

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	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	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。
主要投資対象	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 (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
	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
運用方法	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
	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。）に経費控除後の利子、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89期 <決算日 2022年1月11日>
第90期 <決算日 2022年3月11日>
第91期 <決算日 2022年5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、2022年5月11日に第91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・証券・債券組入比率	純資産総額
		(分配落)	税金込み分配金	騰落率							
第27作成期	77期(2020年1月14日)	円 11,197	円 15	% 2.5	% 50.4	% 0.8	% 33.8	% -	% -	% 12.8	百万円 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
第31作成期	89期(2022年1月11日)	13,020	15	△0.4	50.1	0.8	32.8	-	-	14.2	431
	90期(2022年3月11日)	12,262	15	△5.7	47.9	1.5	36.1	-	-	14.3	410
	91期(2022年5月11日)	12,591	15	2.8	44.1	1.3	38.1	-	-	11.7	418

(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 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 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率						
第89期	(期 首) 2021年11月11日	円 13,083	% —	% 50.0	% 1.3	% 33.1	% —	% —	% 14.2
	11 月 末	12,864	△1.7	46.1	1.3	33.6	—	—	13.0
	12 月 末	13,196	0.9	49.9	1.8	33.0	—	—	14.6
	(期 末) 2022年 1 月11日	13,035	△0.4	50.1	0.8	32.8	—	—	14.2
第90期	(期 首) 2022年 1 月11日	13,020	—	50.1	0.8	32.8	—	—	14.2
	1 月 末	12,609	△3.2	48.4	1.8	33.7	—	—	14.1
	2 月 末	12,511	△3.9	49.1	1.0	33.9	—	—	14.0
	(期 末) 2022年 3 月11日	12,277	△5.7	47.9	1.5	36.1	—	—	14.3
第91期	(期 首) 2022年 3 月11日	12,262	—	47.9	1.5	36.1	—	—	14.3
	3 月 末	13,155	7.3	47.7	1.4	36.0	—	—	13.5
	4 月 末	12,927	5.4	46.6	1.6	36.5	—	—	12.5
	(期 末) 2022年 5 月11日	12,606	2.8	44.1	1.3	38.1	—	—	11.7

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

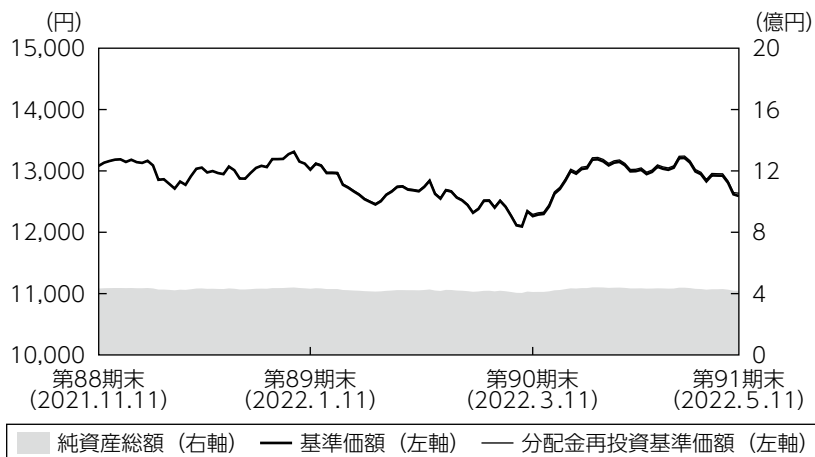
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(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89期～第91期の運用経過（2021年11月12日から2022年5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

海外主要国の長期金利が大きく上昇（債券価格は下落）し内外金利差が拡大する中、主要通貨に対して円安が進んだことがプラスに寄与しました。一方、インフレ懸念や主要国の金融政策の早期正常化観測等から長期金利が上昇したこと、長期金利の上昇やF R B（米連邦準備理事会）の積極的な金融引き締め姿勢を嫌気し世界的に株式市場やリート市場が下落したことがマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
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	△3.3%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.1%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.7%
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	△4.2%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△0.5%

投資環境

国内株式市場は、作成期初から2022年1月半ばまでは、ほぼ横ばいの推移となりました。その後、3月半ばまでは、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として下落しました。3月下旬には一時的に反発する場面もありましたが、作成期末にかけては米国の金融引き締めへの警戒やウクライナ情勢の不透明感の高まりを受けて下落しました。

