1,190	159,855	2026/04/30	
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,194	429,092	2024/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	4,010	3,491	468,917	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/15/24	国債証券	0.3750	4,140	3,935	528,671	2024/04/15	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,043	274,492	2027/04/30	
US T N/B 2.5 04/30/24	国債証券	2.5000	4,010	3,895	523,179	2024/04/30	
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,000	2,815	378,184	2029/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	3,700	3,314	445,169	2026/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,341	314,469	2025/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	3,000	2,840	381,552	2027/04/30	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,882	387,156	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	869	116,791	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	910	960	128,992	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	230	243	32,641	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	928	124,733	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	990	133,106	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,914	257,152	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	4,092	549,728	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,287	172,974	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	400	337	45,270	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,358	182,510	2047/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,701	497,215	2052/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	2,230	1,713	230,090	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,430	326,521	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,117	284,480	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,300	2,715	364,751	2049/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	644	86,516	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	3,420	2,627	352,892	2041/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	5,100	4,950	664,909	2024/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,751	503,911	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,593	617,044	2028/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,470	3,161	424,615	2029/05/15	

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,129	554,640	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	555	627	84,238	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,670	3,379	453,980	2026/05/15	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	800	770	103,535	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	3,870	2,161	290,275	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	1,550	1,450	194,825	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	9,240	7,821	1,050,585	2031/05/15	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,515	203,534	2025/05/31	
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,360	451,421	2042/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	6,650	6,155	826,829	2032/05/15	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,980	1,702	228,647	2027/05/31	
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	3,300	2,867	385,217	2028/05/31	
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	7,500	7,079	950,969	2024/05/15	
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	5,650	4,505	605,229	2030/05/15	
US T N/B 2.5 05/31/24	国債証券	2.5000	4,180	4,052	544,394	2024/05/31	
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	3,410	3,210	431,193	2027/05/31	
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,072	412,678	2029/05/31	
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,630	3,243	435,623	2026/05/31	
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	3,890	3,537	475,152	2025/05/31	
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	4,000	3,849	517,090	2025/05/15	
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	290	279	37,531	2024/06/30	
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	999	134,312	2025/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,880	1,743	234,223	2026/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,283	172,381	2024/06/30	
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,384	320,330	2027/06/30	
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,217	432,220	2028/06/30	
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,176	426,615	2025/06/30	
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	3,500	3,379	453,886	2027/06/30	
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,555	477,543	2024/06/15	
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	2,964	398,176	2026/06/30	
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,000	2,874	386,101	2029/06/30	
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	4,920	4,748	637,776	2025/06/15	
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	380	366	49,207	2024/07/31	
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,123	285,253	2025/07/31	
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,000	1,852	248,827	2026/07/31	
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,903	255,644	2024/07/31	
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,770	3,215	431,892	2028/07/31	
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,213	431,669	2027/07/31	
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,437	461,727	2025/07/31	
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	2,570	2,373	318,786	2029/07/31	
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,900	3,452	463,687	2026/07/31	
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,611	485,042	2027/07/31	
US T N/B 0.375 07/15/24	国債証券	0.3750	4,000	3,755	504,413	2024/07/15	
US T N/B 3.0 07/31/24	国債証券	3.0000	3,820	3,719	499,593	2024/07/31	
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,094	415,670	2025/07/15	
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	820	794	106,691	2041/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,279	171,824	2040/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,540	1,267	170,217	2042/08/15	
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,804	242,413	2044/08/15	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	980	1,051	141,238	2039/08/15	
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,381	185,618	2043/08/15	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,110	3,439	462,016	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,457	195,769	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	4,050	3,831	514,671	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,784	239,650	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	3,040	2,193	294,573	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	3,640	3,067	411,995	2052/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	4,610	4,444	596,962	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,070	1,506	202,297	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,810	2,360	317,078	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,922	526,825	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,730	3,404	457,331	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,530	4,273	573,981	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,759	236,357	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,960	3,448	463,216	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	783	105,289	2024/08/31
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,658	357,068	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	4,930	3,452	463,693	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,160	2,013	270,388	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,870	2,799	375,976	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	5,840	5,341	717,415	2032/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,130	6,636	891,362	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,340	5,024	674,950	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	998	134,165	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,870	2,719	365,229	2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,242	435,570	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	4,100	3,835	515,216	2024/08/15
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,200	429,932	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,611	350,731	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	2,950	2,616	351,465	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,938	394,652	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,957	397,289	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,784	508,341	2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,689	226,869	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	590	565	75,973	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,310	2,801	376,311	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,417	190,418	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,980	3,432	461,003	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,349	449,937	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	4,310	4,091	549,611	2024/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	2,000	2,002	268,986	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	3,110	2,764	371,360	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,934	394,200	2025/09/15
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,866	250,758	2024/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	3,250	3,230	433,930	2029/09/30
US T N/B 4.25 09/30/24	国債証券	4.2500	2,200	2,181	292,958	2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,350	2,254	302,779	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,270	1,223	164,362	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,710	1,562	209,840	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,082	548,376	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,760	2,614	351,231	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,108	417,485	2027/10/31

銘柄	当	種	類	利	率	額	面	金	額	期		末		
										評			額	償
										外	貨			
(アメリカ)					%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド		
US T N/B 1.125 10/31/26		国	債	証	券	1.1250	3,390		3,034		407,622	2026/10/31		
US T N/B 0.625 10/15/24		国	債	証	券	0.6250	4,000		3,739		502,314	2024/10/15		
US T N/B 4.0 10/31/29		国	債	証	券	4.0000	2,000		2,003		269,059	2029/10/31		
US T N/B 4.375 10/31/24		国	債	証	券	4.3750	2,070		2,056		276,239	2024/10/31		
US T N/B 4.125 10/31/27		国	債	証	券	4.1250	3,940		3,947		530,223	2027/10/31		
US T N/B 0.25 10/31/25		国	債	証	券	0.2500	4,000		3,587		481,831	2025/10/31		
US T N/B 4.25 10/15/25		国	債	証	券	4.2500	2,800		2,789		374,678	2025/10/15		
US T N/B 5.25 11/15/28		国	債	証	券	5.2500	850		903		121,383	2028/11/15		
US T N/B 6.125 11/15/27		国	債	証	券	6.1250	200		217		29,227	2027/11/15		
US T N/B 3.0 11/15/44		国	債	証	券	3.0000	1,560		1,317		177,027	2044/11/15		
US T N/B 4.25 11/15/40		国	債	証	券	4.2500	600		623		83,803	2040/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/42		国	債	証	券	2.7500	1,556		1,277		171,593	2042/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/41		国	債	証	券	3.1250	1,020		899		120,822	2041/11/15		
US T N/B 3.75 11/15/43		国	債	証	券	3.7500	1,460		1,396		187,573	2043/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/47		国	債	証	券	2.7500	2,250		1,801		241,941	2047/11/15		
US T N/B 1.625 11/15/50		国	債	証	券	1.6250	4,780		2,935		394,308	2050/11/15		
US T N/B 1.875 11/15/51		国	債	証	券	1.8750	4,670		3,041		408,512	2051/11/15		
US T N/B 4.0 11/15/52		国	債	証	券	4.0000	2,460		2,519		338,378	2052/11/15		
US T N/B 3.0 11/15/45		国	債	証	券	3.0000	860		724		97,267	2045/11/15		
US T N/B 2.875 11/15/46		国	債	証	券	2.8750	1,080		886		119,135	2046/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/24		国	債	証	券	2.2500	3,080		2,954		396,785	2024/11/15		
US T N/B 4.375 11/15/39		国	債	証	券	4.3750	1,000		1,057		142,106	2039/11/15		
US T N/B 3.375 11/15/48		国	債	証	券	3.3750	3,200		2,883		387,345	2048/11/15		
US T N/B 2.375 11/15/49		国	債	証	券	2.3750	3,290		2,438		327,498	2049/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/25		国	債	証	券	2.2500	3,620		3,423		459,875	2025/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/28		国	債	証	券	3.1250	4,380		4,180		561,571	2028/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/26		国	債	証	券	2.0000	2,830		2,616		351,452	2026/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/27		国	債	証	券	2.2500	3,270		3,015		405,100	2027/11/15		
US T N/B 2.125 11/30/24		国	債	証	券	2.1250	1,780		1,702		228,629	2024/11/30		
US T N/B 2.875 11/30/25		国	債	証	券	2.8750	1,360		1,307		175,567	2025/11/30		
US T N/B 4.0 11/15/42		国	債	証	券	4.0000	1,200		1,196		160,705	2042/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/40		国	債	証	券	1.3750	3,190		2,120		284,839	2040/11/15		
US T N/B 1.5 11/15/41		国	債	証	券	2.0000	4,250		3,102		416,683	2041/11/15		
US T N/B 1.625 11/30/26		国	債	証	券	1.6250	1,810		1,651		221,798	2026/11/30		
US T N/B 4.125 11/15/32		国	債	証	券	4.1250	4,500		4,605		618,606	2032/11/15		
US T N/B 1.75 11/15/29		国	債	証	券	1.7500	2,050		1,797		241,409	2029/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/31		国	債	証	券	1.3750	7,990		6,549		879,702	2031/11/15		
US T N/B 0.875 11/15/30		国	債	証	券	0.8750	8,280		6,665		895,296	2030/11/15		
US T N/B 0.625 11/30/27		国	債	証	券	0.6250	3,900		3,324		446,539	2027/11/30		
US T N/B 1.25 11/30/26		国	債	証	券	1.2500	3,700		3,322		446,256	2026/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/28		国	債	証	券	1.5000	4,000		3,484		468,084	2028/11/30		
US T N/B 0.375 11/30/25		国	債	証	券	0.3750	3,190		2,862		384,544	2025/11/30		
US T N/B 3.875 11/30/29		国	債	証	券	3.8750	2,300		2,286		307,149	2029/11/30		
US T N/B 0.75 11/15/24		国	債	証	券	0.7500	2,610		2,438		327,486	2024/11/15		
US T N/B 3.875 11/30/27		国	債	証	券	3.8750	3,000		2,978		400,016	2027/11/30		
US T N/B 4.5 11/15/25		国	債	証	券	4.5000	3,570		3,581		481,011	2025/11/15		
US T N/B 4.5 11/30/24		国	債	証	券	4.5000	4,200		4,183		561,929	2024/11/30		
US T N/B 2.625 12/31/25		国	債	証	券	2.6250	1,000		955		128,317	2025/12/31		
US T N/B 2.25 12/31/24		国	債	証	券	2.2500	3,000		2,871		385,645	2024/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/26		国	債	証	券	1.7500	2,110		1,931		259,380	2026/12/31		
US T N/B 1.25 12/31/26		国	債	証	券	1.2500	3,890		3,488		468,519	2026/12/31		

