

運用報告書 (全体版)

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類 信託期間	追加型投信／内外／資産複合 2007年1月26日から無期限です。
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。 マネックス資産設計 ファンド<隔月分配型> 国内株式パッシブ・ファンド (普通化法)・マザーファンド 外国株式パッシブ・ ファンド・マザーファンド 国内債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド 外国債券パッシブ・ ファンド・マザーファンド J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド
主要投資対象	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。 海外の株式を主要投資対象とします。 わが国の公社債を主要投資対象とします。 海外の公社債を主要投資対象とします。 東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。
運用方法	世界の6資産(国内外の株式・債券・リート)に分散投資を行います。基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。また、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
分配方針	決算日(原則として奇数月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に経費控除後の子、配当等収入および売買益(評価益を含みます。)等の中から、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、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。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

第86期 <決算日 2021年7月12日>
第87期 <決算日 2021年9月13日>
第88期 <決算日 2021年11月11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、「マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>」は、2021年11月11日に第88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/>

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	投資信託・債券・商品・不動産組入比率	純資産額
		(分配落)	税金分配金	騰落率							
第26作成期	74期(2019年7月11日)	円 10,582	円 15	% 2.3	% 47.8	% 1.3	% 36.9	% -	% -	% 12.8	百万円 430
	75期(2019年9月11日)	10,589	15	0.2	47.6	0.8	36.2	-	-	13.1	427
	76期(2019年11月11日)	10,940	15	3.5	49.0	1.3	36.2	-	-	13.1	430
第27作成期	77期(2020年1月14日)	11,197	15	2.5	50.4	0.8	33.8	-	-	12.8	439
	78期(2020年3月11日)	9,943	15	△11.1	45.1	1.4	39.1	-	-	12.3	375
	79期(2020年5月11日)	9,993	15	0.7	49.1	1.2	35.4	-	-	12.3	370
第28作成期	80期(2020年7月13日)	10,436	15	4.6	51.2	0.9	34.1	-	-	12.0	387
	81期(2020年9月11日)	10,697	15	2.6	51.9	1.2	33.2	-	-	12.1	391
	82期(2020年11月11日)	11,046	15	3.4	53.2	1.6	32.1	-	-	13.0	401
第29作成期	83期(2021年1月12日)	11,519	15	4.4	54.3	1.5	30.6	-	-	11.8	405
	84期(2021年3月11日)	11,965	15	4.0	55.1	1.4	29.5	-	-	12.5	414
	85期(2021年5月11日)	12,325	15	3.1	48.0	1.6	38.7	-	-	13.9	421
第30作成期	86期(2021年7月12日)	12,665	15	2.9	48.7	0.9	34.5	-	-	14.4	430
	87期(2021年9月13日)	12,905	15	2.0	49.6	1.4	33.7	-	-	14.0	433
	88期(2021年11月11日)	13,083	15	1.5	50.0	1.3	33.1	-	-	14.2	433

(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」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券・投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投資信託先物を含めて表示しています。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注6) 当ファンドは、国内外の株式、債券および不動産投資信託証券(リート)の6資産に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。各資産の基本資産配分比率については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づいて決定しますが、原則として年1回見直すこととします。

上記コンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■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 比	株 式 先 物 比	債 券 組 比	債 券 先 物 比	新株予約権付社債(転換社債)比率	債 券 先 物 比	投資信託受益証券、投資証券組入比率
			騰 落 率							
第86期	(期 首) 2021年 5 月 11 日	円 12,325	% —	% 48.0	% 1.6	% 38.7	% —	% —	% —	% 13.9
	5 月 末	12,424	0.8	48.2	1.5	35.2	—	—	—	13.9
	6 月 末	12,594	2.2	47.8	2.1	34.5	—	—	—	14.1
	(期 末) 2021年 7 月 12 日	12,680	2.9	48.7	0.9	34.5	—	—	—	14.4
第87期	(期 首) 2021年 7 月 12 日	12,665	—	48.7	0.9	34.5	—	—	—	14.4
	7 月 末	12,608	△0.5	48.3	1.4	34.7	—	—	—	14.5
	8 月 末	12,790	1.0	48.7	1.3	33.9	—	—	—	14.3
	(期 末) 2021年 9 月 13 日	12,920	2.0	49.6	1.4	33.7	—	—	—	14.0
第88期	(期 首) 2021年 9 月 13 日	12,905	—	49.6	1.4	33.7	—	—	—	14.0
	9 月 末	12,751	△1.2	47.7	1.5	35.4	—	—	—	13.2
	10 月 末	13,050	1.1	49.4	1.6	33.3	—	—	—	14.3
	(期 末) 2021年 11 月 11 日	13,098	1.5	50.0	1.3	33.1	—	—	—	14.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

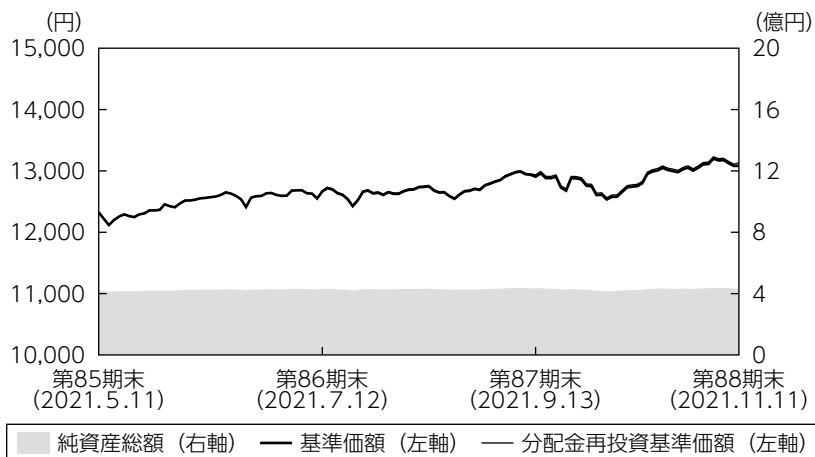
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第86期～第88期の運用経過（2021年5月12日から2021年11月11日まで）

基準価額等の推移



（注1）分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。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2）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3）当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチンが普及したことによる経済正常化への期待等を背景に世界的に株式市場が上昇し、また外国市場を中心にリート市場も上昇したこと、為替市場でリスク回避姿勢が後退したこと等を背景に米ドルに対し円安となったこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	6.8%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.6%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.0%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.7%
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	1.6%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.9%

投資環境

国内株式市場は、作成期初から2021年8月までは、国内での新型コロナウイルス感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月から10月上旬にかけては、菅首相の退陣と共に上昇した後、岸田新首相の政策不安や米国の金利上昇、中国大手不動産会社の債務問題などを要因として下落しました。その後、作成期末にかけては、円安ドル高の進行などを要因として上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。新型コロナウイルス変異株の感染拡大による不透明感、中国大手不動産会社を巡る懸念や米国のインフレ加速への懸念などから調整する場面も見られましたが、ワクチン接種の進展や、経済活動正常化への期待感、パウエルF R B（米連邦準備理事会）議長が利上げを急がないとの姿勢を示したことなどを受け堅調に推移し、作成期末を迎えました。

国内債券市場は上昇しました。作成期初から2021年8月にかけては、米国の早期利上げ観測などを背景に利回りが上昇（価格は下落）する場面もあったものの、新型コロナウイルスの感染収束が見通せない中、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格は上昇）基調となりました。9月から10月下旬にかけては、エネルギー価格の上昇などを受けインフレ懸念が高まったことから利回りは上昇したものの、その後、欧米の中央銀行が利上げに消極的な姿勢を示したことなどを受け、利回りは低下しました。

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

国内リート市場は若干の上昇となりました。期を通じて新型コロナウイルス用ワクチンの接種進展と経済活動再開への期待が継続した一方で、利益確定の売りや相次ぐ公募増資の発表による需給悪化懸念などのマイナス要因もあり、方向感の定まらない展開となりました。

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

為替市場ではまちまちの動きとなりました。ドル／円相場は、米国で金融政策の早期正常化観測が高まったこと、リスク回避姿勢が後退したこと等を背景に円安ドル高の動きとなりました。またその他の主要通貨においては、欧州金利の低下が国内金利の低下を上回ったことで内外金利差がやや縮小したユーロに対して円は小幅円高になった一方、内外金利差が拡大したカナダドルに対しては円安となるなど、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

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととしていますが、当作成期において変更はありませんでした。組入れる6資産の保有比率が概ね基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。

なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分についてはリバランスを行いませんでした。

<基本資産配分比率>

日本株式：25% 外国株式：25% 日本債券：30% 外国債券：7% 日本リート：7% 外国リート：6%

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

●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。

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

リートの実質組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持しました。

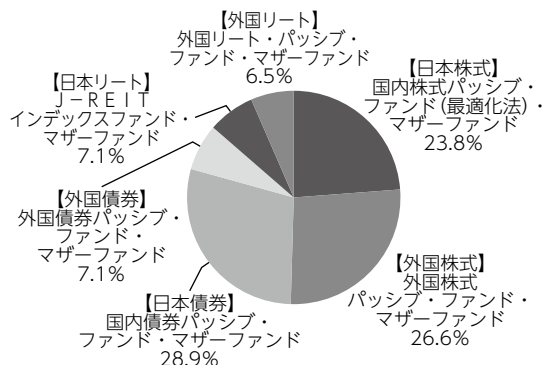
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

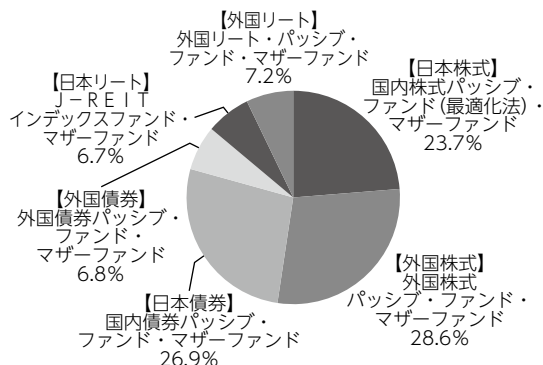
【運用状況】 2021年11月11日現在

○マザーファンド組入比率

前作成期末



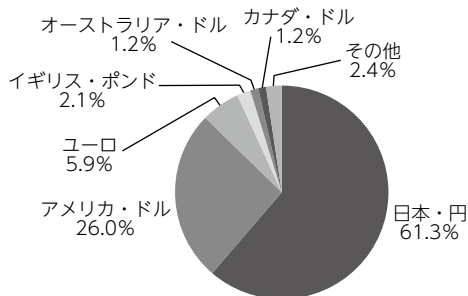
当作成期末



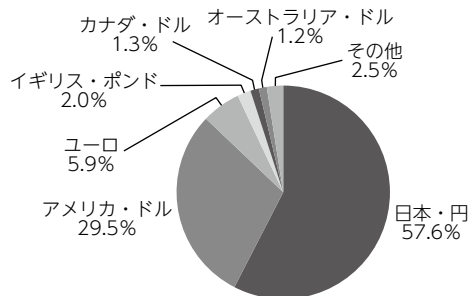
(注) 組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



(注1) 組入比率は当ファンドが実質的に投資している有価証券の評価額に対する割合です。

(注2) 組入比率が1.0%未満の通貨については、合計してその他として表示しております。

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86期	第87期	第88期
	2021年5月12日 ～2021年7月12日	2021年7月13日 ～2021年9月13日	2021年9月14日 ～2021年11月11日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.12%	0.12%	0.11%
当期の収益	15円	15円	15円
当期の収益以外	－円	－円	－円
翌期繰越分配対象額	3,368円	3,608円	3,786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

マザーファンドの組入比率について、基本資産配分比率に基づき高位組入れを維持します。また、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、年1回の基本資産配分比率の見直し時を除いては原則としてリバランスを行いません。

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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目標としたパッシブ運用を行います。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●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。

●J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

引き続き、リートの実質組入比率を高め、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。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持するよう努めます。

●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	第86期～第88期		項目の概要
	(2021年5月12日 ～2021年11月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	35円	0.277%	(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12,700円です。
(投信会社)	(18)	(0.144)	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)	(14)	(0.111)	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)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	1	0.006	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(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	0.011	(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)	(0)	(0.002)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(1)	(0.007)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	38	0.296	

(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。

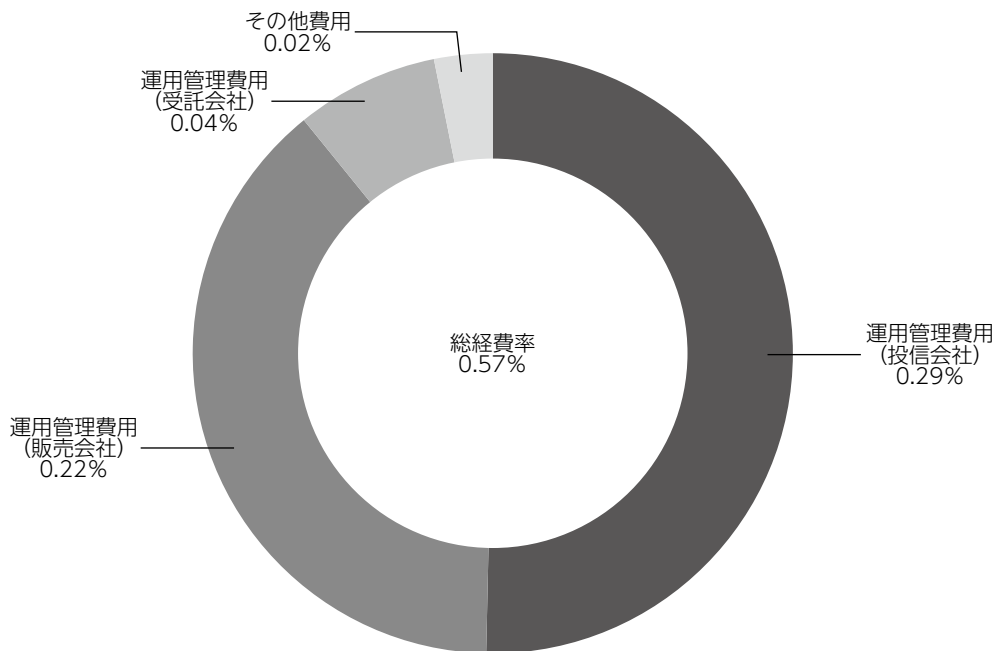
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.57%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年5月12日から2021年11月11日まで）

	第 86 期 ～ 第 88 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	－	－	1,297	4,187
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	－	－	772	4,187
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	－	－	3,837	5,024
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	－	－	574	1,172
J－R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	－	－	477	1,172
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	－	－	657	1,004

■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 86 期 ～ 第 88 期	
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	426,844,313千円	346,422,053千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	378,458,894千円	579,401,743千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.12	0.59

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年5月12日から2021年11月11日まで）

【マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 86 期 ～ 第 88 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	9千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.016千円
(B)／(A)	0.2%

(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みます。

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド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 86 期 ～ 第 88 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 263,674	百万円 106,315	% 40.3	百万円 163,170	百万円 25	% 0.0

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 86 期 ～ 第 88 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 2,053	百万円 1,424	百万円 3,406

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 86 期 ～ 第 88 期	
	買 付 額	額
株 式	百万円 1,226	

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 86 期 ～			第 88 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
公 社 債	百万円 341,690	百万円 50,605	% 14.8	百万円 181,004	百万円 33,003	% 18.2

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 86 期 ～ 第 88 期	
	買 付 額	
公 社 債	百万円 304	

【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。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 86 期 ～			第 88 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
投 資 証 券	百万円 236,602	百万円 100	% 0.0	百万円 94,245	百万円 237	% 0.3

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 86 期 ～ 第 88 期	
	買 付 額	
投 資 証 券	百万円 10,946	

【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、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第 29 作 成 期 末	第 30 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	31,789	30,491	101,564
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	21,408	20,636	122,593
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	92,027	88,189	115,281
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14,546	13,972	29,086
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	12,233	11,755	28,883
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,707	18,050	30,631

■投資信託財産の構成

2021年11月11日現在

項 目	第 30 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	101,564	23.4
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	122,593	28.2
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	115,281	26.5
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29,086	6.7
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	28,883	6.7
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	30,631	7.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,261	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	434,302	100.0

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

(注 2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年11月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは 688,155,547千円、99.8％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは152,675,508千円、99.8％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは83,065,730千円、99.7％です。

(注 3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年11月11日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝113.96円、1 カナダ・ドル＝91.25円、1 オーストラリア・ドル＝83.44円、1 香港・ドル＝14.63円、1 シンガポール・ドル＝84.23円、1 ニュージーランド・ドル＝80.51円、1 イギリス・ポンド＝152.77円、1 イスラエル・シェケル＝36.518円、1 スイス・フラン＝124.14円、1 デンマーク・クローネ＝17.59円、1 ノルウェー・クローネ＝13.19円、1 スウェーデン・クローナ＝13.09円、1 メキシコ・ペソ＝5.533円、100韓国・ウォン＝9.64円、1 オフショア・人民元＝17.808円、1 マレーシア・リンギット＝27.395円、1 ポーランド・ズロチ＝28.38円、1 ユーロ＝130.83円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年7月12日)、 (2021年9月13日)、 (2021年11月11日)現在

項 目	第 86 期 末	第 87 期 末	第 88 期 末
(A) 資 産	431,459,143円	435,328,605円	434,302,000円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,635,316	6,779,461	6,261,171
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーフアンド(評価額)	100,704,374	106,758,704	101,564,723
外国株式パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	115,497,724	116,184,197	122,593,485
国内債券パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	119,246,072	117,662,612	115,281,962
外国債券パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	29,542,571	29,180,812	29,086,159
J-R E I Tインデックスファンド・マザーフアンド(評価額)	31,016,149	30,053,972	28,883,282
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	28,816,937	28,708,847	30,631,218
(B) 負 債	943,486	1,784,937	980,697
未 払 収 益 分 配 金	509,900	503,908	496,807
未 払 解 約 金	35,366	870,927	99,999
未 払 信 託 報 酬	395,439	407,237	381,205
そ の 他 未 払 費 用	2,781	2,865	2,686
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	430,515,657	433,543,668	433,321,303
元 本	339,933,749	335,938,914	331,204,771
次 期 繰 越 損 益 金	90,581,908	97,604,754	102,116,532
(D) 受 益 権 総 口 数	339,933,749口	335,938,914口	331,204,771口
1 万口当たり基準価額(C／D)	12,665円	12,905円	13,083円

(注) 第85期末における元本額は341,815,072円、当作成期間(第86期～第88期)中における追加設定元本額は7,665,051円、同解約元本額は18,275,352円です。

■損益の状況

〔自 2021年5月12日〕〔自 2021年7月13日〕〔自 2021年9月14日〕
 〔至 2021年7月12日〕〔至 2021年9月13日〕〔至 2021年11月11日〕

項 目	第 86 期	第 87 期	第 88 期
(A) 配 当 等 収 益	△183円	△247円	△180円
受 取 利 息	－	7	2
支 払 利 息	△183	△254	△182
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	12,378,475	8,990,095	6,777,269
売 買 益	12,404,947	9,623,544	11,054,789
売 買 損	△26,472	△633,449	△4,277,520
(C) 信 託 報 酬 等	△398,220	△410,102	△383,891
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	11,980,072	8,579,746	6,393,198
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	90,138,017	99,760,270	105,500,852
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△11,026,281	△10,231,354	△9,280,711
(配 当 等 相 当 額)	(12,881,821)	(13,385,758)	(14,013,737)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,908,102)	(△23,617,112)	(△23,294,448)
(G) 合 計(D + E + F)	91,091,808	98,108,662	102,613,339
(H) 収 益 分 配 金	△509,900	△503,908	△496,807
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	90,581,908	97,604,754	102,116,532
追 加 信 託 差 損 益 金	△11,026,281	△10,231,354	△9,280,711
(配 当 等 相 当 額)	(12,883,362)	(13,386,787)	(14,016,693)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,909,643)	(△23,618,141)	(△23,297,404)
分 配 準 備 積 立 金	101,608,189	107,836,108	111,397,243

(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 86 期	第 87 期	第 88 期
(a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益	964,694円	875,062円	1,427,884円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	11,015,378	7,704,684	4,965,314
(c) 収 益 調 整 金	12,883,362	13,386,787	14,016,693
(d) 分 配 準 備 積 立 金	90,138,017	99,760,270	105,500,852
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	115,001,451	121,726,803	125,910,743
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	3,383.05	3,623.48	3,801.60
(g) 分 配 金	509,900	503,908	496,807
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	15	15	15

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 86 期	第 87 期	第 88 期
1 万口当たり分配金	15円	15円	15円

分配金の課税上の取扱いについて

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

《お知らせ》

- 当ファンドが投資対象とする「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を2,000億円から5,000億円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年6月2日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2021年2月8日）

（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年10月30日から無期限です。
運 用 方 針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主 要 投 資 対 象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額 総
	期 騰 落 率	中 率	(配当込み) (ベンチマーク)	期 騰 落 率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期（2017年2月7日）	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期（2018年2月7日）	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期（2019年2月7日）	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期（2020年2月7日）	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期（2021年2月8日）	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

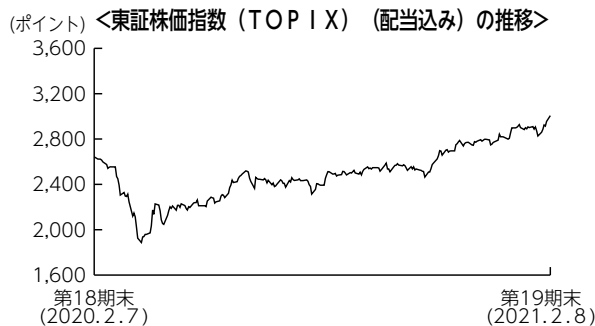
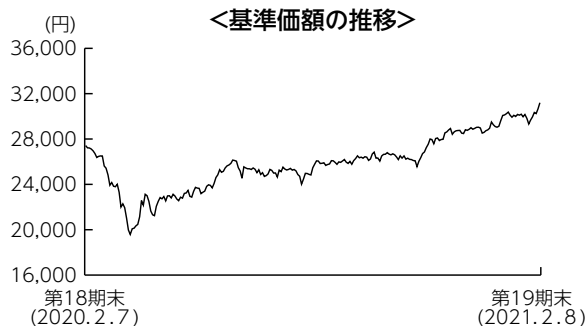
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
		騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 7 日	円 27,423	% －	ポイント 2,642.55	% －	% 97.6	% 2.4
2 月 末	23,926	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3 月 末	22,498	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4 月 末	23,470	△14.4	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5 月 末	25,068	△8.6	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6 月 末	25,027	△8.7	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7 月 末	24,020	△12.4	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8 月 末	25,983	△5.3	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9 月 末	26,316	△4.0	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10 月 末	25,569	△6.8	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11 月 末	28,422	3.6	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12 月 末	29,264	6.7	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021 年 1 月 末	29,330	7.0	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期 末) 2021 年 2 月 8 日	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月8日から2021年2月8日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,202円となり、前期末比で13.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】（注1）組入比率は純資産総額に対する割合です。
（注2）業種は東証33業種分類によるものです。

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	電気機器	14.2%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.4
4	化学	6.9
5	医薬品	6.1
6	銀行業	5.5
7	サービス業	5.1
8	機械	5.0
9	卸売業	4.9
10	小売業	4.4



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4

○組入上位10銘柄

期首（前期末）

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151銘柄	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	

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13.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%
(株 式)	(0)	(0.000)
(先物・オプション)	(0)	(0.001)
合 計	0	0.001

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,909円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2020年2月8日から2021年2月8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
		63,510.4 (△11,652.101)	127,938,692 (-)	55,403.199	112,472,446

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円	百万円	百万円	百万円
		71,359	71,662	-	-

(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	240,411,139千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	237,278,032千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.01

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月8日から2021年2月8日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	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 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

(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 1,047	百万円 867	百万円 2,537

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 250

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	3,691千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	207千円
(B)／(A)	5.6%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				ビーエス三菱	11.1	12.2	8,405	森永製菓	25.4	27.8	118,984
極洋	5.1	5.4	16,956	日本ハウスホールディングス	23.2	25.6	9,088	中村屋	2.8	2.5	9,925
日本水産	146.5	148.6	76,083	大東建託	40.5	40.5	486,000	江崎グリコ	32.1	32.7	156,469
マルハニチロ	21.2	25.2	64,688	新日本建設	14.4	15.9	14,182	名糖産業	5.2	5.6	8,428
雪国まいたけ	—	9.9	17,998	N I P P O	27.9	30.8	87,348	井村屋グループ	4.6	6.8	17,999
カネコ種苗	4.5	4.6	7,369	東亜道路工業	2.1	2.4	9,372	不二家	6	7.6	18,088
サカタのタネ	17.4	19.2	75,552	前田道路	35.8	22.9	45,777	山崎製パン	81.2	89	172,126
ホクト	11.2	13.6	29,648	日本道路	3.3	3.6	27,108	第一屋製パン	1.8	2.9	2,821
ホクリヨウ	2.3	2.3	1,628	東亜建設工業	10.5	9.9	20,304	モロゾフ	1.8	1.7	9,707
鉱業 (0.2%)				日本国土開発	19.8	36.3	20,763	亀田製菓	6.2	6.9	34,051
住石ホールディングス	30.1	27.8	3,141	若築建設	6.1	6.7	8,736	寿スビリッツ	10.4	11.4	75,924
日鉄鉱業	3.4	3.7	20,831	東洋建設	37.9	41.6	22,713	カルビー	49.4	54.1	166,898
三井松島ホールディングス	5.7	6.7	6,117	大洋建設	134	157.5	140,175	森永乳業	20	21.9	111,690
国際石油開発帝石	587.5	590.1	411,889	世紀東急工業	16.2	17.9	15,501	六甲バター	7.1	8	14,848
石油資源開発	19.2	21	49,224	福田組	3.9	4.3	22,489	ヤクルト本社	74.5	81.6	438,192
K&Oエナジーグループ	7.1	7.7	11,118	住友林業	85.7	87.2	199,164	明治ホールディングス	71.6	78.5	580,115
建設業 (2.3%)				日本基礎技術	11.4	11.7	5,814	雪印メグミルク	26.1	28.6	68,153
ヒノキヤグループ	3.7	4	8,560	巴コーポレーション	15.2	16.8	6,820	プリマハム	16.9	16.8	55,860
ショーボンドホールディングス	22.7	22.9	107,859	大和ハウス工業	334.5	342.4	1,101,500	日本ハム	41.4	45.4	212,472
ミライト・ホールディングス	43.6	55.7	96,361	ライト工業	19.4	21.3	38,254	林兼産業	3.7	3.6	2,199
タマホーム	6.9	9.7	18,100	積水ハウス	369.9	402.2	850,451	丸大食品	11.6	11.8	20,886
サンヨーホームズ	1.2	2.2	1,850	日特建設	8.9	9.9	7,959	S F o o d s	8.7	10.7	37,610
日本アーク	5.8	6.4	3,916	北陸電気工事	5.8	6.6	8,144	柿安本店	3.8	4.1	11,512
ファーストコーポレーション	4.5	4.9	3,528	ユアテック	19.4	21.3	18,147	伊藤ハム株式会社ホールディングス	69.8	76.7	57,525
ベステラ	2.5	3	4,932	日本リーテック	—	7.7	18,995	サッポロホールディングス	36.9	40.5	88,492
T A T E R U	30.3	29.9	5,621	四電工	1.7	1.7	4,845	アサヒグループホールディングス	226.6	259.3	1,151,032
キャンディル	—	2.8	1,598	中電工	13.7	17.1	38,970	キリンホールディングス	459	503.3	1,138,716
スペースビューホールディングス	17.8	19.6	13,818	関電工	48.1	60.4	55,749	宝ホールディングス	81	87.9	124,378
ダイセキ環境ソリューション	2.9	3.1	2,476	きんでん	80.4	80.2	146,365	オゾンホールディングス	28.7	34.2	13,885
第一カッター興業	1.8	4	5,532	東京エネシス	11.2	12.3	11,771	養命酒製造	3.4	4	7,812
安藤・間	87.2	102.9	81,805	トーエネック	3.4	3.8	14,934	コトコロ ホリスグループホールディングス	76	90.8	159,989
東急建設	42.9	47	26,696	住友電設	9.6	10.5	27,111	サントリー食品インターナショナル	72.4	79.5	302,497
コムシスホールディングス	51.9	56.9	194,598	日本電設工業	18.6	20.4	41,616	ダイドグループホールディングス	5.6	6.7	36,180
ピーアールホールディングス	16	19	13,756	協和エクシオ	51.3	56.2	163,429	伊藤園	32.8	36.1	241,870
福松コンストラクショングループ	9.1	10.1	21,573	新日本空調	9	9.8	21,903	キーコーヒー	10.7	11.8	25,735
東建コーポレーション	4.5	4.9	43,414	九電工	23.8	26.1	92,916	ユカフェ	2.9	3.9	3,966
ソネック	1.5	1.7	1,390	三機工業	24.4	26.3	34,374	ジャパンフーズ	1.5	1.5	1,866
ヤマウラ	6.4	7.2	6,789	日揮ホールディングス	104.1	123.6	166,365	日清オイリオグループ	14	15.3	48,118
大成建設	112.8	115.4	437,366	中外炉工業	3.7	4.1	7,121	不二製油グループ本社	26.4	29	95,410
大林組	338.1	370.8	350,406	ヤマト	10.8	11.9	8,472	かどや製油	1.1	1	4,060
清水建設	343.2	347.3	277,492	太平電業	8.2	8.2	21,287	Jーオイルミルズ	5.6	5.6	21,336
飛島建設	9.7	10.5	12,316	高砂熱学工業	29.4	33.5	55,442	キッコーマン	77.9	85.4	628,544
長谷工コーポレーション	130.9	121.3	163,633	三晃金属工業	1.4	1.6	4,753	味の素	239	282.3	648,301
松井建設	13.4	14.7	10,936	朝日工業社	2.2	2.1	6,224	キューピー	60.3	66	160,512
銭高組	1.4	1.2	5,412	明星工業	21.8	24.1	19,810	ハウス食品グループ本社	40.5	44.4	175,824
鹿島建設	265.5	271.6	413,646	大気社	16.4	18	53,946	カゴメ	41.1	48.5	169,507
不動テトラ	8.9	9.1	16,489	ダイダン	8.1	8.2	23,780	焼津水産化学工業	5.3	4.8	4,939
大末建設	4	4.9	4,356	日比谷総合設備	10.9	12.2	23,131	アリアゲジャパン	9.9	10.9	78,153
鉄建建設	7.3	7.5	14,970	フィル・カンパニー	1.4	2.1	4,166	ビエトロ	1.4	1.2	2,109
西松建設	26	26.5	68,688	OSJBホールディングス	53.1	54.1	14,985	エバラ食品工業	2.5	2.4	6,684
三井住友建設	81.7	89.4	42,912	東洋エンジニアリング	14.2	15.4	7,499	やまみ	0.5	1.1	2,332
大豊建設	7.6	8.1	30,942	レイズネクト	18.2	20	23,800	ニチレイ	51.5	56.5	167,070
前田建設工業	84.7	92.9	89,834	食料品 (3.4%)				東洋水産	55.7	61	291,580
佐田建設	7.4	6.7	2,974	ニッポン	31.6	35	57,435	イトアンドンホールディングス	3.8	4.2	7,988
ナカノフード建設	9.3	9.7	3,899	日清製粉グループ本社	122.3	134.1	246,207	大冷	1.4	1.5	2,919
奥村組	18.4	20.4	56,630	日清製粉	0.7	0.6	4,032	ヨシムラ・フード・ホールディングス	5.9	6.7	6,110
東鉄工業	14.5	16	44,624	昭和産業	10	10.1	32,168	日清食品ホールディングス	46	46.5	400,830
イチケン	2.4	2.7	5,367	鳥越製粉	9.7	10.8	9,698	永谷園ホールディングス	5.3	6	14,418
富士ビー・エス	5	5	3,100	中部飼料	13.3	14.6	21,681	一正蒲鉾	4	4	4,872
浅沼組	3.8	4.4	20,064	フィード・ワン	72.9	16.2	14,596	フジッコ	11.7	13	26,806
戸田建設	140.3	154.1	122,201	東洋精糖	1.7	1.7	2,087	ロック・フィールド	11.7	12.8	20,569
熊谷組	15.7	17.1	48,273	日本甜菜製糖	5.7	6.4	10,873	日本たばこ産業	624.9	636.5	1,369,111
北野建設	2	1.9	4,677	三井製糖	9.5	9.5	18,800	ケンコーマヨネーズ	6.1	7.3	14,235
植木組	1.5	1.6	4,606	塩水港精糖	11.3	14.4	3,283	わらべや日清ホールディングス	7.1	7.8	13,392
矢作建設工業	14.9	16.7	14,545	日新製糖	5.1	4.5	8,536	なとり	6.1	6.9	13,869

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
イフジ産業	千株	千株	千円	ラサ工業	千株	千株	千円	ハリマ化成グループ	千株	千株	千円
ビックルスコーポレーション	1.9	2.3	2,081	クレハ	3.8	3.8	9,146	花王	8.8	8.7	8,404
北の達人コーポレーション	2.3	2.8	9,996	多摩化学	9.1	9.9	70,587	第一工業製薬	258.1	283.1	2,128,062
ユーグレナ	37.7	41.4	25,957	テイカ	3.1	4.5	27,945	石原ケミカル	4	3.9	15,015
ミヨシ油脂	46.2	51.2	47,104	石原産業	7.8	8.4	12,793	日華化学	3	3	6,240
理研ビタミン	4.4	4.4	5,302	片倉コープアグリ	19	20.6	17,036	ニイタカ	3.7	4.3	3,857
繊維製品 (0.5%)	5.1	11.2	15,792	日本曹達	3	2.4	3,033	三洋化成工業	1.6	2.4	6,835
片倉工業	15.4	15.6	21,715	東ソー	15.6	16.2	54,270	有機合成薬品工業	6.3	6.9	37,191
グンゼ	7.8	8.5	32,895	トクヤマ	163.3	178.9	334,364	大日本塗料	8.5	9.2	2,815
東洋紡	41.7	45.8	63,707	セントラル硝子	30.5	34.3	91,615	日本ペイントホールディングス	12	13.2	13,002
ユニチカ	31.2	33.8	15,345	東亞合成	21.6	22	49,038	関西ペイント	87.2	95.5	926,350
富士紡ホールディングス	5.1	5.6	24,948	大阪ソーダ	66.4	70.7	84,274	神東塗料	118.7	130.1	404,611
倉敷紡績	10.9	10.7	20,811	関東電化工業	10.8	11.9	32,713	中国塗料	8.8	9.3	1,953
シキボウ	5.6	6.6	6,890	デンカ	25.1	27.3	23,778	日本特殊塗料	30.1	27.9	25,891
日本毛織	34.8	38.1	38,100	信越化学工業	38.6	42.2	175,763	藤倉化成	8	8.7	9,952
ダイトウボウ	17.8	19.3	2,161	日本カーバイド工業	181.3	214.1	3,869,857	太陽ホールディングス	14.5	16	8,256
トー紡コーポレーション	4.1	4.1	1,927	堺化学工業	3.7	4.2	5,712	D I C	7.8	8.5	52,105
ダイドーリミテッド	14.1	16.6	3,170	第一稀元素化学工業	6.8	8.1	17,293	サカタインクス	44.7	48.9	134,866
帝国繊維	11.8	13	30,407	エア・ウォーター	11.5	11.7	11,594	東洋インキS Cホールディングス	23.2	25.3	28,513
帝人	86.2	109	211,351	日本薬業ホールディングス	90.2	118.1	208,800	T & K T O K A	22.4	24.5	47,309
東レ	764.7	838.4	618,655	日本化学工業	101.5	95.3	196,413	富士フイルムホールディングス	8.4	9.4	7,802
サカイオーベックス	2.9	3.1	6,767	東邦アセチレン	3.3	3.2	9,712	資生堂	206.7	207.8	1,281,918
住江織物	2.3	2.1	4,332	日本パーカライズン	1.5	1.9	2,758	ライオン	214.3	235	1,830,180
日本フェルト	5.7	5.5	2,480	高圧ガス工業	53.3	58.4	64,824	高砂香料工業	140.2	153.7	363,961
イチカフ	1.5	1.3	1,683	チタン工業	16.9	18.5	13,912	マンダム	6.8	7.4	19,336
日東製網	1.2	1.3	1,970	四国化成工業	1.3	1.5	3,553	ミルボン	24.3	24.7	43,076
アツギ	8.8	9.3	4,770	戸田工業	16.3	15.5	19,313	ファンケル	14.4	15.8	111,232
ダイニツク	3.9	3.6	2,851	ステラ ケミファ	2.4	2.4	5,347	コーセー	43.7	43	168,560
セーレン	26	28.5	52,012	保土谷化学工業	5.8	6.3	22,522	コタ	20.3	22.2	385,614
ソトー	3.8	4	3,272	日本触媒	4	3.4	17,238	シーボン	5.7	7	10,703
東海染工	1.4	1.3	1,458	大日精化工業	16.4	21	126,000	ホーラ・オルビスホールディングス	1.2	1.3	2,581
小松マテリアル	17.3	19.1	20,093	カネカ	9.4	9.6	22,790	ノビアホールディングス	46	50.5	109,585
ワコールホールディングス	27.5	28.9	68,695	三菱瓦斯化学	27.3	30	119,850	アジバホールディングス	10.3	10	50,500
ホギメディカル	12	15.6	50,934	三井化学	99.7	116	291,972	新日本製薬	2.3	3	3,267
レナウン	28.2	—	—	J S R	96	100	335,500	エヌピー	—	2.4	6,506
クラフディアホールディングス	2.9	2.4	691	東京応化工業	98.4	116.2	362,544	アグロ カネショウ	6.9	7.7	16,016
T S Iホールディングス	35.5	34.7	10,028	大阪有機化学工業	18.2	19.9	142,882	コニシ	3.4	4.5	6,961
マツオカコーポレーション	3.1	3.7	7,788	三菱ケミカルホールディングス	9.8	10.7	39,162	長谷川香料	17.7	19.5	32,311
ワールド	15	15.1	21,789	K Hネオケム	706.2	774.1	577,943	星光PMC	14.4	20.5	43,009
三陽商会	5.5	6	4,512	ダイセル	18.6	19.1	48,380	荒川化学工業	6.3	6.9	5,361
ナイガイ	4	3.8	1,250	住友ベークライト	144.5	155.5	130,309	メック	30.2	33.1	364,100
オンワードホールディングス	63.5	69.3	20,166	積水化学工業	16.6	18.2	74,074	日本高純度化学	9.7	9.9	12,780
ルックホールディングス	3.6	4	3,752	日本ゼオン	227.1	244.9	502,289	タカラバイオ	7.4	8.1	17,293
キムラタン	57.9	68.3	1,707	アイカ工業	95.3	104.5	172,425	J C U	3.1	3.3	9,147
ゴールドウイン	19.2	19.1	139,812	宇都興産	31.7	32.2	122,360	新田ゼラチン	28.2	31	96,565
デサント	20.6	19.8	35,224	積水樹脂	53.3	58.4	123,048	O A Tアグリオ	13.1	13.3	49,010
キング	5	4.6	2,737	旭有機材	19	19.1	41,408	テクセリアルズ	6.7	7.7	5,197
ヤマトインターナショナル	6.3	10.6	3,710	日立化成	22.8	25.2	17,589	アース製薬	1.8	2.3	3,061
パルプ・紙 (0.2%)				ニチバン	6	6.6	10,553	北興化学工業	27.8	33	46,860
特種東海製紙	6.7	7.2	34,452	リケンテクノス	48.9	—	—	大成ラミック	8.2	8.9	55,269
王子ホールディングス	441.3	521.3	347,185	大倉工業	5.6	6.2	11,315	クミアイ化学工業	11.1	10.9	12,415
日本製紙	46.7	51.1	75,219	積水化成製品工業	26.7	28.2	14,128	日本農業	3.3	3.7	11,081
三菱製紙	12	17.1	5,950	群栄化学工業	5	5.5	10,923	アキレス	44.7	48.8	44,359
北越コーポレーション	70	82.9	38,797	タイガースポリマー	14.2	15.6	8,923	日東電工	19.4	21.2	10,833
中越パルプ工業	4.5	4.7	5,705	ミライアル	2.4	2.2	5,526	レック	7.4	8.2	12,464
巴川製紙所	3.2	3.7	3,048	ダイキアクシス	5.6	6.7	2,914	三光合成	17	16.5	16,665
阿波製紙	46.3	56	103,936	ダイキョーニシカワ	3.8	3.7	4,421	きもと	74.5	75.7	734,290
レンゴー	2.8	3	1,407	竹本容器	4.3	4.2	4,592	藤森工業	11.5	14	18,802
トーモク	99.9	119.4	110,206	恵和	22.2	24.5	22,025	前澤化成工業	12.4	12.4	5,642
ザ・バック	6.5	7.2	13,788	日本化薬	3.8	4.2	3,691	未来工業	18.5	18.9	3,761
化学 (7.4%)	8	8.7	23,307	カーリットホールディングス	5.7	6.3	13,721	エフピコ	9.7	10.6	50,774
旭化成	166.4	182.3	220,947	日本精化	—	1.7	3,525	天馬	6.9	7.8	7,776
共和レザー	700	767.5	953,618	扶桑化学工業	11.3	11.5	8,682	ニフコ	5.8	4.3	7,705
昭和電工	5.8	6.8	4,664	トリケミカル研究所	8.6	8.4	11,978		3.9	4	3,344
住友化学	75.2	87.9	233,110	日油	10.7	9.1	32,987		6.3	7	12,943
日産化学	776	911.2	467,445	新日本理化学	2.3	9.8	40,572		11.8	21.8	91,887
	4.7	5.7	23,769		48.7	53.3	99,564		7.1	8.9	19,731
	59.1	63.9	382,761		39.8	43.6	248,084		19.4	18.2	19,019
					18	19	5,054		27.1	31.1	7,837
									39.6	43.4	173,166