外国株式市場は下落しました。作成期初から2021年12月下旬にかけ、F R Bの資産買い入れ縮小加速への警戒感などから不安定な展開となりました。2022年に入ると米国の金融緩和策の急速な転換が懸念され下落しました。3月上旬にかけては、ロシアのウクライナ侵攻が嫌気され下落しました。その後はロシア・ウクライナの和平交渉の進展期待から反発しましたが、作成期末にかけ米国の追加利上げ見通しや中国における新型コロナウイルスの感染拡大を嫌気し下落しました。

国内債券市場は下落しました。作成期初から2021年12月にかけては、各国中央銀行が利上げに対して慎重な姿勢を見せたことや、新型コロナウイルス変異株の感染拡大懸念などから利回りは低下（価格は上昇）しました。2022年に入ると、欧米主要国の中央銀行の金融政策引き締め観測などを受けて利回りは上昇しました。

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

国内リート市場は下落しました。前半は公募増資による需給悪化や新型コロナウイルスの新たな変異株による感染拡大などが懸念され、上値の重い展開が続きました。2022年1月には米国金利の上昇懸念などからリスク回避的な動きが強まり大幅に下落しました。その後もウクライナ情勢の緊迫化などが上値を抑える要因となりましたが、作成期末にかけては新型コロナウイルス感染症まん延防止等重点措置の解除や日銀の金融緩和維持姿勢などを受けてやや値を戻しました。

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

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

ポートフォリオについて

●当ファンド

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。

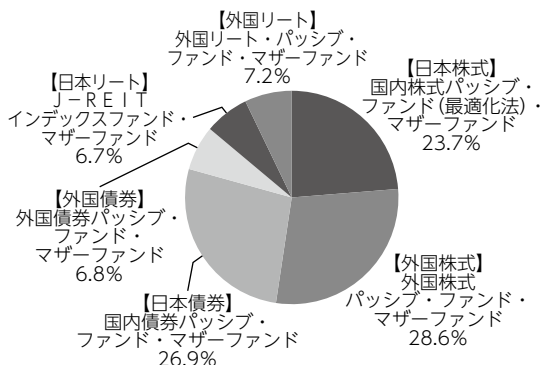
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

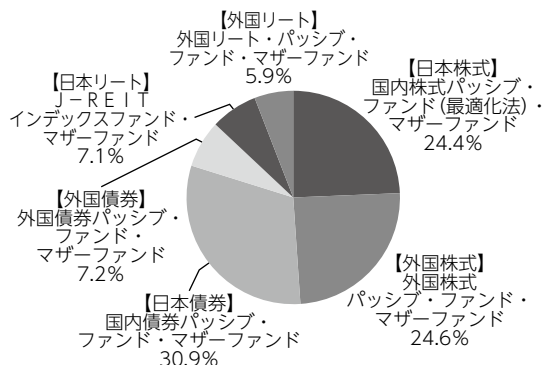
【運用状況】 2022年5月11日現在

○マザーファンド組入比率

前作成期末



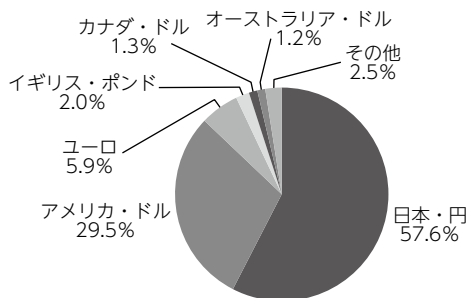
当作成期末



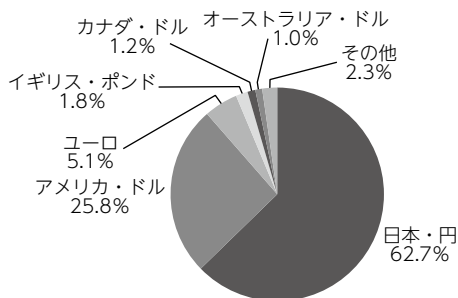
(注) 組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

○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89期	第90期	第91期
	2021年11月12日 ～2022年1月11日	2022年1月12日 ～2022年3月11日	2022年3月12日 ～2022年5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%	0.12%
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	3,787円	3,789円	3,835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89期～第91期		項目の概要
	(2021年11月12日 ～2022年5月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	35円	0.272%	(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12,856円です。
(投信会社)	(18)	(0.142)	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)	(0.109)	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	0.007	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(1)	(0.004)	
(d) その他費用	1	0.012	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(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	0.294	