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	
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,887	253,493	2024/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,500	3,888	522,344	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,688	361,168	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	3,320	2,823	379,294	2027/12/31
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	4,610	4,314	579,498	2024/12/15
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,104	551,371	2025/12/15
小計	—	—	774,590	689,046	92,552,791	—
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	193	19,261	2024/02/01
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,151	114,920	2025/02/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	420	410	40,980	2024/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	662	66,097	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,271	126,871	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	1,210	1,108	110,592	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	480	482	48,142	2028/03/01
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,432	142,914	2024/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,043	104,188	2025/04/01
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	940	907	90,610	2024/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	655	65,387	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	842	84,063	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	737	73,611	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	280	332	33,171	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	970	947	94,560	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	570	621	62,003	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	850	797	79,553	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,273	127,124	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	498	49,729	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	430	405	40,463	2029/06/01
CANADA 1.5 06/01/30	国債証券	1.2500	1,850	1,608	160,516	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	214,768	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,940	1,741	173,827	2032/06/01
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	590	576	57,579	2024/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	422	42,143	2024/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,910	1,755	175,177	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	850	825	82,361	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,270	1,161	115,930	2026/09/01
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	810	766	76,518	2024/10/01
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	500	489	48,838	2025/10/01
CANADA 3.0 11/01/24	国債証券	3.0000	860	842	84,120	2024/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	700	719	71,803	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	630	571	57,018	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,820	2,152	214,810	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,200	1,560	155,691	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	345	34,442	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,800	1,458	145,555	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,020	1,746	174,312	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,300	1,215	121,266	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	500	469	46,853	2029/12/01
小計	—	—	41,990	38,354	3,827,785	—
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	880	719	66,774	2047/03/21

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
<b>(オーストラリア)</b>			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500		1,380	1,372	127,357	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500		840	877	81,455	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500		970	959	89,073	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500		1,200	1,225	113,742	2026/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500		1,500	1,466	136,143	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000		1,230	1,301	120,771	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500		830	804	74,696	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500		880	822	76,347	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000		1,810	1,671	155,113	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500		900	736	68,400	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500		1,890	1,517	140,866	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500		1,200	1,187	110,260	2034/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500		820	735	68,266	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000		1,610	1,350	125,353	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500		650	574	53,337	2035/06/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500		1,200	716	66,507	2051/06/21	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000		1,815	1,629	151,265	2026/09/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500		960	916	85,049	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500		1,230	1,183	109,875	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500		1,400	1,320	122,592	2029/11/21	
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000		1,170	1,084	100,627	2033/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500		1,850	1,542	143,147	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000		2,170	1,722	159,897	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500		1,360	1,244	115,518	2025/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500		1,990	1,878	174,356	2024/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000		1,670	1,360	126,286	2030/12/21	
小計	-	-		35,405	31,922	2,963,084	-	
<b>(シンガポール)</b>			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000		280	276	27,762	2024/02/01	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000		800	810	81,493	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500		500	482	48,469	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750		490	402	40,454	2050/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500		340	325	32,749	2042/04/01	
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250		420	410	41,263	2028/05/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750		780	764	76,828	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250		370	357	35,923	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750		590	580	58,381	2029/07/01	
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750		190	169	17,081	2039/07/01	
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250		350	310	31,180	2031/07/01	
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000		125	133	13,468	2072/08/01	
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500		590	528	53,119	2036/08/01	
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000		720	717	72,120	2024/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750		620	606	61,025	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750		330	335	33,709	2033/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750		200	198	19,950	2027/09/01	
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750		410	342	34,462	2051/10/01	
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500		410	382	38,467	2026/11/01	
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000		380	353	35,499	2025/11/01	
小計	-	-		8,895	8,486	853,411	-	
<b>(ニュージーランド)</b>			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000		700	704	59,147	2027/04/15	

銘柄	柄	当期					未	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(ニュージーランド)</b>			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円		
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	350	326	27,388	2033/04/14		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	330	269	22,671	2037/04/15		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	570	548	46,062	2025/04/15		
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	350	325	27,343	2029/04/20		
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	440	320	26,955	2051/05/15		
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	261	21,933	2041/05/15		
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	580	467	39,248	2031/05/15		
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	128	10,762	2034/05/15		
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	350	288	24,274	2032/05/15		
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	350	284	23,880	2028/05/15		
NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	国債証券	0.5000	650	616	51,759	2024/05/15		
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国債証券	0.5000	360	318	26,719	2026/05/15		
小計	—	—	5,560	4,858	408,149	—		
<b>(イギリス)</b>			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,140	1,024	165,561	2044/01/22		
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,450	1,349	218,056	2045/01/22		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	900	935	151,164	2060/01/22		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	630	407	65,817	2049/01/22		
UK TREASURY 3.75 01/29/38	国債証券	3.7500	400	393	63,654	2038/01/29		
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	1,670	895	144,822	2046/01/31		
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	760	511	82,633	2039/01/31		
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	2,370	1,911	308,921	2032/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,739	281,174	2024/01/31		
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	680	571	92,378	2029/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,040	886	143,227	2028/01/31		
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	2,400	2,245	362,991	2025/01/31		
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,150	1,048	169,427	2026/01/30		
UK TREASURY 4.125 01/29/27	国債証券	4.1250	800	815	131,800	2027/01/29		
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,095	1,127	182,246	2025/03/07		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,700	1,782	288,153	2036/03/07		
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	950	920	148,822	2024/04/22		
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,440	1,527	246,876	2032/06/07		
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,060	996	161,098	2025/06/07		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,000	616	99,579	2047/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,630	889	143,790	2051/07/31		
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	970	940	152,076	2052/07/22		
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	1,110	638	103,220	2053/07/31		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,130	685	110,865	2057/07/22		
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,250	922	149,098	2065/07/22		
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	930	882	142,612	2068/07/22		
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	1,100	1,033	167,081	2026/07/22		
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,600	1,461	236,203	2027/07/22		
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	900	686	111,006	2033/07/31		
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,770	1,352	218,668	2031/07/31		
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	1,350	936	151,303	2035/07/31		
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,260	1,311	211,965	2039/09/07		
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	810	798	129,072	2024/09/07		
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,190	1,150	185,901	2025/09/07		
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	900	971	157,087	2034/09/07		
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,390	1,066	172,392	2037/09/07		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	870	515	83,279	2054/10/22		