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
バルカー	千株	千株	千円	日本山村硝子	千株	千株	千円	古河機械金属	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	8.8	9.7	20,622	日本電気硝子	4.5	5.3	4,833	エス・サイエンス	19	19.3	25,765
ショーエコーポレーション	207.9	250.8	1,171,236	オハラ	43.3	43.8	107,397	大倉チタニウムテクノロジーズ	47.6	54.7	2,461
医薬品 (5.7%)	1.2	2.6	2,727	住友大阪セメント	4.3	4.7	8,892	東邦チタニウム	11.1	12	9,972
協和キリン	108.4	119	379,015	太平洋セメント	20.4	21.3	71,355	UACJ	19.1	20.9	19,395
武田薬品工業	897.1	983.7	3,584,602	日本ヒューム	68.1	70	197,120	CKサンエツ	16.2	17.7	40,656
アステラス製薬	948.4	1,025.1	1,882,083	日本コンクリート工業	10.8	11	8,690	古河電気工業	1.9	2.1	8,158
大日本住友製薬	79.9	87.6	164,512	三谷セキサン	23.4	25.4	8,280	住友電気工業	33.1	36.4	106,142
塩野義製薬	137.9	148.7	883,426	アジアパイルホールディングス	5	5.5	27,775	フジクラ	398.6	407.9	652,232
わかもと製薬	13	14.3	3,532	ダントーホールディングス	15.3	18.5	9,342	昭和電線ホールディングス	128.7	141.1	77,605
あすか製薬	12.3	13.4	20,314	日本カーボン	112.9	115.5	180,988	東京特殊電線	12.3	11.3	21,470
日本新薬	28.3	33.5	269,675	東洋炭素	5.5	6.5	27,072	タツタ電線	1.6	1.5	3,870
バイオフェルミン製薬	1.7	2.2	5,658	リタケカンパニリミテド	6.3	7	14,329	カナレ電気	21.1	20.6	14,440
中外製薬	112.4	369.8	1,982,497	TOYO	5.9	6.6	24,156	平河ヒューテック	1.7	2.2	3,916
科研製薬	18.5	20.2	83,426	日本硝子	77	84.5	612,625	リョービ	4	6.5	7,956
エーザイ	129	130.6	1,020,377	日本特殊陶業	131.6	130	248,430	アーレスティ	13.2	14.2	18,616
ロート製薬	55.3	56.3	181,849	ダントーホールディングス	83.9	90	179,910	アサヒホールディングス	14	14.6	5,956
小野薬品工業	247.6	271.5	856,854	MAIRUWA	8	8.6	3,706	アサヒホールディングス	18.7	21.9	93,294
久光製薬	28.5	34.4	226,008	黒崎橋本	4.2	4.1	44,936	金属製品 (0.6%)			
持田製薬	15	16.4	69,946	ヨータイ	2.9	2.8	8,066	稲葉製作所	6	6.7	9,601
参天製薬	200.8	205.7	353,392	インソライト工業	2.1	2	9,830	宮地エンジニアリンググループ	3.3	3.8	8,759
扶桑薬品工業	3.8	3.8	10,598	東京窯業	8.6	8.6	8,101	トーカロ	29.6	30.2	43,004
日本ケミファ	1.4	1.2	2,703	ニッカトー	5.5	5.3	3,121	アルファ	3.8	4.5	4,761
ソムラ	33.5	39.5	138,842	フジミンコーポレート	13.8	15.7	5,243	SUMCO	127.7	149.6	338,694
日医工	30.6	33.4	35,971	クニミネ工業	4.9	5.4	4,152	川田テクノロジーズ	2.1	2.4	10,896
キッセイ薬品工業	19.1	20.9	49,135	エーアンドエーマテリアル	9.6	9.5	38,475	RS Technologies	3.1	3.8	24,472
生化学工業	20.8	20.9	23,345	ニチアス	4.4	3.8	4,993	ジェイテックコーポレーション	—	1	3,855
栄研化学	19	20.8	48,672	ニチハ	1.8	2.4	2,625	信和	4.6	6.4	4,588
日本製薬	4.6	4.6	4,696	鉄鋼 (0.7%)	29.5	29.9	76,514	野村建設グループホールディングス	67.9	74.5	100,426
鳥居薬品	6.7	7.4	23,495	日本製鉄	15	16.5	55,687	ホッカンホールディングス	5.9	6	8,946
JCRファーマ	7.6	33.3	105,727	神戸製鋼所	477.3	558.1	819,848	コロナ	5.9	6.8	6,473
東和薬品	13.8	17.1	36,337	中山製鋼所	195.1	213.7	135,508	横河ブリッジホールディングス	19.9	20.1	40,099
富士製薬工業	7.3	8.1	11,064	合同製鐵	14.9	17.1	6,788	駒井ハルテック	1.9	2.4	5,296
沢井製薬	22.1	25.9	127,557	ジェイエフイーホールディングス	5.7	6.3	13,097	高田機工	0.9	0.8	2,056
ゼリア新薬工業	19.6	21.5	46,547	東京製鐵	287.9	338.2	364,579	三和ホールディングス	102.3	110.2	146,566
第一三共	308.5	1,015	3,273,375	共英製鋼	52	45.6	34,792	文化シャッター	31.5	34.6	33,873
キョーリン製薬ホールディングス	23.8	26.1	51,025	大和工業	12	13.1	18,929	三協立山	14.8	15	13,065
大幸薬品	4.4	14.5	23,229	東京製鐵	22.6	24.9	68,574	アルインコ	7.8	7.8	7,612
ダイト	6.3	7.5	28,537	大阪製鐵	4.4	4.5	8,824	東洋シャッター	2.5	2.4	1,682
大塚ホールディングス	205.4	245.8	1,165,829	淀川製鋼所	5.7	6.3	8,057	LIXIL	157.4	161	464,485
大正製薬ホールディングス	22.7	28.1	200,634	丸一鋼管	14.4	15.9	36,395	日本フイルコン	8.3	8.5	4,309
ペプチドリーム	54.6	60.1	391,251	モリ工業	34.6	37.9	92,097	ノーリツ	22.1	24.3	39,438
石油・石炭製品 (0.4%)				大同特殊鋼	3.2	3.5	8,193	長府製作所	10.8	12	25,860
日本コークス工業	92.1	100.5	10,050	日本高周波鋼業	17.4	19.1	92,730	リンナイ	20.7	22.7	252,197
ニチレキ	12.7	14	21,910	山陽特殊製鋼	4.2	4	1,528	ダイニチ工業	5.7	5.7	5,033
ユシロ化学工業	6	6.8	7,922	愛知製鋼	8.9	9.1	18,627	日東精工	14.7	15.1	7,368
ピーピー・カストロール	3.9	4.3	5,400	日立金属	7.6	14	23,282	三洋工業	1.4	1.3	2,455
富士石油	29	28.8	6,681	日本冶金工業	6	6.6	21,813	岡部	21.6	24.1	19,207
MORESCO	4	4.5	5,301	日立金属	114.8	110.3	191,922	ジューテクト	13.3	14.6	23,038
出光興産	121.3	131.2	339,414	日本金属	2.4	2.9	3,503	東邦	19.9	21.9	35,565
ENEOSホールディングス	1,621.8	1,778.3	788,498	大平洋金属	7.2	7.8	17,643	高周波熱錬	20.5	22.3	12,532
コスモエネルギーホールディングス	31.2	37.3	88,550	新日本電工	69.2	75.3	21,234	東京製鋼	7.6	8.2	11,873
ゴム製品 (0.6%)				栗本鐵工所	5.3	5.4	9,579	サンコール	6.1	10.3	4,923
横浜ゴム	62.4	68.4	124,556	虹技	1.6	1.3	1,492	モリテックススチール	8.4	9	3,807
TOYO TIRE	61.9	62.2	113,452	日本鋳鉄管	1.1	1.4	1,828	パイオラックス	15.7	17.3	28,493
ブリヂストン	331.4	314.4	1,301,930	三菱製鋼	8	8.8	6,151	エイチワン	10.5	11.6	9,767
住友ゴム工業	96.9	106	110,770	日亜鋼業	15.7	17.8	5,340	日本発条	114.3	116.4	99,522
藤倉コンポジット	9.5	10.8	4,762	日本精線	1.7	1.7	6,613	中央発條	1.2	1	2,803
オカモト	6.5	7.3	29,382	エンビプロ・ホールディングス	4.1	5.1	3,529	アドパネクス	1.3	1.6	2,606
フコク	4.7	4.4	3,132	シンニツタン	16.6	14.5	3,146	立川プラインド工業	4.7	5.3	7,080
ニッタ	12.1	12.2	30,841	新家工業	2.4	3.1	4,417	三益半導体工業	8.4	9.1	24,151
住友理工	20.9	22.8	15,572	非鉄金属 (0.8%)				機械 (5.7%)			
三ツ星ベルト	14.2	14.4	25,531	大紀アルミニウム工業所	17.5	17.7	14,248	日本ドライエミカル	2.7	3	4,746
バンドー化学	19	20.9	14,818	日本軽金属ホールディングス	270	31.9	67,915	日本製鋼所	32.3	35.5	113,422
ガラス・土石製品 (0.8%)				三井金属鉱業	28.8	31.6	125,768	三浦工業	46.1	50.6	300,564
日東紡績	16	17.5	87,237	東邦亜鉛	5.5	6.5	15,938	タクマ	36.1	39.6	90,010
AGC	106.6	108.6	407,793	三菱マテリアル	70.5	77.2	195,007	ツガミ	22	24.2	41,019
日本板硝子	51.5	59.8	36,179	住友金属鉱山	136.3	149.4	747,747	オークマ	12.4	13.6	85,680
石塚硝子	1.9	2.1	3,929	DOWAホールディングス	27	29.6	126,836	芝浦機械	12	12.2	34,147
								アマダ	135.5	171.2	220,848

銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株価	株数	評価額		株数	株価	株数	評価額		株数	株価	株数	評価額
アイダエンジニアリング	千株	千円	千株	千円	鶴見製作所	千株	千円	千株	千円	ブラザー工業	千株	千円	千株	千円
滝澤鉄工所	27.9	30.7	31.774	8.4	住友精密工業	9.2	16,928	9.2	16,928	131.6	144.3	346,175	131.6	144.3
F U J I	3.3	3.9	4,102	1.6	日本ギヤ工業	1.9	3,957	1.9	3,957	200.1	203.7	522,286	200.1	203.7
牧野フライス製作所	45.8	46.6	129,268	3.5	酒井重工業	6	1,842	6	1,842	518.1	568.4	2,840,294	518.1	568.4
オーエスジー	12.4	13.7	57,677	2	荏原製作所	1.9	4,166	1.9	4,166	1,078.2	1,182.4	2,039,048	1,078.2	1,182.4
ダイジェット工業	49.3	57.6	111,628	44.6	石井鐵工所	49	185,465	49	185,465	65	71.2	310,432	65	71.2
旭ダイヤモンド工業	1.2	1	1,416	1.4	西島製作所	1.2	3,501	1.2	3,501	4.3	4.7	5,893	4.3	4.7
DMG森精機	27.9	31	15,562	10.9	北越工業	12.2	10,748	12.2	10,748	116.1	127.3	731,975	116.1	127.3
ソディック	67.4	73.9	126,960	11.1	ダイキン工業	12.4	13,652	12.4	13,652	14	15.4	21,560	14	15.4
ディスコ	25.1	25.6	25,216	137.4	オルガノ	150.6	3,519,522	150.6	3,519,522	19.8	20	48,920	19.8	20
日東工器	14.5	15.9	539,805	3.9	トーヨーカネツ	3.8	24,662	3.8	24,662	3	2.6	3,536	3	2.6
パンチ工業	5.8	5.7	10,584	4.7	栗田工業	4.4	11,272	4.4	11,272	5.2	5.7	36,651	5.2	5.7
富士ダイス	3.2	4.6	12,999	58.3	椿本チエイン	64	267,840	64	267,840	9.2	10.1	21,290	9.2	10.1
豊和工業	9.8	9.9	4,623	15.4	大同工業	16.9	48,705	16.9	48,705	13.5	12.7	54,229	13.5	12.7
OKK	4.6	6.4	4,256	5.2	加藤製作所	4.6	3,666	4.6	3,666	1.9	2.1	10,122	1.9	2.1
石川製作所	5.9	6.5	5,772	9	油研工業	9.8	6,076	9.8	6,076	29.9	32.7	156,142	29.9	32.7
東洋機械金属	4.4	4.8	2,256	16.7	タダノ	20	22,360	20	22,360	129.7	284.6	4,044,166	129.7	284.6
津田駒工業	2.5	3	5,295	55.1	フジシマガリレイ	65.1	725,865	65.1	725,865	6.5	7	4,137	6.5	7
エンシュウ	7.5	8.4	3,981	3	オーイズミ	2.9	10,643	2.9	10,643	6.2	6.4	9,401	6.2	6.4
島精機製作所	2	2.4	2,229	5.9	ダイコク電機	6.4	6,412	6.4	6,412	6	6	9,564	6	6
オプトラン	2.5	2.4	2,174	1.7	アミノ	1.7	2,808	1.7	2,808	16.7	23.2	23,014	16.7	23.2
NCホールディングス	17.1	17.1	39,398	52	サクサホールディングス	57	57,342	57	57,342	4	4.4	3,445	4	4.4
イワキ	11.9	14.6	38,441	39.2	メルコホールディングス	40.8	103,224	40.8	103,224	11.8	12.9	64,113	11.8	12.9
フリュー	3.3	3.1	2,011	30	テクノメディア	27.4	65,677	27.4	65,677	15.6	19.3	36,477	15.6	19.3
ヤマシンフィルタ	5.1	7.6	6,429	8.2	日本電気	10	15,000	10	15,000	88	101.9	20,991	88	101.9
日版製作所	10.4	11.5	13,259	30.1	正興電機製作所	32.9	52,113	32.9	52,113	9.6	11	5,995	9.6	11
やまびこ	23.2	23.5	19,928	9.5	不二電機工業	9.2	13,606	9.2	13,606	4	5.5	12,325	4	5.5
平田機工	13.2	14.8	12,742	24	ジェエスエス	28	85,120	28	85,120	25.3	27.7	36,010	25.3	27.7
ベガスマシン製造	20.7	22.6	30,668	11.9	大崎電気工業	7.26	7,260	7.26	7,260	21.4	23.4	14,578	21.4	23.4
マルマシ	5	5.5	45,650	6.8	オムロン	7.6	12,046	7.6	12,046	96.7	98.4	954,480	96.7	98.4
タツモ	10.7	12.2	5,014	6.6	サカイ工業	8.1	36,652	8.1	36,652	15.8	17.3	37,108	15.8	17.3
ナプテスコ	4.4	4.3	5,594	4.6	アイシン	5.1	2,136	5.1	2,136	15.6	15.9	29,605	15.6	15.9
三井海洋開発	5	4.9	7,609	5.6	ルネサスエレクトロニクス	5.6	5,230	5.6	5,230	2.5	2.7	6,280	2.5	2.7
レオン自動機	62.8	68.9	337,265	18.1	セイコーエプソン	19.7	50,766	19.7	50,766	1.2	2.3	2,983	1.2	2.3
S M C	11.3	12.4	25,940	28.3	ワコム	31	79,236	31	79,236	36	42.4	146,068	36	42.4
ヤマハモーターサイクルシステムズ	10.5	11.4	14,113	15	アルバック	16.5	11,187	16.5	11,187	2.5	2.8	3,984	2.5	2.8
ホソカワミクロン	33.9	34.6	2,244,156	14.2	アクセル	16.5	7,326	16.5	7,326	3.8	4.1	15,785	3.8	4.1
ユニオンツール	9.3	—	—	10.1	E I Z O	10.6	9,423	10.6	9,423	2.4	2.8	4,536	2.4	2.8
オイレス工業	3.8	4.1	25,625	16.4	ジャパンディスプレイ	16.3	26,748	16.3	26,748	1.7	3.4	6,344	1.7	3.4
日精工・エス・ピー機械	4	4.4	15,180	27.6	日本信号	30.4	70,041	30.4	70,041	130.9	150.2	949,264	130.9	150.2
サトーホールディングス	13.8	16.5	28,726	10	京三製作所	11	21,417	11	21,417	103.9	106.4	1,710,380	103.9	106.4
技研製作所	3.6	3.4	20,604	15.6	能美防炎	19	21,584	19	21,584	43.9	47.9	53,456	43.9	47.9
日本エアテック	15.2	15.4	36,867	107	ホーチキ	107.5	184,470	107.5	184,470	4.8	4.4	3,872	4.8	4.4
カワタ	9.4	10.3	52,530	4	星和電機	4.5	4,603	4.5	4,603	5.2	5.7	16,569	5.2	5.7
日精樹脂工業	3.4	3.8	5,688	5	エレコム	5.5	12,375	5.5	12,375	11.7	13.8	61,341	11.7	13.8
オカダアイヨン	3.2	3.2	3,088	14.5	パナソニック	16	25,248	16	25,248	1.9	1.9	2,850	1.9	1.9
ワイエイシールディングス	9	9.2	8,675	22	シャープ	22.5	29,970	22.5	29,970	6.1	6.8	12,124	6.1	6.8
小松製作所	3.4	3.8	4,468	31.5	アンリツ	37.2	398,040	37.2	398,040	514.9	508.7	611,966	514.9	508.7
住友重機械工業	4.6	4.6	4,779	8.9	富士通ゼネラル	9.8	7,712	9.8	7,712	133.8	146.6	273,115	133.8	146.6
日立建機	488.3	535.7	1,654,241	203	ソニー	242.6	254,972	242.6	254,972	72.4	85.5	76,180	72.4	85.5
日工	61.7	67.6	213,278	249.6	TDK	272.6	84,506	272.6	84,506	19.8	21.8	107,365	19.8	21.8
巴工業	43.1	55.3	166,453	103.4	タムラ製作所	113.3	128,029	113.3	128,029	4.5	4.9	3,748	4.5	4.9
井関農機	14.8	17.6	13,217	10	アルプスアルパイン	11	48,235	11	48,235	8.4	10	38,250	8.4	10
TOWA	4.6	4.8	9,936	31.9	池上通信機	32.2	16,357	32.2	16,357	31.2	40.4	20,604	31.2	40.4
丸山製作所	10.8	11.8	17,405	62.7	帝国通信工業	73.7	261,266	73.7	261,266	27.4	27.6	27,048	27.4	27.6
北川鉄工所	10.9	11	22,066	8.4	タムラ製作所	7.9	7,884	7.9	7,884	25.2	25.4	11,125	25.2	25.4
ローテ	2.2	2.4	3,955	3.9	アルプスアルパイン	4.2	9,256	4.2	9,256	14.3	15.7	36,816	14.3	15.7
タカキタ	4.8	5.5	7,936	13.3	池上通信機	14.7	17,772	14.7	17,772	7.9	8.6	11,266	7.9	8.6
クボタ	4.7	5.2	40,352	7.1	池上通信機	7.3	4,358	7.3	4,358	5.4	5.9	4,271	5.4	5.9
荏原実業	3.7	4.3	3,074	10.9	池上通信機	12.1	22,155	12.1	22,155	11.7	13.5	68,445	11.7	13.5
三菱化工機	572.1	621.2	1,568,530	43.8	池上通信機	36.6	22,582	36.6	22,582	1,231.9	1,260.9	1,827,044	1,231.9	1,260.9
月島機械	2.7	2.9	11,861	140.6	池上通信機	154.2	766,374	154.2	766,374	124.7	136.8	306,568	124.7	136.8
帝国電機製作所	3.8	3.7	11,340	85.6	池上通信機	93.7	61,092	93.7	61,092	69.5	71	178,636	69.5	71
東京機械製作所	19.9	21.8	30,498	180.7	池上通信機	185.7	590,154	185.7	590,154	29.3	36.2	115,840	29.3	36.2
新東工業	8.9	8.3	10,557	77.6	池上通信機	79.5	166,791	79.5	166,791	681.6	740.6	8,957,557	681.6	740.6
澁谷工業	4.7	4.3	1,345	16.6	池上通信機	18.2	30,266	18.2	30,266	52	57.1	903,893	52	57.1
アイチコーポレーション	25.5	28.2	22,334	71.8	池上通信機	72	62,712	72	62,712	4.7	5.6	6,294	4.7	5.6
小森コーポレーション	9.4	10.4	37,024	66	池上通信機	56.8	276,900	66	276,900	36	42.3	23,688	36	42.3
	18.7	20.5	19,249	235.6	池上通信機	239.4	131,430	235.6	131,430	95.5	96.5	143,688	95.5	96.5
	27.3	30.1	21,792		池上通信機					3.5	4	3,468	3.5	4

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株	数	価 額		株	数	価 額		株	数	価 額
日本電波工業	千株	千株	千円	太陽誘電	千株	千株	千円	T B K	千株	千株	千円
鈴木	9.8	11.5	8,372	村田製作所	47.9	52.5	308,175	エクセディ	12.9	11.8	5,298
日本トリム	5.8	5.3	6,333	双葉電子工業	316.7	347.3	3,288,236	豊田合成	14.7	16	26,592
ローランド ディー・ジー	1.4	2.5	11,500	北陸電気工業	17	20.3	20,320	愛三工業	34.8	38.2	114,600
フォスター電機	5.9	7	12,838	ニチコン	4.3	4.6	4,443	盟和産業	16.9	18.5	11,322
S M K	11.3	12.4	18,910	日本ケミコン	36.6	37.1	52,756	ヨロズ	1.6	1.6	1,465
ヨコオ	2.8	3.1	9,501	K O A	8.2	11.9	20,658	日本プラス	8.4	10.3	5,963
ティアック	6.9	8.7	28,710	市光工業	16.2	16.3	27,106	エフ・シー・シー	10.1	10.2	14,280
ホンデン	8	7.3	985	小糸製作所	16.1	17.6	13,710	シマノ	17.6	19.3	32,539
ヒロセ電機	29.5	32.2	36,225	ミツバ	64.6	70.8	544,452	テイ・エス テック	40.4	44.3	1,087,786
日本航空電子工業	16.7	18.2	297,024	SCREENホールディングス	19.9	21.7	11,001	ジャムコ	25	27.4	86,858
T O A	24.7	27	45,873	キャノン電子	18.7	20.5	171,995	精密機器 (2.6%)	5.4	7	5,306
マクセルホールディングス	11.5	14	12,670	キャノン	11.3	10.9	19,227	テルモ	305.1	362.5	1,653,000
古野電気	23.3	23.4	34,351	象印マホービン	580.4	587.5	1,395,312	クリエートメディック	3.6	4.2	4,124
ユニデンホールディングス	13.9	15.1	17,938	MUTOHホールディングス	274.3	300.7	282,658	日機装	32.3	38.2	42,058
スミダコーポレーション	3	3	7,113	東京エレクトロン	31.6	31.9	59,621	日本エム・ディ・エム	6.2	6.8	14,708
アイコム	8.3	10	10,410	輸送用機器 (7.0%)	1.4	1.2	1,868	島津製作所	128.8	152.2	637,718
リオン	6	4.9	13,940	トヨタ紡織	71.9	69.3	2,851,695	J M S	9.2	10	11,540
本多通信工業	4.5	5	15,975	芦森工業	31.4	34.5	64,618	クボテック	2.8	3.1	1,159
船井電機	9.4	9.4	4,690	ユニプレス	2.2	2.4	2,460	長野計器	7.8	8.5	8,185
横河電機	10.9	13.4	6,324	豊田自動織機	20.9	19.3	21,654	ブイ・テックノロジー	5	5.5	35,200
新電元工業	98.9	118.3	282,855	三機工業	87.3	95.7	912,021	東京計器	6.9	7.5	7,177
アズビル	3.8	4.5	13,360	デンソー	18.9	19	34,827	愛知時計電機	1.3	1.2	5,334
東亜ディーケーケー	68	80	404,800	三井物産ホールディングス	13.7	16.3	15,273	インターアクション	5.8	5.9	15,045
日本光電工業	5.3	6.1	5,264	東海理化電機製作所	237.4	260.4	1,749,627	オーバル	9.8	10.7	3,520
テクノ	44.6	48.9	154,035	三井E&Sホールディングス	28.4	31.2	60,091	東京精密	19.5	19.9	90,744
共和電業	3.7	3.8	5,506	川崎重工工業	39	45.7	20,245	マニー	42.9	47	134,843
日本電子材料	11.3	13	5,187	名村造船所	83.9	91.9	221,019	ニコン	174.4	180.4	162,179
堀場製作所	4.3	4.3	8,376	日本車輛製造	34.7	35.7	6,961	トプコン	54.3	59.5	81,158
アドバンテスト	21.3	23.4	165,438	三菱ロジスネクスト	13.2	15.5	2,464	オリンパス	596.7	654.2	1,336,857
小野測器	80.2	87.9	777,036	近畿車輛	4	4.3	11,145	理研計器	9.5	10.5	32,182
エスベック	4.2	4.3	2,390	日産自動車	14.3	15.7	18,698	タムロン	8.7	9.5	20,510
キーエンス	9.5	10.5	21,231	いすゞ自動車	1.6	1.6	2,035	G O Y A	215.3	234.6	3,065,049
日置電機	97.7	116	6,583,000	トヨタ自動車	1,271.6	1,394.4	877,914	シード	4.6	5.2	3,354
シスメックス	5.6	5.7	23,740	日野自動車	312.4	342.6	393,304	ノーリツ銅機	7.2	10.6	23,415
日本マイクロニクス	77	92.2	1,095,797	三菱自動車工業	1,203.1	1,197.8	9,626,718	イー・アンド・ディ	9.8	9.9	13,087
メガチップス	18.8	20.6	32,774	エフテック	134.6	147.7	146,518	朝日インテック	91.6	124.4	414,252
OBARA GROUP	10	11.9	35,200	レスポールホールディングス	399	437.1	135,938	シチズン時計	126.3	149.2	54,010
澤藤電機	5.6	7	29,050	G M B	7.5	8.4	5,955	リズム	3.4	3.1	2,263
原田工業	1.3	1.3	2,701	ファルテック	4.4	4.6	2,829	大研医器	7.5	9.5	5,443
コーセル	5.1	5	4,550	武蔵精密工業	2	2.2	2,305	メニコン	14.8	18.1	120,908
イリソ電子工業	13.2	14.4	17,121	日産車体	1.9	2.3	1,731	シンシア	1.1	1.2	824
オプテックスグループ	9.1	9.9	50,985	新明和工業	24	26.4	43,612	松風	4.9	5.5	10,274
千代田インテグレイ	17.6	19.4	37,830	極東開発工業	21.1	17.3	15,760	セイコーホールディングス	15.2	16.6	26,609
アイ・オー・データ機器	5	5.1	9,327	日信工業	29.1	33.3	32,267	ニプロ	74.7	88.1	117,525
レーザータック	4	4.4	4,549	ティラー工業	20	20.4	32,762	その他製品 (2.5%)			
スタンレー電気	47.3	51.9	703,764	曙ブレーキ工業	21.9	—	—	中本バックス	2.8	3.1	5,418
岩崎電気	75.8	82.9	291,808	タチエス	8.9	9.8	14,131	スノーピーク	5.1	7	14,378
岩崎電機	4.2	4.3	6,811	N O K	3.9	3.7	5,901	バクマウントバッドホールディングス	11.4	11.4	54,663
岡谷電機産業	62.6	60.6	84,840	太平洋産業	59.3	64.1	10,961	トランザクション	6.9	6.4	7,180
ヘリオス テクノ ホールディング	8.5	8.9	3,408	K Y B	17.6	18.1	21,683	粧美堂	3.2	3	1,218
エノモト	9.9	11.2	3,998	大同メタル工業	57.9	57.2	81,224	ニホンフラッシュ	5	10.1	12,796
日本セラミック	3.3	3.3	5,824	プレス工業	30.1	29.6	16,605	前田工織	11.8	13	37,388
遠藤照明	10.9	12	36,360	ミクニ	12	13.2	34,848	永大産業	14.3	16.8	5,292
古河電池	5.4	6.7	3,912	大日本電産	20.7	24.6	13,677	アートネイチャー	11.5	11.6	7,992
双信電機	7.6	8.4	14,086	エフエス	53.5	58.5	20,884	バクダイナムホールディングス	111.5	97.8	903,574
山一電機	5.4	5.8	2,615	日産車体	13.7	16.1	4,620	アイフィスジャパン	2.8	3.2	2,307
図研	7.9	7.6	11,947	ケーヒン	22.5	24.8	30,975	共立印刷	18.4	21.9	2,825
日本電子	7	7.7	23,600	河西工業	24.8	—	—	S H O E I	5.2	10.4	44,200
カシオ計算機	21.2	21.6	90,504	アイシン精機	14.5	16.2	7,306	フランクフルトホールディングス	15.3	15.4	15,138
ファナック	95.4	95.1	190,580	マツダ	88.7	86.5	311,400	パイロットコーポレーション	17.5	20.9	67,402
日本シイエムケイ	102.4	103.8	2,932,869	今仙電機製作所	317.2	370.8	358,192	萩原工業	6	6.7	9,922
エンプラス	25.4	25.5	11,908	本田技研工業	10	10.4	7,904	トッパン・フォームズ	23.2	21.2	24,104
大真空	5.5	5.3	26,553	スズキ	849	930.9	2,804,801	フジシールインターナショナル	24.2	24.3	50,082
ROOM	4	4	9,624	S U B A R U	213.7	234.4	1,166,843	タカラトミー	48.3	52.9	50,731
浜松ホトニクス	47.8	49.2	551,532	安永	334.7	338.8	717,239	廣済堂	7.5	8.1	6,868
三井ハイテック	77.3	84.8	541,872	ヤマハ発動機	11.9	5.2	7,119	エスターホールディングス	2.8	4	2,584
新光電気工業	11.9	11.6	47,792	ショーワ	36.2	140.6	413,906	アーク	41.5	—	—
京セラ	151.7	180.2	1,248,786		25.4	—	—	タカノ	4.2	4.5	2,704

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
プロネックス	千株	千株	千円	鴻池運輸	千株	千株	千円	クロスキャット	千株	千株	千円
ホクシン	9.3	10.3	12,030	西日本鉄道	17.1	19	20,805	システナ	2.8	3	3,690
ウッドワン	7.2	8.5	994	ハマキョウレックス	29.9	32.8	97,088	デジタルアーツ	37.7	41.4	83,172
大建工業	3.5	3.4	3,733	サカイイ越センター	8.3	9.1	30,667	日鉄ソリューションズ	5.2	6.8	70,040
凸版印刷	7.2	8	14,808	近鉄グループホールディングス	5.7	5.5	29,095	キューブシステム	15.9	17.3	60,896
大日本印刷	152.2	179.6	290,952	阪神ホールディングス	102.1	111.9	536,001	エイジア	5.6	6.2	7,303
共同印刷	141.1	142.8	286,456	南海電気鉄道	136.2	149.3	555,396	コア	1.9	1.8	3,319
N I S S H A	3.4	3.7	13,597	京阪ホールディングス	48.4	53.1	144,697	ラクーンホールディングス	4.5	4.9	7,599
光村印刷	22.1	24.3	35,235	神戸電鉄	45.5	49.9	257,983	ソリトンシステムズ	5.1	8.2	16,334
TAKARA & COMPANY	0.9	0.8	1,436	山陽電気鉄道	2.4	2.8	10,500	ソフトクリエイトホールディングス	4.6	5.8	10,242
アシックス	5.2	5.8	10,440	ヤマトホールディングス	83.9	92.1	261,379	T I S	4.6	4.5	12,123
ツツミ	89	104.6	204,702	丸連	7.3	8.1	17,074	JNSホールディングス	35.3	116	283,272
ローランド	3.4	3	5,739	丸全昭利運輸	36.1	38.8	299,536	電算システム	4.3	5.5	3,151
小松ウオール工業	—	6.9	27,117	センコグループホールディングス	179	157	449,962	エニグモ	4.1	4.3	13,029
ヤマハ	3.4	3.7	6,645	トナミホールディングス	28.4	28.7	128,289	GMOベババ	64.9	71.1	43,726
河合楽器製作所	64.2	70.3	447,108	ニッコンホールディングス	5.9	7.6	1,968	コーエーテックモホールディングス	—	0.8	4,624
クリナップ	3.4	3.3	10,065	日本石油輸送	8.3	9.1	32,396	三菱総合研究所	21.6	23.7	149,073
ビジョン	10.1	11.4	5,814	福山通運	56.3	61.9	62,828	ボルテージ	4.6	5	20,975
オリバー	65.2	75.9	340,411	セイノールホールディングス	2.4	2.3	13,501	電算	1.9	2.8	1,512
兼松サステック	2.2	2.4	6,345	エスライン	36.5	37.6	85,540	AGS	1.2	1	2,539
キングジム	0.7	0.6	1,057	神奈川中央交通	1.1	0.9	2,394	ファインデックス	5.9	6.1	5,105
リンテック	9	10.2	9,169	日立物流	13.1	14.4	65,232	ブレインパッド	9	9.7	10,864
イトーキ	25.6	25.4	61,366	丸和運輸機関	76.5	83.9	128,702	K L a b	2.1	2.9	12,397
任天堂	22.9	23.3	8,108	C&Fロジックホールディングス	3.1	3	2,709	エムアップホールディングス	20.4	21.2	20,966
三菱鉛筆	66.1	67.7	4,295,565	九州旅客鉄道	2.5	2.5	9,825	エイチーム	12.7	15.4	18,587
タカラスタンダード	17.7	19.5	27,865	S Gホールディングス	18.8	24.7	84,721	テクノスジャパン	1.5	1.9	4,727
コクヨ	22.2	24.5	40,400	日本郵船	10.8	23.6	50,409	en i s h	301.2	293.1	1,017,057
ナカバヤシ	51.7	56.6	82,239	商船三井	10.3	11.4	23,210	コロブラ	27.3	35.3	16,696
グローブライド	10.7	12.1	7,562	川崎汽船	91.1	86.4	220,665	プロードリーフ	3.1	3	7,266
オカムラ	4.8	5.7	24,367	NTSユニテッド海運	107.2	211.7	544,492	クロス・マーケティンググループ	7.2	8	9,792
美津濃	37.6	45.4	49,440	飯野海運	—	—	—	デジタルハーツホールディングス	7.5	10.9	14,137
電気・ガス業 (1.3%)	9.8	11.7	27,144	乾汽船	85.4	93.6	276,120	システム情報	8.3	8.9	6,363
東京電力ホールディングス	860.8	1,002.3	407,936	日本航空	64.6	66.4	204,844	メディアアドゥ	4.7	5.9	2,979
中部電力	330	361.8	488,249	ANAホールディングス	31.4	34.5	67,930	じげん	34.7	38	35,986
関西電力	408.6	448	479,360	パスコ	5.6	5.4	8,456	ブイキューブ	7.9	6.8	2,944
中国電力	149.1	170.7	223,787	倉庫・運輸関連業 (0.2%)	10.2	12.3	5,043	エンカレッジ・テクノロジ	52.5	57.4	37,424
北陸電力	98.6	108.1	75,886	三井物産	48.1	52.4	22,741	サイバーリンクス	4.9	5.4	2,143
東北電力	269.6	276.8	259,361	日新	1.8	2.2	2,085	ディー・エル・イー	5.6	5.3	6,990
四国電力	97.2	98.2	74,533	三菱倉庫	5.9	5.9	5,846	フィックスターズ	5.4	8.5	10,081
九州電力	222.3	261	246,123	三井倉庫ホールディングス	183.8	272.7	606,212	CARTA HOLDINGS	3.4	4.4	27,236
北海道電力	101	110.3	51,841	住友倉庫	186.6	302.1	721,565	オプティム	26.2	28.2	11,928
沖縄電力	20	23	33,281	住友倉庫	1.9	2.2	3,416	セレス	6.5	6.3	19,246
電源開発	85.9	94	164,970	東陽倉庫	2.9	3.4	29,648	S H I F T	1.7	2.2	1,471
エフオン	5.1	7.2	8,071	キムラユニティ	32.4	38.7	125,001	ティーガイア	1.6	3.8	8,208
イーレックス	15.3	17.3	30,396	キムラユニティ	8.8	9	12,591	ディー・エル・イー	7.9	9.2	2,999
レノバ	17.8	19.9	74,426	キムラユニティ	32.4	38.7	125,001	フィックスターズ	11.2	12.2	12,322
東京瓦斯	207.5	227.3	527,676	キムラユニティ	11.6	11.9	27,036	CARTA HOLDINGS	5.1	4.7	6,283
大阪瓦斯	209.3	214.1	432,053	キムラユニティ	37.5	40.3	56,460	オプティム	2.8	8.1	26,365
東邦瓦斯	53	58.1	381,136	キムラユニティ	5.6	6.3	14,565	セレス	3.5	3.8	10,260
北海道瓦斯	5.8	6.6	10,791	キムラユニティ	18.5	16.8	5,796	S H I F T	2.8	5.2	67,288
広島ガス	22.4	25.4	9,804	キムラユニティ	22.5	25.1	14,809	ティーガイア	9.4	12.3	23,628
西部瓦斯	12.1	13.3	39,806	キムラユニティ	1.8	1.7	2,327	セック	1.5	1.7	4,836
静岡ガス	30.6	33.5	33,165	キムラユニティ	6.2	6.4	7,628	日本アジアグループ	11.1	11.2	14,425
メタウォーター	5.2	13.4	30,860	キムラユニティ	1.8	2.1	2,480	豆蔵ホールディングス	7.2	—	—
陸運業 (3.6%)				キムラユニティ	8.4	9.6	9,177	テックマトリックス	7.4	17.9	34,708
SBSホールディングス	9.3	8.7	22,011	キムラユニティ	2.2	2	2,296	プロシッパ	3.1	3.4	4,848
東武鉄道	113.7	123.2	394,240	キムラユニティ	3.1	3	4,266	ガホー・オンライン・エンターテイメント	25.5	27.9	73,181
相鉄ホールディングス	34.5	40.5	106,393	キムラユニティ	8.7	8.5	3,995	GMOベイメントゲートウェイ	17.4	24.6	378,594
東急	271.9	298.1	432,245	キムラユニティ	58.5	62.4	123,614	ザッパリス	5.6	4.6	2,093
京浜急行電鉄	138.5	151.8	268,230	キムラユニティ	2.3	2.3	1,649	システムリサーチ	2.9	3.4	6,245
小田急電鉄	160.3	189.4	623,126	キムラユニティ	2.8	3.5	3,976	インターネットイニシアティブ	15.6	30.9	70,050
京王電鉄	56	66	564,960	キムラユニティ	2.5	2.9	4,663	ざくらインターネット	11.3	12.2	8,491
京成電鉄	75.1	88.6	352,628	キムラユニティ	21.6	21.2	57,579	ヴィンクス	3	3.2	3,843
富士急行	14.7	16.1	92,736	キムラユニティ	5.8	7.9	2,512	S R Aホールディングス	1.9	2.5	24,950
新京成電鉄	2.8	3	6,873	キムラユニティ	7.2	7.2	7,905	システムインテグレータ	5.6	6.2	16,002
東日本旅客鉄道	189.8	208.1	1,600,497	キムラユニティ	3.6	4.1	5,161	朝日ネット	3.4	3.2	2,025
西日本旅客鉄道	96.1	105.3	680,448	キムラユニティ	3.3	3.7	6,397	e B A S E	7.5	9.4	8,262
東海旅客鉄道	89.7	98.3	1,678,472	キムラユニティ	—	—	—	アバント	6.3	13.8	14,172
西武ホールディングス	144.7	142.4	170,025	キムラユニティ	—	—	—	アドソル日進	7.5	12.4	19,108
				キムラユニティ	10	38.3	76,408		3.8	4.1	11,951