銘	柄	当 期				末	
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(イギリス)</b>			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5	10/22/61	国債証券	0.5000	1,460	511	82,741	2061/10/22
UK TREASURY 1.625	10/22/71	国債証券	1.6250	830	451	72,904	2071/10/22
UK TREASURY 1.125	10/22/73	国債証券	1.1250	740	317	51,393	2073/10/22
UK TREASURY 1.25	10/22/41	国債証券	1.2500	1,600	1,036	167,567	2041/10/22
UK TREASURY 0.625	10/22/50	国債証券	0.6250	450	202	32,747	2050/10/22
UK TREASURY 1.625	10/22/28	国債証券	1.6250	1,130	1,028	166,269	2028/10/22
UK TREASURY 0.875	10/22/29	国債証券	0.8750	2,260	1,922	310,711	2029/10/22
UK TREASURY 0.375	10/22/30	国債証券	0.3750	1,220	969	156,774	2030/10/22
UK TREASURY 0.375	10/22/26	国債証券	0.3750	1,390	1,244	201,133	2026/10/22
UK TREASURY 6.0	12/07/28	国債証券	6.0000	680	770	124,599	2028/12/07
UK TREASURY 4.75	12/07/38	国債証券	4.7500	980	1,080	174,681	2038/12/07
UK TREASURY 4.5	12/07/42	国債証券	4.5000	1,265	1,362	220,223	2042/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/46	国債証券	4.2500	1,080	1,122	181,458	2046/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/55	国債証券	4.2500	1,212	1,294	209,168	2055/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/27	国債証券	4.2500	910	944	152,599	2027/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/40	国債証券	4.2500	1,070	1,113	179,988	2040/12/07
UK TREASURY 4.75	12/07/30	国債証券	4.7500	1,395	1,521	245,866	2030/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/49	国債証券	4.2500	1,017	1,065	172,151	2049/12/07
小	計	—	—	65,284	55,908	9,037,014	—
<b>(イスラエル)</b>			%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5	01/31/42	国債証券	5.5000	1,090	1,342	50,386	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5	02/27/26	国債証券	0.5000	310	280	10,514	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75	03/31/47	国債証券	3.7500	2,090	2,078	78,013	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0	03/31/27	国債証券	2.0000	2,230	2,076	77,940	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75	03/31/24	国債証券	3.7500	1,320	1,311	49,247	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0	03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,380	89,364	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5	04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,749	65,680	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5	05/31/37	国債証券	1.5000	1,450	1,096	41,155	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75	08/31/25	国債証券	1.7500	2,300	2,176	81,698	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25	09/28/28	国債証券	2.2500	1,460	1,347	50,569	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25	10/30/26	国債証券	6.2500	220	237	8,917	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 0.4	10/31/24	国債証券	0.4000	320	300	11,286	2024/10/31
小	計	—	—	17,540	16,376	614,774	—
<b>(デンマーク)</b>			%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25	11/15/52	国債証券	0.2500	3,760	2,037	39,256	2052/11/15
DENMARK 4.5	11/15/39	国債証券	4.5000	7,860	9,812	189,081	2039/11/15
DENMARK 1.75	11/15/25	国債証券	1.7500	4,040	3,926	75,669	2025/11/15
DENMARK 0.5	11/15/27	国債証券	0.5000	6,350	5,749	110,795	2027/11/15
DENMARK 0.5	11/15/29	国債証券	0.5000	4,830	4,202	80,975	2029/11/15
DENMARK 0.0	11/15/31	国債証券	0.0000	4,180	3,337	64,317	2031/11/15
DENMARK 0.0	11/15/24	国債証券	0.0000	2,200	2,090	40,284	2024/11/15
小	計	—	—	33,220	31,156	600,381	—
<b>(ノルウェー)</b>			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5	02/19/26	国債証券	1.5000	4,480	4,252	55,831	2026/02/19
NORWAY 1.75	02/17/27	国債証券	1.7500	2,400	2,266	29,760	2027/02/17
NORWAY 3.0	03/14/24	国債証券	3.0000	2,370	2,358	30,962	2024/03/14
NORWAY 1.75	03/13/25	国債証券	1.7500	6,130	5,931	77,883	2025/03/13
NORWAY 2.0	04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,950	25,605	2028/04/26
NORWAY 2.125	05/18/32	国債証券	2.1250	1,980	1,805	23,710	2032/05/18
NORWAY 1.375	08/19/30	国債証券	1.3750	4,310	3,788	49,745	2030/08/19
NORWAY 1.75	09/06/29	国債証券	1.7500	2,620	2,396	31,459	2029/09/06



銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(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 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,650	2,260	29,686	2031/09/17
小 計	—	—	29,010	27,010	354,646	—
(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	3,420	3,860	50,146	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	2,890	2,632	34,192	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,120	6,057	78,681	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	5,420	4,469	58,060	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	2,654	34,482	2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	6,210	5,833	75,777	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,010	2,685	34,885	2029/11/12
小 計	—	—	29,770	28,193	366,227	—
(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	29,842	26,541	194,062	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	10,580	9,121	66,691	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	9,180	8,225	60,143	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	20,159	19,594	143,272	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,648	28,407	207,710	2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	5,790	5,244	38,343	2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,746	23,052	168,555	2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	6,290	5,645	41,276	2053/07/31
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	22,070	21,098	154,263	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	17,277	15,096	110,380	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	16,161	14,508	106,083	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,807	108,271	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,931	43,367	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	4,835	4,411	32,257	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	15,902	15,707	114,846	2024/12/05
小 計	—	—	234,607	217,394	1,589,526	—
(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 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	20,000	19,779	387,117	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	34,500	34,380	672,902	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	5,100	5,167	101,145	2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	10,997	215,235	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	12,000	12,005	234,970	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	14,320	14,442	282,676	2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	2,100	2,255	44,148	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	30,100	29,875	584,732	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	1,000	1,013	19,830	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	3,000	2,969	58,114	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,600	6,522	127,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,452	165,436	2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	7,500	7,549	147,767	2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	20,000	19,904	389,565	2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	450	460	9,015	2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	国債証券	2.1800	4,200	4,193	82,076	2024/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,256	396,471	2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	13,000	12,764	249,819	2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	30,000	29,770	582,671	2025/08/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	26,600	26,675	522,102	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	国債証券	3.5900	5,000	5,236	102,489	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	7,300	7,120	139,358	2032/09/01

銘	柄	当期					末
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(中国)</b>			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	15,300	15,328	300,017	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	国債証券	2.6200	17,500	17,269	338,002	2029/09/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	国債証券	1.9900	10,000	9,952	194,784	2024/09/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	18,950	19,723	386,034	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,600	15,727	307,828	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	国債証券	2.4400	11,000	10,892	213,183	2027/10/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	国債証券	2.8000	17,300	17,178	336,224	2032/11/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	4,100	4,107	80,384	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	国債証券	2.2800	14,800	14,705	287,825	2025/11/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	国債証券	2.7900	9,000	8,959	175,359	2029/12/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,500	3,608	70,632	2027/12/03	
小計	—	—	419,720	419,249	8,205,585	—	
<b>(マレーシア)</b>			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	600	606	18,376	2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	300	316	9,589	2046/03/15	
MALAYSIA 3.882 03/14/25	国債証券	3.8820	300	302	9,173	2025/03/14	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,050	1,077	32,645	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,200	1,253	37,974	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,660	1,632	49,455	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,700	1,806	54,730	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	913	27,676	2031/04/15	
MALAYSIA 4.504 04/30/29	国債証券	4.5040	300	312	9,471	2029/04/30	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	650	646	19,599	2027/05/31	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	1,500	1,413	42,811	2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	600	608	18,440	2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,004	60,726	2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	670	683	20,720	2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	620	672	20,372	2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,003	30,395	2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	400	377	11,430	2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,030	1,041	31,556	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	1,990	2,145	65,000	2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	920	931	28,222	2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,820	1,778	53,865	2034/07/05	
MALAYSIA 3.582 07/15/32	国債証券	3.5820	1,400	1,366	41,392	2032/07/15	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	700	702	21,286	2029/08/15	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,400	2,429	73,614	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,600	1,725	52,286	2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	900	909	27,561	2024/09/30	
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	1,200	1,272	38,537	2042/10/15	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,660	1,683	51,001	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	1,430	1,447	43,851	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	950	1,006	30,484	2033/11/07	
小計	—	—	33,550	34,072	1,032,254	—	
<b>(ポーランド)</b>			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,391	42,100	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,480	2,923	88,426	2028/04/25	
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,370	1,609	48,679	2032/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	780	748	22,634	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	3,370	2,995	90,600	2025/04/25	
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	1,450	1,303	39,438	2027/05/25	

銘	柄	当 期				末	
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(ポーランド)</b>			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,790	2,456	74,295	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,830	3,562	107,763	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,007	60,709	2027/07/25	
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	1,710	1,571	47,534	2024/07/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	630	504	15,259	2029/10/25	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	2,150	2,015	60,979	2024/10/25	
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	3,930	2,716	82,172	2030/10/25	
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,504	45,504	2026/10/25	
小 計	—	—	32,170	27,310	826,099	—	
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	840	678	97,320	2045/02/18	
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	360	321	46,147	2031/03/18	
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	240	241	34,614	2024/03/18	
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	850	893	128,106	2025/03/13	
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	159	22,810	2041/04/22	
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	580	402	57,806	2050/05/15	
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	390	331	47,564	2033/05/15	
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	590	574	82,454	2030/05/15	
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	610	555	79,654	2028/05/15	
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	659	94,564	2029/05/15	
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	950	899	129,077	2026/05/15	
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	350	292	41,922	2037/05/15	
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	270	38,782	2035/05/15	
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	520	467	67,011	2027/05/15	
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	870	679	97,428	2031/10/18	
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	400	314	45,125	2032/10/18	
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	550	451	64,775	2030/10/18	
小 計	—	—	9,450	8,192	1,175,166	—	
<b>(ユーロ…オランダ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,320	1,510	216,714	2042/01/15	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,540	1,567	224,837	2047/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,000	488	70,076	2052/01/15	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	780	881	126,470	2028/01/15	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,280	1,454	208,697	2037/01/15	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,110	1,087	156,000	2033/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	550	364	52,258	2038/01/15	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,110	775	111,308	2040/01/15	
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	360	313	44,992	2054/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,110	948	136,123	2029/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,080	972	139,514	2027/01/15	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	640	590	84,697	2026/01/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,420	1,317	189,022	2026/07/15	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,140	1,124	161,327	2024/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,490	1,402	201,127	2025/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,240	1,121	160,908	2028/07/15	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,160	1,068	153,227	2027/07/15	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,060	911	130,746	2029/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	575	82,581	2030/07/15	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,200	960	137,748	2031/07/15	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	200	163	23,462	2032/07/15	
小 計	—	—	21,490	19,601	2,811,844	—	