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
ODKソリューションズ	千株	千株	千円	ベース	千株	千株	千円	ゼンリン	千株	千株	千円
フリービット	—	2	1,550	フォーカスシステムズ	—	1	5,420	昭文ホールディングス	21.1	21	29,505
コムチュア	6.3	6.9	6,706	クレスコ	6.5	7.7	7,546	インプレスホールディングス	5	4.4	2,050
サイバーコム	11.8	10.7	33,116	フジ・メディア・ホールディングス	6.5	7.9	11,194	アイネット	8.8	10	1,950
アステリア	1.8	2.1	3,654	オービック	101.9	120.1	159,372	松竹	5.4	6	9,168
アイル	6.4	8.3	8,715	ジャストシステム	36.7	36.6	718,824	東宝	7	7.6	116,888
マークラインズ	3.8	6.5	10,276	TDCソフト	17.2	16.5	129,030	東映	63.2	68.5	289,412
メディカル・データ・ビジョン	5.3	4.8	12,086	Zホールディングス	9.3	10.2	9,904	Eヌ・ティ・ティ・データ	4	3.8	76,646
gumi	8.1	13.2	33,950	トレンドマイクロ	1,452.9	1,593.8	1,063,064	ピー・シー・エー	281.7	309	518,193
ショーケース	13.6	16	14,672	IDホールディングス	47	61.9	372,019	ビジネスブレイン太田昭	1.3	1.7	7,633
モバイルファクトリー	2.4	2.4	2,409	日本オラクル	4.1	4.5	5,728	DT S	1.8	4	7,236
テラスカイ	2.3	2.4	2,680	アルファシステムズ	21.4	23.5	301,035	スウェア・エンクス・ホールディングス	23.7	24	58,080
データ・インフォメーション・テクノロジ	3.8	3.7	14,152	フューチャー	3.3	3.1	11,966	シーイーシー	45.1	49.5	346,995
PCIホールディングス	4.7	5.1	8,221	CAC Holdings	12.7	14	27,356	カブコン	11.3	12.2	17,677
パイプドHD	2.1	4.4	6,116	S Bテクノロジ	6.8	7.5	10,725	アイ・エス・ピー	49.9	49.7	339,948
アイビージー	1.3	2.4	3,796	トーセ	3.8	4.2	12,999	ジャステック	2	5.3	7,234
ネオジャパン	1.9	1.9	2,101	オービックビジネスコンサルタント	2.9	3.3	2,653	S C S K	6.7	7.3	9,117
P R T I M E S	1.9	2.2	4,052	伊藤忠テクノソリューションズ	10.8	11.9	80,920	日本システムウェア	24.4	26.8	179,024
ランドコンピュータ	0.9	2.4	8,964	アイティフォー	48.2	52.9	195,730	アイネス	3.5	3.8	7,923
ダブルスタンダード	1.6	1.5	1,707	東計電算	12.9	15.1	13,741	T K C	10.4	11.3	15,740
オープンドア	1.3	1.5	6,615	エックスネット	1.5	1.8	7,542	富士ソフト	9	9.8	71,050
マイネット	5.2	6.9	14,276	大塚商会	1.6	2.2	2,206	N S D	13.6	12.3	70,479
アカツキ	3.5	3.8	3,587	サイボウズ	57.2	62.8	331,584	コナミホールディングス	34.8	37.3	75,980
ベネフィットジャパン	3.8	4.6	19,964	ソフトブレーン	12.3	13.5	37,732	電研コンピュータホールディングス	38.5	42.1	309,435
Ubicomホールディングス	0.8	0.9	1,746	電通国際情報サービス	6.2	—	—	BCCホールディングス	4.2	5.3	20,908
L I N E	2.3	3	9,720	A C C E S S	6.5	14.4	58,032	ミロク情報サービス	7.1	7.8	11,832
カナミックネットワーク	24.2	—	—	デジタルガレージ	—	10.8	8,424	ソフトバンクグループ	9.3	11.5	25,656
ノムラシステムコーポレーション	6.4	10.6	7,706	イーエムシステムズ	19.1	19.1	77,164	卸売業 (4.5%)	839.5	920.5	8,730,942
チェンジ	2.3	5.1	1,907	ウェザーニューズ	14.9	19.2	18,316	ハウスイ	0.9	0.6	604
シンクロ・フード	2.1	16.2	58,887	C I J	3.6	3.4	17,612	高干糖交易	4.1	4.7	5,729
オークネット	4.6	6.9	2,566	ビジネスエンジニアリング	7.9	7.9	7,149	オルパルストアホールディングス	—	1.6	2,544
キャピタル・アセット・プランニング	6.5	6.1	8,021	日本エンタープライズ	1.2	1.2	4,080	伊藤忠食品	2.4	2.4	12,768
セググループ	—	1.5	1,491	WOWOW	10.8	11.6	2,865	エレマテック	9.9	9.4	10,020
エイトレッド	1.7	2.9	3,775	スカラ	5.1	5.7	16,404	J A L U X	3.1	3.3	5,240
AOI TYO HOLDINGS	1.3	2.2	5,717	インテリジェント ウェブ	7.5	10.3	8,549	あらた	8.5	9.3	45,570
マクロミル	10.7	12	5,580	IMAGICA GROUP	4	6.9	4,974	トーメンデバイス	1.6	1.6	6,400
ビーグリー	18.9	23.6	20,437	ネットワンシステムズ	9	10	4,030	東京エレクトロニクス	1.6	3.9	13,813
オロ	2	2.3	4,054	システムソフト	40.3	47.3	172,172	フィールズ	8.2	10.2	5,783
ユーザーローカル	2.8	3.6	13,860	アルゴグラフィックス	26.3	25.5	3,162	双日	586.6	641.6	168,740
テモナ	—	1.8	7,560	メバラス	9	9	28,305	アルフレッサ ホールディングス	118	120.7	267,471
ニーズウェル	1.3	2.5	2,527	エイベックス	16.1	18.2	16,398	横浜冷凍	29.9	30.8	27,812
サンポスト	1.2	2.2	1,515	日本ユニシス	18.2	19.9	28,536	神栄	1.5	1.6	2,657
ソルクシーズ	1.6	2.6	2,631	兼松エレクトロニクス	3.3	40.3	143,266	アルコニック	5.6	6.5	6,051
フェイス	4.5	4.4	4,386	TBSホールディングス	5.7	6.4	24,576	神戸物産	11.2	12.3	20,750
プロトコーポレーション	3.8	3.6	3,002	日本テレビホールディングス	—	4.3	6,712	ハイパー	36.6	80.4	244,014
ハイマックス	9.5	10.4	12,823	朝日放送グループホールディングス	64.4	76.9	170,641	あい ホールディングス	—	2	1,088
野村総合研究所	1.2	2.9	4,355	テレビ朝日ホールディングス	88.3	96.6	137,751	ディービーエックス	15.2	16.7	35,003
サイバネットシステム	149.9	211.8	751,890	スカパーJSATホールディングス	10.5	12.1	8,796	ダイボウホールディングス	3.8	4	4,268
CEホールディングス	7.5	8.2	8,077	テレビ東京ホールディングス	29.1	35.8	77,614	マクニコ・富士エレクトロニクス	9.1	10.6	90,312
日本システム技術	6.1	6.2	3,844	日本BS放送	69.6	76.3	37,844	ラクト・ジャパン	25.3	27.7	61,909
インテリジェントホールディングス	1.7	2.1	3,303	ビジョン	8.7	8.5	21,173	グリムス	4	5.1	13,882
東邦システムサイエンス	13.3	14.4	17,323	スマートバリュー	3.6	4.1	4,825	八洲電機	20	2.5	4,362
ソースネクスト	2.9	3	2,817	USEN-NEXT HOLDINGS	9.9	14.2	14,185	メディアスホールディングス	—	20.6	17,180
インフォコム	50.2	54.7	17,230	ワイヤレスゲート	3.1	3.1	2,938	レスタールホールディングス	8.3	9.2	8,914
HEROZ	11.5	10.6	32,489	コネクショ	4	4.4	7,810	ジュテックホールディングス	6	6.8	6,038
ラクスル	0.5	3.2	9,888	日本通信	5	4.8	3,124	大光	11.1	12.2	26,242
I P S	5.6	9.4	38,493	クロップス	6	6.7	9,393	OCH Iホールディングス	2.3	2.3	2,449
FIG	—	2.1	5,592	日本電信電話	81.8	102	20,910	TOKAIホールディングス	4.6	4.9	3,278
システムサポート	11.6	12.6	3,376	KDD I	1.9	2.3	1,826	黒谷	3.1	3.5	4,777
イソソル	0.9	3.4	5,215	ソフトバンク	1,414.3	1,357.1	3,781,559	Cominix	56.2	56.6	56,883
アルテリア・ネットワークス	3.8	6.2	8,314	光通信	788.5	930.4	3,104,744	三洋貿易	1.9	3.3	2,372
EDULAB	11.7	12.8	21,030	エムティーアイ	10.9	13.7	295,920	ビューティガレージ	1.8	1.7	1,319
東海ソフト	—	1.1	8,041	GMOインターネット	781.6	—	—	ウイン・パートナーズ	10.6	11.6	12,980
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	1.4	1,668	ファイバーゲート	10.2	11.4	10,077	ミタチ産業	1.7	1.9	4,755
東名	2.4	2	2,428	アイトマルマーケティングコミュニケーション	41.7	41.5	134,875	シブハルスケアホールディングス	7.6	8.5	9,987
ヴィッツ	—	0.6	670	KADOKAWA	2	3.7	8,091	明治電機工業	3.2	3	1,785
トビラシステムズ	—	1.1	1,579	学研ホールディングス	3.2	2.9	1,342	デリカフーズホールディングス	17	20.6	130,604
Link-u	—	0.7	966	—	28.5	31.3	121,757	—	3.4	3.1	4,495
ギフティ	—	5.2	17,784	—	3.6	15.6	26,754	—	3.9	5.2	3,328

銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株価	株数	評価額		株数	株価	株数	評価額		株数	株価	株数	評価額
スターティアホールディングス	千株	千円	千株	千円	佐藤商事	千株	千円	千株	千円	スズケン	千株	千円	千株	千円
コメダホールディングス	23.2	2.4	25.4	2,454	菱洋エレクトロ	10.8	8.8	10	9,850	ジェコス	45	49.3	212,236	
ピーバンドットコム	—	1.5	1.426	50,342	東京産業	9.6	11	11	25,678	グローセル	7.3	8.2	7,986	
アセンテック	0.8	2.9	5,417		ユアサ商事	10.1	12	12	7,370	小売業 (4.7%)	9.4	12.9	6,566	
富士興産	3.3	3.5	4,665		神鋼商事	2.7	2.7	2.7	39,480	ローソン	26.8	29.5	158,710	
協栄産業	1.2	1.5	2,095		トルク	6.3	5.8	5.8	5,402	サンエー	8.9	8.8	37,708	
小野建	9.6	10.7	13,407		阪和興業	19.9	23.2	23.2	2,700	カワチ薬品	8.3	8.1	24,624	
南陽	2.1	2.1	3,540		正栄食品工業	6.8	7.5	7.5	1,548	エービーシー・マート	16.6	18.1	117,107	
佐島電機	7.9	7.4	5,638		カナデン	8.6	9.6	9.6	68,092	ハードオフコーポレーション	4.2	5.4	4,266	
エコートレーディング	2.3	2.6	1,799		菱電商事	7.6	8.4	8.4	29,437	アスクル	11.1	10.1	39,137	
伯東	6.5	7.1	9,201		フルサト工業	5.9	6.3	6.3	12,220	ゲオホールディングス	19.1	15.6	19,874	
コンドーテック	8.3	9.2	9,926		岩谷産業	23.6	27.9	27.9	13,784	アダストリア	14.7	16.1	34,212	
中山福	6.2	7.1	3,819		ナイス	4.6	4.7	4.7	8,366	ジープット	6.4	7.6	3,268	
ナガイレーベン	15.4	15.5	48,205		昭光通商	3.5	3.4	2.91	180,234	シー・ワイ・エス・バイエリア	1.5	2	840	
三菱食品	11.6	12.9	37,474		ニチモウ	1.7	1.6	3.086	27.9	くら寿司	5.5	6.9	46,713	
松田産業	7.8	8.5	16,192		極東貿易	3.1	3	4.215	7.764	キャンドウ	5.1	5.6	10,651	
第一興商	15.8	17.3	69,373		イワキ	14	15.2	9.910	2,291	アイケイ	—	2.5	2,247	
メディカルホールディングス	114.6	116.7	261,174		三菱石油	26.1	28.7	32,344	9.613	バルグループホールディングス	5.4	10.2	16,932	
S P K	2.2	5.2	6,812		稲畑産業	23.4	27.9	45,393	23,541	エディオン	48.8	49.3	53,441	
萩原電気ホールディングス	4	4.4	12,315		G S I クレオス	2.5	2.8	6,104	77,994	サウコーポレーション	21.6	23.9	14,005	
アズワン	6.9	8.3	127,820		明和産業	9.8	10.8	5,076	52,542	ワッツ	4.8	5.2	4,664	
スズデン	3.7	3.5	4,389		クワザホールディングス	3.8	4.4	2,961	21,665	ハローズ	4	4.4	13,860	
尾家産業	3.1	3	3,978		ヤマエク野	—	8.5	9,613	14,061	フジオフードグループ本社	9	9.8	12,828	
シモンマ	6.5	6.5	9,145		ワキタ	22.6	22.9	23,541	14,061	あみやき亭	2.2	2.5	7,377	
ドウシシャ	10.1	11	20,680		東邦ホールディングス	34.1	37.3	77,994	2,262	ひらまつ	19.6	21.9	3,810	
小津産業	2.3	2.3	4,397		サンゲツ	29.2	31.5	52,542	3,650	大黒天物産	2.5	2.7	16,200	
高速	6.3	6.3	10,111		ミツコグループホールディングス	15.7	17.1	21,665	108,273	ハニースホールディングス	9.4	9.1	9,236	
たけびし	3.5	3.5	5,565		シナホホールディングス	4.4	4.3	14,061	7,098	ファーマイズホールディングス	2.5	3.3	2,577	
リックス	2.3	2.2	3,773		伊藤忠エネクス	23.5	26	26,910	51,315	アルペン	8.2	8.9	20,105	
丸文	9.4	10.6	5,989		サンリオ	29.8	32.6	55,452	26,901	ハブ	3.1	3.6	2,538	
ハピネット	8.9	9.7	16,266		サンワ テクノス	7.5	7.6	8,436	6,102	クオールホールディングス	15.6	15.7	22,011	
橋本総業ホールディングス	2.1	2	5,008		リョーサン	11.7	12.8	30,438	14,215	ジンスホールディングス	5.6	6.2	45,198	
日本ライフライン	31.4	37.6	55,384		新光商事	16.7	15.9	12,497	3,650	ビックカメラ	62.9	69	84,594	
タカショー	5.4	7.4	5,653		トーホー	4.8	5.4	10,303	108,273	DCMホールディングス	57.3	71.9	78,083	
エクセル	3.1	—	—		三信電気	5.7	6.4	13,344	7,098	ベッパーフードサービス	8.5	13.2	3,722	
マルカ	3.8	3.8	7,527		東陽テクニカ	12.2	12.2	14,554	51,315	MonotaRO	75.5	82.8	475,272	
! DOM	28.7	39.3	26,095		モスフードサービス	14	16.5	51,315	6,102	東京一番フーズ	2.7	2.6	1,534	
進和	6.3	7	15,638		加賀電子	10.6	10.5	26,901	14,215	DDホールディングス	4.2	5.2	3,556	
エスケイジャパン	2.2	2.7	1,236		ソーダニッカ	10.8	11.3	6,102	3,650	きちりホールディングス	2.9	3.4	2,080	
ダイトロン	4.5	5	8,300		立花エレクトック	7.9	8.7	14,215	108,273	アークランドサービスホールディングス	7.8	9.7	21,262	
シークス	13.5	14.8	24,375		フローパル	4.7	4.3	3,650	7,098	J. フロント リテイリング	126.8	139	139,139	
田中商事	3.4	3.1	2,176		P A L T A C	17	18.7	108,273	3,274	ドトール・日食ホールディングス	16.9	18.4	30,875	
オーハシテクニカ	5.9	6.2	8,500		三谷産業	14.2	15.6	7,098	3,274	マツモトキヨシホールディングス	43.9	48.1	222,222	
白銅	3.9	3.6	5,320		太平洋興発	4.1	5.1	3,274	7,254	プロコンビリー	5.5	6.1	14,139	
ダイコー通産	—	1.1	1,741		飲料品 smelt a c c o r d i n g t o	1.9	2.6	7,254	1,706	Z O Z O	73	68.7	246,976	
伊藤忠商事	742.8	814.6	2,526,074		ヤマトヘルスマネジメントホールディングス	0.8	1.1	1,706	4,524	トレジャー・ファクトリー	3.2	3.4	2,760	
丸紅	1,105.3	1,148.1	853,956		コア商事ホールディングス	—	3.3	4,524	6,273	物語コーポレーション	2.7	3.1	37,541	
高島	1.6	1.6	2,710		国際紙パルプ商事	25.2	25.5	6,273	7,568	ココカラファイン	11.1	10.4	79,560	
長瀬産業	59.8	65.5	114,297		ヤマタネ	5.3	5.3	7,568	1,655	三井伊勢丹ホールディングス	185.6	203.4	150,516	
蝶理	6.8	7.5	12,412		丸紅建材リース	1	0.9	1,655	32,079	H a m e e	3.3	2.9	5,121	
豊田通商	118.5	116.9	550,599		日鉄物産	7.5	8.3	32,079	11,022	ウエルシアホールディングス	31.6	61.5	222,630	
三共生興	16	18	9,396		泉州電業	3.3	3.3	11,022	76,655	クワイエスDホールディングス	17.8	17.1	60,277	
兼松	39.6	46.5	67,378		オートバックスセブン	22.1	26.7	76,655	61,646	丸連CH1ホールディングス	12.4	15.4	5,790	
ツカモトコーポレーション	1.8	1.7	2,585		モリト	39.4	43.2	61,646	5,562	ミザワ	2.1	2.4	1,608	
三井物産	933.4	945.5	1,900,455		加藤産業	7.8	9	5,562	60,671	ディーライフ	1.4	1.7	2,055	
日本紙パルプ商事	6	6.1	22,539		北恵	16.6	16.9	60,671	3,004	エー・ピーホールディングス	2	1.9	805	
日立ハイテック	36.9	—	—		イノテック	2	3.2	3,004	8,058	チムニー	3.3	3.5	4,938	
カメイ	13.9	15.2	18,939		イエローハット	6.3	6.6	8,058	39,288	シュッピン	7.2	7.9	7,497	
東都水産	1.3	1.4	4,963		J K ホールディングス	20.1	21.9	39,288	9,137	オイシックス・ラ・大地	—	11.5	35,707	
OUGホールディングス	1.6	1.8	5,122		日伝	9.6	9.7	21,786	1,934	ネクステージ	15.2	19.9	33,969	
スターゼン	3.9	4.3	19,371		日伝	9.6	9.7	21,786	14,059	ジョイフル本田	31.1	34.2	49,384	
山善	41.4	45.5	47,502		北沢産業	7.8	7.3	1,934	78,745	鳥貴族ホールディングス	3.5	3.3	5,369	
椿本興業	1.9	1.7	6,230		杉本商事	5.7	5.9	14,059	11,111	キリン堂ホールディングス	4.2	—	—	
住友商事	670	734.9	1,094,633		因幡電機産業	30.2	31.1	78,745	525,600	ホットランド	7.1	8.6	10,732	
内田洋行	4.5	4.6	20,447		東テック	3.5	3.9	11,111	2,525	すかいらーくホールディングス	119	130.4	223,896	
三菱商事	745.2	709	2,012,142		ミスミグループ本社	133	146	525,600	8,056	S F Pホールディングス	4.5	5.7	8,567	
第一実業	5.2	5.3	22,472		アルテック	8.6	8.8	2,525	4	綿半ホールディングス	4	8.8	11,897	
キャノンマーケティングジャパン	30.4	28.9	71,469		タキヒヨー	3.1	4	8,056	30.9	ヨシックス	1.7	2.3	5,048	
西華産業	6	6.2	8,872		蔵王産業	2.1	1.9	2,650	30.9	20(チタニ)スノーマウント・ホールディングス	30.9	33.9	39,188	

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	6	5,916	SRSホールディングス	12.5	14.6	12,585	ヤマザワ	2	2.6	4,555
B E E N O S	4	5.4	12,792	千趣会	19.2	20.9	7,064	やまや	2.1	2.5	5,577
あさひ	8	8.6	13,975	タカキュー	8.6	9.9	1,485	ペルーナ	22.7	25	26,350
日本調剤	3.3	7.1	11,786	リテールパートナーズ	—	14.1	19,711	銀行業 (4.7%)			
コスモス薬品	4.7	11.8	197,296	ケーヨー	21.8	21.6	16,372	島根銀行	2.1	4.3	2,906
トーエル	5.2	5.7	4,776	上新電機	12.5	13.7	42,744	じもとホールディングス	72.2	8	6,648
オンリー	1.8	2.6	1,209	日本瓦斯	16.8	19.2	100,800	じもとホールディングス	72.2	8	6,648
セブン&アイ・ホールディングス	415.4	455.6	1,935,388	ロイヤルホールディングス	18.6	20.3	38,955	あさひフィナンシャルグループ	552.6	604.6	130,593
クワイエット・レストラン・ホールディングス	28.6	62.5	55,437	東大紅	0.8	0.6	554	九州フィナンシャルグループ	174.5	238	105,196
ツルハホールディングス	23.1	25.4	372,110	島忠	13.2	13	22,750	ゆうちょ銀行	301.3	330.8	318,560
サンマルクホールディングス	8.4	9.1	14,696	チヨダ	20	—	—	富山第一銀行	25.4	28.6	8,608
フェリスシモ	2.3	2.6	3,458	ライフコーポレーション	11.1	12.2	12,285	コンソルティア・フィナンシャルグループ	625.3	709.7	291,686
トリドールホールディングス	13.2	28.8	47,001	リンガーハット	8.1	8.8	29,656	西武フィナンシャルホールディングス	72.5	77.6	53,388
TOKYO BASE	9.6	10.4	6,905	Mr M a x H D	13.1	14.4	35,913	関西フィナンシャルグループ	62.4	54.8	31,181
ウィルプラスホールディングス	1.6	1.9	1,575	テンアライド	14.6	15.9	12,465	三井フィナンシャルグループ	9.9	10.2	13,637
JMホールディングス	5.4	8.8	18,647	AOKIホールディングス	9.8	11.7	4,223	新設建設フィナンシャルグループ	18.5	19	44,270
サツドラホールディングス	1.5	1.5	3,097	オークワ	21.2	23.1	14,691	ひろぎんホールディングス	—	172.2	110,380
アレナホールディングス	5.3	6.7	9,339	オモリ	16.6	18.2	23,314	新生銀行	78	95.1	131,428
華か田中ホールディングス	1.6	3	5,172	青山商事	16.4	18	51,948	あおぞら銀行	63.3	69.4	148,169
パロックスジャンリミテッド	7.3	8.1	6,625	しまむら	21.9	25.7	18,735	三井住友フィナンシャル・グループ	7,320.8	7,977.2	4,144,953
グスリのアオキホールディングス	9.5	11.6	102,544	はせがわ	12.3	13.5	157,545	りそなホールディングス	1,167	1,267.6	513,758
カノ源ホールディングス	4.8	5.4	3,520	高島屋	5.3	5.2	1,549	三井住友トラスト・ホールディングス	201	220.5	771,529
スシローホールディングス	11.6	63.9	269,658	松屋	77.4	84.7	93,000	三井住友フィナンシャルグループ	735.5	807.1	2,881,347
L I X I L ビバ	10.5	—	—	エイチ・ウー・オー リテイリング	21.4	25.4	24,384	千葉銀行	365.7	388.8	250,776
メディカルシステムネットワーク	10.3	10.2	7,701	近鉄百貨店	50.3	55	45,815	群馬銀行	209	239.8	81,532
はるやまホールディングス	4.5	6.1	4,385	丸コ	4	4.5	15,277	武蔵野銀行	15.8	17.3	28,233
ノジマ	18.9	20.7	57,525	パルコ	10.2	—	—	千葉興業銀行	29.2	29.8	7,688
カッパ・クリエイティブ	14.9	16.4	25,420	丸井グループ	97.3	98.5	207,539	筑波銀行	44.4	48.4	9,002
ライトオン	8	8.8	5,737	アグリアル リテイリング	8.8	9.7	48,694	七十七銀行	35.9	36.6	51,715
ジーンズメイト	3.4	3.6	1,130	井筒屋	5.8	6.3	1,417	青森銀行	8.3	9	22,077
良品計画	141	154.5	391,348	イオン	408.7	448.1	1,543,704	秋田銀行	6.8	7.1	10,089
三城ホールディングス	11.5	14.9	4,410	イズミ	21.6	23.6	95,580	山形銀行	11.9	13	13,884
アドヴァン	16.2	12	13,560	平和堂	21.5	21.5	47,558	岩手銀行	6.9	7.6	15,481
アルビス	4	3.7	9,375	フジ	12.9	14.1	28,482	東邦銀行	95.1	104.1	22,069
コナカ	12.5	14.1	4,808	ヤオコー	12	13.2	92,004	東北銀行	5.1	5.9	6,578
ハウス オブ ローゼ	1.3	1.2	2,034	ゼビオホールディングス	12.9	14	13,440	みちのく銀行	6.8	7.5	7,792
G-7ホールディングス	6.2	6.9	16,870	ケースホールディングス	102.5	103.7	153,683	静岡銀行	89.5	105.1	216,716
イオン北海道	10.7	15.6	16,426	Olympicグループ	5.5	6	5,526	十六銀行	263.3	283.9	230,526
ゴジマ	18.3	19.9	13,273	日産東京販売ホールディングス	15.9	14.3	3,875	スルガ銀行	13.4	14.6	29,127
ヒマラヤ	3.5	4.3	4,067	シルバライフ	—	1.6	3,393	八十二銀行	108.8	101.6	34,645
コーナン商事	15.1	16.6	49,401	一家ダニングプロジェクト	—	1.1	687	山梨中央銀行	256.7	262.3	97,051
エコス	3.9	4.3	8,380	Genky DrugStores	5.2	5.1	20,145	大垣共立銀行	12.3	13.6	11,655
ワタミ	12.5	15.3	15,682	ナルミヤ・インターナショナル	1.8	2.3	2,263	福井銀行	21	23	47,817
マルシェ	2.9	3	1,524	総合メディカルホールディングス	9.3	—	—	北國銀行	9.1	10	19,210
パンパシフィック・インターナショナルホールディングス	233.4	232.8	572,688	フックオフグループホールディングス	6.2	6.8	5,997	清水銀行	10.9	10.9	28,797
西松屋チェーン	23.3	25.5	38,683	ギフト	—	1.1	2,302	富山銀行	4.4	4.9	8,374
ゼンショーホールディングス	50.9	62.5	181,312	アインホールディングス	13.1	16.9	122,525	滋賀銀行	2	1.9	5,449
幸楽苑ホールディングス	6.7	7.3	12,942	元気寿司	2.7	3.2	8,102	南都銀行	21.3	23.3	46,157
ハークスレイ	2	2	1,852	ヤマダホールディングス	323.6	390.2	214,610	百五銀行	17.6	17	30,685
サイゼリヤ	17.5	17.2	37,083	アークランドサカモト	16.6	18.2	28,301	京都銀行	95.7	105.2	32,401
VITホールディングス	44.1	43.9	19,140	ニトリホールディングス	46	46.3	954,011	紀陽銀行	38	41.7	254,787
魚力	3	3.5	6,443	グルメ軒屋	7.5	8.4	8,509	ほくほくフィナンシャルグループ	37.6	41.3	58,728
ポプラ	2.8	3.3	1,135	愛眼	8.3	7.6	1,770	広島銀行	70.7	77.5	75,950
フジ・コーポレーション	2.9	3.1	6,993	ケーユーホールディングス	5.5	6	5,088	山陰合同銀行	157.1	—	—
コナテッドアローズ	11.1	13.2	26,637	吉野家ホールディングス	34.9	38.2	84,956	中国銀行	63	73.6	36,652
ハイドロハイ	15.3	16.8	31,197	松屋フーズホールディングス	5.1	5.6	20,524	鳥取銀行	91.5	100.4	86,344
京都きもの友禅	7	6.4	1,561	サガミホールディングス	14.2	15.7	19,106	伊予銀行	3.7	4	4,480
コロワイド	35.3	38.6	76,775	関西スーパーマーケット	8.9	8.8	10,419	百十四銀行	151.7	154.6	99,717
ピーシーデポコーポレーション	14.1	13.6	8,214	王将フードサービス	7.8	7.7	46,354	四国銀行	11.3	12.2	19,202
壺番屋	7.4	8.2	42,640	プレナス	11.9	13.2	26,386	阿波銀行	16.1	16.7	12,007
トップカルチャー	3.9	4.8	1,689	ミニストップ	7.9	8.7	12,693	大分銀行	17.3	17.8	40,441
P L A N T	2.8	3.1	2,321	アークス	21.7	22.1	53,238	宮崎銀行	6.1	6.8	14,518
スギホールディングス	21.2	23.2	171,216	パローホールディングス	23.5	23.8	60,618	佐賀銀行	7	7.3	16,498
薬王堂ホールディングス	4.6	5.1	13,729	藤久	0.9	2.7	2,119	沖縄銀行	6.4	6.7	9,065
ヴィア・ホールディングス	13.1	14.2	4,047	大 庄	5.2	5.8	35,438	琉球銀行	9.7	10.7	30,291
スクロール	16.3	16.6	20,766	ファーストリテイリング	5.7	6.3	6,684	セブン銀行	24.6	25.4	19,761
ヨシダホールディングス	10.8	10.8	22,064	サンドラッグ	14.2	15.6	1,460,628	みずほフィナンシャルグループ	355.3	389	95,694
ファミリーマート	84.9	—	—	サックスホールディングス	40	43.8	191,844	高知銀行	14,451.2	1,584.6	2,423,645
木曽路	13.9	15.3	36,857		9	10	5,900		4	4.2	3,229

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末		
	株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額
山口フィナンシャルグループ	132.8	千株	145.4	千株	千円	92,474	アコム	213.7	千株	千円	234.5	千株	千円	日神グループホールディングス	15.7	千株	千円	15.7	千株	千円
長野銀行	3.5	3.9	4,992			4,992	ジャックス	11.7	12.8	27,737				日本エスコン	19.2	21.1	16,521			
名古屋銀行	8.6	9.4	26,263			26,263	オリエントコーポレーション	287.8	315.1	45,059				タカラレーベン	48.7	48.6	16,961			
北洋銀行	160.2	176	40,832			40,832	日立キャピタル	25.1	27.5	79,227				AVANTIA	6	6.6	6,072			
愛知銀行	3.9	3.9	11,352			11,352	アプラスフィナンシャル	51.2	—	—				イオンモール	53.3	58.4	108,215			
中京銀行	4.4	4.3	7,817			7,817	オリックス	665.2	723.4	1,331,779				毎日コムネット	2.2	3.5	2,418			
大光銀行	3.7	3.5	4,501			4,501	三菱UFJリソース	269.9	262.4	149,830				フォースト住建	4.6	5	5,535			
愛媛銀行	14.9	16.5	16,153			16,153	九州リソースサービス	5	6.5	4,257				ランド	589.5	624.6	6,246			
トマト銀行	4.1	4.5	4,810			4,810	日本取引所グループ	305.3	315	800,257				カチタス	13.2	28.9	90,746			
京葉銀行	45.3	49.7	21,718			21,718	イー・ギランティ	11.4	13.3	32,731				トーセイ	14.7	16.1	17,339			
栃木銀行	51.4	56.1	10,210			10,210	アサックス	5.5	6.5	4,888				穴吹興産	2.2	2.7	4,514			
北日本銀行	3.4	3.7	7,078			7,078	NECキャピタルソリューション	4.3	4.8	9,777				サンフロンティア不動産	14.7	14.1	13,352			
東和銀行	18.7	20.5	14,022			14,022	不動産業 (2.0%)							エフ・ジェー・ネクスト	9.3	11.6	13,282			
福島銀行	10.4	13.2	3,009			3,009	いちご	135.3	129.6	41,990				インテリックス	3.1	2.7	1,490			
大東銀行	5.6	5.9	3,829			3,829	日本駐車場開発	117.2	115.5	16,747				ランドビジネス	4.3	4.4	1,491			
トモニホールディングス	82.3	90.1	29,012			29,012	スター・マイカ・ホールディングス	5.5	6.1	7,118				サンネクスダグループ	2.8	3.8	3,701			
フィデアホールディングス	103.6	114	13,224			13,224	SREホールディングス	—	1.3	6,175				グランディハウス	8.3	8.1	3,636			
池田泉州ホールディングス	122.8	133.5	21,360			21,360	ABワークスグループ	—	22.5	3,555				日本空港ビルディング	34	37.2	212,040			
証券・商品先物取引業 (0.8%)							ヒューリック	227.1	247.2	303,314				サービス業 (5.6%)						
FPG	32.8	35.8	21,515			21,515	三井建築設計	4.3	4.7	8,492				明豊ファシリティワークス	—	5.3	3,614			
ジャフインベストメントアドバイザー	—	5.9	7,634			7,634	野村不動産ホールディングス	64.5	70.7	171,094				日本工営	6.9	7.1	19,716			
マセリアインベストメント	4.7	4.8	3,624			3,624	三越東武ホールディングス	21.5	23.7	11,968				LI FUL L	36	39.4	17,690			
SBIホールディングス	118.8	143	413,270			413,270	サムティ	15.1	16.5	28,578				ミクシィ	—	21.6	54,367			
日本アジア投資	9.3	10.1	2,454			2,454	ディア・ライフ	13.7	16.4	7,412				ジェイシーリクルーメント	6.9	7.5	14,617			
ジャフコ グループ	16.3	17.9	107,937			107,937	コーセーアールイー	3.2	3.5	2,149				日本M&Aセンター	77.8	92.6	561,156			
大和証券グループ本社	853.2	873.3	452,107			452,107	イー・ディー・ワークス	201.8	—	—				メンバーズ	3.1	3.3	8,556			
野村ホールディングス	1,871.3	1,780.3	1,072,986			1,072,986	日本商業開発	6.7	7.3	12,629				中広	1.1	1.2	422			
岡三証券グループ	90.6	99.2	39,580			39,580	フルサンスホールディングス	17.4	19.1	28,650				UTグループ	12.1	16.3	58,680			
丸三証券	31.5	34.6	20,414			20,414	ユニソールホールディングス	16	—	—				アイティメディア	3.1	3.7	8,295			
東洋証券	38.2	38.2	5,882			5,882	THEグローバル社	5.5	7.3	2,014				タケエイ	9.9	12.5	16,412			
新日本経済ホールディングス	122	123.8	43,082			43,082	ハウスコム	1.4	1.2	1,588				E・Jホールディングス	1.2	4.4	4,422			
光世証券	2.5	3	1,962			1,962	日本管理センター	7	6.2	7,582				ピーネックスグループ	11.3	14.1	17,568			
水戸証券	30.8	31.2	8,455			8,455	サンセイロシティック	3.2	3.5	2,618				コジダホールディングス	24.8	26.8	13,480			
いちよし証券	19.8	23.2	13,270			13,270	エストラスト	1.4	1.3	929				アルトナー	2.5	2.8	2,514			
松井証券	60.7	57.1	49,962			49,962	フージャースホールディングス	21.2	19	13,110				パソナグループ	11.1	12.2	25,010			
だいこう証券ビジネス	5.2	—	—			—	オープンハウス	30.9	36.7	164,409				CDS	2.5	2.4	3,492			
マネックスグループ	80.3	104.4	73,497			73,497	東急不動産ホールディングス	289.3	316.7	206,805				リンクアンドモチベーション	22.7	20.7	13,579			
極東証券	14.3	15.7	12,607			12,607	飯田グループホールディングス	88.7	97.2	242,319				GCA	12.4	14.6	11,008			
岩井コスモホールディングス	10	11.9	17,980			17,980	イージランド	1.7	2.3	1,927				エス・エム・エス	32	38.4	145,344			
監理證券	19.1	21.1	17,913			17,913	ムゲンエステート	7.3	7.3	3,577				サニーサイドアップグループ	2.3	4	2,720			
マネポートナズグループ	11.5	12.8	2,777			2,777	ピーロット	2.4	5.4	3,531				パソナホールディングス	103	113	246,905			
スパークス・グループ	36.8	53.8	16,893			16,893	ファーストブラザーズ	2.4	2.2	2,206				リニカル	5	6.5	4,972			
小林洋行	3.2	3	822			822	ハウスドゥ	5.9	5.6	6,949				クックパッド	36.1	35.6	11,605			
保険業 (1.9%)							シーアールイー	2.7	3	3,777				エスクリ	3.3	3.6	1,299			
かんぽ生命保険	37.6	144.5	324,836			324,836	プロ/ティエーエージェント	1.6	1.9	2,603				アイ・ケイ・ケイ	5.1	5.6	3,500			
SOMPOホールディングス	200	205.6	897,855			897,855	ケイアイスター不動産	3.4	3.6	9,540				学情	3.7	3.9	5,541			
アニコム ホールディングス	8.8	32.8	36,932			36,932	アグリ都市デザイン	1.5	2.1	1,644				スタジオアリス	5.2	5.7	12,135			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	278	283.3	906,560			906,560	グッドコムアセット	2.4	5.5	7,293				シミックホールディングス	5.7	5.6	9,088			
ソニーフィナンシャルホールディングス	87.4	—	—			—	ジェイ・エス・ビー	1.1	2.2	7,821				エプコ	1.6	2.8	2,741			
第一生命ホールディングス	601.8	616	1,114,960			1,114,960	テンポインノベーション	2.4	3.3	3,111				NJS	2.2	2.8	5,656			
東京海上ホールディングス	380.3	386.6	2,135,965			2,135,965	グローバル・リンク・マネジメント	1.7	2	1,500				総合警備保障	41	45	237,150			
T&Dホールディングス	317.8	348.4	496,818			496,818	パーク24	57.1	62.5	142,937				カカココム	77.1	83.5	288,075			
アドバンスクリエイト	2.4	2.4	4,596			4,596	パラカ	2.8	3.1	5,118				アイロムグループ	3.7	4	7,684			
その他金融業 (1.1%)							三井不動産	524.5	531.4	1,279,079				セントウ・ホールディング	6.7	8.3	8,466			
全国保証	30	30.3	150,591			150,591	三菱地所	745.2	766	1,401,780				サイネックス	1.7	2.2	1,617			
ジェイリース	3	3.8	2,922			2,922	平和不動産	19.5	20	76,400				ルネサンス	5.7	7	7,938			
イントラスト	3.8	3.3	2,508			2,508	東京建物	116.3	114.9	183,495				ディップ	14.5	17.6	52,553			
日本メージャーサービス	2.1	5.9	7,056			7,056	ダイヤビル	27.4	30.1	38,528				デジタルホールディングス	5.6	7.8	15,748			
CASA	3.7	3.2	3,257			3,257	京阪神ビルディング	17.2	20.1	31,778				新日本科学	11.2	13.7	9,439			
アルヒ	16.9	17.1	29,736			29,736	住友不動産	239.1	262.1	943,822				ツクイホールディングス	24.3	26.7	18,289			
プレミアアグループ	5.8	5.4	13,300			13,300	テオ・シー	20.9	22.9	17,518				キャリアデザインセンター	2.7	2.5	2,412			
クレディセゾン	74.5	68	91,868			91,868	東京楽天地	1.4	2	9,060				ベネフィット・ワン	28.2	41.2	130,810			
芙蓉総合リース	11.1	12.2	93,330			93,330	レオパレス21	139.4	96.5	15,729				エムスリー	227.1	199.3	1,717,168			
みずほリース	16.4	18	61,290			61,290	スターツコーポレーション	14.5	13.8	39,633				ツカダ・グローバルホールディング	6.7	9.5	2,964			
東京センチュリー	21.4	27.1	237,125			237,125	フジ住宅	12.4	13.6	9,125				プラス	0.8	1.5	732			
日本証券金融	46.8	49.4	30,825			30,825	空港施設	10.8	12.1	6,497				アウトソーシング	59	64.7	96,532			
アイフル	162.3	195.2	55,436			55,436	明和地所	5.9	5.5	3,542				ウェルネット	9.8	11.5	5,681			
リコーリース	8.4	9.2	30,360			30,360	ゴールドクレスト	8.4	10.5	18,952				ワールドホールディングス	3.5	3.9	7,889			
イオンフィナンシャルサービス	65.1	71.3	99,748			99,748	エスリード	4.2	4.6	7,130				ディー・エヌ・エー	50.5	47.8	100,858			