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000		1,570	1,769	253,826	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500		1,280	1,440	206,696	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000		1,070	1,122	161,070	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000		630	678	97,342	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000		1,220	1,440	206,598	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500		810	684	98,207	2033/04/22	
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500		220	205	29,452	2039/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500		740	787	112,920	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000		780	556	79,875	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000		980	697	100,014	2050/06/22	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000		710	453	65,042	2053/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500		390	307	44,168	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500		450	342	49,111	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500		670	275	39,451	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000		1,030	971	139,373	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000		840	834	119,770	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000		1,570	1,348	193,449	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000		1,010	909	130,468	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000		450	278	40,016	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000		1,430	1,272	182,594	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000		680	670	96,134	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000		610	510	73,245	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000		1,980	1,888	270,861	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000		960	881	126,503	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500		380	302	43,460	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000		1,300	1,066	153,048	2030/06/22	
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500		600	471	67,607	2032/06/22	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000		750	720	103,373	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000		940	728	104,517	2031/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000		580	509	73,051	2027/10/22	
小計	-	-		26,630	24,128	3,461,253	-	
<b>(ユーロ…フランス)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000		2,450	2,192	314,456	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000		2,910	2,672	383,300	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000		1,220	1,183	169,796	2024/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000		1,990	1,876	269,117	2025/02/25	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500		1,980	1,789	256,749	2028/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000		3,020	2,923	419,317	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000		3,320	3,122	447,954	2025/03/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000		3,000	3,058	438,763	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000		2,640	3,099	444,621	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000		1,530	1,756	252,027	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000		1,170	1,372	196,903	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000		3,880	4,463	640,344	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500		1,930	2,252	323,055	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500		2,470	2,486	356,634	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000		1,950	1,548	222,122	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000		2,470	1,719	246,634	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500		2,040	1,112	159,652	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500		1,950	1,038	148,975	2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500		990	678	97,377	2066/05/25	

銘柄	当	期				末		
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額			邦貨換算金額
<b>(ユーロ…フランス)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	303	43,504		2072/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	2,500	2,475	355,131		2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,550	4,467	640,891		2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,110	4,602	660,267		2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,480	3,152	452,258		2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	4,230	4,008	574,961		2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,123	448,037		2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,860	2,380	341,450		2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	3,460	3,210	460,508		2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,360	2,191	314,327		2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,650	1,065	152,893		2040/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	3,190	2,551	365,992		2036/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	500	384	55,135		2038/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	250	222	31,949		2043/05/25	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,290	1,757	252,091		2032/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,070	1,706	244,852		2039/06/25	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,150	680	97,578		2044/06/25	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,340	335,802		2025/10/25	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,890	3,882	556,952		2027/10/25	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,940	2,134	306,132		2038/10/25	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,510	3,108	445,887		2032/10/25	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,330	334,287		2024/11/25	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,606	373,927		2025/11/25	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,620	2,382	341,795		2026/11/25	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	3,400	3,033	435,169		2028/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,270	2,556	366,670		2031/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	3,780	3,048	437,298		2030/11/25	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	1,600	1,476	211,757		2032/11/25	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,890	2,399	344,241		2029/11/25	
小計	-	-	120,130	109,930	15,769,556	-		
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,493	214,254		2028/01/04	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	780	965	138,430		2030/01/04	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,520	1,847	265,041		2031/01/04	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,830	2,144	307,667		2037/01/04	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,900	1,815	260,429		2025/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	2,660	2,496	358,117		2026/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	2,080	1,828	262,241		2029/02/15	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,940	1,761	252,687		2028/02/15	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,430	1,413	202,749		2024/02/15	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,120	1,937	277,926		2027/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,840	1,521	218,263		2031/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,900	2,340	335,782		2032/02/15	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	2,620	2,215	317,775		2030/02/15	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,500	1,455	208,741		2024/03/15	
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,260	1,220	175,013		2024/04/05	
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,498	214,963		2025/04/11	
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	2,110	1,943	278,846		2026/04/10	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,360	1,224	175,662		2027/04/16	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,520	1,493	214,299		2024/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,660	1,223	175,440		2035/05/15	

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	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	350	282	40,482	2038/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,580	1,133	162,637	2036/05/15
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	国債証券	0.2000	1,250	1,206	173,032	2024/06/14
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	850	985	141,339	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	560	622	89,277	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,700	2,093	300,283	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,480	212,336	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,070	2,084	298,951	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,410	1,847	265,047	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,820	2,227	319,477	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,170	2,205	316,314	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	1,040	525	75,360	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	500	434	62,328	2053/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,430	1,914	274,671	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,317	332,464	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,910	1,749	250,924	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,980	1,810	259,750	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,770	1,570	225,347	2028/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,820	1,770	253,925	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,990	1,702	244,286	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	2,230	1,182	169,652	2050/08/15
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	1,430	1,342	192,628	2032/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,190	1,789	256,743	2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	710	376	54,038	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,430	2,032	291,544	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	590	494	70,887	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	800	654	93,934	2031/08/15
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	国債証券	0.4000	900	865	124,202	2024/09/13
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,590	1,516	217,554	2024/10/18
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,360	1,238	177,641	2026/10/09
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,750	1,630	233,851	2025/10/10
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,880	1,780	255,344	2027/10/15
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	450	419	60,243	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,440	206,670	2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,060	1,792	257,198	2028/11/15
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	800	781	112,076	2029/11/15
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	国債証券	2.2000	1,350	1,333	191,285	2024/12/12
小 計	-	-	91,020	84,475	12,118,072	-
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,460	1,682	241,329	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,200	1,219	174,885	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,400	1,480	212,407	2037/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	2,050	1,932	277,228	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,610	1,426	204,579	2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	996	142,881	2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,960	1,789	256,768	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,580	226,690	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,470	1,483	212,736	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,210	2,073	297,511	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,330	1,284	184,311	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,170	1,073	153,970	2028/04/30

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,400	1,266	181,616	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,550	1,226	176,010	2032/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,500	1,242	178,240	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,380	1,066	153,023	2031/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	1,110	1,068	153,206	2024/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	670	624	89,589	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,630	1,778	255,064	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,290	1,477	211,882	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,630	1,834	263,149	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,020	146,328	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,135	1,176	168,776	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,620	232,436	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,815	2,167	310,970	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,470	1,325	190,206	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	250	236	33,860	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,510	1,380	198,013	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,840	1,521	218,249	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,080	1,037	148,864	2024/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	408	58,668	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	336	48,220	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,750	1,580	226,787	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	700	603	86,557	2029/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,190	2,180	312,749	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,830	2,014	288,987	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,458	209,176	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,026	147,252	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,190	983	141,024	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	670	439	63,062	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	410	196	28,229	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,590	846	121,393	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,010	1,964	281,833	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,560	1,448	207,740	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,730	1,625	233,239	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,530	1,295	185,780	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,640	1,294	185,709	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,597	229,206	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,260	845	121,305	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,750	1,514	217,197	2030/10/31
小計	-	-	69,860	64,753	9,288,912	-
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,310	1,181	169,475	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	300	300	43,125	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,460	1,635	234,590	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	2,170	2,094	300,422	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,350	1,249	179,236	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,800	1,697	243,575	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,475	211,666	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,500	1,231	176,723	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,090	825	118,364	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,190	1,025	147,101	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,710	1,729	248,084	2024/03/01