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	株 数		株 数	評 価 額	株 数	株 数		評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
博報堂DYホールディングス	千株	千株	千円		デザインワン・ジャパン	千株	千株	千円		ダイレクトマーケティングミックス	千株	千株	千円	
ぐるなび	143.3	157.2	266,454		イー・ガーディアン	2	3.5	752		ポピーズホールディングス	—	4.4	14,190	
タカミヤ	18	19.6	11,936		リブセンス	5.2	4.9	15,312		アドバンスティクス・マネジメント	—	2.3	6,354	
ジャパンベス・レスキューシステム	11	14.1	7,755		ジャパネットホリタル	6.7	6.2	1,475		リロググループ	5.2	5.7	4,218	
ファンコミュニケーションズ	6.9	8.9	8,971		ベクトル	31.7	34.8	53,278		東祥	56.3	61.7	158,939	
ライク	28.4	31.3	13,146		ウチマホールディングス	12.9	14	18,018		エイチ・アイ・エス	6.4	7.1	12,900	
ビジネス・ブレークスルー	4.1	3	6,102		チャーム・ケア・コーポレーション	5.2	5.8	2,088		ラックランド	16	16.4	33,767	
エスプール	4.4	5.1	2,233		ライクキッズ	7.5	8.4	11,440		共立メンテナンス	2.1	3.2	7,657	
WDBホールディングス	19.9	28.9	28,813		キャリアリンク	2.4	—	—		イネンホールディングス	17	18.7	73,210	
手間いらず	4.7	5.2	14,346		I B J	3.4	3.6	11,340		建設技術研究所	11.5	11.8	16,000	
ティア	—	1.1	5,852		アサンテ	7	9.1	8,881		スペース	7.1	7.3	18,374	
CDG	6.1	7.2	3,204		N・フィールド	4.2	4.1	6,994		長 大	6.7	7.7	6,337	
アドウェイズ	1.1	1.3	1,999		バリューHR	7.1	7.6	7,554		燦ホールディングス	3.8	4.5	7,191	
バリューコマース	—	13.7	9,809		M&Aキャピタルパートナーズ	2	4.5	7,717		スバル興業	4.5	4.7	5,687	
インフォマート	5.8	7.5	23,175		ライダックス・アスレチックホールディングス	7.3	9.3	46,267		東京デアトル	0.6	0.7	5,705	
J Pホールディングス	112.9	114.3	109,842		ER Iホールディングス	4.3	9.146			西尾レントオール	4.1	4.6	6,016	
エナックホールディングス	32.4	32.6	9,682		アビスト	3	2.8	1,789		アゴラ・ホスピタリティ・グループ	1.9	2.2	3,102	
E P Sホールディングス	18.8	20.7	1,966		シグマクシス	1.6	1.8	5,351		トランス・コスモス	3.3	3.6	41,364	
レックス	15.5	15.3	19,966		ウィルグループ	7	6.2	11,749		乃村工藝社	2.2	0.6	3,618	
プラスター・インターナショナル	2.5	2.7	4,887		エスグロー・エージェンツ・ジャパン	6.7	8.2	8,552		藤田観光	6.7	7.3	33,507	
アミューズ	38.6	42.2	35,490		メディア	14.5	16.6	5,063		常盤興産	4.2	4.7	6,396	
ドリムインキュベータ	5.6	6.2	17,043		レアジョブ	—	5.3	38,213		カナモト	16.8	19.9	47,978	
ウィック	3.2	3.5	4,291		リクルートホールディングス	—	1.6	3,825		東京ドーム	41.8	44.5	57,716	
T A C	6.4	7	8,638		エラン	738	809.3	4,030,314		西尾レントオール	10.5	10.4	27,071	
ケネディクス	6.7	6.3	1,701		土木管理総合試験所	6.1	15.6	23,478		アゴラ・ホスピタリティ・グループ	69	71.2	1,922	
電通グループ	98	32.3	24,128		ネットマーケティング	4.5	5.7	2,023		トランス・コスモス	9.8	10.8	30,974	
ティグアンドギヴ・ニーズ	106.2	127	473,075		日本郵政	3.8	5.4	3,699		乃村工藝社	44.2	48.3	39,992	
びあ	4	5.2	3,468		ベルシテム24ホールディングス	844.5	855.3	754,716		藤田観光	4.5	4.4	7,290	
イオンファンタジー	2.9	3.2	10,048		鎌倉新書	17.2	18.9	36,174		KNT-CTホールディングス	6.4	6	6,114	
シーティーエス	4	4.3	10,582		SMN	7.6	11.4	10,488		日本管財	4.5	4.4	7,290	
ネクシィーズグループ	11.6	12.6	12,020		一蔵	1.6	2.4	1,855		トーカイ	11	12.2	25,607	
H. U. グループホールディングス	3.6	3.5	3,367		L I T A L I C O	10	11	24,684		白洋舎	10	11	24,684	
アルプス技研	28.9	31.7	98,587		グローバル・ケル・COMPANY	1.1	1.7	649		セコム	1.1	1	2,427	
サンニクス	9.1	10	21,600		エトリア	3.6	4.6	16,560		セントラル警備保障	109.3	111.3	1,140,268	
ダイオーズ	18.1	17.7	6,000		アトラエ	1.5	2.1	1,881		丹青社	5	5.4	19,008	
日本空調サービス	2	2.2	2,145		ストライク	4.6	6.1	10,107		メイテック	19.5	21.1	17,048	
オリエンタルランド	10.8	12.2	8,930		ソラスト	2.7	3.4	10,472		応用地質	12.7	13.8	77,142	
ダスキン	109.5	120.1	2,141,383		インソース	3.9	4.2	20,223		船井総研ホールディングス	11.1	13.2	17,410	
明光ネットワークジャパン	26.4	26.2	75,482		ペイカレント・コンサルティング	28.4	27.7	41,439		進学会ホールディングス	21.3	23.1	59,736	
ファコホールディングス	26.4	26.2	75,482		Orchestra Holdings	3.3	3.5	6,191		いであ	4.1	4.9	2,401	
秀英予備校	12.1	14.2	8,548		アイモバイル	5	9.4	20,670		学究社	8.1	7.9	5,925	
田谷	5.7	5.4	9,763		キャリアインデックス	6.2	7.4	130,684		パネッセルホールディングス	1.9	2.7	4,884	
ラウンドワン	2.3	2.8	1,226		MS - J a p a n	2	2.5	5,897		イオンディライト	3.1	3.4	4,831	
リゾートトラスト	2	1.7	974		船場	3.3	4	4,900		ナック	34.3	41.4	92,818	
ビー・エム・エル	28.8	38.5	38,808		グレイステクノロジー	4.2	4.6	2,783		ニチエ学館	12.7	13.9	40,991	
ワタベウエディング	47.2	51.7	88,045		フルテック	4.5	5.413			ダイセキ	5.7	5.6	5,510	
りららコミュニケーションズ	13.3	14.6	51,465		グリーンズ	1.7	1.6	1,403		ステップ	14.7	—	—	
リソー教育	1.6	1.7	562		ツナググループ・ホールディングス	4.7	5.7	35,454		株数・金額	17.2	18.9	64,638	
早稲田アカデミー	18.7	17.1	24,504		G A M E W I T H	10.8	32.5	77,187		銘柄数<比率>	3.8	4.3	6,712	
ユー・エス・エス	47.1	57.3	20,169		ソウルダウト	1.2	1.8	2,534		合計	株数・金額	千株	千円	
東京個別指導学院	3.4	4.4	4,307		MS&Consulting	3.9	4.2	2,205		株数・金額	127,662.7	124,117.8	311,274,068	
サイバーエージェント	115.4	126.4	274,920		エル・ディー・エス	1.2	1.7	603		銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,183銘柄	<97.7%>	
楽天	3.7	9.9	6,672		ミダック	2.2	3.5	2,075		(注1)	銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。			
グリーク・アンド・リバー社	59.3	69.6	467,016		日総工産	1.6	2.7	4,665		(注2)	会社欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。			
モーニングスター	480.2	526.6	583,999		キュービートネットホールディングス	1.4	1.9	1,181		(注3)	評価額の単位未満は切捨ててあります。			
デー・オー・ダブリュ	5.3	5.8	7,105		R P Aホールディングス	—	0.8	3,336						
山田コンサルティンググループ	—	12.4	6,001		スプリックス	—	2.4	7,716						
セントラルスポーツ	9	19.8	5,841		マネジメントソリューションズ	6.8	8.7	7,786						
フルキャストホールディングス	5	6.6	6,943		プロレド・パートナーズ	4.3	5.2	8,824						
エン・ジャパン	3.9	4.2	10,243		and factory	5.8	12.8	8,652						
リソルホールディングス	10.3	9.8	18,247		テノ・ホールディングス	3.5	3.2	2,646						
テクノプロ・ホールディングス	18.4	20.1	68,239		フロンティア・マネジメント	1.1	5.5	9,916						
アトラ	1	0.9	3,555		ピアラ	—	1.6	5,624						
インターワークス	20.7	22.5	180,000		コプロ・ホールディングス	—	1	770						
アイ・アールジャパンホールディングス	2.3	2.5	890		ギークス	—	0.9	1,140						
KeepPer 技研	1.9	3.5	1,284		カープスホールディングス	—	2	4,892						
ファーストロジック	4.2	4.6	68,356		フォーラムエンジニアリング	—	0.6	1,209						
三機サービス	3.9	7.3	14,899			—	0.6	2,265						
Gunosy	2.3	2.2	1,771			—	1.5	2,359						
	2.1	2.3	2,300			—	31	29,884						
	7.1	6.8	5,596			—	5.8	5,945						

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総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		期末
		買建額	売建額	額
国内	T O P I X	百万円 7,442		百万円 －

■投資信託財産の構成

2021年2月8日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
株式	千円 311,274,068	% 97.6	
コール・ローン等、その他	7,511,950	2.4	
投資信託財産総額	318,786,019	100.0	

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月8日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	318,786,019,057円
コ	ー ル ・ ロ ー ン 等	6,651,925,208
株	式(評価額)	311,274,068,500
未	収 入	391,827,620
未	収 配 当	389,312,729
差	入 委 託 証 拠	78,885,000
(B) 負	債	199,379,000
未	払 解 約	199,379,000
(C) 純	資 産 総 額(A－B)	318,586,640,057
元	次 期 繰 越 損 益	102,105,610,506
(D) 受	益 権 総 口 数	216,481,029,551
1	万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	102,105,610,506口
		31,202円

(注1) 期首元本額 98,370,254,055円
 追加設定元本額 67,069,989,134円
 一部解約元本額 63,334,632,683円

(注2) 期末における元本の内訳

One DC 国内株式インデックスファンド	15,975,939,497円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,179,107,702円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,626,890円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	5,088,758円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	8,151,762円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	24,072,359円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	14,018,113円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	12,980,814円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	612,281,321円
たわらノーロード バランス (堅実型)	23,454,696円
たわらノーロード バランス (標準型)	140,720,417円
たわらノーロード バランス (積極型)	207,209,167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)	1,707,448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)	108,252,549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)	245,952,107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)	166,536,220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)	228,275,842円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	431,973円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,205,302円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	4,833,419円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,885,817円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,004,044円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,764,926,964円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,023,160,847円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,393,344,349円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	35,744,954円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,112,139,190円
マネックス資産設計ファンド エゴリレーション	21,186,872円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	313,080,893円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	264,026,418円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	439,000,020円
投資のソムリエ	15,620,354,669円
クルーズコントロール	637,176,611円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,620円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	6,918,316円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	16,838,854円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	19,134,149円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	9,070,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,599,277円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	42,338,447円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,803,475,886円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	9,278,066円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	5,239,774円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	5,173,103円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870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)	52,904,100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)	64,217,224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)	71,448,850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)	32,545,912円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	41,658,362円
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視) (加替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	562,668,029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)	85,977,917円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	72,359,909円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	128,443,286円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	7,951,637円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	35,906,053円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	8,484,030円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,658,825円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	21,889,554円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	46,792,943円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	689,878,804円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	729,307,036円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,064,787,625円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	150,408,971円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	37,142,128円
DIAM アスク グローバル・バランス30VA (適格機関投資家限定)	373,020,041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)	102,439,732円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,576,268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)	468,054,341円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	24,008,365円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	99,685,187円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	238,004,405円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	323,286,503円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	45,168,755円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	20,550,710円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	362,800,005円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	1,106,076,367円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,467,666,407円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	58,984,178円
期末元本合計	102,105,610,506円

(注3) 担保資産
 代用として担保を提供している資産はありません。

■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収	益
	受	取	配	当	金
	受	取		利	息
	そ	の	他	収	益
	支	払		利	息
(B)	有	価	証	券	売
	売			買	損
	売			買	益
(C)	先	物	取	引	等
	取			取	引
	取			引	損
(D)	当	期	損	益	金(A + B + C)
(E)	前	期	繰	越	損
(F)	解	約	差	損	益
(G)	追	加	信	託	差
(H)	合				計(D + E + F + G)
	次	期	繰	越	損
				益	金(H)

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

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月18日～2021年2月15日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年9月2日から無期限です。
運 用 方 針	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主 要 投 資 対 象	海外の株式を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
		期 騰 落 率	(円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	期 騰 落 率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期(2017年2月15日)	30,270	26.6	971,437.64	27.0	95.6	1.7	278,963
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

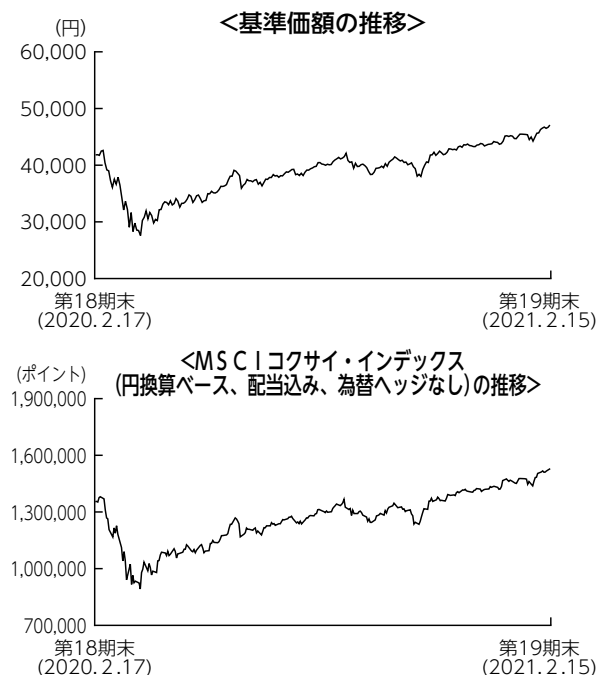
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 17 日	円 41,812	% ー	ポイント 1,354,548.25	% ー	% 94.7	% 2.7
2 月 末	37,252	△10.9	1,206,797.36	△10.9	95.7	1.4
3 月 末	31,648	△24.3	1,027,164.79	△24.2	96.5	2.6
4 月 末	34,754	△16.9	1,126,486.20	△16.8	94.3	3.0
5 月 末	36,243	△13.3	1,175,146.51	△13.2	94.1	3.4
6 月 末	36,940	△11.7	1,198,230.56	△11.5	96.0	1.5
7 月 末	38,177	△8.7	1,236,614.10	△8.7	95.4	2.2
8 月 末	41,110	△1.7	1,333,631.14	△1.5	90.7	7.9
9 月 末	39,487	△5.6	1,281,404.41	△5.4	95.4	2.1
10 月 末	38,389	△8.2	1,245,785.85	△8.0	95.9	1.6
11 月 末	42,818	2.4	1,390,283.49	2.6	95.9	2.9
12 月 末	44,055	5.4	1,430,471.52	5.6	96.0	2.3
2021 年 1 月 末	44,967	7.5	1,461,431.17	7.9	96.1	1.7
(期 末) 2021 年 2 月 15 日	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月18日から2021年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は47,083円となり、前期末比で12.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

株式市場では米国市場が新型コロナウイルスの感染拡大への懸念による急落から反発し、前期末の水準を大きく上回る上昇となり、基準価額を押し上げました。為替市場では米ドルなど一部の通貨が円高となりマイナスに寄与したものの、ユーロなどの欧州通貨が円安となりプラスの寄与となりました。こうした要因から当期の基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は2020年2月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から急落しましたが、3月下旬以降は米景気対策法案への期待などから反発しました。その後も欧米における新型コロナウイルスの感染拡大から調整する場面もありましたが、ワク

チン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感などを受けて堅調に推移しました。欧州市場は急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

為替市場はまちまちの値動きとなりました。新型コロナウイルスの感染拡大から大きく変動した2020年2月、3月を除いて、米ドルに対してはほぼ一貫して円高となりました。これは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因です。一方でユーロなど他の多くの通貨に対しては円安となりました。経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退したことから、安全資産と見られた円が売られ、その他の通貨が買われたためです。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.3%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.9
3	銀行	7.3
4	資本財	6.7
5	メディア・娯楽	6.1
6	ヘルスケア機器・サービス	4.9
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9
8	小売	4.8
9	食品・飲料・タバコ	4.6
10	エネルギー	4.5



期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	12.1%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.6
3	メディア・娯楽	7.1
4	資本財	6.2
5	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.1
6	小売	5.8
7	銀行	5.6
8	ヘルスケア機器・サービス	5.1
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	各種金融	4.4

（注1）比率は純資産総額に対する割合です。

（注2）業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で12.9%上昇しました。

当ファンドはベンチマーク比で△0.3%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%
（株 式）	（ 1 ）	（0.002）
（新株予約権証券）	（ 0 ）	（0.000）
（先物・オプション）	（ 1 ）	（0.002）
（投資信託受益証券）	（ 0 ）	（0.000）
（投 資 証 券）	（ 0 ）	（0.000）
(b) 有価証券取引税	5	0.013
（株 式）	（ 5 ）	（0.012）
（新株予約権証券）	（ 0 ）	（0.000）
（投資信託受益証券）	（ 0 ）	（0.000）
（投 資 証 券）	（ 0 ）	（0.000）
(c) そ の 他 費 用	9	0.024
（保 管 費 用）	（ 0 ）	（0.000）
（そ の 他）	（ 9 ）	（0.024）
合 計	16	0.040

（注）金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（39,034円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況（2020年2月18日から2021年2月15日まで）

(1) 株 式

		買		付		売		付	
		株	数	金	額	株	数	金	額
外	ア メ リ カ	76,463.16 (14,562.26)	百株	千アメリカ・ドル 701,987 (△3,608)		45,411.7	百株	千アメリカ・ドル 353,039	
	カ ナ ダ	12,093.39 (△21.96)	百株	千カナダ・ドル 51,424 (△0.21676)		7,238.68	百株	千カナダ・ドル 24,349	
	オーストラリア	21,852.12 (453.07)	百株	千オーストラリア・ドル 36,147 (-)		14,694.93	百株	千オーストラリア・ドル 16,462	
	香 港	19,390 (△2,849.15)	百株	千香港・ドル 83,001 (-)		12,540.48	百株	千香港・ドル 48,260	
	シ ン ガ ポ ー ル	8,246.5 (2,113.75)	百株	千シンガポール・ドル 3,326 (-)		12,498.19	百株	千シンガポール・ドル 2,401	
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	872.37 (-)	百株	千ニューージーランド・ドル 822 (-)		719.94	百株	千ニューージーランド・ドル 502	
	イ ギ リ ス	78,899.1 (5,792.39)	百株	千イギリス・ポンド 42,047 (△8)		50,946.95	百株	千イギリス・ポンド 18,921	
	イ ス ラ エ ル	496.65 (39.42)	百株	千イスラエル・シェケル 1,841 (-)		39.42	百株	千イスラエル・シェケル 32	
	ス イ ス	4,418.96 (0.31)	百株	千スイス・フラン 31,583 (△340)		2,215.29	百株	千スイス・フラン 15,848	
	デ ン マ ー ク	1,158.98 (-)	百株	千デンマーク・クローネ 58,612 (-)		555.11	百株	千デンマーク・クローネ 28,435	
	ノ ル ウ ェ ー	1,469.2 (-)	百株	千ノルウェー・クローネ 19,876 (-)		582.96	百株	千ノルウェー・クローネ 8,645	
	ス ウ ェ ー デ ン	6,788.69 (375.01)	百株	千スウェーデン・クローナ 111,556 (-)		3,516.25	百株	千スウェーデン・クローナ 42,207	
国	ユ ー ロ	イ ギ リ ス	269.98 (-)	百株	千ユーロ 1,265 (-)	1,401.32	百株	千ユーロ 6,758	
		ア イ ル ラ ン ド	458.5 (1.04)	百株	千ユーロ 2,589 (-)	1,443.88	百株	千ユーロ 982	
		オ ラ ン ダ	4,881.21 (839.88)	百株	千ユーロ 15,275 (△4)	3,280.09	百株	千ユーロ 7,736	
		ベ ル ギ ー	432.31 (-)	百株	千ユーロ 2,499 (-)	232.58	百株	千ユーロ 900	
		ル ク セ ン ブ ル グ	569.96 (101.97)	百株	千ユーロ 530 (-)	306.11	百株	千ユーロ 153	
		フ ラ ン ス	6,144.78 (△285.63)	百株	千ユーロ 29,258 (△125)	3,419.66	百株	千ユーロ 14,451	
	ド イ ツ	6,260.14 (378.62)	百株	千ユーロ 29,572 (△322)		3,026.64	百株	千ユーロ 12,394	

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユ ー ロ ム	ポ ル ト ガ ル	百株 370.56 (2,016.06)	千ユーロ 154 (-)	百株 2,016.06	千ユーロ 18
		ス ペ イ ン	百株 11,323.51 (36,219.26)	千ユーロ 6,785 (△1)	百株 47,689.27	千ユーロ 4,268
		イ タ リ ア	百株 8,841.37 (-)	千ユーロ 6,080 (-)	百株 3,017.58	千ユーロ 2,303
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 2,365.02 (-)	千ユーロ 3,003 (-)	百株 1,056.68	千ユーロ 1,660
		オ ー ス ト リ ア	百株 213.07 (-)	千ユーロ 503 (-)	百株 140.25	千ユーロ 378

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

			買 付		売 付	
			証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ア メ リ カ		証券 9,583	千アメリカ・ドル 153	証券 9,583 (-)	千アメリカ・ドル 29 (-)
		ス イ ス	証券 87,844	千スイス・フラン 17	証券 (-)	千スイス・フラン (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		4.85 (-)	777 (-)	1.49 (-)	258 (-)
BOSTON PROPERTIES INC		4.047 (-)	379 (-)	3.127 (-)	267 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		4.922 (-)	183 (-)	- (-)	- (-)
SL GREEN		2.636 (-)	121 (-)	9.733 (-)	487 (-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		42.275 (-)	276 (-)	22.963 (-)	139 (-)
PROLOGIS INC		18.354 (-)	1,753 (-)	8.083 (-)	798 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC		2.743 (-)	435 (-)	0.905 (-)	145 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST		6.861 (-)	594 (-)	5.28 (-)	501 (-)
EQUINIX INC		2.314 (-)	1,707 (-)	0.844 (-)	633 (-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		- (-)	- (-)	13.649 (-)	514 (-)

	買		付		売		付	
	□	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	
DUKE REALTY TRUST		9.24		334		4.589		173
		(-)		(-)		(-)		(-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		11.24		1,808		3.992		639
		(-)		(-)		(-)		(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC		1.316		285		0.887		186
		(-)		(-)		(-)		(-)
EQUITY RESIDENTIAL		14.226		867		6.987		404
		(-)		(-)		(-)		(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST		-		-		6		523
		(-)		(-)		(-)		(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		11.492		269		6.111		200
		(-)		(-)		(-)		(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.835		527		0.775		231
		(-)		(-)		(-)		(-)
WELLTOWER INC		15.617		849		9.305		519
		(-)		(-)		(-)		(-)
KIMCO REALTY		-		-		32.98		366
		(-)		(-)		(-)		(-)
IRON MOUNTAIN INC		5.143		127		4.529		143
		(-)		(-)		(-)		(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		2.461		151		-		-
		(-)		(-)		(-)		(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC		8.836		125		-		-
		(-)		(-)		(-)		(-)
MID AMERICA		4.745		576		2.725		311
		(-)		(-)		(-)		(-)
REALTY INCOME CORP		9.434		560		3.459		207
		(-)		(-)		(-)		(-)
REGENCY CENTERS CORP		3.096		123		-		-
		(-)		(-)		(-)		(-)
UDR INC		10.298		374		5.586		190
		(-)		(-)		(-)		(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC		7.149		492		2.372		151
		(-)		(-)		(-)		(-)
PUBLIC STORAGE		3.283		697		1.637		311
		(-)		(-)		(-)		(-)
SUN COMMUNITIES INC		2.252		330		-		-
		(-)		(-)		(-)		(-)
VENTAS INC		8.055		304		2.539		132
		(-)		(-)		(-)		(-)
VORNADO REALTY TRUST		3.954		132		3.712		139
		(-)		(-)		(-)		(-)
WEYERHAEUSER CO		15.289		354		8.814		254
		(-)		(-)		(-)		(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC		3.124		339		-		-
		(-)		(-)		(-)		(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC		9.706		1,350		1.819		276
		(-)		(-)		(-)		(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST		21.376		429		7.418		132
		(-)		(-)		(-)		(-)
AGNC INVESTMENT CORP		9.532		111		8.245		149
		(-)		(-)		(-)		(-)
VEREIT INC		20.066		138		-		-
		(△82.136)		(-)		(-)		(-)
AMERICAN TOWER CORP		10.881		2,582		5.358		1,305
		(-)		(-)		(-)		(-)
WP CAREY INC		7.024		454		4.534		323
		(-)		(-)		(-)		(-)

	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
INVITATION HOMES INC	8.091	231	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICI PROPERTIES INC	30.263	635	17.38	344
	(—)	(—)	(—)	(—)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	—	—	3.067	73
	(—)	(—)	(—)	(—)
CANADIAN APT PPTYS REIT	3.947	157	3.812	220
	(—)	(—)	(—)	(—)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	10.748	104
	(—)	(—)	(—)	(—)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.935	174	30.611	555
	(—)	(—)	(—)	(—)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
DEXUS	24.397	218	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
GOODMAN GROUP	30.602	436	14.296	213
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICINITY CENTRES	101.268	160	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	66.3	4,266	24	1,464
	(—)	(—)	(—)	(—)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	136.1	294	—	—
	(148.536)	(375)	(—)	(—)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	161.8	490	70	236
	(—)	(△7)	(—)	(—)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(△206.3)	(△429)	(—)	(—)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	563.1	1,151	293	609
	(—)	(△2)	(—)	(—)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△1)	(—)	(—)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	13.709	129	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
ICADE	—	—	2.234	138
	(—)	(—)	(—)	(—)
KLEPIERRE	4.769	104	4.712	125
	(—)	(△14)	(—)	(—)
COVIVIO	1.942	112	1.544	148
	(—)	(—)	(—)	(—)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	2.022	119	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)

(注 1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	株 式 先 物 取 引	百万円 147,648	百万円 147,076	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	160,063,426千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	346,644,284千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.46

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月18日から2021年2月15日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	325.49	380.64	124,762	13,115,060	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,365.53	1,585.92	20,336	2,137,746	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	475.98	567.35	1,618	170,152	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	35.74	39.87	1,309	137,620	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	684.81	798.02	9,640	1,013,365	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	790.23	1,053.11	9,875	1,038,061	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	375.4	429.77	21,438	2,253,630	ソフトウェア
CHUBB LTD	352.14	406.4	6,671	701,304	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	173.59	198.54	5,172	543,781	化学
ALLEGHANY CORP	10.94	12.63	769	80,865	保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	60.52	551	57,937	バイオテクノロジー
RALPH LAUREN CORP	34.22	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
ALLSTATE CORP	258.32	283.81	2,963	311,557	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	556.87	627.86	12,781	1,343,575	コングロマリット
AMGEN INC	464.84	524.53	12,442	1,307,942	バイオテクノロジー
HESS CORP	213.67	247.76	1,486	156,267	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	544.74	616.15	7,986	839,544	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	392.77	450.17	3,538	371,997	電力
AFLAC INC	570.28	582.83	2,734	287,465	保険
AMERICAN INTL GROUP	680.37	754.5	3,123	328,355	保険
AMERCO	5.85	9.29	464	48,851	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	291.05	335.79	5,398	567,525	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	181.92	192.19	3,044	319,995	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	604.52	653.14	3,499	367,869	建設関連製品
JONES LANG LASALLE INC	40.87	—	—	—	不動産管理・開発
VALERO ENERGY CORP	314.33	374	2,421	254,524	石油・ガス・消耗燃料
APACHE CORP	314.7	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	67.7	79.7	3,216	338,138	ソフトウェア
APPLE INC	3,499.77	15,286.24	206,929	21,752,463	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	711.21	818.51	9,552	1,004,107	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	76.34	95.36	1,570	165,039	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	421.46	517.45	2,883	303,085	食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	78.13	92.78	706	74,308	電力
AMEREN CORP	194.87	222.73	1,632	171,573	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	57.95	66.51	698	73,467	電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	59.13	75.7	713	75,016	自動車部品
AUTODESK INC	172.35	198.42	6,054	636,458	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	334.93	386.31	6,452	678,290	情報技術サービス
AUTOZONE INC	19.17	21.6	2,476	260,357	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	65.49	76.27	1,351	142,094	容器・包装
BALL CORP	252.62	288.47	2,586	271,945	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,020.32	1,250.78	30,326	3,187,912	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	666.37	702.98	2,947	309,851	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	370.97	443.26	3,489	366,846	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	207.72	260.87	6,686	702,897	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	178.21	200.08	2,435	256,069	電気設備
VERIZON COMM INC	3,203.11	3,685.67	19,976	2,099,911	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	122.01	125.11	849	89,272	保険
BEST BUY CO INC	187.2	215.6	2,598	273,122	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	15.24	18.59	1,231	129,435	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	231.1	273.93	2,889	303,706	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	435.84	478	1,493	156,972	電力
BOEING CO	413.69	481.42	10,156	1,067,703	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	83.24	111.11	819	86,174	専門サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BORGWARNER INC	172.1	219.38	921	96,834	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,066.58	1,290.98	4,956	520,982	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	99.88	117.19	1,069	112,472	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	87.66	106.87	2,135	224,526	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	19.29	22.08	2,695	283,321	ライフサイエンス・ツール／サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,814.88	2,018.55	12,109	1,272,927	医薬品
INGREDION INC	53.05	—	—	—	食品
ONEOK INC	324.27	392.84	1,772	186,283	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	59	80.93	874	91,913	保険
UNITED RENTALS INC	61.81	61.81	1,769	185,970	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	215.99	261.13	3,251	341,752	総合公益事業
FEDEX CORP	193.68	224.18	5,895	619,780	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	80.48	87.62	1,773	186,413	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	227.63	262.07	3,561	374,388	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	243.81	260.85	2,004	210,726	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,252.54	971.36	591	62,184	メディア
CSX CORP	595.4	686.59	6,188	650,579	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	314.16	314.16	572	60,203	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	166.23	777	81,691	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	200.52	196.41	1,418	149,089	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	128.2	146.75	3,540	372,191	飲料
CARDINAL HEALTH INC	229.5	247.18	1,281	134,750	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	319.62	471.45	971	102,091	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	432.58	486.12	9,624	1,011,747	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	98.65	1,190	125,187	ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	94.64	99.33	1,367	143,759	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	804.24	947	99,590	各種電気通信サービス
CERNER CORP	251.43	272.58	2,042	214,758	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,476.52	2,725.45	38,496	4,046,802	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	198.96	212.87	1,765	185,593	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	112.22	128.72	1,189	125,053	保険
CINTAS CORP	66.04	80.99	2,773	291,542	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,309.4	3,769.58	17,826	1,873,905	通信機器
CLOROX COMPANY	98.76	117.85	2,191	230,386	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,147.58	3,644.71	18,475	1,942,095	飲料
COPART INC	167.49	186.28	2,224	233,855	商業サービス・用品
COGNEX CORP	122.84	146.77	1,379	145,012	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	627.79	712.97	5,591	587,812	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	221.45	256.86	3,325	349,610	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	—	52.03	1,125	118,292	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
COMERICA INC	119.85	—	—	—	銀行
NRG ENERGY, INC.	210.39	210.39	905	95,188	電力
COMCAST CORP-CL A	3,511.08	4,081.73	21,727	2,283,947	メディア
CONAGRA BRANDS INC	358.02	461.45	1,594	167,593	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	252.2	298.44	2,120	222,929	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	229.37	259.36	1,462	153,713	総合公益事業
COOPER COS INC	39.36	50.31	1,938	203,822	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	132.2	165.13	726	76,394	飲料
CORNING INC	583.76	710.11	2,618	275,297	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	138.7	611	64,283	容器・包装
HEICO CORP-CL A	52.92	62.36	724	76,126	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	119.63	137.18	3,346	351,813	機械
DR HORTON INC	283.55	322.07	2,646	278,228	家庭用耐久財
DANAHER CORP	482.99	572.81	14,085	1,480,657	ヘルスケア機器・用品
MOODY'S CORP	129.22	151.99	4,235	445,236	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	423.7	470.43	3,620	380,579	情報技術サービス
TARGET CORP	394.21	449.86	8,611	905,258	複合小売り

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
DEERE & CO	238.24	267.97	8,387	881,689	機械
MORGAN STANLEY	951.98	1,216.65	9,077	954,218	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	180.81	191.36	1,746	183,576	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	27.85	34.38	3,230	339,631	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,394.4	1,619.66	30,396	3,195,244	娯楽
DOLLAR TREE INC	186.97	219.16	2,375	249,675	複合小売り
DOVER CORP	111.13	126.52	1,552	163,228	機械
OMNICON GROUP	173.65	196.63	1,302	136,937	メディア
DTE ENERGY CO	148.17	177.93	2,151	226,206	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	568.01	642.05	5,766	606,215	電力
FLOWERVE CORP	98.82	—	—	—	機械
DARDEN RESTAURANTS INC	97	109.02	1,400	147,206	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	637.71	614.91	3,874	407,292	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	6,844.79	6,976.37	23,280	2,447,209	銀行
CITIGROUP INC	1,746.72	1,867.17	11,880	1,248,909	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	94.23	122.29	1,335	140,416	化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	171.04	—	—	—	資本市場
EATON CORP PLC	318.18	364.97	4,524	475,657	電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	—	—	—	資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	226.28	246.39	3,589	377,318	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	177.49	214.2	671	70,612	メディア
ECOLAB INC	204.79	230.5	5,068	532,772	化学
PERKINELMER INC	83.38	97.55	1,468	154,401	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	224.91	251.42	3,714	390,466	娯楽
SALESFORCE.COM INC	644.04	815.12	19,593	2,059,620	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	583	61,367	保険
EMERSON ELECTRIC CO	467.05	522.99	4,462	469,116	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	86.5	115.03	1,047	110,097	ガス
ENTERGY CORP	150.31	171.95	1,631	171,517	電力
EOG RESOURCES INC	446.03	540.41	3,297	346,641	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	91.61	103.22	1,828	192,259	専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	173.46	202.15	5,867	616,781	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	125.15	139.42	1,346	141,546	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,276.09	3,789.44	19,144	2,012,443	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	102.09	114.16	1,229	129,221	化学
NEXTERA ENERGY INC	374.04	1,752.42	14,567	1,531,374	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	28.75	32.46	1,025	107,825	資本市場
FAIR ISAAC CORP	—	24.82	1,175	123,612	ソフトウェア
ASSURANT INC	45.94	55.23	707	74,389	保険
FASTENAL CO	458.91	504.82	2,392	251,482	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	581.44	636.46	2,069	217,507	銀行
M&T BANK CORP	99.99	114.32	1,625	170,922	銀行
FISERV INC	443.49	514.04	5,653	594,340	情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	—	—	—	電子装置・機器・部品
FORD MOTOR CO	3,108.36	3,423.19	3,919	412,023	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	237.13	654	68,848	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,149.93	1,269.73	3,965	416,839	金属・鉱業
FLEX LTD	351.27	—	—	—	電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	142.7	179.22	2,091	219,820	保険
GAP INC/THE	182.95	—	—	—	専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	183.86	1,017	106,976	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	188.21	215.99	3,560	374,244	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	461.41	538.66	3,076	323,435	食品
GENUINE PARTS CO	116.05	133.93	1,330	139,829	販売
GILEAD SCIENCES INC	978.31	1,130.1	7,559	794,627	バイオテクノロジー
GARTNER INC	73.84	75.22	1,375	144,645	情報技術サービス
MCKESSON CORP	145.58	142.89	2,604	273,735	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	金額	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
NVIDIA CORP	447.12	552.38	33,057	3,474,970	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	6,747.57	7,857.77	9,217	968,908	コングロマリット
WW GRAINGER INC	37.62	42.34	1,575	165,604	商社・流通業
HALLIBURTON CO	668.43	774.83	1,562	164,284	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	327.28	345.68	3,170	333,327	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	249	293.78	8,999	945,982	資本市場
HARLEY-DAVIDSON INC	129.01	—	—	—	自動車
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	175.86	189.69	3,526	370,728	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	94.73	113.83	1,041	109,463	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	115.16	115.16	799	84,085	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	22.78	36.23	465	48,954	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	112.92	136.22	2,062	216,767	食品
HP INC	1,174.82	1,251.84	3,441	361,750	コンピュータ・周辺機器
F5 NETWORKS INC	48.74	55.29	1,164	122,414	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	104.72	120.24	1,189	125,081	容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	279.39	705	74,157	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	118.55	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	196.88	240.09	1,992	209,427	ヘルスケア機器・用品
UNUM GROUP	151.85	—	—	—	保険
HOME DEPOT INC	846.67	963.81	26,746	2,811,612	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	131.85	162.88	1,417	149,029	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	241.61	262.54	1,266	133,133	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	376.78	490.65	1,049	110,271	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	29.13	853	89,677	建設関連製品
HUMANA INC	103.84	119.37	4,543	477,633	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	60	75.44	1,118	117,621	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	795.17	938.57	1,356	142,567	銀行
BIOGEN INC	141.19	144.18	4,008	421,387	バイオテクノロジー
IDEX CORP	61.54	72.94	1,457	153,249	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	247.55	275.8	5,543	582,683	機械
INTUIT INC	200.54	233.97	9,686	1,018,205	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	67.91	77.82	4,234	445,081	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	109.6	625	65,739	バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	182.44	218.91	3,304	347,317	建設関連製品
INTEL CORP	3,428.07	3,802.57	23,503	2,470,707	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	79.65	199.06	2,668	280,523	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	294.11	319.83	1,572	165,345	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	288.62	353.17	869	91,439	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	101.08	110.33	1,267	133,259	建設・土木
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	60.19	68.74	1,001	105,238	情報技術サービス
INCYTE CORP	137.98	159.42	1,344	141,313	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,043.38	2,351.55	39,172	4,117,773	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	287.53	334.76	1,660	174,577	保険
KLA CORPORATION	127.24	141.3	4,688	492,852	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	333.12	560.14	1,119	117,646	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	191.81	219.54	1,259	132,421	食品
EAST WEST BANCORP INC	115.6	—	—	—	銀行
KEYCORP	794.97	875.97	1,670	175,600	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	261.25	308.61	4,077	428,644	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	89.29	136.68	9,881	1,038,763	資本市場
KOHL'S CORP	119.1	—	—	—	複合小売り
KROGER CO	639.44	712.62	2,419	254,321	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	111.39	130.86	7,670	806,321	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27.16	33.02	1,280	134,645	航空宇宙・防衛
PACKAGING CORP OF AMERICA	71.43	84.38	1,123	118,131	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	132.54	141.53	1,437	151,141	情報技術サービス
LEGGETT & PLATT INC	109.28	—	—	—	家庭用耐久財