銘柄	当	期				末		
		種	利	額	評		償	
					面			額
類	率	金	額	外	年			
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	700	485	69,607	2067/03/01		
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	209	30,091	2072/03/01		
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	560	577	82,809	2025/03/01		
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,910	1,963	281,716	2026/03/01		
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,790	1,466	210,341	2032/03/01		
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	2,350	1,981	284,218	2040/03/01		
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,020	922	132,392	2035/03/01		
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,870	1,828	262,352	2030/03/01		
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,120	805	115,517	2036/03/01		
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	785	112,672	2041/03/01		
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,080	705	101,182	2037/03/01		
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	522	74,992	2038/03/01		
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,229	176,429	2028/03/15		
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	660	637	91,495	2035/04/30		
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	810	486	69,716	2045/04/30		
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,306	187,389	2030/04/01		
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,610	1,268	181,937	2031/04/01		
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,400	1,348	193,479	2024/04/15		
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	550	540	77,564	2028/04/01		
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	1,520	1,363	195,585	2026/04/01		
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,100	996	142,922	2027/04/01		
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,480	2,836	406,842	2031/05/01		
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	990	972	139,517	2024/05/15		
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,280	1,228	176,239	2025/05/15		
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	200	201	28,948	2033/05/01		
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,350	1,271	182,328	2026/06/01		
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,400	200,836	2025/06/01		
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,290	1,219	175,002	2027/06/01		
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,380	1,048	150,371	2032/06/01		
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,129	162,052	2029/06/15		
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,290	1,231	176,614	2026/07/15		
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,174	168,428	2024/07/01		
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	927	133,115	2028/07/15		
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,196	171,670	2025/07/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,660	1,757	252,057	2034/08/01		
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,170	1,246	178,813	2039/08/01		
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,500	1,404	201,465	2027/08/01		
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,610	1,535	220,254	2029/08/01		
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,520	1,150	165,069	2031/08/01		
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,090	156,378	2030/08/01		
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国債証券	0.0000	1,460	1,389	199,277	2024/08/15		
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,287	184,674	2025/08/15		
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,250	1,108	159,050	2026/08/01		
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,810	1,525	218,828	2038/09/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,110	1,156	165,911	2044/09/01		
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,180	986	141,559	2046/09/01		
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	1,765	253,286	2028/09/01		
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,250	1,337	191,918	2040/09/01		
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,150	806	115,658	2050/09/01		
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,020	595	85,400	2051/09/01		
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,126	161,584	2033/09/01		



銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	510	326	46,792	2052/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,620	1,628	233,638	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	850	776	111,363	2049/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	860	680	97,558	2036/09/01	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,493	214,269	2027/09/15	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	350	395	56,749	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,510	1,698	243,685	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	2,140	2,329	334,212	2029/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	680	658	94,459	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,350	1,317	188,940	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	1,660	1,596	228,985	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,530	1,406	201,823	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,637	1,613	231,494	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,740	1,656	237,564	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500	1,700	1,312	188,276	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,740	1,470	210,955	2030/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,340	1,161	166,670	2032/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500	800	795	114,082	2029/12/15	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券	0.0000	1,360	1,279	183,569	2024/12/15	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500	1,220	1,165	167,238	2027/12/01	
小計	—	—	106,807	97,750	14,022,270	—	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250	320	148	21,335	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	370	366	52,545	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	200	168	24,206	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	390	286	41,101	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	460	429	61,648	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	480	392	56,370	2034/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000	380	235	33,842	2043/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	290	197	28,384	2036/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750	110	103	14,905	2027/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	410	422	60,548	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	490	488	70,016	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	430	404	57,984	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	300	257	36,986	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	350	333	47,855	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	550	483	69,295	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	420	379	54,371	2027/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	290	178	25,651	2040/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000	50	43	6,298	2032/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250	300	236	33,990	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000	210	168	24,221	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券	0.0000	410	392	56,286	2024/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000	430	388	55,752	2026/09/15	
小計	—	—	7,640	6,508	933,600	—	
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000	240	279	40,061	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	640	471	67,598	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	920	799	114,719	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	835	754	108,210	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000	710	561	80,597	2031/02/20	

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・オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	900	751	107,806	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	930	759	108,894	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	710	753	108,052	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	990	1,106	158,759	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	590	340	48,873	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	210	94	13,571	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,070	974	139,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	580	544	78,164	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	770	720	103,422	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	290	228	32,749	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	127	18,336	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	540	545	78,195	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	415	472	67,713	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	520	499	71,615	2024/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	160	155	22,342	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	285	40,901	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	930	910	130,642	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,190	1,104	158,454	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	940	902	129,412	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	380	259	37,176	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	258	37,104	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	570	484	69,568	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	16,225	2086/11/02
小 計	—	—	17,370	15,259	2,188,922	—
合 計	—	—	—	—	185,001,333	—

## ■投資信託財産の構成

2023年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 185,001,333	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,186,068	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	188,187,402	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、186,640,391千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.32円、1カナダ・ドル=99.80円、1オーストラリア・ドル=92.82円、1シンガポール・ドル=100.56円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=161.64円、1イスラエル・シェケル=37.54円、1デンマーク・クローネ=19.27円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.311円、1オフショア・人民元=19.572円、1マレーシア・リンギット=30.295円、1ポーランド・ズロチ=30.248円、1ユーロ=143.45円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産 等	188,187,402,199円
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,927,378,048
公 社 債(評価額)	185,001,333,837
未 収 利 息	1,090,149,276
前 払 費 用	168,541,038
(B) 負 債	1,365,031,536
未 払 金	1,352,244,536
未 払 解 約 金	12,787,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	186,822,370,663
元 本	92,568,430,085
次 期 繰 越 損 益	94,253,940,578
(D) 受 益 権 総 口 数	92,568,430,085口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,182円

(注1) 期首元本額	70,448,298,510円
追加設定元本額	63,457,547,851円
一部解約元本額	41,337,416,276円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,063,618,127円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,664,534円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,013,145円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	61,798,332円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	61,093,331円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,637,226円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	48,023,427円
たわらノーロード 先進国債券	17,008,425,615円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	245,317,778円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,489,017,308円
たわらノーロード バランス (堅実型)	65,360,184円
たわらノーロード バランス (標準型)	335,170,560円
たわらノーロード バランス (積極型)	71,793,070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)	16,208,215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)	982,389,497円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	1,586,938,015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)	725,563,344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)	429,869,427円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	2,046,942円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,848,744円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	179,191,650円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	14,908,588円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	24,576,579円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,613,575,783円
One DC 先進国債券インデックスファンド	837,273,305円
Oneグローバルバランス	18,428,191円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	743,440,279円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,368,236,637円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,625,122,028円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	419,973,327円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	846,255,978円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	741,934,563円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	512,673,651円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	36,330,259円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	146,595,885円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	150,866,647円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	231,293,861円
グループコントロール	895,480,870円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	600,448,211円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	610,839,468円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,820,147円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	318,874,880円

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220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)	259,574,682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)	265,741,005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)	128,786,227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)	162,358,218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)	256,453,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定)	618,270,983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・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	198,620,020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)	231,445,712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・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	208,546,866円
D I A M海替フルレンジ外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,554,465,372円
D I A M外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,585,064,790円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,555,775,823円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,282,640,293円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,242,436円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	49,166,703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)	442,107,851円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	362,944,405円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	238,451,787円
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,931,845円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,911,489円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,822,125円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	49,876円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	14,713,798円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	43,966,666円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,620,938,828円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,399,685,001円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,546,932,927円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	65,747,358円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	124,222,256円
D I A Mアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,489,912,024円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	300,752,649円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	163,842円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	305,817,896円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	273,773,162円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	379,947,236円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	46,662,175円
動的パッケージファンド<DC年金>	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
M H A M外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	756,300,586円
M H A M外国債券インデックスファンド<海替ヘッジあり> (ファンドラップ)	514,130,947円
M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	7,052,612,220円
M H A M外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,364,933,377円
期末元本合計	92,568,430,085円

## ■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,630,658,528	円
	受取利息	3,630,482,398	
	その他の収益	573,045	
	支払利息	△396,915	
(B)	有価証券売買損益	△4,048,984,550	
	売買益	22,763,661,538	
	売買損	△26,812,646,088	
(C)	その他の費用	△27,916,414	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△446,242,436	
(E)	前期繰越損益金	71,516,620,489	
(F)	解約差損益金	△44,647,207,624	
(G)	追加信託差損益金	67,830,770,149	
(H)	計(D+E+F+G)	94,253,940,578	
	次期繰越損益金(H)	94,253,940,578	

(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17期 (決算日 2023年2月20日)

(計算期間 2022年2月22日～2023年2月20日)

インデックス225 マザーファンドの第17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			
13期(2019年2月20日)	円	%	円	%	%	%	百万円
	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
17期(2023年2月20日)	22,882	4.6	27,531.94	2.3	97.4	2.6	130,473

(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）。

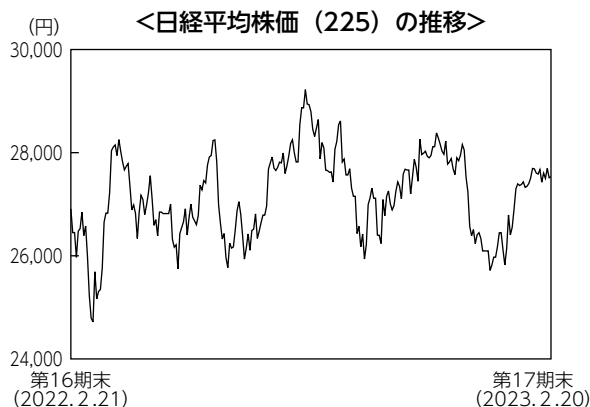
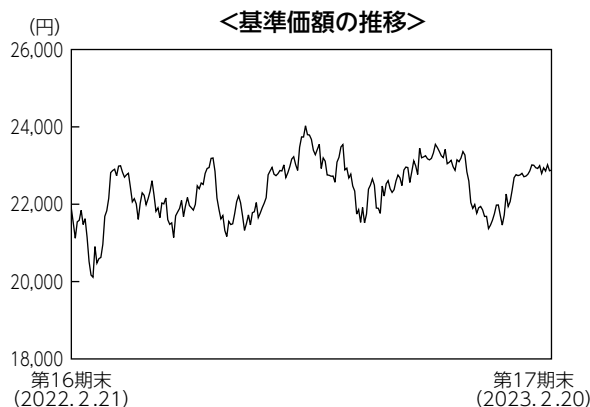
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 2 月 21 日	円 21,886	% -	円 26,910.87	% -	% 98.3	% 1.6
2 月 末	21,585	△1.4	26,526.82	△1.4	97.9	2.1
3 月 末	22,827	4.3	27,821.43	3.4	97.2	2.7
4 月 末	22,031	0.7	26,847.90	△0.2	97.5	2.3
5 月 末	22,401	2.4	27,279.80	1.4	96.9	2.6
6 月 末	21,702	△0.8	26,393.04	△1.9	97.6	2.4
7 月 末	22,860	4.5	27,801.64	3.3	98.4	1.5
8 月 末	23,112	5.6	28,091.53	4.4	97.9	2.1
9 月 末	21,517	△1.7	25,937.21	△3.6	97.3	2.7
10 月 末	22,884	4.6	27,587.46	2.5	97.5	2.5
11 月 末	23,206	6.0	27,968.99	3.9	98.1	1.9
12 月 末	21,686	△0.9	26,094.50	△3.0	97.5	2.5
2023年 1 月 末	22,711	3.8	27,327.11	1.5	98.4	1.5
(期 末) 2023年 2 月 20 日	22,882	4.6	27,531.94	2.3	97.4	2.6

(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（2022年2月22日から2023年2月20日まで）



### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は22,882円（1万口あたり）となり、前期末比で4.6%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

国内株式市場は、期初から2022年3月中旬にかけ、新型コロナウイルス新規感染者数の拡大、世界的な金融引き締めへの警戒感やロシアのウクライナ侵攻などを受けて下落基調で推移しました。その後、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。期末にかけては、インフレ鈍化期待の高まりを受けた米株高を好感し、国内株も戻り歩調を辿りました。

### 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2.3%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.3%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)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は22,398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 (2022年2月22日から2023年2月20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
		6,595.8 (390.8)	28,219,567 (-)	7,397	30,404,016

(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 73,572	百万円 72,474	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

## ■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	58,623,583千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	123,633,591千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.47

(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2月22日から2023年2月20日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 28,219	百万円 -	% -	百万円 30,404	百万円 36	% 0.1
株 式 先 物 取 引	73,572	73,572	100.0	72,474	72,474	100.0
金 銭 信 託	0.193939	0.193939	100.0	0.193939	0.193939	100.0

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 5	百万円 6	百万円 33

### (3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,778千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1,778千円
(B) / (A)	100.0%

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

## ■組入資産の明細

### (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株数	株数	評 価	額
	千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
ニッスイ	164	158	85,952	
マルハニチロ	16.4	—	—	
<b>鉱業 (0.1%)</b>				
INPEX	65.6	63.2	90,123	
<b>建設業 (1.7%)</b>				
コムシスホールディングス	164	158	392,788	
大成建設	32.8	31.6	138,250	
大林組	164	158	154,524	
清水建設	164	158	115,814	
長谷工コーポレーション	32.8	31.6	48,632	
鹿島建設	82	79	126,953	
大和ハウス工業	164	158	492,012	
積水ハウス	164	158	402,189	
日揮ホールディングス	164	158	277,764	
<b>食料品 (3.5%)</b>				
日清製粉グループ本社	164	158	246,638	
明治ホールディングス	32.8	31.6	202,872	
日本ハム	82	79	297,830	
サッポロホールディングス	32.8	31.6	99,066	
アサヒグループホールディングス	164	158	744,338	
キリンホールディングス	164	158	317,027	
宝ホールディングス	164	158	168,586	
キッコーマン	164	158	1,030,160	
味の素	164	158	651,434	
ニチレイ	82	79	214,880	
日本たばこ産業	164	158	440,583	
<b>繊維製品 (0.1%)</b>				
東洋紡	16.4	15.8	16,542	
ユニチカ	16.4	—	—	
帝人	32.8	31.6	45,788	
東レ	164	158	126,700	
<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>				
王子ホールディングス	164	158	85,004	
日本製紙	16.4	15.8	15,910	
<b>化学 (7.1%)</b>				
クラレ	164	158	191,022	
旭化成	164	158	150,747	
レゾナック・ホールディングス	16.4	15.8	36,482	
住友化学	164	158	75,366	
日産化学	164	158	930,620	
東ソー	82	79	141,094	
トクヤマ	32.8	31.6	66,865	
デンカ	32.8	31.6	93,030	
信越化学工業	164	158	3,035,180	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株数	株数	評 価	額
	千株	千株	千円	
三井化学	32.8	31.6	102,700	
三菱ケミカルグループ	82	79	64,187	
UBE	16.4	15.8	32,690	
花王	164	158	808,328	
DIC	16.4	15.8	38,378	
富士フィルムホールディングス	164	158	1,014,202	
資生堂	164	158	972,174	
日東電工	164	158	1,325,620	
<b>医薬品 (7.4%)</b>				
協和キリン	164	158	464,994	
武田薬品工業	164	158	673,554	
アステラス製薬	820	790	1,489,940	
住友ファーマ	164	158	137,144	
塩野義製薬	164	158	973,280	
中外製薬	492	474	1,692,180	
エーザイ	164	158	1,234,138	
第一三共	492	474	2,027,298	
大塚ホールディングス	164	158	657,912	
<b>石油・石炭製品 (0.2%)</b>				
出光興産	65.6	63.2	194,340	
ENEOSホールディングス	164	158	73,090	
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>				
横浜ゴム	82	79	192,839	
ブリヂストン	164	158	825,076	
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>				
AGC	32.8	31.6	157,368	
日本板硝子	16.4	15.8	10,996	
日本電気硝子	49.2	47.4	117,978	
住友大阪セメント	16.4	15.8	60,514	
太平洋セメント	16.4	15.8	38,868	
東海カーボン	164	158	205,084	
TOTO	82	79	361,030	
日本碍子	164	158	283,452	
<b>鉄鋼 (0.1%)</b>				
日本製鉄	16.4	15.8	48,932	
神戸製鋼所	16.4	15.8	14,062	
JFEホールディングス	16.4	15.8	27,571	
大平洋金属	16.4	15.8	31,394	
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>				
日本軽金属ホールディングス	16.4	15.8	22,878	
三井金属鉱業	16.4	15.8	53,483	
東邦亜鉛	16.4	15.8	32,927	
三菱マテリアル	16.4	15.8	33,843	
住友金属鉱山	82	79	411,037	
DOWAホールディングス	32.8	31.6	142,674	

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	
古河電気工業	16.4	15.8	38,346	
住友電気工業	164	158	263,781	
フジクラ	164	158	152,628	
<b>金属製品 (0.0%)</b>				
SUMCO	16.4	15.8	29,593	
<b>機械 (5.7%)</b>				
日本製鋼所	32.8	31.6	82,950	
オークマ	32.8	31.6	165,584	
アマダ	164	158	189,442	
SMC	-	15.8	1,057,652	
小松製作所	164	158	522,506	
住友重機械工業	32.8	31.6	93,093	
日立建機	164	158	492,170	
クボタ	164	158	329,588	
荏原製作所	32.8	31.6	176,644	
ダイキン工業	164	158	3,689,300	
日本精工	164	158	117,868	
NTN	164	158	53,404	
ジェイテクト	164	158	160,844	
三井E&Sホールディングス	16.4	15.8	6,746	
日立造船	32.8	31.6	28,313	
三菱重工業	16.4	15.8	79,726	
IHI	16.4	15.8	57,354	
<b>電気機器 (23.5%)</b>				
コニカミノルタ	164	158	95,116	
ミネベアミツミ	164	158	376,198	
日立製作所	32.8	31.6	222,780	
三菱電機	164	158	244,821	
富士電機	32.8	31.6	165,268	
安川電機	164	158	813,700	
日本電産	-	126.4	876,204	
オムロン	164	158	1,143,762	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32.8	31.6	78,336	
日本電気	16.4	15.8	75,524	
富士通	16.4	15.8	276,658	
沖電気工業	16.4	-	-	
セイコーエプソン	328	316	591,868	
パナソニック ホールディングス	164	158	186,519	
シャープ	164	158	154,366	
ソニーグループ	164	158	1,807,520	
TDK	492	474	2,156,700	
アルプスアルパイン	164	158	225,150	
横河電機	164	158	327,218	
アドバンテスト	328	316	3,182,120	
キーエンス	16.4	15.8	920,350	
カシオ計算機	164	158	213,616	
ファナック	164	158	3,586,600	