銘 柄	期 首(前期末)	当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円
LENINAR CORP	227.53	258.81	2,396	251,874
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	207.95	—	—	—
ELI LILLY & CO	672.42	771.11	15,984	1,680,273
LINCOLN NATIONAL CORP	153.44	180.9	947	99,549
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	539.13	633.18	10,345	1,087,521
AGILENT TECHNOLOGIES INC	236.62	284.52	3,641	382,772
LOCKHEED MARTIN CORP	196.76	225.05	7,600	798,976
LOEWS CORP	217.59	217.59	1,057	111,208
LOWE'S COS INC	599.41	679.92	12,045	1,266,219
DOMINION ENERGY INC	637.96	733.73	5,273	554,331
MGM RESORTS INTERNATIONAL	385.73	458.5	1,647	173,173
MCCORMICK & CO INC	99.35	215.14	1,928	202,748
MCDONALD'S CORPORATION	587.12	664.19	14,207	1,493,442
S&P GLOBAL INC	190.18	215.72	7,322	769,753
EVEREST RE GROUP LTD	31.14	34.16	831	87,452
MANPOWERGROUP INC	45.55	—	—	—
MARKEL CORPORATION	10.65	12.01	1,329	139,752
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	165.61	561.91	4,925	517,730
MARSH & MCLENNAN COS	388.72	442.08	4,986	524,197
MASCO CORP	212.16	231.51	1,272	133,728
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	47.86	52.58	1,739	182,856
METLIFE INC	612.6	679.99	3,785	397,932
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	213.86	235.91	2,269	238,614
MEDTRONIC PLC	1,037.71	1,200.14	14,370	1,510,624
ACTIVISION BLIZZARD INC	602.43	696.43	7,229	759,979
CVS HEALTH CORP	1,004.51	1,175.45	8,723	916,963
MERCK & CO. INC.	1,983.19	2,257.06	16,927	1,779,466
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	326.86	366.51	1,512	159,003
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	80.49	85.88	2,046	215,094
MICROSOFT CORP	5,617.88	6,425.29	157,413	16,547,273
MICRON TECH INC	847.94	999.6	8,797	924,791
MIDDLEBY CORP	41.88	—	—	—
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	184.73	218.94	3,493	367,203
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	487.15	612.87	3,298	346,734
3M CO	442.96	515.39	9,210	968,157
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	49.76	842	88,546
MOTOROLA SOLUTIONS INC	125.93	150.06	2,717	285,625
KANSAS CITY SOUTHERN	76.14	83.46	1,746	183,634
MYLAN NV	435.74	—	—	—
ILLUMINA INC	116.19	131.34	6,629	696,894
XCEL ENERGY INC	389.63	465.91	2,867	301,401
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	65.45	80.58	919	96,649
NOV INC	271.94	—	—	—
NETAPP INC	179.63	198.04	1,383	145,434
NEWELL BRANDS INC	333.17	333.17	805	84,720
NEWMONT CORP	638.69	726.65	4,282	450,215
NVR INC	2.63	3.05	1,433	150,690
NIKE INC-CL B	967	1,116.09	15,861	1,667,399
NOBLE ENERGY INC	394.36	—	—	—
NORDSTROM INC	94.87	—	—	—
NORDSON CORP	—	46.44	874	91,909
NORFOLK SOUTHERN CORP	202.6	229.57	5,850	614,990
EVERSOURCE ENERGY	247.68	305.69	2,603	273,686
NISOURCE INC	315.48	314.27	708	74,430
TAPESTRY INC	217.9	—	—	—
NORTHERN TRUST CORP	159.59	173.65	1,704	179,145
NORTHROP GRUMMAN CORP	121.94	136.98	4,073	428,178

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WELLS FARGO & CO	3,239.87	3,503.46	11,747	1,234,855	銀行
NUCOR CORP	240.42	288.6	1,625	170,922	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	191.75	191.9	1,297	136,406	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	359.69	417.51	4,916	516,788	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	695.5	852.06	2,163	227,414	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	52.09	87.12	1,848	194,343	陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	160.28	505	53,140	電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	58.22	65.76	2,847	299,354	専門小売り
ORACLE CORP	1,806.97	1,782.61	11,244	1,182,043	ソフトウェア
PACCAR INC	273.94	304.46	2,983	313,647	機械
PTC INC	77.66	94.33	1,346	141,520	ソフトウェア
EXELON CORP	737.21	853.23	3,601	378,587	電力
PARKER HANNIFIN CORP	100.92	119	3,287	345,556	機械
PAYCHEX INC	253.29	298.42	2,667	280,446	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	61.63	65.29	3,979	418,372	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	537.24	713.2	1,997	209,995	電力
PEPSICO INC	1,082.92	1,235.16	16,535	1,738,168	飲料
PENTAIR PLC	125.11	155.64	834	87,743	機械
PFIZER INC	4,280.75	4,971.81	17,262	1,814,594	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	155.16	229.37	1,070	112,503	水道
CONOCOPHILLIPS	858.96	1,233.91	5,819	611,705	石油・ガス・消耗燃料
PVH CORP	52.05	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
PG&E CORP	—	1,239.99	1,463	153,810	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	129.08	181.44	2,400	252,316	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,442.97	1,673.74	7,264	763,595	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	344.94	382.89	6,213	653,126	銀行
BROWN & BROWN INC	172.94	203.08	909	95,638	保険
POLARIS INC	40.95	—	—	—	レジャー用品
GARMIN LTD	107.74	123.65	1,616	169,885	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	190.31	206.85	2,865	301,264	化学
IPG PHOTONICS CORP	26.08	33.53	847	89,135	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	339.84	394.44	13,913	1,462,626	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	184.83	200.07	3,264	343,210	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	108.83	119.26	1,502	157,986	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	1,939.08	2,223.79	28,380	2,983,306	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	461.27	528.87	4,562	479,616	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	390.39	445.03	2,593	272,596	総合公益事業
PULTE GROUP INC	212.09	243.05	1,178	123,863	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	236.92	271.25	5,348	562,235	情報技術サービス
QUALCOMM INC	939.82	1,010	14,945	1,571,121	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	103.88	107.44	1,226	128,899	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	113.06	139.11	2,156	226,674	バイオテクノロジー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	31.61	40.52	645	67,819	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	61.16	95.04	4,615	485,163	バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	50.42	60.97	688	72,423	保険
RESMED INC	111.16	132.86	2,664	280,093	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,156.14	1,226.62	5,843	614,281	銀行
SEAGEN INC	91.5	102.96	1,707	179,491	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	315	343.83	1,208	127,044	保険
ROSS STORES INC	288.14	311.97	3,715	390,547	専門小売り
ROLLINS INC	123.78	185.67	697	73,366	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	79.49	91.27	3,614	379,953	コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	92.51	107.18	2,670	280,745	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	140.75	158.79	1,073	112,888	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	111.41	110.04	955	100,405	化学
RAYTHEON COMPANY	219.72	—	—	—	航空宇宙・防衛
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	38.48	—	—	—	情報技術サービス

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ACCENTURE PLC-CL A	493.57	568.7	14,642	1,539,200	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,113.85	1,278.63	7,056	741,806	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	101.9	117.94	2,682	281,951	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	195.63	221.48	3,232	339,823	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	474.12	557.29	7,556	794,376	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	32.83	36.87	7,929	833,516	インターネット販売・通信販売
SCHLUMBERGER LTD	1,065.93	1,309.4	3,505	368,473	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	898.67	1,376.29	8,008	841,867	資本市場
POOL CORP	—	35.32	1,193	125,434	販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	155.9	181.87	2,935	308,529	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	106.22	133.04	1,037	109,084	食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	106.53	611	64,323	資本市場
ANTHEM INC	197.28	226.07	6,571	690,785	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	127.49	138.36	1,455	152,978	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	221.75	250.38	1,355	142,469	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	63.67	73.88	5,327	559,986	化学
CENTENE CORP	461.24	509.9	3,018	317,316	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	40.44	45.32	2,295	241,298	銀行
IAC INTERACTIVE CORP	62.52	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SMITH (A.O.) CORP	113.51	113.51	685	72,034	建設関連製品
ACUITY BRANDS INC	30.87	—	—	—	電気設備
SNAP-ON INC	39.81	48.25	916	96,343	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	313.88	372.26	3,010	316,421	保険
ADVANCE AUTO PARTS	52.97	62.26	951	100,010	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	266.52	350.41	2,029	213,312	電力
SOUTHERN CO	800.67	923.98	5,553	583,743	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,036.81	1,215.55	6,565	690,132	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	113.52	117.91	605	63,634	旅客航空輸送業
AT&T INC	5,656.86	6,363.97	18,328	1,926,663	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,471.08	1,721.63	15,933	1,674,949	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	117.76	140.26	2,462	258,862	機械
STATE STREET CORP	295.9	324.04	2,381	250,363	資本市場
STARBUCKS CORP	923.12	1,049.03	11,046	1,161,185	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	175.47	690	72,545	金属・鉱業
STRYKER CORP	258.5	304.36	7,552	793,939	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	338.6	394.98	21,981	2,310,687	娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	489.55	1,051	110,487	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	97.93	424	44,615	陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	118.55	133.81	3,908	410,856	ソフトウェア
SYSCO CORP	382.29	421.71	3,215	337,973	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	88.5	105.44	8,517	895,364	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	34.55	40.02	1,625	170,880	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	883.22	982	103,242	医薬品
TERADYNE INC	121.62	142.84	2,034	213,833	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	720.56	818.5	14,703	1,545,635	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	163.04	194.86	991	104,241	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	309.95	354.62	18,008	1,893,071	ライフサイエンス・ツール/サービス
TIFFANY & CO	87.33	—	—	—	専門小売り
GLOBE LIFE INC	72.82	105.78	994	104,546	保険
DAVITA INC	81.59	64.97	682	71,704	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	95.73	104.62	1,673	175,885	専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	224.42	1,660	174,502	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	28.51	34.73	1,648	173,337	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	227.36	249.8	1,637	172,153	食品
UGI CORP	147.97	200.72	780	82,035	ガス
MARATHON OIL CORP	584.18	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	544.82	605.64	12,909	1,357,080	陸運・鉄道

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株		千アメリカ・ドル	千円	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	634.51	1,372.1		9,962	1,047,291	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	733.07	849.87		27,896	2,932,441	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	61.53	61.53		795	83,618	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	72.26	81.39		1,433	150,683	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	267.5	287.12		2,282	239,977	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	453.61	493.63		2,878	302,572	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	198.29	239.38		5,122	538,451	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	97.94	121.7		2,001	210,446	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	602.5	668.71		3,368	354,145	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,104.64	1,264.14		18,263	1,919,809	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	323	383.57		4,343	456,633	商業サービス・用品
WATERS CORP	54.68	52.11		1,479	155,542	ライフサイエンス・ツール/サービス
ALLERGAN PLC	252.62	—		—	—	医薬品
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	52.4	70.09		2,060	216,622	ヘルスケア機器・用品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	91.76	103.06		1,186	124,695	食品
VAIL RESORTS INC	31.09	35.9		1,031	108,447	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	225.67	258.67		1,696	178,293	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	149.64	162.57		1,309	137,620	機械
WHIRLPOOL CORP	46.14	56.56		1,130	118,870	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	139.02	153.31		2,905	305,397	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	79.7	86.39		1,018	107,023	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	90.2	100.97		1,433	150,707	資本市場
CME GROUP INC	276.73	321.8		5,933	623,679	資本市場
WILLIAMS COS INC	907.18	1,125.35		2,570	270,189	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	221.96	236.91		874	91,945	販売
ALLIANT ENERGY CORP	172.21	228.29		1,102	115,885	電力
WEC ENERGY GROUP INC	238.39	290.02		2,408	253,193	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	218.2	—		—	—	資本市場
CARMAX INC	120.81	142.09		1,777	186,855	専門小売り
XILINX INC	189.97	214		3,119	327,874	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	930.1	1,081.5		7,354	773,073	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	41.28	45.61		2,178	229,053	電子装置・機器・部品
ZIONS BANCORP NA	131.42	—		—	—	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	274	—		—	—	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	1,087		498	52,447	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	206		1,116	117,368	コンゴロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171		432	45,460	コンゴロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	81.78	102.39		1,616	169,973	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	—		—	—	銀行
CBRE GROUP INC	236.13	296.17		2,112	222,074	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	127.32		319	33,566	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	764.8	855.82		1,673	175,969	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32.56	36.41		1,402	147,420	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	37.37		1,442	151,602	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CHEMICAL CORP	30	—		—	—	化学
T-MOBILE US INC	256.75	499.8		6,181	649,802	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	277.59	302.77		1,696	178,295	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	282.49	325.92		953	100,281	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	28.92	32.09		1,773	186,391	資本市場
CELANESE CORP	103.26	115.88		1,538	161,682	化学
DEXCOM INC	72.16	87.06		3,591	377,564	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	104.23	153.62		734	77,189	メディア
EXPEDIA GROUP INC	115.27	115.08		1,686	177,236	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	184.75		819	86,151	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	103.12	106.14		2,314	243,321	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23		843	88,625	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	442.48	487.85		5,418	569,597	資本市場

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	146.96	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
LIVE NATION	113.39	138.04	1,161	122,137	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	20.4	23.26	3,553	373,536	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	45.08	—	—	—	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	36.81	47.45	2,735	287,549	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	699.14	798.24	27,219	2,861,364	情報技術サービス
HANESBRANDS INC	276.19	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	352.22	353.67	848	89,189	情報技術サービス
OWENS CORNING	77.56	99.65	854	89,824	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	111.13	128.66	1,386	145,796	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	88.07	—	—	—	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	70.67	—	—	—	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	308	32,464	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	91.76	99.59	1,474	155,013	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	295.45	—	—	—	銀行
DELTA AIR LINES INC	111.58	147.23	637	66,999	旅客航空輸送業
INSULET CORP	47.81	55.66	1,612	169,543	ヘルスケア機器・用品
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	60.38	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	239.78	269.75	2,528	265,753	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	256.41	289.3	3,754	394,646	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	—	45.05	1,242	130,571	ヘルスケア機器・用品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	159.7	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	40.76	—	—	—	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	82.55	108.17	3,708	389,860	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	65.32	74.64	1,083	113,871	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	35	40.41	7,851	825,366	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	45.77	45.38	1,451	152,593	専門小売り
INVESCO LTD	334.43	334.43	758	79,697	資本市場
MSCI INC	67.14	76.17	3,311	348,119	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,203.48	1,392.7	11,993	1,260,802	タバコ
VISA INC	1,337.71	1,505.8	31,615	3,323,450	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	—	484.8	1,540	161,906	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	145.36	169.15	2,734	287,501	水道
DISCOVERY INC-C	304.21	304.21	1,239	130,312	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	514.74	595.87	3,006	316,070	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	116.24	117.44	1,055	110,910	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,600.64	1,859.92	2,760	290,143	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	132.37	172.22	1,707	179,444	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	208.76	246.36	2,368	248,977	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.84	613	64,505	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	111.94	146.41	2,537	266,765	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	40.23	53.33	2,134	224,393	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC	—	53.66	1,088	114,473	インターネット・メディアおよびサービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	148.14	762	80,135	資本市場
HCA HEALTHCARE INC	206.49	236.31	4,100	431,014	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	123.2	136.44	2,585	271,791	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	42.73	52.57	880	92,574	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	68.85	78.06	2,063	216,875	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	124.53	149.86	2,328	244,790	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	213.18	243.75	4,738	498,085	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	98.33	116.67	963	101,291	情報技術サービス
TARGA RESOURCES CORP	190.38	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	46.81	46.81	747	78,568	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	86.22	104.72	936	98,401	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	172.68	202.43	1,336	140,486	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	202.52	218.25	4,334	455,636	複合小売り
FORTINET INC	111.5	121.46	2,000	210,325	ソフトウェア

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AON PLC	181.89	—	—	—	保険
HORIZON PHARMA PLC	—	189.86	1,718	180,680	医薬品
TESLA INC	105.48	667.04	54,438	5,722,571	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	—	54.02	1,765	185,598	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	—	101.63	2,098	220,621	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,006.95	1,164.31	6,240	656,022	自動車
XPO LOGISTICS INC	76.14	76.14	923	97,094	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	318.71	338.57	1,422	149,515	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	121.38	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	102.73	135.03	742	78,040	各種金融サービス
APTIV PLC	189.2	236.97	3,703	389,322	自動車部品
PHILLIPS 66	342.35	399.51	3,085	324,338	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	58.85	71.72	922	97,022	ソフトウェア
FACEBOOK INC	1,861.56	2,150.14	58,161	6,113,914	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	134.53	168.96	3,255	342,184	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	114.24	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SERVENOW INC	144.06	172.89	10,222	1,074,622	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	72.72	84.6	3,342	351,386	ソフトウェア
WORKDAY INC	122.24	155.26	4,368	459,205	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,144.34	1,581.52	16,517	1,736,308	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	368.25	426.6	7,111	747,597	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	168.99	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	238.13	—	—	—	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	717	75,459	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	140.75	—	—	—	商社・流通業
CDW CORP	114.06	127.68	1,984	208,573	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	—	—	—	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	—	—	—	旅客航空輸送業
HOWMET AEROSPACE INC	307.49	381.27	1,078	113,343	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	91.9	119	5,179	544,516	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	—	62.46	2,289	240,642	ソフトウェア
SNAP INC	571.3	822.23	5,095	535,624	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	—	36.48	3,151	331,324	ソフトウェア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	143.04	195.46	888	93,426	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	83.24	362	38,124	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	142.05	610	64,149	メディア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	154.1	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
OKTA INC	88.16	106.51	3,107	326,686	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	127	130.42	1,139	119,823	情報技術サービス
BAKER HUGHES CO	510.05	572.74	1,300	136,668	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	106.69	131.81	1,017	106,911	食品
ALTICE USA INC-A	138.87	215.06	744	78,220	メディア
TECHNIPFMC LTD	312.57	—	—	—	エネルギー設備・サービス
BROADCOM INC	307.62	360.27	17,520	1,841,770	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	57.25	67.99	3,013	316,824	ソフトウェア
MONGODB INC	34.23	41.88	1,770	186,156	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	50.95	56.02	1,471	154,675	専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	295.78	358.24	1,065	112,033	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	97.33	118.32	3,762	395,559	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	575.62	690.05	4,961	521,548	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	132.14	132.14	771	81,120	電気設備
EVERGY INC	183.88	210.39	1,145	120,378	電力
ALLEGION PLC	74.69	90.22	1,066	112,156	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	114.54	1,119	117,647	ソフトウェア
STERIS PLC	66.58	73.9	1,352	142,161	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	72.2	152.47	4,014	422,007	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WIX.COM LTD	40	49.18	1,440	151,376	情報技術サービス
DROPBOX INC	175.73	281.7	690	72,579	ソフトウェア
KKR & CO INC	373.07	472.67	2,278	239,541	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	105.53	474	49,897	医薬品
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	—	155.78	6,746	709,243	ソフトウェア
MODERNA INC	—	240.31	4,415	464,152	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	206.55	258.78	2,901	305,053	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	181.44	186.32	670	70,509	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA CORP	290.83	331.16	6,852	720,355	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	129.6	205.86	1,647	173,228	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	564.34	647.07	3,762	395,536	化学
AMCOR PLC	1,300	1,461.49	1,680	176,676	容器・包装
PINTEREST INC	131.83	420.97	3,537	371,896	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	—	178.7	2,763	290,546	レジャー用品
XEROX HOLDINGS CORP	174.55	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
FOX CORP-A	262.57	317.51	1,034	108,774	メディア
FOX CORP-B	130.09	130.09	409	43,008	メディア
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	—	130.78	3,166	332,829	ソフトウェア
CHEWY INC	—	65.86	781	82,171	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	—	445.09	1,365	143,498	ライフサイエンス・ツール/サービス
DYNATRACE INC	—	159.49	853	89,746	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	—	132.18	1,136	119,425	ソフトウェア
TRADEWEB MARKETS INC	—	70.65	482	50,717	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	—	750.77	2,798	294,217	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	—	375.35	2,399	252,247	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	133.12	838.27	5,082	534,265	陸運・鉄道
CORTEVA INC	593.22	686.39	3,045	320,144	化学
MATCH GROUP INC	—	215.66	3,656	384,327	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	—	325.12	1,420	149,317	ソフトウェア
BLACKSTONE GROUP INC	508.89	585.87	4,113	432,399	資本市場
CARLYLE GROUP INC	—	125.09	464	48,863	資本市場
10X GENOMICS INC	—	53.12	1,045	109,926	ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	—	130.21	1,469	154,479	ソフトウェア
GRUBHUB INC	81.58	—	—	—	インターネット販売・通信販売
INGERSOLL RAND INC	—	312.82	1,373	144,424	機械
PAYCOM SOFTWARE INC	39.23	43.3	1,788	187,975	ソフトウェア
PPD INC	—	108.28	411	43,253	ライフサイエンス・ツール/サービス
SABRE CORP	198.09	—	—	—	情報技術サービス
AON PLC	—	208.07	4,744	498,776	保険
IAC/INTERACTIVECORP	—	70.64	1,853	194,812	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZENDESK INC	—	100.21	1,575	165,595	ソフトウェア
ROYALTY PHARMA PLC	—	103.61	497	52,257	医薬品
VIATRIS INC	—	1,128.66	2,058	216,408	医薬品
DRAFTKINGS INC	—	146.71	895	94,183	ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	—	28.05	840	88,302	情報技術サービス
ARISTA NETWORKS INC	44.41	50.42	1,630	171,359	通信機器
IHS MARKIT LTD	297.96	344.11	3,220	338,541	専門サービス
FNF GROUP	213.72	245.67	973	102,343	保険
CATALENT INC	—	146.73	1,838	193,219	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	439.86	454.91	1,689	177,651	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	358.2	415.03	1,681	176,780	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	34.57	562	59,154	ソフトウェア
CDK GLOBAL INC	99.69	—	—	—	ソフトウェア
WAYFAIR INC	50.91	55.43	1,623	170,707	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	139.54	174.07	2,671	280,841	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	—	37.41	1,879	197,570	ソフトウェア
QORVO INC	88.71	101.68	1,789	188,119	半導体・半導体製造装置

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	168.88	—	—	—	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	—	29.47	432	45,436	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	83.07	131.89	1,973	207,423	メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18	170.18	463	48,730	化学
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	42.57	1,408	148,071	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	123.28	145.4	1,246	131,064	情報技術サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	262.04	—	—	—	専門サービス
ETSY INC	—	102.37	2,394	251,659	インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	150	167.6	1,593	167,477	専門サービス
SQUARE INC	264.87	335.06	9,138	960,666	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	587.57	477.57	3,413	358,794	化学
CARVANA CO	—	53.47	1,582	166,402	専門小売り
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	193.21	182.96	940	98,894	飲料
TELADOC HEALTH INC	—	104.54	3,069	322,710	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO	182.84	227.78	1,007	105,929	容器・包装
KRAFT HEINZ CO	511.63	568.79	2,012	211,601	食品
NOVOCURE LTD	—	74.08	1,404	147,685	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	225	259.81	1,858	195,329	機械
MATCH GROUP INC	45.99	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
WASTE CONNECTIONS INC	204.17	247.78	2,461	258,799	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	231.32	269	56,356	5,924,174	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,040.4	1,162.57	1,671	175,737	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	864.04	1,000.53	29,852	3,138,127	情報技術サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	354.71	352.77	964	101,422	各種金融サービス
SUNRUN INC	—	100	836	87,964	電気設備
DXC TECHNOLOGY CO	208.48	—	—	—	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC-C	81.66	133.76	2,645	278,137	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL C	242.52	267.96	56,381	5,926,847	インタラクティブ・メディアおよびサービス
BEIGENE LTD ADR	31.59	—	—	—	バイオテクノロジー
ZSCALER INC	—	61.93	1,402	147,440	ソフトウェア
CABLE ONE INC	—	3.92	806	84,754	メディア
LINDE PLC	417.98	470.49	11,888	1,249,702	化学
ATHENE HOLDING LTD	118.47	118.47	535	56,252	保険
ROKU INC	66.74	95.87	4,493	472,318	娯楽
AVALARA INC	—	71.02	1,234	129,737	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	119.86	129.32	7,933	833,931	メディア
VISTRA CORP	300	380.32	811	85,275	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	232,877.56 608銘柄	278,491.28 592銘柄	3,119.137 —	327,883,766 <68.7%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD	163.02	205.78	1,742	144,386	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	684.96	784.79	3,125	258,877	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	1,409.53	1,559.61	4,385	363,305	金属・鉱業
ATCO LTD	71.93	71.93	277	22,988	総合公益事業
BANK OF MONTREAL	502.86	584.93	5,708	472,926	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	945.61	1,094.36	7,771	643,753	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	255.48	291.32	2,117	175,374	銀行
BCE INC	116.73	149.59	830	68,763	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	687.51	1,159.24	6,316	523,275	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	204.15	281.92	1,118	92,669	医薬品
BOMBARDIER INC 'B'	1,516.15	—	—	—	航空宇宙・防衛
SAPUTO INC	186.01	253.95	958	79,415	食品
BLACKBERRY LTD	396.52	466.71	768	63,638	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	363.21	561.93	1,263	104,645	総合公益事業
CGI INC	186.86	198.59	1,997	165,449	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	113.4	153.58	1,017	84,248	容器・包装
CAE INC	230	250.06	802	66,495	航空宇宙・防衛

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額	期末	
(カナダ)	百株	百株	外貨建金額	邦貨換算金額	
CAMECO CORP	326.27	326.27	千カナダ・ドル	千円	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	276.96	315.43	653	54,110	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	341.11	409.56	1,813	150,248	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	914.93	1,007.58	4,645	384,844	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	48.62	3,440	285,042	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	91.19	846	70,138	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	554.93	634.82	294	24,415	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC	—	843.17	8,918	738,815	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	159.11	159.11	513	42,537	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	217.95	252.61	568	47,081	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	1,539	127,503	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	997.41	1,278.09	573	47,486	金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	—	99.63	1,195	98,994	商業サービス・用品
FORTIS INC	323.12	452.28	734	60,851	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	552.96	496.94	2,329	192,954	金属・鉱業
TELUS CORP	159.45	318.9	1,252	103,739	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	207.22	252.5	850	70,482	保険
IMPERIAL OIL LTD	215.42	215.42	785	65,052	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,565.99	1,830.5	554	45,934	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	29.53	60.69	8,056	667,361	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,470.54	1,716.81	211	17,521	保険
LOBLAW CO LTD	153.54	151.36	4,271	353,844	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	239.09	270.24	947	78,466	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	442.41	518.08	2,672	221,359	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	20.72	23.98	3,212	266,090	保険
METRO INC	199.49	207.6	1,229	101,883	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	287.49	—	1,136	94,173	石油・ガス・消耗燃料
EMERA INC	191.38	224.33	1,166	96,634	電力
METHANEX CORP	52.81	—	—	—	化学
ONEX CORP	66.46	66.46	481	39,898	各種金融サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	187.66	794	65,851	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	237.92	465.51	1,431	118,580	保険
POWER FINANCIAL CORP	216.76	—	—	—	保険
QUEBECOR INC-B	113.31	160.42	521	43,203	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,113.11	1,270.82	13,496	1,118,017	銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	107.47	122.36	5,673	470,010	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	354.31	434.84	982	81,410	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,191.41	1,308.06	2,994	248,035	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	434.8	643.1	855	70,854	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	410.16	1,026	85,046	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	163.94	150.49	1,582	131,111	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	74.17	689	57,110	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,409.24	1,612.38	12,160	1,007,381	銀行
TC ENERGY CORP	717.04	824.24	4,664	386,396	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	56.96	72	678	56,209	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	61.84	61.84	599	49,640	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	109.89	125.15	1,867	154,723	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	349.63	409.93	2,091	173,290	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	15.65	18.64	3,008	249,222	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	149.22	176.52	2,714	224,856	金属・鉱業
B2GOLD CORP	—	1,016.75	649	53,821	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	206.95	202.85	388	32,196	資本市場
KEYERA CORP	166.68	166.68	434	35,983	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	105.83	144.97	545	45,227	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	239.44	239.44	476	39,432	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	426.84	504.1	1,775	147,077	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	235.36	269.06	1,311	108,636	複合小売り

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
STARS GROUP INC	185.29	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CENOVUS ENERGY INC W/I	807.21	1,197.09	1,025	84,986	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	—	175.68	864	71,631	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
TMX GROUP LTD	—	50.58	650	53,917	資本市場
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	152.5	218.4	1,061	87,910	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD	279.46	418.63	729	60,446	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	444.53	506.3	3,599	298,206	化学
CRONOS GROUP INC	160	—	—	—	医薬品
SSR MINING INC	—	180	378	31,313	金属・鉱業
WSP GLOBAL INC	84	101.94	1,176	97,451	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	81.04	122.78	794	65,786	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	—	164.85	604	50,063	商業サービス・用品
OVINTIV INC	192.78	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	—	108.45	695	57,632	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	149.61	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
AIR CANADA	107.22	107.22	239	19,833	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	196.85	251.76	1,888	156,481	ホテル・レストラン・レジャー
AURORA CANNABIS INC	665.62	—	—	—	医薬品
SHOPIFY INC	76.05	97.39	17,989	1,490,281	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	—	35.03	664	55,008	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	186.34	952	78,941	医薬品
HYDRO ONE LTD	273.4	273.4	787	65,272	電力
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	192,614	15,956,174	
	30,926.62	35,759.37	—	<3.3%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	124.32	168.54	1,087	88,733	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,181.8	2,577.13	6,396	521,949	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,654.07	3,180.22	7,041	574,546	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,156.62	1,535.17	3,658	298,518	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	2,969.65	3,644.09	1,184	96,641	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	390.14	—	—	—	銀行
AMP LTD	3,024.14	3,024.14	399	32,573	各種金融サービス
ASX LTD	155.73	191.62	1,349	110,110	資本市場
BHP GROUP LTD	2,281.36	2,637.49	11,794	962,460	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	209.46	560	45,720	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	148.67	—	—	—	複合小売り
COMPUTERSHARE LT	380.4	380.4	539	44,046	情報技術サービス
CSL LIMITED	351.66	407.66	11,282	920,643	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	41.19	57.45	902	73,675	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,064.75	2,508.16	3,273	267,088	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	486.01	526.93	691	56,455	飲料
COCHLEAR LTD	43.81	55.33	1,142	93,192	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,328.6	1,328.6	579	47,268	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,370.26	1,589.4	13,807	1,126,660	銀行
BORAL LIMITED	861.01	—	—	—	建設資材
RIO TINTO LIMITED	280.81	338.59	3,973	324,225	金属・鉱業
APA GROUP	941.06	1,182.05	1,120	91,439	ガス
ARISTOCRAT LEISU	453.23	517.17	1,710	139,558	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,805.73	2,251.8	1,202	98,120	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	287.19	212	17,365	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32.75	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	339.26	398.39	1,621	132,310	建設資材
ORICA LTD	278.65	413.11	632	51,575	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	87.09	178	14,603	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	429.74	621.16	741	60,519	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	369.41	496.93	844	68,934	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	851.3	1,160.56	648	52,938	運送インフラ

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	評 価 額 邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MACQUARIE GROUP LTD	247.65	298.21	4,302	351,090	資本市場
WORLEY LTD	277.72	—	—	—	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,047.83	1,174.54	1,235	100,826	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,264.21	2,998.19	7,474	609,918	銀行
NEWCREST MINING LTD	620.8	732.02	1,900	155,066	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,054.7	1,978.95	801	65,400	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,364.26	—	—	—	化学
QANTAS AIRWAYS LIMITED	622.82	622.82	283	23,124	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,078.2	1,448.68	1,254	102,371	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	934.04	1,126	91,918	金属・鉱業
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	457.07	—	—	—	各種金融サービス
SANTOS LTD	1,328.62	1,596.18	1,086	88,699	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	346.84	401.48	1,376	112,336	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	44.66	84.06	243	19,830	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	1,485.35	2,056.49	913	74,507	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	860.51	1,015.75	5,586	455,868	複合小売り
ALUMINA LIMITED	1,846.13	—	—	—	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	759.44	861.96	2,153	175,699	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	956.47	1,117.03	4,590	374,625	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	99.95	99.95	484	39,515	資本市場
SEEK LTD	258.99	358.36	1,119	91,381	インターネット・メディアおよびサービス
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	282	23,032	電力
AGL ENERGY LTD	496.44	490.76	542	44,250	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,266.93	1,271.66	1,323	108,021	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	324	26,519	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	—	1,409.64	651	53,142	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,501.5	1,501.5	578	47,171	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	576.67	576.67	585	47,762	飲料
XERO LTD	—	104.98	1,367	111,585	ソフトウェア
AFTERPAY LTD	—	183.22	2,780	226,862	情報技術サービス
MEDIBANK PVT LTD	2,069.1	2,831.54	812	66,312	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	3,575.25	4,123.45	1,067	87,146	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	816.08	1,210.32	2,196	179,253	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	80	136.04	446	36,466	ソフトウェア
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	外 貨 建 金 額 銘 柄 数<比 率>	評 価 額 邦 貨 換 算 金 額 銘 柄 数<比 率>	
	57,763.33	65,373.59	127,470	10,401,584	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	191	329	3,964	53,757	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	3,476	47,145	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,038.6	1,038.6	1,842	24,983	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,210	1,345	9,710	131,679	電力
PCCW LTD	3,310	3,310	1,515	20,556	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	495	495	2,096	28,426	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	944.4	1,090.4	58,336	791,041	資本市場
MTR CORP	1,260	1,260	5,657	76,714	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD	577	657	9,605	130,248	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,154.5	1,154.5	3,607	48,921	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,015	1,345	5,561	75,414	電力
HONG KONG & CHINA GAS	7,767.55	9,132.92	10,027	135,978	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,570	1,970	13,583	184,187	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES LTD	735	—	—	—	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,750	3,175	7,508	101,820	銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,350	—	—	—	コンプロマリット
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	505	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,842.66	1,630.66	5,788	78,496	不動産管理・開発
SINO LAND CO	2,554	2,554	2,911	39,480	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,250	1,085	11,804	160,073	不動産管理・開発

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SVWIRE PACIFIC LTD A	305	495	2,440	33,091	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,135	1,285	15,921	215,890	機械
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	700	—	—	—	食品
WHEELOCK & CO LTD	640	—	—	—	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	1,660	3,701	50,196	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	1,560	1,539	20,878	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	1,244	1,749	23,717	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	9,356.27	10,872.27	112,527	1,525,879	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	2,890	3,040	41,226	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,992	1,988	6,739	91,385	ホテル・レストラン・レジャー
SVWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,349	31,862	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	957.5	1,497.5	6,581	89,245	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD	—	1,474	4,171	56,564	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,745	23,671	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,019	1,506	3,945	53,503	飲料
WH GROUP LTD	7,425	8,970	5,767	78,210	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,088.32	2,553.32	13,660	185,233	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,983.32	2,248.32	8,982	121,796	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	72,797.12 36銘柄	76,797.49 33銘柄	351,864 —	4,771,281 <1.0%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,250	465	36,902	航空宇宙・防衛
SEMBCORP INDUSTRIES	814	—	—	—	総合公益事業
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,237	—	—	—	メディア
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,419	1,557	4,059	322,130	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	261	20,740	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	59.44	—	—	—	販売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	478	—	—	—	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	689	685	54,405	資本市場
CAPITALAND LTD	2,045.15	3,088.15	960	76,218	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,164	4,268	367	29,128	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,011	1,349	690	54,812	コングロマリット
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,779	—	—	—	陸運・鉄道
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,515.53	2,716.53	2,865	227,440	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,071.22	6,768.22	1,610	127,835	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	475	1,608.5	702	55,783	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	952	1,024	2,451	194,547	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	301	23,944	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	210	418	33,214	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,423	1,814	972	77,162	食品
YANGZUJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,888	—	—	—	機械
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	29,249.34 20銘柄	27,111.4 14銘柄	16,812 —	1,334,268 <0.3%>
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	852.45	1,102.26	760	57,726	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	298.94	437	33,240	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	550.91	550.91	587	44,573	食品
FISHER & PAYKEL	431.84	490.44	1,581	120,048	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	641.04	—	—	—	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	1,596.23	749	56,881	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	419	31,862	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	756.56	1,241.62	721	54,752	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	5,745.31 8銘柄	5,897.74 7銘柄	5,258 —	399,085 <0.1%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	317.98	317.98	487	71,096	金属・鉱業
ASHTAD GROUP	366.89	389.16	1,524	222,381	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
SEVERN TRENT PLC	182.17	219.33	514	75,110	水道	
BHP GROUP PLC	1,612.84	1,844.54	3,905	569,662	金属・鉱業	
BARCLAYS PLC	13,428.31	16,088.89	2,347	342,363	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	822.83	822.83	559	81,606	家庭用耐久財	
BT GROUP PLC	6,307.77	7,955.07	986	143,870	各種電気通信サービス	
BUNZL PLC	278.38	288.34	675	98,533	商社・流通業	
EASYJET PLC	136.28	—	—	—	旅客航空輸送業	
AVIVA PLC	3,146.91	3,634.64	1,267	184,797	保険	
CRODA INTERNATIONAL	103.91	125.68	829	120,980	化学	
DIAGEO PLC	1,828.12	2,096.47	6,308	920,062	飲料	
SCHRODERS PLC	109.32	113.54	400	58,439	資本市場	
DCC PLC	78.98	78.98	464	67,756	コングロマリット	
NATIONAL GRID PLC	2,646.42	3,068.81	2,628	383,312	総合公益事業	
KINGFISHER PLC	1,656.8	1,971.59	534	77,899	専門小売り	
BAE SYSTEMS PLC	2,486.72	2,737.49	1,313	191,646	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,772.72	2,065.85	5,607	817,890	タバコ	
HALMA PLC	279.01	319.01	816	119,064	電子装置・機器・部品	
NEXT PLC	100.18	114.67	880	128,411	複合小売り	
IMPERIAL BRANDS PLC	716.56	877.08	1,309	191,051	タバコ	
JOHNSON MATTHEY PLC	150.17	191.07	573	83,686	化学	
ANGLO AMERICAN PLC	789.81	1,075.54	2,864	417,738	金属・鉱業	
COMPASS GROUP PLC	1,195.6	1,564.43	2,205	321,608	ホテル・レストラン・レジャー	
HSBC HOLDINGS PLC	15,612.12	18,255.85	7,335	1,069,838	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,527.58	5,146.92	1,337	195,101	保険	
CENTRICA PLC	4,713.4	—	—	—	総合公益事業	
UNILEVER PLC	855.86	2,351.36	9,313	1,358,408	パーソナル用品	
MEGGITT PLC	621.81	—	—	—	航空宇宙・防衛	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	1,686.76	2,302.12	393	57,415	食品・生活必需品小売り	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	544.87	677.14	639	93,230	水道	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	808.64	954.87	646	94,284	保険	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	255.47	311.66	694	101,229	食品	
PEARSON PLC	650.09	650.09	496	72,382	メディア	
PERSIMMON PLC	260.85	281.26	765	111,661	家庭用耐久財	
PRUDENTIAL PLC	2,049.4	2,268.96	3,013	439,472	保険	
RIO TINTO PLC	874.36	1,010.08	5,993	874,197	金属・鉱業	
VODAFONE GROUP PLC	20,437.18	24,232.37	3,244	473,241	無線通信サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	544.64	645.58	4,071	593,759	家庭用品	
RELX PLC	1,475.23	1,741.63	3,250	474,122	専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	1,406.17	1,697.66	891	130,041	商業サービス・用品	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,392.68	6,709.69	622	90,814	航空宇宙・防衛	
NATWEST GROUP PLC	3,974.34	4,230.54	724	105,696	銀行	
ST JAMES'S PLACE PLC	376.85	497.89	609	88,956	資本市場	
SSE PLC	746.84	886.46	1,260	183,850	電力	
BP PLC	15,740.09	18,382.94	4,812	701,925	石油・ガス・消耗燃料	
SAGE GROUP PLC(THE)	871.11	1,084.48	640	93,352	ソフトウェア	
SMITHS GROUP PLC	317.2	403.17	603	88,027	コングロマリット	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55.18	65.74	773	112,804	機械	
STANDARD CHARTERED PLC	2,183.29	2,400.93	1,111	162,096	銀行	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	53,939.91	64,953.56	2,409	351,465	銀行	
TAYLOR WIMPLEY PLC	2,522.87	3,467.94	558	81,484	家庭用耐久財	
TESCO PLC	7,573.16	8,605.34	2,070	301,974	食品・生活必需品小売り	
3I GROUP PLC	766.43	886.51	1,016	148,304	資本市場	
SMITH & NEPHEW PLC	680.27	769.28	1,209	176,433	ヘルスケア機器・用品	
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,862.19	4,499.85	5,750	838,755	医薬品	
WEIR GROUP	191.61	—	—	—	機械	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	246.6	275.89	2,703	394,337	資本市場	
WPP PLC	951.48	1,115.98	920	134,314	メディア	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)	百株	百株	千円	千円	
ASTRAZENECA PLC	1,015.56	1,175.51	8,782	1,280,889	医薬品
WHITBREAD PLC	98.14	185.94	596	86,971	ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	133.5	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,767.3	—	—	—	複合小売り
INTERTEK GROUP PLC	120.83	138.42	808	117,860	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	316.86	389.5	696	101,573	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	124.6	166.52	815	118,884	ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	2,543.08	—	—	—	メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,372.15	1,902.05	435	63,555	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	1,222.5	—	—	—	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	476	69,470	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	82.33	115.81	498	72,681	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,336.87	3,777.76	5,130	748,349	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,863.67	3,238.58	4,212	614,334	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	182	429	62,645	医薬品
TUI AG-DI	298.24	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
AVEVA GROUP PLC	57.04	104.08	397	57,911	ソフトウェア
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,011.44	2,063.13	659	96,230	資本市場
EXPERIAN PLC	698.42	803.76	2,120	309,248	専門サービス
MONDI PLC	397.67	471.7	867	126,587	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	209.27	280.11	461	67,245	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	—	173.85	177	25,875	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	310.11	427.89	1,121	163,508	インターネット販売・通信販売
INFORMA PLC	1,024.75	1,493.58	758	110,662	メディア
GLENCORE PLC	8,664.21	8,804.08	2,366	345,159	金属・鉱業
ENTAIN PLC	496.18	496.18	671	97,913	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	487.65	487.65	250	36,500	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	81.49	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	1,126.94	345	50,344	保険
COCA-COLA HBC AG	152.08	152.08	361	52,679	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	517.21	366	53,483	保険
FERGUSON PLC	171.28	205.31	1,831	267,104	商社・流通業
M&G PLC	2,049.4	2,049.4	384	56,104	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.86	320.86	258	37,634	専門小売り
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	261	—	—	—	ソフトウェア
AUTO TRADER GROUP PLC	763.48	980.62	580	84,727	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,647.35	4,246.75	725	105,791	コンピュータリット
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	232,616.39 93銘柄	266,360.93 85銘柄	146,478 —	21,363,882 <4.5%>
(イスラエル)	百株	百株	千円	千円	
BANK HAPOLIM BM	797.54	1,023.59	2,359	76,231	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,063.99	1,307.03	2,594	83,826	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	17.6	820	26,499	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,021.34	1,021.34	1,278	41,315	銀行
ICL GROUP LTD	494.11	494.11	944	30,508	化学
NICE LTD	49.02	55.35	4,964	160,415	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	104.44	803	25,946	銀行
AZRIELI GROUP	22.91	44.14	898	29,022	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	3,570.95 8銘柄	4,067.6 8銘柄	14,663 —	473,765 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千円	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,914.83	2,257.7	2,782	327,931	資本市場
LOGITECH INTL-REG	—	144.29	1,512	178,207	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	2,303.64	2,570.32	25,888	3,050,931	食品
CIE FINANCIER RICHEMONT	409.15	474.14	4,162	490,491	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	544.32	628.85	19,695	2,321,124	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	28.96	34.67	870	102,555	機械

銘柄		期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額 邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千円	千円	
SIKA INHABER		102.09	123.63	3,147	370,946	化学
SGS SA-REG		4.24	5.4	1,473	173,670	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS		1,662.22	1,981.27	16,246	1,914,639	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R		32.52	42.59	660	77,798	保険
BARRY CALLEBAUT AG		2.65	2.65	535	63,147	食品
CLARIANT AG-REG		122.82	199.79	371	43,794	化学
SWISSCOM AG-REG		19.6	24.89	1,156	136,339	各種電気通信サービス
ABB LTD		1,408.52	1,657.76	4,343	511,861	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG		129.44	129.44	738	87,011	専門サービス
GEBERIT AG		29.01	31.81	1,773	208,958	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG		57.93	68.69	4,190	493,802	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART		0.79	0.95	779	91,861	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN		0.09	0.09	774	91,215	食品
GIVAUDAN-REG		7.42	8.12	2,967	349,762	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		115.58	135.85	5,063	596,689	保険
LAFARGEHOLCIM LTD		379.97	478.95	2,392	281,939	建設資材
TEMENOS GROUP		47.3	57.23	600	70,784	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG		45.84	46.98	1,122	132,269	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG		40.18	45.18	942	111,015	海運業
STRAUMANN HOLDING AG		7.94	9.19	1,015	119,730	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B		21.34	24.41	646	76,233	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		45.92	45.92	235	27,734	繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN		16.63	16.63	416	49,035	機械
SWISS LIFE HOLDING AG		24.58	27.61	1,204	141,964	保険
BANQUE CANTONALE VAUD		—	25	248	29,285	銀行
VIFOR PHARMA AG		34.65	46.45	548	64,594	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING		6.33	8.27	740	87,228	化学
SWISS PRIME SITE AG		59.9	83.37	731	86,166	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING PORTEUR		30	—	—	—	各種金融サービス
DUFREY GROUP		31.38	—	—	—	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		15.05	16.58	1,852	218,354	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD		178.49	201.18	1,098	129,451	資本市場
SWISS RE LTD		225.97	248.71	2,086	245,914	保険
ALCON INC		320.32	429.61	2,856	336,686	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG		3,016.86	3,314.28	4,540	535,105	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,444.47 39銘柄	15,648.45 39銘柄	122,411 —	14,426,235 <3.0%>	
(デンマーク)		百株	百株	千円	千円	
CARLSBERG AS-B		84.41	99.74	9,585	164,191	飲料
A P MOLLER A/S		4.91	5.68	7,196	123,277	海運業
AP MOLLER MAERSK A		2.73	2.55	2,996	51,325	海運業
DANSKE BANK A/S		510.34	593.05	6,505	111,443	銀行
GENMAB A/S		50.14	61.9	15,524	265,935	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS		155.33	177.4	7,195	123,256	化学
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS		—	8.13	1,843	31,585	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B		1,369.25	1,540.44	70,860	1,213,835	医薬品
GN STORE NORD A/S		—	128.95	7,110	121,799	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		139.63	181.27	23,583	403,980	電気設備
COLOPLAST-B		97.29	107.34	11,056	189,389	ヘルスケア機器・用品
DSV PANALPINA A S		176.26	190.49	21,353	365,792	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S		72.44	107.39	2,849	48,804	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S		48.4	48.4	1,235	21,158	医薬品
TRYG A/S		111.07	111.07	2,228	38,166	保険
PANDORA A/S		82.51	82.51	5,052	86,556	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		75.39	93.36	5,355	91,733	化学
AMBU A/S B		—	141.56	4,675	80,095	ヘルスケア機器・用品

銘柄	株数	当期		業種等
		株数	評価額	
(デンマーク)	百株	百株	千円	
ISS A/S	111.07	—	—	商業サービス・用品
ORSTED A/S	150.9	164.71	17,162	電力
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	3,242.07 17銘柄	223,369 19銘柄	3,826,326 <0.8%>
(ノルウェー)	百株	百株	千円	
MOWI ASA	351.83	435.37	8,374	食品
DNB ASA	713.52	807.09	13,280	銀行
NORSK HYDRO ASA	931.39	1,290.36	5,293	金属・鉱業
TELENOR ASA	547.66	630.38	8,945	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	—	75.37	2,713	メディア
ORKLA ASA	649.38	652.83	5,291	食品
EQUINOR ASA	810.22	831.49	12,555	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	121.71	151.93	6,285	化学
AKER BP ASA	85.52	—	—	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	166.83	3,403	保険
ADEVINTA ASA	—	222.65	2,996	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	2,251	メディア
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	4,452.51 10銘柄	71,390 11銘柄	888,100 <0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	522.84	564.89	27,803	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	287.68	360.51	15,314	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,361.6	2,649.68	30,100	通信機器
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,239	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	288.12	348.49	7,757	機械
SANDVIK AB	877.84	1,034	22,344	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,308.27	1,449.9	13,692	銀行
SKANSKA AB-B SHS	244	316.53	6,580	建設・土木
SWEDBANK AB	719.58	798.25	11,940	銀行
SVENSKA CELLULOSEA AB-B SHS	—	529.45	8,023	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,121.06	1,392.3	11,831	銀行
VOLVO AB-B SHS	1,192.27	1,305.9	27,450	機械
SWEDISH MATCH AB	129.41	138.45	8,525	タバコ
TELE2 AB-B SHS	346.18	470.55	5,187	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	—	119.55	3,498	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	114.03	3,183	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	191.91	4,055	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98	3,012	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	351.8	395.67	25,750	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	602.83	688.14	12,376	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	810.88	870.21	19,614	建設関連製品
Telia CO AB	2,318.55	2,104.77	7,436	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB	121.46	147.39	3,746	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	218.55	283.76	8,816	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	233.43	283.92	7,072	機械
KINNEVIK AB-B	183.1	217.22	9,554	各種金融サービス
MILICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	78.44	—	—	無線通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER	—	89.67	3,753	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	59.2	90.09	3,714	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92	3,463	家庭用耐久財
NIBE INDUSTRIER AB	—	288.34	8,367	建設関連製品
HEXAGON AB	211.45	265.34	19,481	電子装置・機器・部品
EPIROC AB-A	489.55	607.5	10,409	機械
EPIROC AB-B	308.99	308.99	4,795	機械
ESSITY AB-B	466.4	521.43	13,739	家庭用品
EQT AB	—	209.34	5,442	資本市場
EVOLUTION GAMING GROUP AB	—	136.41	14,152	ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	株数	当期		業種等
		株数	金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	
NORDEA BANK ABP	2,592.68	2,957.52	21,193	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	—	149.45	3,036	コンプロマリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,051.27	419,459	5,310,363
(ユーロ…イギリス)	百株	百株	千円	
UNILEVER PLC	1,131.34	—	—	パーソナル用品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	—	—
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千円	
CRH PLC	619.9	716.53	2,635	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	62.46	141.28	2,263	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	122.58	147.3	1,596	食品
KINGSPAN GROUP PLC	117.68	134.52	716	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	173.97	208.7	874	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	822.56	—	—	銀行
AIB GROUP PLC	413.52	—	—	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,348.33	8,085	1,030,453
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千円	
AIRBUS SE	451.22	531.76	4,903	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	137.16	152.1	2,210	化学
ING GROEP NV-CVA	3,045.08	3,448.92	2,879	銀行
RANDSTAD NV	90.74	126.01	681	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	890.26	992.8	2,334	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	195.82	226.83	1,951	飲料
AKZO NOBEL	174.91	179.59	1,530	化学
ASML HOLDING NV	330.53	380.98	18,848	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,503.49	1,503.49	561	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	719.25	829.19	3,976	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	206.87	257.15	1,811	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	556.11	541.76	1,912	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	179.74	207.63	936	ライフサイエンス・ツール/サービス
VOPAK (KON.)	53.64	53.64	234	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV	2,910.29	3,478.24	1,018	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	97.91	100.04	743	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	397.52	553.04	540	飲料
FERRARI NV	89.34	115.42	1,947	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	779.51	893.78	1,083	機械
PROSUS NV	368.71	442.19	4,656	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV	—	73.08	235	食品
NN GROUP NV	217.2	252.74	900	保険
ARGENX SE	—	38.79	1,201	バイオテクノロジー
STELLANTIS NV	790.84	1,769.58	2,347	自動車
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	90	108.36	982	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV	342.51	342.51	300	銀行
EXOR NV	79.71	99.66	672	各種金融サービス
ALTICE EUROPE NV	567.63	—	—	各種電気通信サービス
ADYEN NV	8.18	15.89	3,479	情報技術サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	17,715.17	64,885	8,269,017
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千円	
UMICORE	141.15	176.54	839	化学
KBC GROUPE	185.77	210.38	1,245	銀行
SOFINA	—	13.82	406	各種金融サービス
SOLVAY SA	55.63	71.83	687	化学
AGEAS	143.65	143.65	652	保険
UCB SA	90.95	105.71	927	医薬品

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
COLRUYT NV	46.73	46.73	236	30,169	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	66.89	99.04	841	107,208	各種金融サービス
PROXIMUS	142.83	137.39	233	29,730	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	34.26	34.26	242	30,859	バイオテクノロジー
ELIA GROUP	—	28.62	281	35,816	電力
TELENET GROUP HOLDING NV	36.34	—	—	—	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	587.31	663.27	3,488	444,612	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,531.51 11銘柄	1,731.24 12銘柄	10,083 —	1,285,048 <0.3%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	467.14	615.94	1,150	146,676	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	8.99	113.3	922	117,605	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	369.59	369.59	262	33,488	エネルギー設備・サービス
SES FDR	288.47	288.47	199	25,476	メディア
AROUNDTOWN SA	717.83	830.54	483	61,558	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,852.02 5銘柄	2,217.84 5銘柄	3,019 —	384,805 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	363.17	412	5,557	708,296	化学
AXA SA	1,481.6	1,694.93	3,240	412,909	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	444.49	507.07	1,140	145,332	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	1.63	2.95	270	34,512	航空宇宙・防衛
DANONE	488.33	543.15	2,928	373,229	食品
SAFRAN SA	258.98	280.36	3,053	389,089	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	122.77	173.8	519	66,247	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	175.72	214.17	718	91,570	建設・土木
BNP PARIBAS	864.34	1,017.91	4,731	602,949	銀行
THALES SA	85.49	105.13	818	104,368	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	125.15	149.12	2,017	257,122	情報技術サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	42.64	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	43.34	—	—	—	電子装置・機器・部品
NATIXIS	701.66	701.66	280	35,767	資本市場
EIFFAGE	64.61	84.65	690	87,942	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	151.98	185.95	873	111,378	メディア
FAURECIA	61.17	61.17	268	34,269	自動車部品
L'OREAL	195.54	224.47	7,144	910,543	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	214.86	248.73	13,165	1,677,783	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	713.47	258	32,951	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	124.22	148.02	1,727	220,139	自動車部品
PERNOD-RICARD	167.19	190.38	3,032	386,494	飲料
PEUGEOT SA	439.05	—	—	—	自動車
RENAULT SA	149.17	190.19	748	95,351	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.6	296	37,760	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	394.36	445.6	1,879	239,585	建設関連製品
SEB SA	15.51	22.18	371	47,374	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	611.81	695.95	1,236	157,623	銀行
VINCI S.A.	392.37	472.57	4,048	515,881	建設・土木
SODEXO	70.75	91.78	684	87,208	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	436.56	483.76	6,240	795,289	電気設備
VIVENDI SA	679.89	709.95	1,852	236,142	娯楽
TOTAL SE	1,860.2	2,258.11	7,897	1,006,487	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	196.53	196.53	635	81,048	自動車部品
ORANGE	1,512.46	1,840.93	1,794	228,649	各種電気通信サービス
HERMES INTL	24.83	28.8	2,662	339,279	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	99.53	121.83	2,317	295,382	ソフトウェア
KERING	58.3	68.27	3,740	476,691	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	187	23,921	保険

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CARREFOUR SA	510.94	499.26	721	91,907	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	73.04	89.72	592	75,463	情報技術サービス
SANOFI	871.69	1,014.54	7,929	1,010,553	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	59.35	76.86	580	73,932	娯楽
TELEPERFORMANCE	43.83	53.12	1,567	199,703	専門サービス
EURAZEO	27.48	52.29	324	41,315	各種金融サービス
JC DECAUX SA	60.58	—	—	—	メディア
ESSILORLUXOTTICA	217.61	249.84	3,420	435,884	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	862.05	986.85	1,073	136,768	銀行
ORPEA	—	49.32	574	73,192	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	22.2	216	27,570	各種金融サービス
ILIAD SA	21.02	10.46	160	20,401	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	32.48	407	51,988	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	18.84	23.87	969	123,504	ライフサイエンス・ツール／サービス
ENGIE	1,392.72	1,660.61	2,167	276,280	総合公益事業
ALSTOM	157.12	217.79	915	116,682	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	125.42	—	—	—	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	538	547.78	581	74,102	電力
IPSEN SA	36.46	36.46	271	34,569	医薬品
ARKEMA SA	50.33	63.93	571	72,820	化学
LEGRAND SA	206.73	238.06	1,798	229,176	電気設備
ADP	23.13	23.13	231	29,462	運送インフラ
SCOR SE	101.16	156.67	436	55,625	保険
BUREAU VERITAS SA	231.79	298.1	668	85,135	専門サービス
GETLINK	376.46	376.46	499	63,616	運送インフラ
SUEZ SA	266.2	266.2	454	57,875	総合公益事業
EDENRED	191.88	214.88	1,023	130,376	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	80.92	312	39,764	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	77.58	223.86	1,762	224,578	情報技術サービス
AMUNDI SA	41.19	59.24	392	50,015	資本市場
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	20,629.42	23,068.91	119,655	15,248,842
		67銘柄	64銘柄	—	< 3.2% >
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	139	172.02	5,021	639,909	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	252.51	312.17	2,192	279,475	自動車
COMMERZBANK AG	831.18	831.18	425	54,233	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	314.63	390.3	1,410	179,809	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	98.82	98.82	374	47,717	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	267	34,137	化学
HANNOVER RUECK SE	48.68	48.68	691	88,093	保険
GEA GROUP AG	118.38	118.38	362	46,239	機械
CONTINENTAL AG	83.12	103.36	1,267	161,557	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	760.32	869.75	3,742	476,948	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	126.49	126.49	762	97,170	自動車
MERCK KGAA	98.5	118.74	1,697	216,390	医薬品
RWE AG	464.89	592.73	2,013	256,600	総合公益事業
SAP SE	760.71	934.54	10,145	1,292,925	ソフトウェア
E.ON SE	1,813.17	2,098.42	1,835	233,941	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	75.85	86.02	665	84,848	家庭用品
SIEMENS AG-REG	591.13	686.52	9,200	1,172,542	コングロマリット
PUMA AG	73.51	92.39	789	100,622	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	720.11	887.08	4,785	609,901	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	137.59	162.41	1,419	180,896	家庭用品
DAIMLER AG	694.81	780.56	5,047	643,202	自動車
BASF SE	705.54	832.15	5,560	708,620	化学
BEIERSDORF AG	83.71	83.71	770	98,209	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	17.07	17.07	130	16,587	建設・土木

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HEIDELBERGCEMENT AG	120.31	145.71	932	118,880	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	162.14	201.91	1,239	157,939	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	329.44	375.04	7,333	934,585	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	160.96	279.9	298	38,042	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	110.91	123.01	2,873	366,200	保険
VOLKSWAGEN AG	26.45	27.58	499	63,617	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	144.01	163.61	2,637	336,109	自動車
NEMETSCHKE SE	—	50.95	295	37,659	ソフトウェア
THYSSENKRUPP AG	271.1	—	—	—	金属・鉱業
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,493.84	1,659.49	1,490	189,913	資本市場
BMW VORZUG	41.16	41.16	225	28,771	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,635.92	2,993.58	4,443	566,339	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	27.12	30.44	1,464	186,593	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	990.68	1,188.79	4,227	538,731	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	—	4.79	397	50,696	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG	37.71	37.71	504	64,301	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	—	25.11	425	54,272	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	145.25	167.52	2,288	291,623	資本市場
FRAPORT AG	31.49	—	—	—	運送インフラ
WIRECARD AG	89.63	—	—	—	情報技術サービス
LANXESS AG	68.56	68.56	416	53,105	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	41.68	48.73	947	120,756	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN	269.47	290.97	1,200	153,034	不動産管理・開発
SYMRISE AG	99.88	113.08	1,179	150,377	化学
BRENNTAG SE	123.53	140.44	921	117,408	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	171.16	171.16	474	60,464	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	615.41	983.85	225	28,712	各種電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN AG	—	59.34	700	89,265	不動産管理・開発
KION GROUP AG	45.67	59.03	438	55,879	機械
VONOVIA SE	386.17	454.51	2,508	319,733	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	44.92	68.6	736	93,875	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	114.68	238.05	1,162	148,136	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	107.74	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	136.68	624	79,567	ソフトウェア
SIEMENS ENERGY AG	—	358.31	1,121	142,970	電気設備
ZALANDO SE	99.64	147.56	1,473	187,787	インターネット販売・通信販売
SCOUT24 AG	—	96.7	645	82,320	インタラクティブ・メディアおよびサービス
COVESTRO AG	127.08	163.37	957	121,962	化学
HELLOFRESH SE	—	128.38	984	125,486	インターネット販売・通信販売
UNIPER SE	142.52	182.03	550	70,150	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	80.81	109.74	1,445	184,185	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	株 数 銘 柄 数<比 率>	110,876	14,130,044	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	195.17	195.17	246	31,463	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,016.06	2,386.62	1,179	150,280	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	400.88	400.88	361	46,050	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	株 数 銘 柄 数<比 率>	1,787	227,795	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	4,772.67	5,508.72	5,952	758,544	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	158.85	212.06	714	91,046	電気設備
REPSOL SA	1,149.98	1,359.9	1,206	153,791	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	3,677.55	4,558.87	1,715	218,623	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	234.17	277.36	608	77,515	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	201.37	213.95	547	69,800	建設・土木
BANKINTER S.A.	579.6	—	—	—	銀行

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		5,235.94	5,782.51	2,544	324,246	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		236.12	236.12	495	63,161	ガス
BANCO SANTANDER SA		12,640.63	15,869.57	4,435	565,265	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA		345.96	345.96	517	65,979	電力
BANCO SABADELL		4,136.31	—	—	—	銀行
INDITEX		838.83	1,004.23	2,581	329,034	専門小売り
MAPFRE SA		844.74	—	—	—	保険
ENAGAS		180.95	234.77	416	53,136	ガス
GRIFOLS SA		235.18	235.18	534	68,154	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA		386.66	405.93	834	106,308	建設・土木
CAIXABANK		2,972.24	3,073.31	692	88,241	銀行
AMADEUS IT GROUP SA		338.91	411.18	2,226	283,802	情報技術サービス
BANKIA SA		1,006.75	—	—	—	銀行
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS		—	213.57	8	1,129	建設・土木
AENA SME SA		53.38	62.56	822	104,840	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU		197.8	272.34	1,248	159,062	各種電気通信サービス
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	40,424.59 22銘柄	40,278.09 19銘柄	28,104 —	3,581,685 <0.7%>	
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI		870.3	975.69	1,528	194,781	保険
INTESA SANPAOLO		11,576.31	15,123.69	3,169	403,975	銀行
UNICREDIT SPA		1,557.18	1,939.1	1,628	207,481	銀行
ENI SPA		1,978.38	2,193.31	1,947	248,181	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA		416.39	574.42	510	65,049	銀行
ENEL SPA		6,323.33	7,299.44	6,181	787,727	電力
LEONARDO SPA		283.16	—	—	—	航空宇宙・防衛
SNAM SPA		1,691.63	1,712.94	766	97,622	ガス
TELECOM ITALIA SPA		7,626.75	7,626.75	289	36,934	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		4,975.96	4,975.96	213	27,204	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		373.65	452.99	713	90,923	運送インフラ
TERNA SPA		1,136.54	1,136.54	701	89,366	電力
RECORDATI SPA		68.59	103.03	459	58,599	医薬品
AMPLIFON SPA		—	113.72	426	54,332	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA		214.52	223.28	634	80,811	電気設備
DIASORIN SPA		—	22.23	412	52,580	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA		143.53	175.67	900	114,712	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA		—	430.97	698	89,029	情報技術サービス
FINECOBANK SPA		450.48	538.18	810	103,324	銀行
POSTE ITALIANE SPA		400.15	400.15	387	49,353	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA		—	233.44	216	27,607	各種電気通信サービス
PIRELLI & C SPA		340.86	—	—	—	自動車部品
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	40,427.71 18銘柄	46,251.5 20銘柄	22,595 —	2,879,599 <0.6%>	
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B		—	240.85	518	66,053	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ		349.35	349.35	298	38,021	機械
NOKIAN RENKAAT OYJ		93.99	—	—	—	自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ		399.09	448.29	1,441	183,673	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS		419.15	532.5	878	111,904	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		361.41	448.22	1,653	210,777	保険
FORTUM OYJ		374.52	394.09	857	109,284	電力
NOKIA OYJ		4,308	5,185.32	1,802	229,700	通信機器
ELISA OYJ		107.87	136.42	676	86,214	各種電気通信サービス
NELES OYJ		85.85	—	—	—	機械
NESTE OYJ		329.31	367.96	2,105	268,320	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ		265.02	298.9	2,070	263,900	機械

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ORION OYJ	80.51	80.51	288	36,741	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	12,590	1,604,590	
	12	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	128.17	128.17	451	57,528	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	49.08	69.24	482	61,458	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	306	39,113	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	209.43	242.04	642	81,864	銀行
ANDRITZ AG	62.65	—	—	—	機械
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	96.41	179.11	299	38,119	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	2,182	278,083	
	644.49	717.31	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	—	455,954,801	
	858,545.81	974,571.62	—	<95.5%>	
	1,254	1,224	—		

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。
(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(2) 外国新株予約権証券

銘 柄	期 首 (前期末)		当 期 末	
	証 券 数	証 券 数	評 価 額	評 価 額
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(スイス)	証券	証券	千スイス・フラン	千円
CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23	—	87,844	28	3,416
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	証 券 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	—	3,416
	—	87,844	—	<0.0%>
	—	1	—	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。
(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄		期首(前期末)		当期		期末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
不動産ファンド (アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		8.646	12.006	2,077	218,413	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC		12.027	12.947	1,218	128,069	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		17.771	22.693	849	89,336	0.0	
SL GREEN		7.097	—	—	—	—	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		108.247	127.559	1,081	113,708	0.0	
PROLOGIS INC		56.079	66.35	7,143	750,967	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC		10.491	12.329	2,213	232,649	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST		8.062	9.643	1,027	107,996	0.0	
EQUINIX INC		6.522	7.992	5,672	596,324	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		13.649	—	—	—	—	
DUKE REALTY TRUST		27.278	31.929	1,327	139,558	0.0	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		31.583	38.831	6,386	671,311	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		5.075	5.504	1,482	155,840	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL		27.869	35.108	2,369	249,038	0.1	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		40.162	45.543	1,409	148,124	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP		8.778	9.838	2,596	272,958	0.1	
WELLTOWER INC		32.099	38.411	2,593	272,589	0.1	
KIMCO REALTY		32.98	—	—	—	—	
IRON MOUNTAIN INC		23.977	24.591	815	85,744	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		13.626	16.087	1,009	106,165	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC		55.116	63.952	952	100,167	0.0	
MID AMERICA		8.834	10.854	1,499	157,613	0.0	
REALTY INCOME CORP		23.491	29.466	1,840	193,467	0.0	
REGENCY CENTERS CORP		11.403	14.499	762	80,199	0.0	
UDR INC		22.345	27.057	1,155	121,477	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC		23.306	28.083	3,068	322,544	0.1	
PUBLIC STORAGE		12.188	13.834	3,207	337,177	0.1	
SUN COMMUNITIES INC		7.418	9.67	1,438	151,246	0.0	
VENTAS INC		29.505	35.021	1,776	186,720	0.0	
VORNADO REALTY TRUST		12.472	12.714	488	51,308	0.0	
WEYERHAEUSER CO		57.621	64.096	2,245	236,091	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC		9.261	12.385	1,447	152,167	0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC		15.605	23.492	3,290	345,875	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST		39.953	53.911	1,212	127,510	0.0	
AGNC INVESTMENT CORP		44.741	46.028	752	79,108	0.0	
VEREIT INC		82.604	20.534	776	81,592	0.0	
AMERICAN TOWER CORP		34.213	39.736	9,027	948,983	0.2	
WVP CAREY INC		13.039	15.529	1,093	114,905	0.0	
INVITATION HOMES INC		42.384	50.475	1,564	164,483	0.0	
VICI PROPERTIES INC		34.2	47.083	1,283	134,919	0.0	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	1,077.717	1,135.78	80,159	8,426,360	—	
		41銘柄<2.2%>	37銘柄<1.8%>	—	—	1.8	
(カナダ)		千□	千□	千カナダ・ドル	千円	%	
SMARTCENTRES REIT		3.067	—	—	—	—	
CANADIAN APT PPTYS REIT		7.819	7.954	409	33,900	0.0	
H & R REAL ESTATE INVESTMENT		10.748	—	—	—	—	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST		17.676	—	—	—	—	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		13.467	13.467	242	20,069	0.0	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	52.777	21.421	651	53,970	—	
		5銘柄<0.0%>	2銘柄<0.0%>	—	—	0.0	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末			
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%	
MIRVAC GROUP	329.418	329.418	764	62,362	0.0	
GPT GROUP	158.232	158.232	653	53,325	0.0	
STOCKLAND	194.018	194.018	909	74,251	0.0	
DEXUS	84.575	108.972	950	77,539	0.0	
GOODMAN GROUP	132.051	148.357	2,664	217,422	0.0	
VICINITY CENTRES	270.443	371.711	570	46,559	0.0	
SCENTRE GROUP	420.268	420.268	1,130	92,250	0.0	
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,589.005 7銘柄<0.2%>	1,730.976 7銘柄<0.1%>	7,643 —	623,711 —	— 0.1
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT	157.9	200.2	13,473	182,700	0.0	
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	157.9 1銘柄<0.0%>	200.2 1銘柄<0.0%>	13,473 —	182,700 —	— 0.0
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	199	483.636	1,034	82,136	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200.806	292.606	898	71,289	0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206.3	—	—	—	—	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	286	22,715	0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	270.1	521	41,369	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	192.3	399	31,742	0.0	
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	990.506 5銘柄<0.1%>	1,430.742 5銘柄<0.1%>	3,140 —	249,252 —	— 0.1
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC	69.819	69.819	321	46,842	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	55.843	55.843	338	49,438	0.0	
SEGRO PLC	87.247	100.956	977	142,532	0.0	
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	212.909 3銘柄<0.1%>	226.618 3銘柄<0.1%>	1,637 —	238,813 —	— 0.1
(フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GEICINA SA	3.67	3.67	433	55,189	0.0	
ICADE	2.234	—	—	—	—	
KLEPIERRE	17.042	17.099	323	41,272	0.0	
COVIVIO	4.265	4.663	305	38,982	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10.898	12.92	752	95,926	0.0	
小 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	38.109 5銘柄<0.1%>	38.352 4銘柄<0.0%>	1,815 —	231,370 —	— 0.0
合 計	□ 数 金 額 銘 柄 数<比 率>	4,118.923 67銘柄<2.7%>	4,784.089 59銘柄<2.1%>	— —	10,006,178 —	— 2.1

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		期末
		買建額	売建額	額
外国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T	百万円 8,863		百万円 —
	S & P / T S E 6 0 I X F U T	416		—
	S P I 2 0 0 F U T U R E S	275		—
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E	562		—
	D J E U R O S T O X X 5 0	1,936		—

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

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項目	当期	期末
	評価額	比率
株式	千円 455,954,801	% 95.5
新株予約権証券	3,416	0.0
投資信託受益証券、投資証券	10,006,178	2.1
コール・ローン等、その他	11,688,217	2.4
投資信託財産総額	477,652,614	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、477,230,001千円、99.9％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝105.12円、1カナダ・ドル＝82.84円、1オーストラリア・ドル＝81.60円、1香港・ドル＝13.56円、1シンガポール・ドル＝79.36円、1ニュージーランド・ドル＝75.90円、1イギリス・ポンド＝145.85円、1イスラエル・シェケル＝32.31円、1スイス・フラン＝117.85円、1デンマーク・クローネ＝17.13円、1ノルウェー・クローネ＝12.44円、1スウェーデン・クローナ＝12.66円、1ユーロ＝127.44円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	478,371,556,028円
コ	株	7,543,114,076
株	新	455,954,801,985
投	資	3,416,297
投	信	872,963,897
未	約	9,133,215,008
未	託	997,758,204
差	収	327,168,116
入	入	3,539,118,445
(B) 負	債	805,612,996
未	金	725,661,696
未	金	79,951,300
純	金	477,565,943,032
元	金	101,430,005,374
次	金	376,135,937,658
(D) 受	益	101,430,005,374円
1	口	47,083円
(注1)	期首元本額	88,590,932,378円
	追加設定元本額	45,119,031,395円
	一部解約元本額	32,279,958,399円
(注2)	期末における元本の内訳	
	D I A M 外国株式・ファンド	3,590,651,003円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,310,337円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,547,566円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	6,756,671円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,177,539円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,784,106円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	10,755,334円
	たわらノーロード 先進国株式	19,446,068,276円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	221,026,311円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,352,778,639円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	410,571,761円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	46,019,112円
	たわらノーロード バランス (標準型)	354,659,393円
	たわらノーロード バランス (積極型)	417,152,173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)	1,077,196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)	132,195,005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)	345,649,770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)	228,974,611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)	343,116,453円
	たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	628,040円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	2,639,134円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,984,548円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	4,398,037円
	たわらノーロード 全世界株式	85,362,898円
	D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金>	46,681,552,310円
	One DC 先進国株式インデックスファンド	578,488,633円
	D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	183,355,556円
	D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	935,988,345円
	D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,108,633,939円
	D I A M DC バランス30インデックスファンド	112,383,572円
	D I A M DC バランス50インデックスファンド	336,515,401円
	D I A M DC バランス70インデックスファンド	294,453,629円
	マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	26,718,430円
	マネックス資産設計ファンド (育成型)	815,556,610円
	マネックス資産設計ファンド エポリューション	168,120,959円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	207,380,963円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	175,357,524円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	291,398,144円
	投資のソムリエ	4,677,116,550円
	クルーズコントロール	247,166,541円
	投資のソムリエ<DC年金>	287,425,394円
	D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	195,280,389円
	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	114,819,293円
	D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	1,868,239円
	D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	4,162,455円
	投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型	109,409,614円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,213,146,637円
	ワールドアセットバランス (基本コース)	336,245,295円
	ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	982,171,507円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	12,186,690円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	5,775,603円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,075,918円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	20,712,777円
	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	33,065,020円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	740,973,150円
	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,140,431円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	6,120,622円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	3,347,358円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	3,322,497円
	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,214,984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)	117,075,833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)	142,051,776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)	6,645,402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)	72,091,910円
	M S C I コアサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	257,923,303円
	D I A M 外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	63,007,304円
	D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,445,094,582円
	D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,156,121,882円
	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	862,725,175円
	D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	11,658,494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)	190,209,441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)	47,142,712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)	83,869,902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)	5,197,402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)	34,446,092円
	D I A M 国内重複バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,743,840円
	D I A M 国内重複バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,557,070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)	12,351,541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)	42,816,355円
	D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	298,196,031円
	D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	415,545,865円
	D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,340,967,617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)	497,122,927円
	D I A M グローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	73,316,094円
	D I A M アグロ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	487,021,391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)	21,947,333円
	D I A M 世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,736,583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)	203,141,179円
	D I A M 世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	15,672,052円
	D I A M 世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	65,152,864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)	103,614,222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)	210,904,861円
	期末元本合計	101,430,005,374円

■損益の状況

当期 自2020年2月18日 至2021年2月15日

項 目					当 期
(A)	配 受 受 そ 支	当 取 の 取 他 払	等 配 利 収 益 利 益	収 当 金 息 金 息	6,240,305,046円 6,234,830,400 332,462 5,507,444 △365,260
(B)	有 売 売	価 証 券	買 売 買 損 益	損 益 損 益	50,582,940,100 87,299,316,083 △36,716,375,983
(C)	先 取 取	物 取 引	引 等 取 引 損 益	損 益 損 益	1,388,470,803 4,988,951,090 △3,600,480,287
(D)	そ の	他 費 用	費 用	費 用	△87,341,531
(E)	当 期	損 益	金(A + B + C + D)	金	58,124,374,418
(F)	前 期	繰 越	損 益	金	281,829,514,820
(G)	解 約	差 損	損 益	金	△91,806,425,185
(H)	追 加	信 託	差 損	益 金	127,988,473,605
(I)	合 次	期 繰 越	損 益	金(I)	376,135,937,658

(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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月15日～2021年2月15日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月3日から無期限です。
運 用 方 針	NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主 要 投 資 対 象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債券組入 比 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率	純 資 産 総 額
	円	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率				
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	ポイント 376.81	% 0.9	% 98.6	% —	% —	百万円 379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）NOMURA-BPI 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

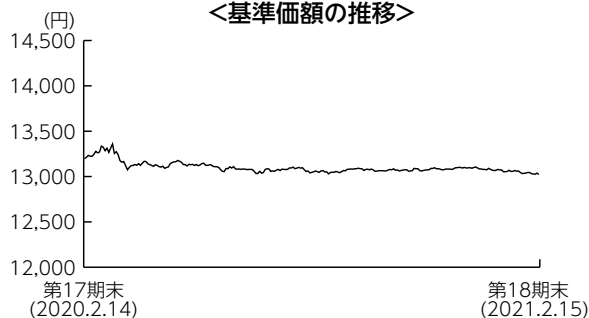
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2020 年 2 月 14 日	円 13,197	% —	ポイント 390.72	% —	% 99.4	% —	% —
2 月 末	13,336	1.1	394.74	1.0	101.0	—	—
3 月 末	13,124	△0.6	388.45	△0.6	101.4	—	—
4 月 末	13,169	△0.2	389.79	△0.2	99.4	—	—
5 月 末	13,112	△0.6	388.13	△0.7	99.4	—	—
6 月 末	13,060	△1.0	386.56	△1.1	99.7	—	—
7 月 末	13,104	△0.7	387.91	△0.7	99.5	—	—
8 月 末	13,044	△1.2	386.09	△1.2	100.0	—	—
9 月 末	13,081	△0.9	387.22	△0.9	99.7	—	—
10 月 末	13,059	△1.0	386.63	△1.0	99.5	—	—
11 月 末	13,076	△0.9	387.12	△0.9	99.9	—	—
12 月 末	13,078	△0.9	387.20	△0.9	99.3	—	—
2021 年 1 月 末	13,045	△1.2	386.25	△1.1	99.2	—	—
(期 末) 2021 年 2 月 15 日	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月15日から2021年2月15日まで）

＜基準価額の推移＞



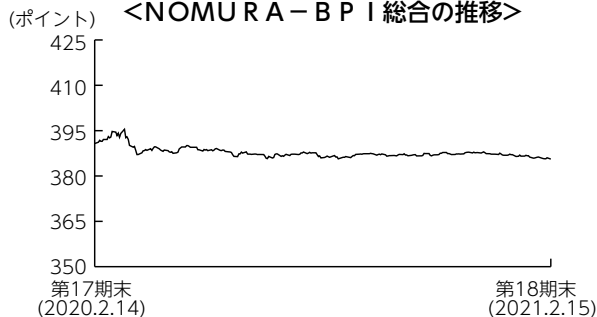
基準価額の推移

当期末の基準価額は13,022円となり、前期末比で1.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり基準価額は上昇して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和政策などを受けて基準価額は下落に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に基準価額は下落しました。