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	
京セラ	328	316	2,113,724	
太陽誘電	164	158	661,230	
村田製作所	131.2	126.4	935,739	
SCREENホールディングス	32.8	31.6	326,428	
キャノン	246	237	701,638	
リコー	164	158	168,428	
東京エレクトロン	164	158	7,185,840	
<b>輸送用機器 (4.6%)</b>				
デンソー	164	158	1,166,988	
川崎重工業	16.4	15.8	47,795	
日産自動車	164	158	82,823	
いすゞ自動車	82	79	129,639	
トヨタ自動車	820	790	1,502,975	
日野自動車	164	158	90,376	
三菱自動車工業	16.4	15.8	8,405	
マツダ	32.8	31.6	36,972	
本田技研工業	328	316	1,093,360	
スズキ	164	158	754,766	
SUBARU	164	158	347,284	
ヤマハ発動機	164	158	533,250	
<b>精密機器 (4.1%)</b>				
テルモ	656	632	2,341,560	
ニコン	164	158	204,452	
オリンパス	656	632	1,450,440	
HOYA	-	79	1,059,390	
シチズン時計	164	158	131,930	
<b>その他製品 (2.7%)</b>				
パンダイナムコホールディングス	164	158	1,354,850	
凸版印刷	82	79	189,758	
大日本印刷	82	79	287,560	
ヤマハ	164	158	782,890	
任天堂	16.4	158	863,312	
<b>電気・ガス業 (0.2%)</b>				
東京電力ホールディングス	16.4	15.8	7,584	
中部電力	16.4	15.8	22,910	
関西電力	16.4	15.8	20,903	
東京瓦斯	32.8	31.6	84,719	
大阪瓦斯	32.8	31.6	67,845	
<b>陸運業 (1.4%)</b>				
東武鉄道	32.8	31.6	94,958	
東急	82	79	128,849	
小田急電鉄	82	79	129,481	
京王電鉄	32.8	31.6	148,520	
京成電鉄	82	79	305,730	
東日本旅客鉄道	16.4	15.8	109,099	
西日本旅客鉄道	16.4	15.8	83,424	
東海旅客鉄道	16.4	15.8	241,740	

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	164	158	368,298	
NIPPON EXPRESSホールディングス	16.4	15.8	121,028	
<b>海運業 (0.4%)</b>				
日本郵船	16.4	47.4	157,794	
商船三井	16.4	47.4	162,108	
川崎汽船	16.4	47.4	154,050	
<b>空運業 (0.0%)</b>				
ANAホールディングス	16.4	15.8	44,445	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
三菱倉庫	82	79	246,085	
<b>情報・通信業 (11.3%)</b>				
ネクソン	328	316	970,120	
Zホールディングス	65.6	63.2	24,205	
トレンドマイクロ	164	158	1,027,000	
日本電信電話	65.6	63.2	251,030	
KDDI	984	948	3,828,972	
ソフトバンク	164	158	242,135	
東宝	16.4	15.8	74,734	
エヌ・ティ・ティ・データ	820	790	1,487,570	
コナミグループ	164	158	989,080	
ソフトバンクグループ	984	948	5,431,092	
<b>卸売業 (2.8%)</b>				
双日	16.4	15.8	40,700	
伊藤忠商事	164	158	649,064	
丸紅	164	158	277,843	
豊田通商	164	158	881,640	
三井物産	164	158	617,464	
住友商事	164	158	373,117	
三菱商事	164	158	738,650	
<b>小売業 (12.0%)</b>				
J. フロント リテイリング	82	79	101,436	
三越伊勢丹ホールディングス	164	158	222,938	
セブン&アイ・ホールディングス	164	158	969,172	
高島屋	82	79	150,416	
丸井グループ	164	158	326,428	
イオン	164	158	412,933	
ファーストリテイリング	164	158	13,061,860	
<b>銀行業 (0.7%)</b>				
しずおかフィナンシャルグループ	-	158	175,222	
コンソルディア・フィナンシャルグループ	164	158	90,376	
SBI新生銀行	16.4	-	-	
あおぞら銀行	16.4	15.8	41,885	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	164	158	157,731	
りそなホールディングス	16.4	15.8	11,911	
三井住友トラスト・ホールディングス	16.4	15.8	78,383	
三井住友フィナンシャルグループ	16.4	15.8	94,800	
千葉銀行	164	158	156,420	

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	32.8	31.6	97,802	
静岡銀行	164	-	-	
みずほフィナンシャルグループ	16.4	15.8	33,891	
<b>証券・商品先物取引業 (0.3%)</b>				
大和証券グループ本社	164	158	101,752	
野村ホールディングス	164	158	89,396	
松井証券	164	158	127,190	
<b>保険業 (0.9%)</b>				
SOMPOホールディングス	32.8	31.6	183,153	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	49.2	47.4	211,261	
第一生命ホールディングス	16.4	15.8	46,831	
東京海上ホールディングス	82	237	679,360	
T&Dホールディングス	32.8	31.6	68,414	
<b>その他金融業 (0.8%)</b>				
クレディセゾン	164	158	288,192	
オリックス	-	158	383,387	
日本取引所グループ	164	158	310,707	
<b>不動産業 (1.1%)</b>				
東急不動産ホールディングス	164	158	100,962	
三井不動産	164	158	392,709	
三菱地所	164	158	258,804	
東京建物	82	79	125,847	
住友不動産	164	158	489,800	
<b>サービス業 (4.4%)</b>				
エムスリー	393.6	379.2	1,253,256	
ディー・エヌ・エー	49.2	47.4	85,177	
電通グループ	164	158	688,880	
サイバーエージェント	131.2	126.4	151,680	
楽天グループ	164	158	109,178	
リクルートホールディングス	492	474	1,805,466	
日本郵政	164	158	192,681	
セコム	164	158	1,244,250	
合 計	株 数 ・ 金 額	30,651.6	30,241.2	127,034,597
	銘柄数 < 比率 >	225銘柄	225銘柄	< 97.4% >

(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 3,412		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2023年2月20日現在

項 目		当 期		末
		評 価 額	比 率	
株 式		千円 127,034,597		% 97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		3,762,330		2.9
投 資 信 託 財 産 総 額		130,796,928		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

(2023年2月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	130,787,855,289円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,382,768,689
株 式(評価額)	127,034,597,520
未 収 入 金	12,409,080
未 収 配 当 金	211,880,000
差 入 委 託 証 拠 金	146,200,000
(B) 負 債	314,059,000
未 払 解 約 金	314,059,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	130,473,796,289
元 本	57,021,132,315
次 期 繰 越 損 益 金	73,452,663,974
(D) 受 益 権 総 口 数	57,021,132,315口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,882円

## ■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,714,728,243円
受 取 配 当 金	2,715,532,360
受 取 利 息	22,555
そ の 他 収 益	147,965
支 払 利 息	△974,637
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,998,126,587
売 買 益	10,721,704,842
売 買 損	△6,723,578,255
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	212,471,960
取 引 益	1,292,525,900
取 引 損	△1,080,053,940
(D) そ の 他 費 用	△1
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	6,925,326,789
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	69,175,399,253
(G) 解 約 差 損 益 金	△25,608,265,777
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	22,960,203,709
(I) 合 計(E+F+G+H)	73,452,663,974
次 期 繰 越 損 益 金(I)	73,452,663,974

(注1) 期首元本額 58,198,132,946円  
追加設定元本額 18,933,637,291円  
一部解約元本額 20,110,637,922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)	3,051,800,365円
(適格機関投資家私募) インデックス225 マルチアセット・アロケーション戦略ファンド (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募)	1,207,871,918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)	371,181,703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)	35,830,501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)	59,695,443円
たわらノーロード 日経225	34,491,819,139円
DIAMバランス・インカム・オープン (毎月分配型)	18,989,535円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	269,442,807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)	195,131,369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)	41,460,248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)	41,715,826円
DIAM日経225インデックスファンドVA	836,293,603円
国内株式パッシブ・ファクター日経 225型- (適格機関投資家向け)	4,343,100,287円
DIAM日経225型パッシブ・ファンド (適格機関投資家向け)	3,483,947,801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)	36,634,615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)	30,625,965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)	67,600,610円
MHAM日経225インデックスファンド [適格機関投資家限定]	6,017,605,205円
MHAMインデックス225 [適格機関投資家限定]	2,420,385,375円
期末元本合計	57,021,132,315円

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

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

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

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■第22条（信託業務の委託等）の付表「I.外国での保管会社」を削除しました。

(2023年2月11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	騰落率	ポイント	騰落率		
11期(2018年6月22日)	11,979	1.8	120,101.82	2.4	99.3	53,148
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	47,410
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	78,959
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）。