＜NOMURA-BPI総合の推移＞



投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり利回りは低下（価格は上昇）して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和

政策などを受けて利回りは上昇に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。

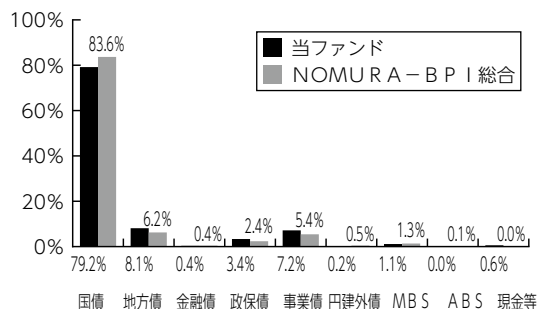
ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

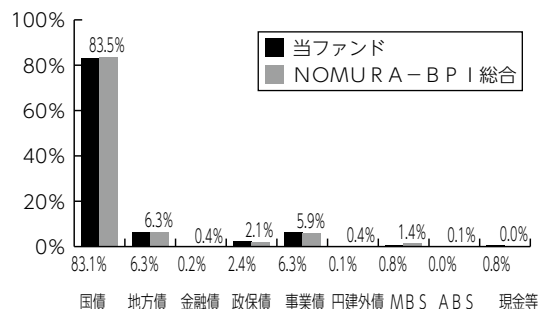
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

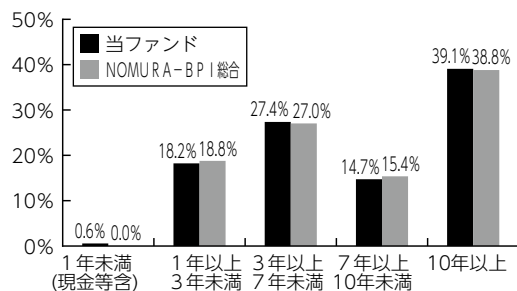


期末

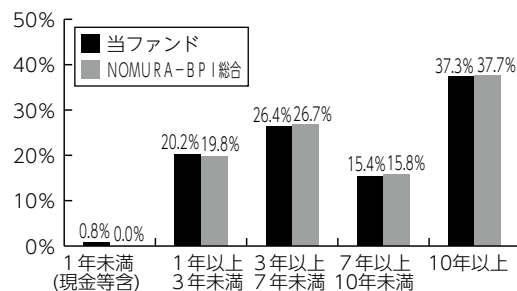


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合は、前期末比で1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況（2020年 2 月15日から2021年 2 月15日まで）

公社債

		買付額	売付額
国	内	千円	千円
		国債証券	136,499,291 (-)
		地方債証券	3,489,753 (-)
		特殊債証券	1,817,635 (203,888)
		社債証券	1,318,867 (-)
		191,780,597	
		2,830,950	
		2,021,381	
		1,451,683	

(注 1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。
(注 2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 3) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等（2020年 2 月15日から2021年 2 月15日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当			期		
区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D / C
公社債	百万円 198,084	百万円 4,470	% 2.3	百万円 143,125	百万円 11,792	% 8.2

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国 債 証 券	千円 212,920,000	千円 227,135,859	% 83.1	% －	% 55.9	% 18.5	% 8.7
地 方 債 証 券	16,600,000	17,224,060	6.3	5.1	2.3	2.8	1.1
特 殊 債 券	14,894,979	15,838,836	5.8	－	3.8	1.5	0.5
金 融 債 券	500,000	500,321	0.2	－	－	0.2	－
普 通 社 債 券	10,281,000	10,583,824	3.9	0.1	1.2	2.0	0.7
合 計	255,195,979	271,282,901	99.2	5.2	63.1	25.1	11.0

(注 1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第 2 位を四捨五入しています。

(注 2) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,300,000	1,315,925	2022/03/20
4 1 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	900,000	902,367	2022/04/01
4 1 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,500,000	1,504,245	2022/05/01
4 1 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	400,000	401,184	2022/06/01
1 3 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,500,000	2,507,700	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	3,200,000	3,244,000	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,050,000	1,063,030	2022/06/20
4 1 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,003,220	2022/07/01
4 1 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	200,000	200,684	2022/08/01
4 1 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,270,000	1,274,597	2022/09/01
1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,980,000	1,987,246	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,400,000	1,420,650	2022/09/20
4 1 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,300,000	1,305,330	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	600,000	602,526	2022/12/01
1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,697,165	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.7000	500,000	507,610	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,200,000	1,220,472	2022/12/20
4 2 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,600,000	1,607,056	2023/01/01
1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,840,000	1,848,648	2023/03/20
3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,790,000	1,817,154	2023/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,250,000	1,256,587	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,770,000	1,808,196	2023/06/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,400,000	1,408,190	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,250,000	1,279,887	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	650,000	662,161	2023/09/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,567,085	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,360,000	2,408,781	2023/12/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,720,000	1,732,263	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,250,000	2,300,557	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,702,742	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,380,000	2,437,453	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,660,000	1,673,163	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	2,940,000	3,005,209	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	350,000	377,958	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,920,000	1,935,916	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	760,000	777,882	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,340,000	1,361,185	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	340,000	367,672	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,500,000	1,513,245	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,030,000	2,072,508	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	152,703	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,750,000	2,775,162	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,107,579	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	190,000	206,606	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,000,000	2,019,380	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,350,000	2,405,295	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	240,000	263,308	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,100,000	1,110,967	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	2,210,000	2,253,537	2025/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	2,580,000	2,605,696	2026/03/20

銘	柄	当期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
8 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	489,249	2026/03/20
3 4 3 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,280,000	2,303,233	2026/06/20
8 8 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	350,000	394,775	2026/06/20
3 4 4 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,280,000	2,303,689	2026/09/20
9 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	300,000	338,418	2026/09/20
3 4 5 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,010,000	3,041,785	2026/12/20
9 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	870,000	981,012	2026/12/20
3 4 6 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,470,000	2,496,429	2027/03/20
9 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	281,637	2027/03/20
9 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	450,000	509,697	2027/03/20
3 4 7 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,010,000	2,031,748	2027/06/20
9 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	350,000	402,692	2027/06/20
3 4 8 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,980,000	2,001,621	2027/09/20
9 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	574,780	2027/09/20
3 4 9 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,060,000	2,082,639	2027/12/20
9 9 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	450,000	516,591	2027/12/20
3 5 0 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,700,000	2,727,837	2028/03/20
1 0 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	695,772	2028/03/20
3 5 1 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,960,000	1,979,462	2028/06/20
1 0 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.4000	360,000	424,504	2028/06/20
3 5 2 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,220,000	2,241,090	2028/09/20
1 0 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	464,652	2028/09/20
1 0 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	350,000	409,230	2028/09/20
3 5 3 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,840,000	1,856,596	2028/12/20
1 0 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	466,412	2028/12/20
1 0 8 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	400,000	460,132	2028/12/20
3 5 4 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,870,000	1,885,876	2029/03/20
1 0 9 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	220,000	253,908	2029/03/20
1 1 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	330,000	386,202	2029/03/20
3 5 5 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,920,000	1,935,187	2029/06/20
1 1 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	290,000	343,064	2029/06/20
1 1 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	646,052	2029/06/20
3 5 6 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,180,000	2,195,892	2029/09/20
1 回	利付国庫債券 (30年)	2.8000	100,000	123,791	2029/09/20
1 1 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	770,000	907,753	2029/09/20
3 5 7 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,160,000	2,173,327	2029/12/20
1 1 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	650,386	2029/12/20
1 1 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	200,000	238,268	2029/12/20
2 回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	121,243	2030/02/20
3 5 8 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,100,000	2,111,403	2030/03/20
1 1 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	320,000	382,585	2030/03/20
1 1 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	650,000	771,238	2030/03/20
3 5 9 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,160,000	2,169,028	2030/06/20
1 1 8 回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	310,000	366,193	2030/06/20
1 1 9 回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	300,000	348,804	2030/06/20
1 2 0 回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	400,000	457,636	2030/06/20
3 6 0 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,090,000	2,096,959	2030/09/20
1 2 1 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	634,451	2030/09/20
1 2 2 回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	350,000	407,883	2030/09/20
4 回	利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	254,984	2030/11/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
3 6 1 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	800,000	801,952	2030/12/20
1 2 3 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	750,000	898,800	2030/12/20
1 2 4 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	390,000	463,565	2030/12/20
1 2 5 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	660,000	800,012	2031/03/20
1 2 6 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	340,000	405,324	2031/03/20
1 2 7 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	420,000	496,490	2031/03/20
1 2 8 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	620,000	734,582	2031/06/20
1 2 9 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	590,000	692,996	2031/06/20
1 3 0 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	680,000	800,734	2031/09/20
1 3 1 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	300,000	350,124	2031/09/20
6 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.4000	200,000	248,698	2031/11/20
1 3 2 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	420,000	491,278	2031/12/20
1 3 3 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	570,000	672,839	2031/12/20
1 3 4 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	630,000	745,397	2032/03/20
1 3 5 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	350,000	410,284	2032/03/20
1 3 6 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	440,000	510,972	2032/03/20
1 3 7 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	350,000	411,176	2032/06/20
1 3 8 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	380,000	437,931	2032/06/20
1 3 9 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	450,000	523,629	2032/06/20
1 4 0 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	1,090,000	1,283,224	2032/09/20
8 回	利付国庫債券 (3 0 年)	1.8000	200,000	238,010	2032/11/22
1 4 1 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	750,000	884,730	2032/12/20
1 4 2 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	400,000	476,508	2032/12/20
1 4 3 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	760,000	889,245	2033/03/20
1 4 4 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	430,000	498,030	2033/03/20
1 1 回	利付国庫債券 (3 0 年)	1.7000	200,000	236,840	2033/06/20
1 4 5 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	1,410,000	1,669,722	2033/06/20
1 2 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.1000	200,000	247,280	2033/09/20
1 4 6 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	1,050,000	1,245,741	2033/09/20
1 3 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.0000	100,000	122,688	2033/12/20
1 4 7 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	1,180,000	1,387,691	2033/12/20
1 4 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.4000	290,000	371,606	2034/03/20
1 4 8 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	1,090,000	1,269,904	2034/03/20
1 5 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	200,000	259,598	2034/06/20
1 4 9 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	1,130,000	1,318,291	2034/06/20
1 6 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	150,000	195,262	2034/09/20
1 5 0 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.4000	1,230,000	1,420,600	2034/09/20
1 7 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.4000	200,000	258,562	2034/12/20
1 5 1 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	1,410,000	1,592,383	2034/12/20
1 8 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.3000	320,000	410,387	2035/03/20
1 5 2 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	1,270,000	1,435,150	2035/03/20
1 9 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.3000	200,000	257,114	2035/06/20
1 5 3 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.3000	1,170,000	1,339,135	2035/06/20
2 0 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	200,000	263,350	2035/09/20
1 5 4 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	1,030,000	1,165,290	2035/09/20
2 1 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.3000	200,000	258,300	2035/12/20
1 5 5 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.0000	1,230,000	1,356,185	2035/12/20
2 2 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	220,000	291,332	2036/03/20
1 5 6 回	利付国庫債券 (2 0 年)	0.4000	940,000	953,564	2036/03/20
2 3 回	利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	200,000	265,498	2036/06/20

銘	柄	当		期		末
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
(国債証券)		%	千円	千円		
157回	利付国庫債券 (20年)	0.2000	1,150,000	1,130,645	2036/06/20	
24回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	190,000	252,825	2036/09/20	
158回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	980,000	1,006,195	2036/09/20	
25回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	260,686	2036/12/20	
159回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,050,000	1,093,501	2036/12/20	
26回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	400,000	528,508	2037/03/20	
160回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	1,080,000	1,140,166	2037/03/20	
161回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,150,000	1,194,424	2037/06/20	
27回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	420,000	564,253	2037/09/20	
162回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	920,000	954,564	2037/09/20	
163回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,070,000	1,109,012	2037/12/20	
28回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	480,000	647,956	2038/03/20	
164回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,160,000	1,182,330	2038/03/20	
165回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	890,000	905,895	2038/06/20	
29回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	560,000	749,616	2038/09/20	
166回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	1,150,000	1,207,684	2038/09/20	
167回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	950,000	963,404	2038/12/20	
30回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	570,000	755,215	2039/03/20	
168回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	850,000	845,716	2039/03/20	
169回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	850,000	829,098	2039/06/20	
31回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	460,000	603,280	2039/09/20	
170回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	820,000	798,212	2039/09/20	
171回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,060,000	1,029,694	2039/12/20	
32回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	610,000	814,807	2040/03/20	
172回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	760,000	751,336	2040/03/20	
173回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,020,000	1,006,444	2040/06/20	
33回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	930,000	1,194,910	2040/09/20	
174回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,100,000	1,084,237	2040/09/20	
175回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	400,000	401,812	2040/12/20	
34回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	920,000	1,221,097	2041/03/20	
35回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,100,000	1,422,652	2041/09/20	
36回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	950,000	1,232,416	2042/03/20	
37回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	990,000	1,267,506	2042/09/20	
38回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	690,000	871,884	2043/03/20	
39回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	610,000	783,972	2043/06/20	
40回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	500,000	633,225	2043/09/20	
41回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	500,000	623,635	2043/12/20	
42回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	810,000	1,011,179	2044/03/20	
43回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	520,000	649,740	2044/06/20	
44回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	590,000	737,848	2044/09/20	
45回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	580,000	700,564	2044/12/20	
46回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	750,000	906,360	2045/03/20	
47回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	710,000	874,720	2045/06/20	
48回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	710,000	842,549	2045/09/20	
49回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	800,000	949,648	2045/12/20	
50回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	610,000	639,389	2046/03/20	
51回	利付国庫債券 (30年)	0.3000	620,000	576,550	2046/06/20	
52回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	680,000	663,442	2046/09/20	
53回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	750,000	748,320	2046/12/20	
54回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	700,000	731,577	2047/03/20	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
55回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	700,000	731,010	2047/06/20
56回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	620,000	646,951	2047/09/20
57回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	690,000	719,407	2047/12/20
58回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	870,000	906,313	2048/03/20
59回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	680,000	691,097	2048/06/20
60回	利付国庫債券 (30年)	0.9000	760,000	809,179	2048/09/20
61回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	660,000	668,566	2048/12/20
2回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	280,000	390,972	2049/03/20
62回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	500,000	480,470	2049/03/20
63回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	570,000	532,072	2049/06/20
64回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	640,000	596,384	2049/09/20
65回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	610,000	567,446	2049/12/20
3回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	290,000	406,925	2050/03/20
66回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	520,000	483,464	2050/03/20
67回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	690,000	676,496	2050/06/20
68回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	710,000	696,005	2050/09/20
69回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	400,000	402,480	2050/12/20
4回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	550,000	776,259	2051/03/20
5回	利付国庫債券 (40年)	2.0000	500,000	683,400	2052/03/20
6回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	570,000	768,348	2053/03/20
7回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	530,000	688,099	2054/03/20
8回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	620,000	753,963	2055/03/20
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,020,000	928,567	2056/03/20
10回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	900,000	960,156	2057/03/20
11回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	750,000	776,655	2058/03/20
12回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	750,000	701,722	2059/03/20
13回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	560,000	523,213	2060/03/20
小 計		—	212,920,000	227,135,859	—
(地方債証券)		%	千円	千円	
23年度20回	愛知県公募公債	1.0820	500,000	505,950	2022/03/29
109回	共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	506,155	2022/04/25
708回	東京都公募公債	0.8900	500,000	505,870	2022/06/20
111回	共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	708,288	2022/06/24
364回	大阪府公募公債	0.7900	300,000	303,675	2022/09/27
194回	神奈川県公募公債	0.7910	300,000	304,290	2022/12/20
24年度7回	千葉県公募公債	0.7400	300,000	304,020	2022/12/22
119回	共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	507,945	2023/02/24
121回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	506,070	2023/04/25
25年度4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	305,760	2023/05/30
720回	東京都公募公債	0.8700	300,000	306,006	2023/06/20
25年度4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	203,676	2023/06/20
25年度2回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	408,404	2023/07/14
374回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	306,657	2023/07/28
25年度5回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	204,162	2023/08/25
128回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	305,367	2023/11/24
726回	東京都公募公債	0.7300	400,000	408,140	2023/12/20
25年度11回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	204,114	2024/02/26
208回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	305,370	2024/06/20
1回	兵庫県公募公債 (12年)	1.1000	300,000	310,767	2024/06/26
26年度5回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	408,188	2024/07/29

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
488回 名古屋市公債券 10年	0.5980	450,000	459,342	2024/09/20
26年度11回 京都府公債券	0.4760	350,000	356,125	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	506,395	2025/01/24
26年度17回 兵庫県公債券	0.4600	200,000	203,420	2025/02/26
5回 東京都公債券 20年	2.1100	100,000	108,538	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	407,380	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	409,088	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	511,810	2025/07/25
1回 静岡県公債券 20年	2.1800	100,000	109,907	2025/09/19
9回 東京都公債券 20年	2.4400	200,000	225,162	2026/06/19
10回 東京都公債券 20年	2.3300	300,000	337,659	2026/09/18
4回 京都市公債券 20年	2.5100	100,000	113,555	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	503,105	2027/01/25
29年度4回 大阪市公債券	0.1500	200,000	200,720	2027/09/21
29年度6回 広島市公債券	0.2300	300,000	302,616	2028/02/25
5回 兵庫県公債券 15年	1.3100	300,000	325,755	2028/05/26
30年度7回 神戸市公債券 30年	0.2540	300,000	302,910	2028/09/20
第91回 川崎市公債券	0.1850	200,000	200,902	2028/09/20
7回 静岡県公債券 20年	2.3200	300,000	349,713	2028/09/21
30年度14回 北海道公債券	0.1950	300,000	301,023	2028/12/28
30年度19回 愛知県公債券	0.1150	200,000	199,584	2029/03/28
802回 東京都公債券	0.1300	400,000	398,920	2030/03/19
8回 静岡県公債券 15年	0.8280	200,000	212,062	2030/06/07
36回2号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	249,280	2030/10/28
19回 神奈川県公債券 20年	1.8180	100,000	117,027	2032/01/30
24年度2回 福岡県公債券 (20年)	1.6350	300,000	346,629	2032/08/16
10回 大阪府公債券 20年	1.7200	200,000	233,022	2032/09/24
14回 千葉県公債券 20年	1.1370	100,000	110,202	2033/04/15
14回 埼玉県公債券 20年	1.5460	300,000	347,556	2034/05/08
17回 北九州市公債券 20年	1.5290	100,000	115,540	2034/06/20
2回 横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	129,352	2035/03/20
18回 千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	110,769	2035/04/13
14回 大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	101,754	2036/09/29
30年度7回 福岡市公債券	0.7010	200,000	207,200	2038/10/19
27年度8回 愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	180,630	2045/06/20
27年度2回 広島県公債券 30年	0.7110	100,000	100,534	2046/03/22
小 計	—	16,600,000	17,224,060	—
(特殊債券)	%	千円	千円	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	303,435	2022/05/20
96回 高速道路路機構債	0.7960	700,000	708,715	2022/09/20
44回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	406,508	2023/01/20
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	508,535	2023/03/20
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	505,830	2023/04/28
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	510,330	2023/06/30
50回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	510,845	2023/07/14
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	337,296	2023/07/31
116回 高速道路路機構債	0.7220	100,000	101,807	2023/09/20
56回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	553,696	2024/01/19
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	305,619	2024/09/13
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	508,850	2025/03/31

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
85回 中日本高速道路債	0.0700	300,000	299,988	2025/10/21
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	400,100	2026/04/28
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	201,450	2027/04/13
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	804,584	2027/04/30
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,936	2027/06/18
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,809	2027/11/19
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	302,601	2028/02/18
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	216,500	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	229,678	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	200,000	234,800	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	353,061	2029/08/28
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	233,760	2029/09/20
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	213,174	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	232,584	2030/10/29
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	580,090	2030/10/31
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	415,009	2031/06/13
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	233,608	2031/12/26
13回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	9,602	9,625	2032/05/10
14回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	48,380	48,479	2032/05/10
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	116,203	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	231,992	2032/09/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	524,544	2033/12/20
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	334,509	2035/02/28
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	224,840	2035/06/28
172回 高速道路路機構債	0.2880	200,000	195,472	2036/06/20
6回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	33,729	34,375	2037/05/10
8回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	23,700	24,300	2037/05/10
9回貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	35,535	36,439	2037/05/10
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	206,776	2037/07/31
26回 高速道路路機構債	2.6700	200,000	269,850	2037/09/18
2回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	37,851	39,092	2037/11/10
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	12,520	12,966	2041/06/10
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,532	49,903	2041/07/10
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	36,441	37,518	2042/02/10
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	59,815	61,473	2042/05/10
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	126,650	135,786	2044/10/10
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	201,216	212,960	2045/05/10
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	232,750	2045/10/31
169回 高速道路路機構債	1.2000	100,000	109,874	2045/12/20
19回 高速道路路機構債	2.7500	150,000	219,892	2047/03/20
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	97,973	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	100,000	98,305	2050/06/20
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	243,543	244,073	2051/11/10
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	256,239	258,150	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	256,635	258,377	2053/01/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,603	262,976	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,339	262,708	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	269,649	272,447	2053/10/10
小 計	—	14,894,979	15,838,836	—

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,245	2024/05/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	400,076	2025/08/27
小 計	—	500,000	500,321	—
(普通社債券)	%	千円	千円	
13回 パナソニック社債	0.5680	100,000	100,504	2022/03/18
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	204,970	2022/03/25
45回 住友商事社債	1.1170	100,000	101,167	2022/04/20
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,933	2022/05/23
1回 BPCE S&A円債(ソーシャルボンド)	0.2140	200,000	200,026	2022/06/30
21回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	103,163	2022/09/20
94回 丸紅社債	1.1700	100,000	101,679	2022/10/12
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	207,266	2022/10/27
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	100,632	2022/12/02
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	306,135	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	102,634	2022/12/20
518回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,522	2023/01/25
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	203,664	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	101,449	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	203,150	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	102,272	2023/03/24
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	306,687	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	101,833	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	204,340	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	102,389	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	410,484	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	315,429	2023/09/20
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,394	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,811	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	206,326	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	211,196	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	307,551	2023/12/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	412,360	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	411,680	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	203,324	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	106,595	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	107,569	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	203,108	2024/10/28
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	204,512	2024/11/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,607	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	325,155	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	216,228	2025/06/20
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	218,268	2025/09/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	134,320	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	104,642	2026/06/25
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	302,778	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	202,562	2027/02/16
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	303,708	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	304,260	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,200	2027/05/07
56回 三菱UFJリソース社債	0.4550	200,000	202,036	2028/01/18
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	202,072	2028/06/06
14回 プリズストン社債	0.3750	200,000	200,284	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	107,232	2029/04/27
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	200,000	201,788	2030/09/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	235,190	2030/12/20
350回 北海道電力社債	0.7540	200,000	202,868	2038/03/25
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	99,910	2038/07/12
71回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	98,726	2059/12/24
47回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	97,235	2060/09/17
小 計	—	10,281,000	10,583,824	—
合 計	—	255,195,979	271,282,901	—

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 271,282,901	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,188,062	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	273,470,964	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目		当 期 末
(A) 資 産	産 等	273,470,964,587円
コ ー ル ・ 公 司 債 等	債(評価額)	1,577,987,460
未 収 社 債(評価額)	利 息	271,282,901,629
前 払 費 用	債 金	528,367,341
(B) 負 未 払 解 約 債 金		81,708,157
(C) 純 資 産 総 額(A - B)		124,841,000
元 次 期 繰 越 損 益 本 金		124,841,000
(D) 受 益 権 総 口 数		273,346,123,587
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)		209,919,027,595
		63,427,095,992
		209,919,027,595円
		13,022円

(注1) 期首元本額 168,870,516,479円
追加設定元本額 167,666,444,476円
一部解約元本額 126,617,933,360円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M国内債券パッシブ・ファンド	20,138,397,472円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	75,739,659円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	64,284,684円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	13,922,204円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	698,579,753円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	175,024,830円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,170,668円
たわらノーロード 国内債券	13,371,410,550円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,375,425,101円
たわらノーロード バランス(堅実型)	479,364,723円
たわらノーロード バランス(標準型)	771,140,997円
たわらノーロード バランス(積極型)	94,268,225円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	35,956,909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)	841,677,984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)	857,299,721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)	267,544,001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)	94,593,242円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	11,595,925円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,216,822円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	15,550,209円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,935,187円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,527,471円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,617,188,939円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	7,945,845,516円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	10,564,168,081円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,214,698,647円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,934,636,468円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,100,996,248円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	317,515,894円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	69,643,768円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	2,183,121,770円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,343,546円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,834,269,246円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,215,297,756円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	244,940,249円
投資のソムリエ	19,968,780,596円
クルーズコントロール	1,710,359,908円
投資のソムリエ<DC年金>	1,200,230,759円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,601,786,821円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	458,001,465円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	6,432,489円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	14,490,817円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,572,825,479円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	28,534,806,570円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,124,286円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,164,986円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	25,891,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	37,090,342円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	588,184,487円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,654,944,013円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,553,714,682円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	8,354,710円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,154,214円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,151,302円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	10,186,401円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,324,203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)	18,427,003円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,519,942,923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)	9,097,902円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,795,147,063円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,101,630,563円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	308,141,870円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI(適格機関投資家限定)	5,804,574,674円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	5,780,092,239円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	5,759,938,173円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV(適格機関投資家限定)	5,767,537,679円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	2,207,986円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	194,833,349円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	115,400,455円
D I A M国際分散バランスファンド30VA	41,774,211円
D I A M国際分散バランスファンド50VA	118,714,473円
D I A M国内重視バランスファンド30VA	47,275,935円
D I A M国内重視バランスファンド50VA	10,741,315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)	63,831,542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)	147,396,923円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,113,378,518円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,455,390,819円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,620,892,716円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	512,197,093円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	209,605,289円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA	2,518,908,521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)	229,060,580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)	10,843,033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)	2,800,949,726円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	54,001,054円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	448,922,701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)	713,955,739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)	1,210,800,648円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	338,532,229円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	106,770,675円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI(適格機関投資家限定)	928,960,030円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	382,409,178円
期末元本合計	209,919,027,595円

■損益の状況

当期 自2020年2月15日 至2021年2月15日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	1,854,548,870円
	受		取	利 息	1,855,446,015
	支		払	利 息	△897,145
(B)	有 価 証 券	売 買	損 益		△5,046,081,656
	売	買	益		53,162,300
	売	買	損		△5,099,243,956
(C)	当 期	損 益	金(A + B)		△3,191,532,786
(D)	前 期	繰 越	損 益 金		53,988,844,136
(E)	解 約	差 損 益 金			△39,191,042,382
(F)	追 加	信 託 差 損 益 金			51,820,827,024
(G)	合 計(C + D + E + F)				63,427,095,992
	次 期	繰 越	損 益 金(G)		63,427,095,992

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月10日から無期限です。
運 用 方 針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「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）」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		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)		債券組入率 比	債券先物率 比	純 資 産 額 総
	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率			
14期 (2017年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期 (2018年2月21日)	17,364	△2.9	108,792.68	△2.7	97.9	—	248,485
16期 (2019年2月21日)	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	—	217,863
17期 (2020年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	—	197,670
18期 (2021年2月22日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	—	130,803
	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—	137,037

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークは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）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) F T S E 世界国債インデックスは、F T S E F i x e d I n c o m e L L Cにより運営されている債券インデックスです。F T S E F i x e d I n c o m e L L Cは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、F T S E F i x e d I n c o m e L L C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F T S E F i x e d I n c o m e L L Cに帰属します（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

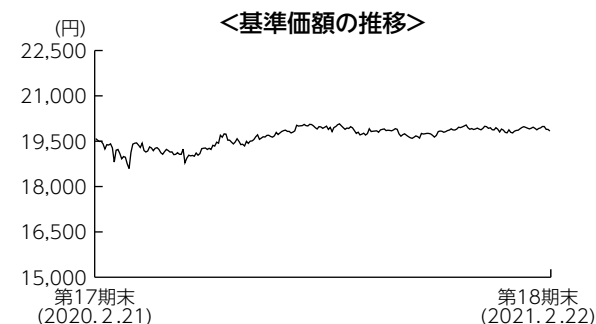
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除 く 日 本 、 円 ベ ー ス 、 為 替 ヘ ッ ジ な し) (ベ ン チ マ ー ク)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 21 日	円 19,586	% —	ポイント 122,662.63	% —	% 97.8	% —
2 月 末	19,413	△0.9	121,401.29	△1.0	97.3	—
3 月 末	19,435	△0.8	121,796.59	△0.7	97.4	—
4 月 末	19,066	△2.7	119,329.72	△2.7	96.1	—
5 月 末	19,338	△1.3	120,973.12	△1.4	97.3	—
6 月 末	19,646	0.3	123,063.01	0.3	98.4	—
7 月 末	19,841	1.3	123,870.50	1.0	99.0	—
8 月 末	19,819	1.2	124,064.52	1.1	99.4	—
9 月 末	19,912	1.7	124,690.18	1.7	97.8	—
10 月 末	19,615	0.1	122,727.67	0.1	98.2	—
11 月 末	19,817	1.2	124,001.42	1.1	99.1	—
12 月 末	19,982	2.0	125,045.38	1.9	98.6	—
2021 年 1 月 末	19,954	1.9	125,100.34	2.0	98.6	—
(期 末) 2021 年 2 月 22 日	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月22日から2021年2月22日まで）

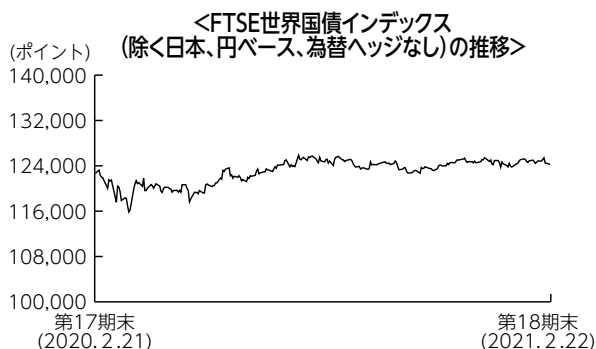


基準価額の推移

当期末の基準価額は19,836円となり、前期末比で1.3%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

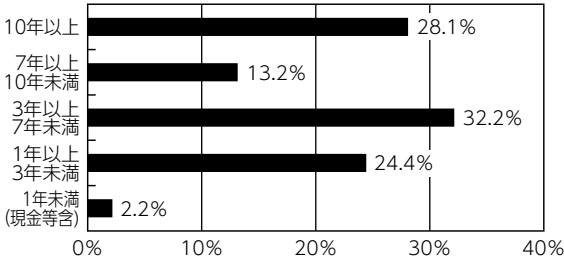
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

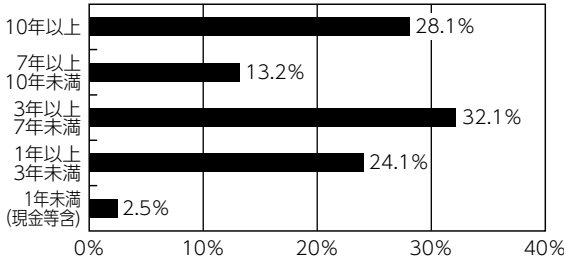
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) そ の 他 費 用	2円	0.012%
（保 管 費 用）	(2)	(0.011)
（そ の 他）	(0)	(0.001)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（19,648円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については8 ページ（1 万口当たりの費用明細）をご参照ください。

■売買及び取引の状況 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)
公社債

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

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

銘	柄	当			期		末																		
		種	類	利	率	額	面	金	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月	日
(アメリカ)		国	債	証	券	%	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	ア	メ	リ	カ	・	ド	ル	千	円	
US T N/B 0.25 09/30/25		国	債	証	券	0.2500	3,000	2,963	312,617	2025/09/30															
US T N/B 3.0 10/31/25		国	債	証	券	3.0000	1,920	2,138	225,648	2025/10/31															
US T N/B 1.625 10/31/23		国	債	証	券	1.6250	4,000	4,156	438,484	2023/10/31															
US T N/B 2.875 10/31/23		国	債	証	券	2.8750	3,690	3,957	417,549	2023/10/31															
US T N/B 1.625 10/31/26		国	債	証	券	1.6250	2,350	2,467	260,301	2026/10/31															
US T N/B 1.5 10/31/24		国	債	証	券	1.5000	2,200	2,294	242,054	2024/10/31															
US T N/B 0.5 10/31/27		国	債	証	券	0.5000	3,000	2,915	307,548	2027/10/31															
US T N/B 0.25 10/31/25		国	債	証	券	0.2500	2,000	1,973	208,164	2025/10/31															
US T N/B 5.25 11/15/28		国	債	証	券	5.2500	850	1,115	117,656	2028/11/15															
US T N/B 6.125 11/15/27		国	債	証	券	6.1250	900	1,208	127,522	2027/11/15															
US T N/B 3.0 11/15/44		国	債	証	券	3.0000	1,790	2,109	222,586	2044/11/15															
US T N/B 4.25 11/15/40		国	債	証	券	4.2500	510	709	74,894	2040/11/15															
US T N/B 2.75 11/15/42		国	債	証	券	2.7500	1,220	1,382	145,894	2042/11/15															
US T N/B 3.125 11/15/41		国	債	証	券	3.1250	760	913	96,410	2041/11/15															
US T N/B 3.75 11/15/43		国	債	証	券	3.7500	1,360	1,794	189,270	2043/11/15															
US T N/B 2.75 11/15/47		国	債	証	券	2.7500	2,140	2,424	255,755	2047/11/15															
US T N/B 1.625 11/15/50		国	債	証	券	1.6250	2,900	2,569	271,052	2050/11/15															
US T N/B 3.0 11/15/45		国	債	証	券	3.0000	1,240	1,464	154,500	2045/11/15															
US T N/B 2.875 11/15/46		国	債	証	券	2.8750	2,020	2,336	246,475	2046/11/15															
US T N/B 2.25 11/15/24		国	債	証	券	2.2500	4,690	5,023	529,933	2024/11/15															
US T N/B 4.375 11/15/39		国	債	証	券	4.3750	910	1,277	134,819	2039/11/15															
US T N/B 3.375 11/15/48		国	債	証	券	3.3750	2,660	3,377	356,378	2048/11/15															
US T N/B 2.375 11/15/49		国	債	証	券	2.3750	2,770	2,922	308,330	2049/11/15															
US T N/B 2.25 11/15/25		国	債	証	券	2.2500	5,190	5,609	591,776	2025/11/15															
US T N/B 3.125 11/15/28		国	債	証	券	3.1250	4,840	5,575	588,210	2028/11/15															
US T N/B 1.625 11/15/22		国	債	証	券	1.6250	5,620	5,766	608,404	2022/11/15															
US T N/B 2.75 11/15/23		国	債	証	券	2.7500	5,520	5,907	623,261	2023/11/15															
US T N/B 2.0 11/15/26		国	債	証	券	2.0000	2,640	2,826	298,190	2026/11/15															
US T N/B 2.0 11/30/22		国	債	証	券	2.0000	6,590	6,810	718,492	2022/11/30															
US T N/B 2.25 11/15/27		国	債	証	券	2.2500	3,270	3,555	375,063	2027/11/15															
US T N/B 2.125 11/30/23		国	債	証	券	2.1250	2,000	2,107	222,390	2023/11/30															
US T N/B 1.375 11/15/40		国	債	証	券	1.3750	2,300	2,073	218,764	2040/11/15															
US T N/B 1.625 11/30/26		国	債	証	券	1.6250	1,020	1,070	112,898	2026/11/30															
US T N/B 1.75 11/15/29		国	債	証	券	1.7500	1,940	2,029	214,088	2029/11/15															
US T N/B 0.875 11/15/30		国	債	証	券	0.8750	6,400	6,137	647,506	2030/11/15															
US T N/B 0.25 11/15/23		国	債	証	券	0.2500	6,000	6,011	634,211	2023/11/15															
US T N/B 0.125 11/30/22		国	債	証	券	0.1250	5,340	5,341	563,524	2022/11/30															
US T N/B 0.625 11/30/27		国	債	証	券	0.6250	2,000	1,957	206,532	2027/11/30															
US T N/B 1.5 11/30/24		国	債	証	券	1.5000	2,000	2,086	220,099	2024/11/30															
US T N/B 0.375 11/30/25		国	債	証	券	0.3750	2,590	2,567	270,875	2025/11/30															
US T N/B 2.625 12/31/23		国	債	証	券	2.6250	3,060	3,272	345,226	2023/12/31															
US T N/B 2.625 12/31/25		国	債	証	券	2.6250	2,290	2,515	265,433	2025/12/31															
US T N/B 2.25 12/31/24		国	債	証	券	2.2500	3,000	3,216	339,322	2024/12/31															
US T N/B 2.125 12/31/22		国	債	証	券	2.1250	5,520	5,726	604,107	2022/12/31															
US T N/B 1.75 12/31/26		国	債	証	券	1.7500	740	781	82,498	2026/12/31															
US T N/B 0.125 12/15/23		国	債	証	券	0.1250	1,000	998	105,314	2023/12/15															
US T N/B 1.75 12/31/24		国	債	証	券	1.7500	1,600	1,684	177,754	2024/12/31															
US T N/B 0.375 12/31/25		国	債	証	券	0.3750	1,000	990	104,502	2025/12/31															
US T N/B 0.625 12/31/27		国	債	証	券	0.6250	1,000	977	103,142	2027/12/31															
小	計	—	—	—	—	519,140	550,714	58,100,386	—																
(カナダ)		国	債	証	券	%	千	カ	ナ	ダ	・	ド	ル	千	カ	ナ	ダ	・	ド	ル	千	円			
CANADA 2.25 03/01/24		国	債	証	券	2.2500	530	560	46,922	2024/03/01															

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

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

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

銘	柄	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	
(スウェーデン)				%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39		国	債 証 券	3.5000	3,270	4,838	61,740	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28		国	債 証 券	0.7500	1,540	1,613	20,589	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25		国	債 証 券	2.5000	6,180	6,890	87,926	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31		国	債 証 券	0.1250	2,200	2,155	27,505	2031/05/12
SWEDEN 3.5 06/01/22		国	債 証 券	3.5000	3,000	3,146	40,153	2022/06/01
SWEDEN 1.5 11/13/23		国	債 証 券	1.5000	8,200	8,604	109,789	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26		国	債 証 券	1.0000	4,250	4,506	57,505	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29		国	債 証 券	0.7500	1,970	2,062	26,313	2029/11/12
小	計	—		—	30,610	33,818	431,523	—
(メキシコ)				%	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	14,859	15,407	79,350	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/09/23		国	債 証 券	6.7500	20,000	21,027	108,292	2023/03/09
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29		国	債 証 券	8.5000	17,109	20,314	104,618	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31		国	債 証 券	7.7500	10,000	11,329	58,346	2031/05/29
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27		国	債 証 券	7.5000	18,071	20,262	104,352	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22		国	債 証 券	6.5000	7,830	8,066	41,542	2022/06/09
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24		国	債 証 券	8.0000	10,000	11,134	57,343	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42		国	債 証 券	7.7500	13,643	14,895	76,713	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47		国	債 証 券	8.0000	9,254	10,313	53,112	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38		国	債 証 券	8.5000	8,125	9,596	49,422	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36		国	債 証 券	10.0000	8,085	10,834	55,799	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34		国	債 証 券	7.7500	7,000	7,917	40,776	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24		国	債 証 券	10.0000	22,596	26,847	138,264	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23		国	債 証 券	8.0000	14,000	15,372	79,167	2023/12/07
小	計	—		—	180,572	203,320	1,047,101	—
(マレーシア)				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27		国	債 証 券	3.8920	800	858	22,423	2027/03/15
MALAYSIA 3.48 03/15/23		国	債 証 券	3.4800	1,220	1,258	32,867	2023/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国	債 証 券	4.3920	3,070	3,362	87,826	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国	債 証 券	4.4980	1,800	2,008	52,448	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国	債 証 券	3.8440	1,210	1,234	32,232	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国	債 証 券	4.7620	1,200	1,349	35,236	2037/04/07
MALAYSIA 3.733 06/15/28		国	債 証 券	3.7330	2,000	2,133	55,725	2028/06/15
MALAYSIA 4.181 07/15/24		国	債 証 券	4.1810	2,430	2,595	67,806	2024/07/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48		国	債 証 券	4.9210	2,600	2,934	76,659	2048/07/06
MALAYSIA 3.828 07/05/34		国	債 証 券	3.8280	600	605	15,815	2034/07/05
MALAYSIA 3.418 08/15/22		国	債 証 券	3.4180	3,000	3,067	80,122	2022/08/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43		国	債 証 券	4.9350	2,000	2,286	59,713	2043/09/30
小	計	—		—	21,930	23,693	618,878	—
(ポーランド)				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23		国	債 証 券	2.5000	2,850	2,981	85,062	2023/01/25
POLAND 5.75 04/25/29		国	債 証 券	5.7500	1,440	1,968	56,166	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28		国	債 証 券	2.7500	3,010	3,373	96,231	2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22		国	債 証 券	2.2500	1,500	1,539	43,927	2022/04/25
POLAND 2.5 04/25/24		国	債 証 券	2.5000	2,290	2,447	69,821	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26		国	債 証 券	2.5000	2,080	2,277	64,976	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25		国	債 証 券	3.2500	2,380	2,662	75,948	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27		国	債 証 券	2.5000	2,280	2,511	71,645	2027/07/25
POLAND 07/25/22		国	債 証 券	—	1,200	1,199	34,226	2022/07/25
POLAND 5.75 09/23/22		国	債 証 券	5.7500	1,720	1,876	53,528	2022/09/23
POLAND 4.0 10/25/23		国	債 証 券	4.0000	3,940	4,340	123,836	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29		国	債 証 券	2.7500	210	236	6,758	2029/10/25