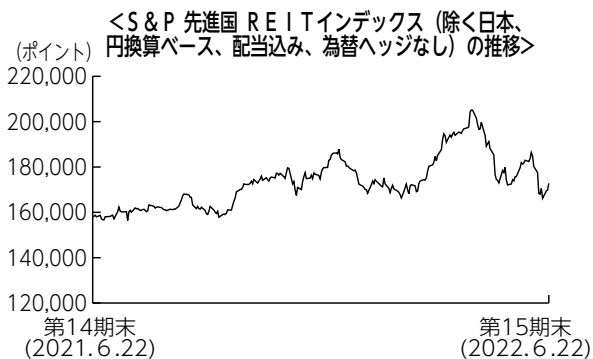
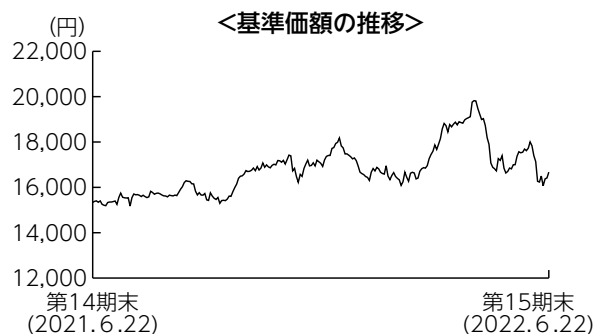


## ■当期中の基準価額と市況の推移

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
<b>アメリカ</b>	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
<b>アメリカ</b>	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
<b>アメリカ</b>	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
<b>アメリカ</b>	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 (-)
<b>カナダ</b>	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
<b>カナダ</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
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
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
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 (-)
<b>香港</b>	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
<b>香港</b>	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 (-)
<b>シンガポール</b>	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	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
<b>シンガポール</b>	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
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)	(-)	(-)
<b>ニュージーランド</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	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
<b>イスラエル</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>韓国</b>	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)	(-)	(-)
<b>ユーロ (シンガポール)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	313.4	747	343.8	820
	(-)	(△3)	(-)	(-)
<b>ユーロ (アイルランド)</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (オランダ)</b>	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
<b>ユーロ (オランダ)</b>	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)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	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)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (ドイツ)</b>	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
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (スペイン)</b>	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
<b>ユーロ (スペイン)</b>	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 (-)
<b>ユーロ (イタリア)</b>	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		%
<b>不動産ファンド (アメリカ)</b>							
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			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	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	
<b>(アメリカ)</b>		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
<b>(カナダ)</b>		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
<b>(オーストラリア)</b>		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	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千円	千口	千円	千口	%
GOODMAN GROUP	789.54	523.576	523.576	9,178	869,275	1.6
VICINITY CENTRES	1,826.547	1,193.493	1,193.493	2,243	212,507	0.4
CHARTER HALL GROUP	220.887	145.638	145.638	1,625	153,934	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	136.67	96.915	96.915	332	31,483	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	513.792	341.231	341.231	934	88,551	0.2
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	212.974	162.422	162.422	469	44,456	0.1
ARENA REIT	159.242	103.753	103.753	422	39,993	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	260.875	186.309	186.309	806	76,404	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	73.145	63.933	63.933	172	16,348	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	516.215	329.249	329.249	740	70,162	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73.965	65.661	65.661	206	19,589	0.0
GDI PROPERTY GROUP	247.876	178.986	178.986	170	16,104	0.0
HOME CONSORTIUM LTD	85.98	-	-	-	-	-
RURAL FUNDS GROUP	160.193	126.29	126.29	334	31,696	0.1
IRONGATE GROUP	256.148	181.194	181.194	341	32,348	0.1
SCENTRE GROUP	2,437.607	1,606.393	1,606.393	4,208	398,610	0.7
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	-	140.343	140.343	115	10,899	0.0
HOME CONSORTIUM LTD	-	53.607	53.607	241	22,847	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT	213.11	439.583	439.583	580	54,955	0.1
HEALTHCO REIT	-	71.487	71.487	105	10,020	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	179.274	127.89	127.89	225	21,317	0.0
AVENTUS GROUP	176.463	-	-	-	-	-
WAYPOINT REIT LTD	382.777	212.662	212.662	480	45,519	0.1
小計	15,356.239	10,522.248	10,522.248	37,590	3,560,193	-
	31銘柄<6.9%>	32銘柄<6.4%>	32銘柄<6.4%>	-	-	6.4
<b>(香港)</b>	千口	千円	千口	千円	千円	%
LINK REIT	977.72	648.62	648.62	41,835	727,527	1.3
PROSPERITY REIT	597	353	353	843	14,671	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	761	682	682	2,066	35,935	0.1
CHAMPION REIT	937.07	632.07	632.07	2,218	38,580	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	451	342	342	1,231	21,410	0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	680	436	436	2,816	48,979	0.1
小計	4,403.79	3,093.69	3,093.69	51,012	887,106	-
	6銘柄<1.7%>	6銘柄<1.6%>	6銘柄<1.6%>	-	-	1.6
<b>(シンガポール)</b>	千口	千円	千口	千円	千円	%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,169.309	1,573.909	1,573.909	3,368	331,393	0.6
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,544.76	1,037.96	1,037.96	2,854	280,843	0.5
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,006.99	668.49	668.49	1,076	105,894	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,370.62	985.82	985.82	1,616	159,071	0.3
STARHILL GLOBAL REIT	656.8	412.4	412.4	239	23,534	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	891.616	588.116	588.116	670	65,965	0.1
KEPPEL REIT	951.5	598.9	598.9	676	66,586	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	622.9	326.6	326.6	728	71,659	0.1
ESR LOGOS REIT	1,148.73	1,558.24	1,558.24	638	62,859	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	365.2	277.1	277.1	357	35,170	0.1
CAPITALAND CHINA TRUST	450.18	338.18	338.18	388	38,264	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	608.8	327.7	327.7	91	9,027	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	216.895	163.795	163.795	221	21,756	0.0
PARKWAY LIFE REIT	179	117.4	117.4	564	55,560	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU	2,759.1	-	-	-	-	-
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	913.12	597.62	597.62	1,500	147,587	0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,028.2	673.1	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	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
<b>(シンガポール)</b>	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
<b>(ニュージーランド)</b>	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
<b>(イギリス)</b>	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			末	
		□ 数	□ 数	外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
REGIONAL REIT LTD	206.337	150.233	115	19,332	0.0	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	153.417	136.07	166	27,879	0.0	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	11,724.532 34銘柄<5.6%>	8,148.22 34銘柄<5.5%>	18,267 -	3,052,903 -	- 5.5
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シケル	千円	%	
REIT 1 LTD	85.363	61.727	1,132	44,721	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	-	63.623	613	24,241	0.0	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	85.363 1銘柄<0.1%>	125.35 2銘柄<0.1%>	1,745 -	68,963 -	- 0.1
(韓国)	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%	
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	39.843	28.835	129,757	13,689	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19.635	19.52	151,670	16,001	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9.958	11.032	60,124	6,343	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	54.509	39.603	224,152	23,648	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17.86	11.152	66,688	7,035	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	-	4.123	21,315	2,248	0.0	
JR REIT XXVII	56.222	45.194	239,076	25,222	0.0	
SK REITS CO LTD	-	17.691	109,861	11,590	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	46.423	43.616	244,249	25,768	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	-	14.329	71,286	7,520	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	-	11.162	57,261	6,041	0.0	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	244.45 7銘柄<0.2%>	246.257 11銘柄<0.3%>	1,375,444 -	145,109 -	- 0.3
(ユーロ…シンガポール)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CROMWELL REIT EUR	131.74	101.34	198	28,494	0.1	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	131.74 1銘柄<0.1%>	101.34 1銘柄<0.1%>	198 -	28,494 -	- 0.1
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
HIBERNIA REIT PLC	306.848	-	-	-	-	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	214.307	125.78	158	22,808	0.0	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	521.155 2銘柄<0.1%>	125.78 1銘柄<0.0%>	158 -	22,808 -	- 0.0
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.21	-	-	-	-	
VASTNED RETAIL	8.822	5.188	115	16,634	0.0	
WERELDHAVE NV	18.894	13.152	192	27,565	0.0	
NSI NV	8.112	5.696	195	27,987	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	-	11.992	263	37,779	0.1	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	54.038 4銘柄<0.2%>	36.028 4銘柄<0.2%>	766 -	109,967 -	- 0.2
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
BEFIMMO	12.281	7.331	346	49,640	0.1	
COFINIMMO SA	13.734	9.07	1,028	147,554	0.3	
RETAIL ESTATES	5.045	3.376	218	31,287	0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10.415	6.965	179	25,679	0.0	
WAREHOUSES DE PAUW	64.409	43.839	1,386	198,862	0.4	
MONTEA SCA	4.725	3.06	283	40,606	0.1	
AEDIFICA	15.707	11.176	1,058	151,913	0.3	
CARE PROPERTY INVEST NV	12.034	8.849	213	30,657	0.1	
XIOR STUDENT HOUSING NV	8.239	6.95	287	41,178	0.1	
小計	□ 数 銘柄数<比率>	146.589 9銘柄<1.3%>	100.616 9銘柄<1.3%>	5,000 -	717,379 -	- 1.3
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA	25.599	16.786	1,636	234,791	0.4	
ICADE	14.526	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	%
投資信託受益証券、投資証券	55,595,607	98.5	55,595,607	98.5
コール・ローン等、その他	842,071	1.5	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・シェケル=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。