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

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

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

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2021年 2月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	134,816,915	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,110,505	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	137,927,421	100.0

- (注 1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第 2 位を四捨五入しています。
- (注 2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、136,245,185千円、98.8%です。
- (注 3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年 2月22日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝105.50円、1 カナダ・ドル＝83.72円、1 オーストラリア・ドル＝83.19円、1 シンガポール・ドル＝79.75円、1 イギリス・ポンド＝147.98円、1 イスラエル・シェケル＝32.23円、1 デンマーク・クローネ＝17.20円、1 ノルウェー・クローネ＝12.49円、1 スウェーデン・クローナ＝12.76円、1 メキシコ・ペソ＝5.15円、1 マレーシア・リンギット＝26.12円、1 ポーランド・ズロチ＝28.53円、1 ユーロ＝127.91円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

D I AM外国債券パッシブ・ファンド	7,285,630,090円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,005,013円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	17,901,375円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,109,682円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	58,667,541円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,579,939円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,987,271円
たわらノーロード 先進国債券	9,989,838,812円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,647,242円
たわらノーロード バランス (8資産向け等型)	971,663,519円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,728,812円
たわらノーロード バランス (標準型)	121,338,758円
たわらノーロード バランス (積極型)	25,135,439円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	4,073,309円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	220,889,452円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	214,665,752円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	46,211,416円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	275,405円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,559,857円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,960,740円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,185,878円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,140,370円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,996,521,601円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	286,853,098円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	632,089,833円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,993,683,959円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	361,021,755円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	767,057,750円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	628,680,822円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	16,652,719円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	516,637,062円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,446,399円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	125,346,778円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	95,961,436円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	160,485,652円

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

■損益の状況

当期 自2020年2月22日 至2021年2月22日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	2,666,161,128円
	受		取	利 息	2,666,403,831
	支		払	利 息	△242,703
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益				△1,147,059,846
	売		買	益	6,089,848,393
	売		買	損	△7,236,908,239
(C)	そ の 他 の 費 用				△15,375,562
(D)	当 期 損 益 金(A + B + C)				1,503,725,720
(E)	前 期 繰 越 損 益 金				64,019,323,522
(F)	解 約 差 損 益 金				△19,145,002,454
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金				21,574,218,073
(H)	合 計(D + E + F + G)				67,952,264,861
	次 期 繰 越 損 益 金(H)				67,952,264,861

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2021年6月7日）

（計算期間 2020年6月9日～2021年6月7日）

J－R E I Tインデックスファンド・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	2006年8月4日から無期限です。
運 用 方 針	東証R E I T指数（配当込み）の動き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	東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている（または採用予定の）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	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 先 物 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 率	(配当込み) ベンチマーク	期 中 騰 落 率			
11期（2017年6月6日）	17,626	△3.6	ポイント	%	%	%	百万円
12期（2018年6月6日）	18,181	3.1	3,285.51	△3.8	98.3	1.5	29,280
13期（2019年6月6日）	20,819	14.5	3,386.35	3.1	97.8	1.7	35,462
14期（2020年6月8日）	19,706	△5.3	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154
15期（2021年6月7日）	24,869	26.2	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
			4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531

（注1）不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）東証R E I T指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証R E I T指数の商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません（以下同じ）。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

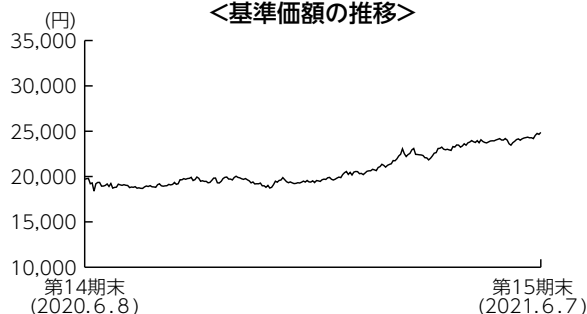
年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (配当込み) (ベンチマーク)		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020 年 6 月 8 日	円	%	ポイント	%	%	%
	19,706	—	3,696.98	—	97.4	2.2
6 月 末	18,802	△4.6	3,525.99	△4.6	97.4	2.1
7 月 末	18,855	△4.3	3,535.10	△4.4	97.8	2.0
8 月 末	19,918	1.1	3,735.15	1.0	97.5	2.2
9 月 末	19,726	0.1	3,698.94	0.1	97.4	2.3
10 月 末	18,737	△4.9	3,512.43	△5.0	96.9	2.6
11 月 末	19,393	△1.6	3,635.82	△1.7	97.6	2.1
12 月 末	20,558	4.3	3,854.76	4.3	97.5	2.2
2021 年 1 月 末	21,354	8.4	4,004.00	8.3	97.3	2.5
2 月 末	22,451	13.9	4,207.24	13.8	97.4	2.4
3 月 末	23,468	19.1	4,399.26	19.0	97.8	2.2
4 月 末	24,106	22.3	4,518.99	22.2	97.6	2.2
5 月 末	24,284	23.2	4,551.00	23.1	97.7	2.2
(期 末) 2021 年 6 月 7 日	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年6月9日から2021年6月7日まで）

＜基準価額の推移＞



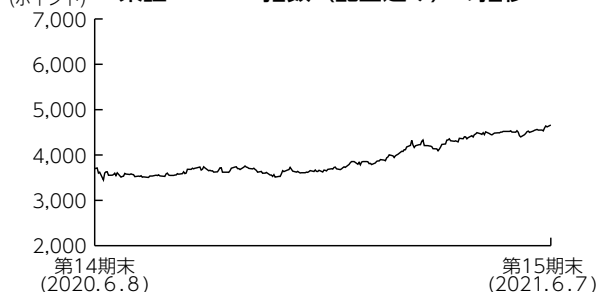
基準価額の推移

当期末の基準価額は24,869円となり、前期末比で26.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種進展を背景に景気回復期待が高まり、東証REIT指数（配当込み）が上昇したことにより当ファンドの基準価額も上昇しました。

＜東証REIT指数（配当込み）の推移＞



投資環境

リート市場は上昇しました。期の前半は新型コロナウイルスのワクチンへの期待などがプラス要因となる一方、相次ぐ公募増資の発表による需給悪化懸念や不動産市況の先行き不透明感などがマイナス要因となり、方向感の定まらない展開となりました。後半に入ると、決算でリート各社の底堅い業績が確認できたことや、欧米でのワクチン接種進展を背景とした景気回復期待などにより上昇基調となりました。

ポートフォリオについて

リーートの組入比率を高め、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）との連動性を保つように努めました。また、ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持しました。

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26.1%上昇しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

引き続き、リーートの組入比率を高め、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。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマーク指数と同等のリスク特性を維持するよう努めます。

■ 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 (先物・オプション) (投 資 証 券)	0円 (0) (0)	0.001% (0.001) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は20,817円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2020年6月9日から2021年6月7日まで)

(1) 投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
		千口		千円		千口		千円
国内		1.82		218,315		1.136		135,907
エスコンジャパンリート投資法人		(-)		(-)		(-)		(-)
サンケイリアルエステート投資法人		2.886		305,490		1.695		183,412
		(-)		(-)		(-)		(-)
S O S I L A 物流リート投資法人		2.753		373,847		1.774		240,901
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本アコモデーションファンド投資法人		3.49		2,140,566		2.389		1,446,998
		(-)		(-)		(-)		(-)
MCUB S M i d C i t y 投資法人		5.636		468,036		3.093		246,384
		(△8.322)		(-)		(-)		(-)
森ヒルズリート投資法人		11.894		1,743,930		8.222		1,201,899
		(-)		(-)		(-)		(-)
産業ファンド投資法人		14.707		2,747,827		9.853		1,812,555
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・レジデンス投資法人		9.543		3,125,584		6.655		2,152,600
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6.91		1,373,500		4.712		933,600
		(-)		(-)		(-)		(-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人		5.033		2,264,531		3.513		1,589,952
		(-)		(-)		(-)		(-)
G L P 投資法人		33.669		5,724,570		21.333		3,586,817
		(-)		(-)		(-)		(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		4.539		1,456,560		3.111		995,139
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プロロジスリート投資法人		15.987		5,391,422		10.848		3,594,072
		(-)		(-)		(-)		(-)
星野リゾート・リート投資法人		1.53		869,077		1.068		617,126
		(-)		(-)		(-)		(-)
O n e リート投資法人		1.566		434,147		1.093		302,741
		(-)		(-)		(-)		(-)
イオンリート投資法人		10.226		1,403,055		7.442		1,014,535
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヒューリックリート投資法人		8.359		1,337,119		5.941		943,979
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本リート投資法人		3.262		1,269,238		2.277		885,386
		(-)		(-)		(-)		(-)
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		64.327		1,082,559		45.364		788,947
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
		千□		千円		千□		千円
積水ハウス・リート投資法人		29.611		2,437,169		20.611		1,705,857
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		2.239		271,609		1.551		190,597
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		4.005		1,002,333		2.747		684,561
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		2.14		283,886		1.493		196,044
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		1.937		214,479		1.388		151,558
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		32.49		5,089,564		22.656		3,535,315
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		1.794		141,849		1.222		97,152
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		12.747		2,159,771		7.817		1,285,247
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		9.881		523,026		7.20962		372,541
		(3.57862)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		0.949		113,528		0.687		80,765
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		3.731		1,956,437		2.382		1,226,096
		(-)		(-)		(-)		(-)
大江戸温泉リート投資法人		1.63		123,759		1.178		88,073
		(-)		(-)		(-)		(-)
さくら総合リート投資法人		0.138		11,229		0.034		2,784
		(△1.079)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		10.885		474,241		7.866		341,145
		(-)		(-)		(-)		(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人		2.19		270,580		1.615		195,818
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		2.694		1,151,341		1.685		709,152
		(-)		(-)		(-)		(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人		3.686		592,672		2.121		340,241
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.569		162,140		1.068		110,920
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		3.093		316,023		2.106		217,645
		(-)		(-)		(-)		(-)
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		4.567		640,817		2.58		346,412
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		11.804		7,539,423		7.683		4,939,198
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		10.044		6,232,251		7.01		4,346,223
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		35.84		4,369,477		27.908		3,212,119
		(21.1)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		20.015		3,524,671		13.971		2,446,975
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		6.278		2,323,472		4.545		1,692,549
		(-)		(-)		(-)		(-)
N T T 都市開発リート投資法人		9.076		1,264,853		6.336		894,848
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		6.732		1,137,484		4.698		796,055
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		6.971		789,624		4.865		549,607
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	21.551 (-)	3,032,504 (-)	15.544 (-)	2,192,163 (-)
森トラスト総合リート投資法人	7.179 (-)	1,037,538 (-)	5.011 (-)	726,138 (-)
インヴィンシブル投資法人	42.132 (-)	1,610,132 (-)	30.371 (-)	1,162,356 (-)
フロンティア不動産投資法人	3.342 (-)	1,434,764 (-)	2.441 (-)	1,045,298 (-)
平和不動産リート投資法人	6.408 (-)	905,417 (-)	4.342 (-)	617,749 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	6.561 (-)	2,007,386 (-)	4.579 (-)	1,378,720 (-)
福岡リート投資法人	5.193 (-)	821,047 (-)	3.624 (-)	574,815 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	3.103 (-)	2,220,907 (-)	2.164 (-)	1,551,811 (-)
いちごオフィスリート投資法人	8.572 (-)	711,475 (-)	5.884 (-)	497,940 (-)
大和証券オフィス投資法人	2.151 (-)	1,498,257 (-)	1.585 (-)	1,099,311 (-)
阪急阪神リート投資法人	4.538 (-)	630,874 (-)	3.167 (-)	442,528 (-)
スターツプロシード投資法人	1.562 (-)	331,889 (-)	1.089 (-)	231,105 (-)
大和ハウスリート投資法人	14.329 (-)	3,991,529 (-)	10.001 (-)	2,784,523 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	32.359 (-)	1,894,989 (-)	22.586 (-)	1,341,805 (-)
大和証券リビング投資法人	13.398 (-)	1,410,087 (-)	9.0687 (-)	959,763 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	9.33 (-)	1,263,813 (-)	6.502 (-)	878,524 (-)

(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。

(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	不動産投信指数先物取引	百万円 6,166	百万円 5,456	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2020年6月9日から2021年6月7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
投 資 証 券	百万円 103,649	百万円 748	% 0.7	百万円 70,913	百万円 7	% 0.0

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 3,000

(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)	771千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1千円
(B)／(A)	0.2%

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期			末
		□ 数	□ 数	評 価	額	比 率
不動産ファンド		千□	千□	千円		%
エスコンジャパンリート投資法人		0.548	1.232	167,428		0.2
サンケイリアルエステート投資法人		0.653	1.844	235,294		0.3
S O S I L A 物流リート投資法人		1.003	1.982	289,768		0.3
日本アコモデーションファンド投資法人		1.497	2.598	1,680,906		1.9
MCUBS MidCity 投資法人		5.779	—	—		—
森ヒルズリート投資法人		5.182	8.854	1,439,660		1.6
産業ファンド投資法人		5.801	10.655	2,109,690		2.4
アドバンス・レジデンス投資法人		4.272	7.16	2,595,500		2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		2.939	5.137	1,188,701		1.3
アクティビア・プロパティーズ投資法人		2.257	3.777	1,903,608		2.2
GLP 投資法人		11.218	23.554	4,404,598		5.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		1.961	3.389	1,192,928		1.3
日本フロロジスリート投資法人		6.778	11.917	4,093,489		4.6
星野リゾート・リート投資法人		0.685	1.147	754,726		0.9
One リート投資法人		0.702	1.175	371,887		0.4
イオンリート投資法人		4.861	7.645	1,194,913		1.3
ヒューリックリート投資法人		3.831	6.249	1,144,191		1.3
日本リート投資法人		1.463	2.448	1,113,840		1.3
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		28.937	47.9	1,082,540		1.2
積水ハウス・リート投資法人		13.17	22.17	2,030,772		2.3
トーセイ・リート投資法人		0.98	1.668	230,851		0.3
ケネディクス商業リート投資法人		1.74	2.998	877,514		1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		0.961	1.608	229,300		0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		0.902	1.451	178,908		0.2
野村不動産マスターファンド投資法人		14.541	24.375	4,463,062		5.0
いちごホテルリート投資法人		0.746	1.318	124,155		0.1
ラサールロジポート投資法人		4.188	9.118	1,629,386		1.8
スターアジア不動産投資法人		1.495	7.745	470,121		0.5
マリモ地方創生リート投資法人		0.444	0.706	97,710		0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		1.282	2.631	1,507,563		1.7
大江戸温泉リート投資法人		0.765	1.217	101,619		0.1
さくら総合リート投資法人		0.975	—	—		—
投資法人みらい		5.122	8.141	418,447		0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		1.057	1.632	228,153		0.3
三菱地所物流リート投資法人		0.887	1.896	892,068		1.0
C R E ロジスティクスファンド投資法人		0.847	2.412	440,672		0.5
ザイマックス・リート投資法人		0.654	1.155	142,642		0.2

銘柄		期首(前期末)	当期			末
		□数	□数	評価額	比率	
不動産ファンド		千□	千□	千円	%	
タカラレーベン不動産投資法人		1.278	2.265	277,689	0.3	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人		0.937	2.924	428,366	0.5	
日本ビルファンド投資法人		4.362	8.483	5,955,066	6.7	
ジャパンリアルエステイト投資法人		4.504	7.538	5,080,612	5.7	
日本都市ファンド投資法人		8.513	37.545	4,317,675	4.9	
オリックス不動産投資法人		8.975	15.019	3,152,488	3.6	
日本プライムリアルティ投資法人		2.96	4.693	2,069,613	2.3	
N T T都市開発リート投資法人		4.068	6.808	1,120,596	1.3	
東急リアル・エステート投資法人		3.02	5.054	1,007,767	1.1	
グローバル・ワン不動産投資法人		3.128	5.234	659,484	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人		10.113	16.12	2,603,380	2.9	
森トラスト総合リート投資法人		3.219	5.387	848,452	1.0	
インヴィンシブル投資法人		19.757	31.518	1,451,403	1.6	
フロンティア不動産投資法人		1.6	2.501	1,268,007	1.4	
平和不動産リート投資法人		2.805	4.871	835,863	0.9	
日本ロジスティクスファンド投資法人		2.943	4.925	1,548,912	1.7	
福岡リート投資法人		2.329	3.898	712,164	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人		1.393	2.332	1,900,580	2.1	
いちごオフィスリート投資法人		3.488	6.176	616,364	0.7	
大和証券オフィス投資法人		1.04	1.606	1,270,346	1.4	
阪急阪神リート投資法人		2.034	3.405	535,266	0.6	
スターツプロシード投資法人		0.701	1.174	273,776	0.3	
大和ハウスリート投資法人		6.427	10.755	3,500,752	4.0	
ジャパン・ホテル・リート投資法人		14.51	24.283	1,660,957	1.9	
大和証券リビング投資法人		5.5137	9.843	1,165,411	1.3	
ジャパンエクセレント投資法人		4.166	6.994	1,114,843	1.3	
合	計	□数・金額	264.9067	472.255	86,402,461	—
		銘柄数<比率>	63銘柄<97.4%>	61銘柄<97.6%>	—	97.6

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

(注2) 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。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(注3) インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、ラサールロジポート投資法人、森トラスト総合リート投資法人、福岡リート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、C R E ロジスティクスファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ケネディクス・オフィス投資法人、ケネディクス商業リート投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、積水ハウス・リート投資法人、平和不動産リート投資法人、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、投資法人みらい、ザイマックス・リート投資法人、伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、Oneリート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載）

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		期末
		買建額	売建額	
国内	東証REIT	百万円 1,985		百万円 －

■投資信託財産の構成

2021年6月7日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
投資証券	千円 86,402,461	95.6	%
コール・ローン等、その他	4,014,673	4.4	
投資信託財産総額	90,417,135	100.0	

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月7日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	90,417,135,541円
コ	ー	
ル	・	
口	ー	
ン	等	3,405,911,232
投	資	86,402,461,800
証	券(評価額)	
未	収	183,819,520
入	金	490,120,359
差	入	△65,177,370
入	委	
託	証	
拠	金	
(B) 負	債	1,885,627,936
未	払	1,698,686,936
未	払	
払	解	
約	金	186,941,000
(C) 純	資	
元	産	
次	総	
額(A-B)	金	88,531,507,605
損	益	35,599,014,873
越	金	52,932,492,732
(D) 受	益	
益	権	
総	口	
数	数	35,599,014,873口
1	万	
口	当	
た	り	
基	準	
価	額(C/D)	24,869円

(注1) 期首元本額 21,254,723,982円
追加設定元本額 54,318,328,453円
一部解約元本額 39,974,037,562円

(注2) 期末における元本の内訳

M I T O ラップ型ファンド (安定型)	265,723円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	755,477円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	888,298円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	2,775,508円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	1,719,811円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	1,206,984円
たわらノーロード 国内リート	4,396,786,108円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	932,624,822円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	969,244,891円
たわらノーロード バランス (堅実型)	18,479,692円
たわらノーロード バランス (標準型)	328,301,241円
たわらノーロード バランス (積極型)	344,504,015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)	36,161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)	112,884,187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)	298,496,743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)	184,755,065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)	240,465,240円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,362,352円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,267,569円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,306,792円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	6,344,196円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	12,109,534円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	387,435,662円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	130,509,613円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	147,057,515円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	282,884,029円
投資のソムリエ	10,024,620,942円
投資のソムリエ<D C年金>	535,068,021円
D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	118,464,447円
投資のソムリエ<D C年金>リスク抑制型	398,097,751円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,120,726,367円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	11,396,430円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	5,368,611円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	3,754,462円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	25,873,028円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,267,692,515円
9資産分散投資・スタンダード<D C年金>	101,490,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	8,346,602円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	4,119,891円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	3,902,574円
Jリートインデックスファンド (D C)	42,526,034円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	82,505,379円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	742,059,473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)	933,075円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4	266,775,224円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	1,238,110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)	104,218,702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)	765,304円
固定比率マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定)	212,081,935円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定)	83,568,801円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03	125,593,501円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	1,120,375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)	5,043,105円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05	166,112,957円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド (適格機関投資家向け)	3,849,271,455円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	253,271,282円
日本資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	616,049,902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)	1,693,642円
D I A M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)	2,597,095,834円
期末元本合計	35,599,014,873円

■損益の状況

当期 自2020年6月9日 至2021年6月7日

項 目						当 期			
(A) 配	当	等	収	益		2,307,938,669円			
受	取	配	当	金		2,308,456,061			
受	取		利	息		915			
そ	の	他	収	益	金	1,000			
支	払		利	息		△519,307			
(B) 有	価	証	券	売	買	損	益	12,848,827,761	
売			買				益	14,036,651,903	
売			買				損	△1,187,824,142	
(C) 先	物	取	引	等	取	引	損	益	356,830,240
取			引				益	367,459,860	
取			引				損	△10,629,620	
(D) 当	期	損	益	金(A + B + C)				15,513,596,670	
(E) 前	期	繰	越	損	益	金		20,630,700,953	
(F) 解	約	差	損	益	金		△	46,304,004,438	
(G) 追	加	信	託	差	損	益	金	63,092,199,547	
(H) 合				計(D + E + F + G)				52,932,492,732	
次	期	繰	越	損	益	金(H)		52,932,492,732	

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

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

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

《お知らせ》

■信託金の限度額を2,000億円から5,000億円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年6月2日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2021年6月22日）

（対象期間 2020年6月23日～2021年6月22日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2007年4月11日から無期限です。
運 用 方 針	S & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）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 R E I T インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （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
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率		
	円	%	ポイント	%	%	百万円
10期(2017年6月22日)	11,770	7.9	117,262.55	8.5	99.7	43,023
11期(2018年6月22日)	11,979	1.8	120,101.82	2.4	99.3	53,148
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	47,410
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	78,959

（注1）ベンチマークはS & P 先進国 R E I T インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）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 R E I T 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 R E I T インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

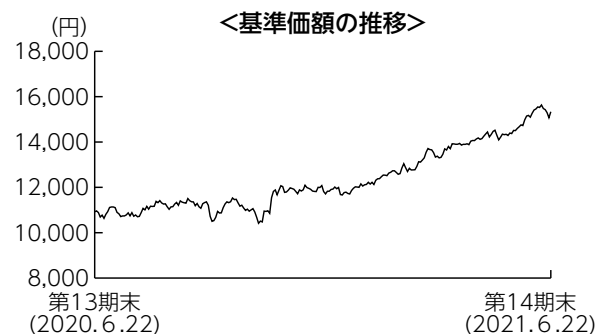
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2020年6月23日から2021年6月22日まで）

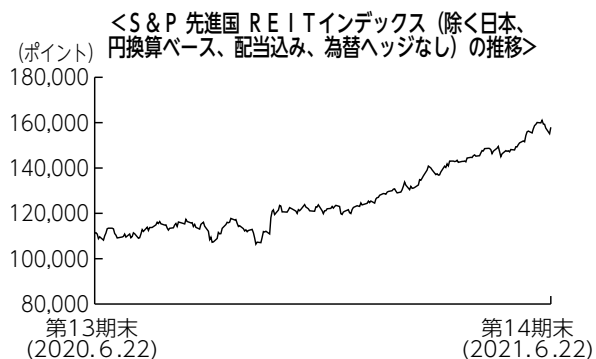


基準価額の推移

当期末の基準価額は15,336円となり、前期末比で40.4%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

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

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

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

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

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

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

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

銘柄		期首(前期末)		当期		期末	
		□数	□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	%	
VICI PROPERTIES INC		137.449	252.573	8,089	892,155	1.1	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES		9.418	15.65	294	32,429	0.0	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC		20.693	37.21	1,080	119,166	0.2	
COLONY CAPITAL INC		139.081	238.549	2,027	223,611	0.3	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	7,409.052	11,651.995	534,054	58,895,551	—	
		157銘柄<74.6%>	156銘柄<74.6%>	—	—	74.6	
(カナダ)		千□	千□	千カナダ・ドル	千円	%	
SMARTCENTRES REIT		20.064	33.365	996	88,778	0.1	
CANADIAN APT PPTYS REIT		24.536	40.179	2,380	211,992	0.3	
H & R REAL ESTATE INVESTMENT		39.965	67.209	1,102	98,213	0.1	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST		30.633	52.733	942	83,915	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		46.927	72.829	1,610	143,392	0.2	
ALLIED PROPERTIES REIT		18.176	29.143	1,344	119,741	0.2	
COMINAR REAL ESTATE INVNT TR		24.741	44.246	477	42,513	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU		8.627	12.866	308	27,439	0.0	
NORTHVIEW APARTMENT REIT		9.997	—	—	—	—	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		7.095	10.875	457	40,751	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU		21.186	31.111	364	32,497	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INV		13.784	21.592	387	34,513	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		18.272	31.544	542	48,286	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES		24.249	43.997	568	50,658	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT		6.002	8.583	144	12,871	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REIT		22.509	42.899	650	57,951	0.1	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT		20.873	37.879	669	59,603	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T		8.495	14.568	1,238	110,268	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT		12.414	22.019	164	14,666	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT		46.042	74.537	1,092	97,306	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE		4.997	8.825	211	18,860	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		14.064	24.18	410	36,518	0.0	
PLAZA RETAIL REIT		—	20.611	96	8,608	0.0	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES		12.087	19.145	438	39,075	0.0	
SLATE GROCERY REIT		5.623	10.657	137	12,270	0.0	
SLATE OFFICE REIT		11.634	11.634	62	5,584	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT		—	7.088	87	7,807	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV		14.74	24.752	513	45,736	0.1	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	487.732	819.066	17,403	1,549,824	—	
		26銘柄<1.9%>	27銘柄<2.0%>	—	—	2.0	
(オーストラリア)		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%	
BWP TRUST		145.963	224.791	973	80,738	0.1	
MIRVAC GROUP		1,181.612	1,846.984	5,393	447,365	0.6	
CROMWELL PROPERTY GROUP		570.442	865.185	787	65,308	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT		136.991	236.221	921	76,418	0.1	
GPT GROUP		575.807	911.007	4,391	364,237	0.5	
CENTURIA CAPITAL GROUP		—	229.128	607	50,366	0.1	
ABACUS PROPERTY GROUP		100.258	196.651	619	51,383	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU		75.176	154.369	534	44,304	0.1	
STOCKLAND		727.078	1,128.82	5,260	436,341	0.6	
INGENIA COMMUNITIES GROUP		68.692	134.675	816	67,698	0.1	
DEXUS		321.924	505.128	5,435	450,847	0.6	
GOODMAN GROUP		478.528	789.54	16,517	1,370,099	1.7	
VICINITY CENTRES		1,197.4	1,826.547	2,986	247,722	0.3	
CHARTER HALL GROUP		136.701	220.887	3,339	277,037	0.4	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		86.456	136.67	552	45,800	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		301.574	513.792	1,310	108,678	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		—	212.974	796	66,071	0.1	

銘柄		期首(前期末)		当		期		末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率		
(オーストラリア)		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円				%
ARENA REIT		93.469	159.242	547	45,439				0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		123.086	260.875	1,254	104,086				0.1
APN INDUSTRIA REIT		41.907	73.145	234	19,415				0.0
NATIONAL STORAGE REIT		280.409	516.215	1,047	86,924				0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD		50.661	73.965	241	20,062				0.0
GDI PROPERTY GROUP		137.85	247.876	280	23,234				0.0
HOME CONSORTIUM LTD		—	85.98	498	41,365				0.1
RURAL FUNDS GROUP		101.989	160.193	397	32,954				0.0
IRONGATE GROUP		—	256.148	371	30,808				0.0
SCENTRE GROUP		1,543.922	2,437.607	6,874	570,202				0.7
HOMECO DAILY NEEDS REIT		—	213.11	303	25,190				0.0
CENTURIA OFFICE REIT		115.908	179.274	419	34,797				0.0
AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD		—	176.463	538	44,644				0.1
WAYPOINT REIT LTD		208.852	382.777	1,014	84,141				0.1
小計	□数・金 銘柄数<比率>	8,802.655	15,356.239	65,264	5,413,690	—	—	—	—
		25銘柄<6.6%>	31銘柄<6.9%>	—	—	—	—	—	6.9
(香港)		千□	千□	千香港・ドル	千円				%
LINK REIT		608.02	977.72	76,066	1,080,145				1.4
PROSPERITY REIT		361	597	1,779	25,262				0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		448	761	3,135	44,521				0.1
CHAMPION REIT		602.07	937.07	4,216	59,878				0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		313	451	2,056	29,203				0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T		405	680	5,712	81,110				0.1
小計	□数・金 銘柄数<比率>	2,737.09	4,403.79	92,966	1,320,122	—	—	—	—
		6銘柄<1.9%>	6銘柄<1.7%>	—	—	—	—	—	1.7
(シンガポール)		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円				%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		839.66	2,169.309	4,555	373,509				0.5
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT		881.66	1,544.76	4,526	371,098				0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		840.979	—	—	—				—
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		698.59	1,006.99	1,470	120,542				0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		880.12	1,370.62	2,768	227,001				0.3
STARHILL GLOBAL REIT		374.2	656.8	361	29,618				0.0
ASCOTT TRUST		530.116	891.616	891	73,103				0.1
KEPPEL REIT		553.6	951.5	1,094	89,715				0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		208.3	622.9	1,501	123,082				0.2
ESR REIT		636.53	1,148.73	470	38,615				0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		250.9	365.2	452	37,129				0.0
CAPITALAND CHINA TRUST		232.58	450.18	621	50,936				0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU		180.1	608.8	167	13,726				0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		140.595	216.895	307	25,252				0.0
PARKWAY LIFE REIT		119.3	179	789	64,722				0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		615	2,759.1	176	14,477				0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		455.82	913.12	2,556	209,626				0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		644.6	1,028.2	2,200	180,406				0.2
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		310.78	587.88	485	39,765				0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		286.2	313.2	134	11,042				0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		614.2	1,019	1,080	88,560				0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		271.3	491.5	289	23,775				0.0
SPH REIT		237	471.9	410	33,661				0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT		275	—	—	—				—
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT		—	127.4	102	8,408				0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T		165.2	208.1	193	15,867				0.0
OUE COMMERCIAL REIT		773.055	1,120.355	448	36,743				0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT		203.6	422.2	339	27,866				0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		235.7	377.1	197	16,232				0.0

銘柄	期首(前期末)	当期				期末
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(シンガポール)	千口	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
IREIT GLOBAL	—	214.5	140	11,519	0.0	
KEPPEL DC REIT	359.7	591.5	1,520	124,637	0.2	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	723.164	1,314.964	1,814	148,783	0.2	
小計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比率>	13,537.549 30銘柄<4.1%>	24,143.319 30銘柄<3.3%>	32,070	2,629,427	— 3.3
(ニュージーランド)	千口	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
PRECINCT PROPERTIES	326.171	510.038	790	60,833	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	106.603	180.112	545	41,994	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	328.996	520.345	1,194	91,893	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	447.199	742.461	864	66,559	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	247.066	388.009	601	46,278	0.1	
小計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比率>	1,456.035 5銘柄<0.4%>	2,340.965 5銘柄<0.4%>	3,996	307,559	— 0.4
(イギリス)	千口	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC	277.336	437.522	2,159	331,216	0.4	
CAPITAL & REGIONAL PLC	9.186	—	—	—	—	
DERWENT LONDON PLC	31.508	52.817	1,827	280,333	0.4	
BIG YELLOW GROUP PLC	48.36	77.686	995	152,776	0.2	
HAMMERSON PLC	233.838	1,976.821	778	119,478	0.2	
LAND SECURITIES GROUP PLC	221.691	355.626	2,409	369,651	0.5	
WORKSPACE GROUP PLC	38.577	63.229	543	83,365	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	1	283	0.0	
UNITE GROUP PLC	106.992	186.15	2,068	317,250	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	355.593	617.519	959	147,206	0.2	
SHAFTESBURY PLC	63.788	144.406	862	132,357	0.2	
SEGRO PLC	327.645	564.915	6,174	947,171	1.2	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	73.391	119.078	878	134,715	0.2	
ASSURA PLC	788.073	1,242.776	945	145,078	0.2	
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERT	—	179.591	131	20,110	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	187.713	255.156	120	18,474	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	170.446	257.572	225	34,533	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	254.022	347.914	271	41,681	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	60.379	97.821	924	141,804	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	269.096	423.479	1,006	154,348	0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT	245.021	370.408	325	50,002	0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL	247.221	397.993	673	103,361	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	—	210.196	348	53,396	0.1	
RDI REIT PLC	74.051	—	—	—	—	
NEWRIVER REIT PLC	102.138	139.604	118	18,224	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	189.831	294.033	345	53,043	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	110.038	177.39	186	28,572	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	—	371.767	438	67,294	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	512.115	810.128	1,598	245,191	0.3	
CUSTODIAN REIT PLC	—	202.92	199	30,629	0.0	
HOME REIT PLC	—	100.813	114	17,629	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	186.961	281.997	243	37,288	0.0	
AEW UK REIT PLC	54.933	83.963	78	12,081	0.0	
LXI REIT PLC	159.926	292.448	414	63,523	0.1	
REGIONAL REIT LTD	129.74	206.337	179	27,537	0.0	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	—	153.417	169	25,934	0.0	
小計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比率>	5,760.649 30銘柄<5.3%>	11,724.532 34銘柄<5.6%>	28,719	4,405,550	— 5.6
(イスラエル)	千口	千口	千口	千イスラエル・シェケル	千円	%
REIT 1 LTD	52.551	85.363	1,515	51,165	0.1	
小計	□ 数 ・ 金 額 銘柄 数<比率>	52.551 1銘柄<0.1%>	85.363 1銘柄<0.1%>	1,515	51,165	— 0.1

銘 柄	期 首(前期末)		当 期			末	
	口	数	口	数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(韓国)		千口		千口	千韓国・ウォン	千円	%
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE		—		39,843	195,230	19,015	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10.894	—		19,635	162,774	15,854	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		—		9,958	54,769	5,334	0.0
LOTTE REIT CO LTD	25.4	—		54,509	332,504	32,385	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		—		17,86	108,053	10,524	0.0
JR REIT XXVII		—		56,222	295,165	28,749	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD		—		46,423	335,174	32,645	0.0
小 計	口 数	・ 金 額		244.45	1,483,671	144,509	—
	銘 柄 数<比 率>		2銘柄<0.1%>	7銘柄<0.2%>	—	—	0.2
(ユーロ…シンガポール)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
CROMWELL REIT EUR		—		131.74	309	40,649	0.1
小 計	口 数	・ 金 額		131.74	309	40,649	—
	銘 柄 数<比 率>		—銘柄<—%>	1銘柄<0.1%>	—	—	0.1
(ユーロ…アイルランド)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
HIBERNIA REIT PLC		208.204		306.848	382	50,200	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI		119.677		214.307	327	42,995	0.1
小 計	口 数	・ 金 額		521.155	709	93,195	—
	銘 柄 数<比 率>		2銘柄<0.1%>	2銘柄<0.1%>	—	—	0.1
(ユーロ…オランダ)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11.468	—		18.21	398	52,266	0.1
VASTNED RETAIL	5.849	—		8,822	227	29,826	0.0
WERELDHAVE NV	11.998	—		18,894	287	37,782	0.0
NSI NV	5.133	—		8,112	280	36,852	0.0
小 計	口 数	・ 金 額		54.038	1,193	156,728	—
	銘 柄 数<比 率>		4銘柄<0.2%>	4銘柄<0.2%>	—	—	0.2
(ユーロ…ベルギー)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
BEFIMMO	6.929	—		12.281	421	55,389	0.1
COFINIMMO SA	7.256	—		13,734	1,801	236,589	0.3
RETAIL ESTATES	3.188	—		5,045	353	46,368	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6.779	—		10,415	242	31,794	0.0
WAREHOUSES DE PAUW	38.064	—		64,409	2,111	277,217	0.4
MONTEA SCA	3.259	—		4,725	481	63,280	0.1
AEDIFICA	7.985	—		15,707	1,782	234,074	0.3
CARE PROPERTY INVEST NV	—	—		12,034	323	42,424	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	—	—		8,239	418	54,954	0.1
小 計	口 数	・ 金 額		146.589	7,936	1,042,092	—
	銘 柄 数<比 率>		7銘柄<1.2%>	9銘柄<1.3%>	—	—	1.3
(ユーロ…フランス)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
GECEIN SA	16.655	—		25,599	3,403	446,864	0.6
ICADE	8.117	—		14,526	1,077	141,518	0.2
ALTAREA	0.977	—		1,643	298	39,175	0.0
KLEPIERRE	60.564	—		93,81	2,133	280,094	0.4
COVIVIO	14.277	—		22,853	1,732	227,445	0.3
MERCIALYS	7.165	—		19,022	196	25,775	0.0
CARMILA SA	—	—		21,853	274	36,095	0.0
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	40.645	—		64,946	5,106	670,510	0.8
小 計	口 数	・ 金 額		264.252	14,223	1,867,480	—
	銘 柄 数<比 率>		7銘柄<2.4%>	8銘柄<2.4%>	—	—	2.4
(ユーロ…ドイツ)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG	21.542	—		32,106	290	38,201	0.0
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	46.459	—		84,625	1,331	174,891	0.2
小 計	口 数	・ 金 額		116,731	1,622	213,092	—
	銘 柄 数<比 率>		2銘柄<0.3%>	2銘柄<0.3%>	—	—	0.3
(ユーロ…スペイン)		千口		千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	72.211	—		119,135	1,060	139,295	0.2

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2021年6月22日現在

項 目	当 期		末	
	評 価	額	比	率
		千円		%
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券		78,493,798		98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		899,846		1.1
投 資 信 託 財 産 総 額		79,393,645		100.0

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

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年6月22日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

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

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月22日

項 目					当 期
(A) 配 当 等 収 益	当 取 配 当 金				1,789,006,467円
受 取 金					1,788,122,236
受 取 利 息					24,391
そ の 他 収 益					1,015,455
支 払 利 息					△155,615
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益					18,149,662,918
売 買 益					20,186,684,133
売 買 損					△2,037,021,215
(C) そ の 他 費 用					△58,742,592
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)					19,879,926,793
(E) 前 期 繰 越 損 益 金					2,935,062,020
(F) 解 約 差 損 益 金					△20,082,050,995
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金					24,738,680,455
(H) 合 計(D + E + F + G)					27,471,618,273
次 期 繰 越 損 益 金(H)					27,471,618,273

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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