(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。

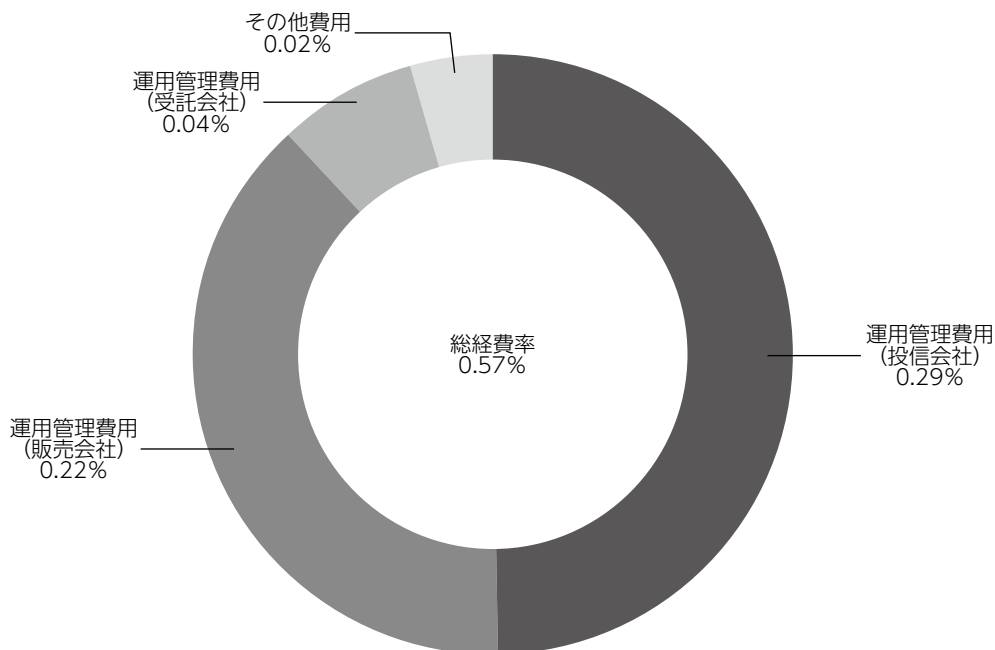
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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11月12日から2022年5月11日まで）

	第 89 期 ～ 第 91 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	千口 2,396	千円 7,868	千口 480	千円 1,547
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	166	961	3,142	19,247
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	12,986	16,586	1,437	1,856
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	588	1,208	208	433
J－R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	897	2,168	178	433
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	139	231	3,781	6,871

■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 89 期 ～ 第 91 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	666,755,175千円	477,658,823千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	389,759,039千円	661,939,946千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.71	0.72

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年11月12日から2022年5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 89 期 ～ 第 91 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	11千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.062千円
(B)／(A)	0.5%

(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 89 期 ～ 第 91 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 278,852	百万円 119,250	% 42.8	百万円 387,902	百万円 199,612	% 51.5

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 89 期 ～ 第 91 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 2,095	百万円 2,934	百万円 2,477

(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 89 期 ～ 第 91 期
	買 付 額
株 式	百万円 11

【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】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 89 期 ～ 第 91 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 703,106	百万円 78,436	% 11.2	百万円 518,138	百万円 69,042	% 13.3

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。

【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－R E I T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	第 89 期 ～ 第 91 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 119,493	百万円 259	% 0.2	百万円 159,149	百万円 21,504	% 13.5

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 89 期 ～ 第 91 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 5,114

【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 30 作 成 期 末	第 31 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	30,491	32,407	100,572
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,636	17,659	101,479
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	88,189	99,738	127,606
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13,972	14,352	29,654
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	11,755	12,475	29,351
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,050	14,409	24,332

■投資信託財産の構成

2022年5月11日現在

項 目	第 31 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	100,572	24.0
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	101,479	24.2
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	127,606	30.4
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29,654	7.1
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	29,351	7.0
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	24,332	5.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,493	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	419,490	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2022年5月11日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは690,630,879千円、98.7％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは169,873,890千円、95.0％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは56,413,107千円、95.0％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年5月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝130.32円、1カナダ・ドル＝100.07円、1オーストラリア・ドル＝90.53円、1香港・ドル＝16.60円、1シンガポール・ドル＝93.67円、1ニュージーランド・ドル＝82.02円、1イギリス・ポンド＝160.66円、1イスラエル・シェケル＝37.707円、1スイス・フラン＝130.92円、1デンマーク・クローネ＝18.45円、1ノルウェー・クローネ＝13.40円、1スウェーデン・クローナ＝12.96円、1メキシコ・ペソ＝6.398円、100韓国・ウォン＝10.21円、1オフショア・人民元＝19.294円、1マレーシア・リンギット＝29.729円、1ポーランド・ズロチ＝29.338円、1ユーロ＝137.27円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年1月11日)、 (2022年3月11日)、 (2022年5月11日)現在

項 目	第 89 期 末	第 90 期 末	第 91 期 末
(A) 資 産	433,333,299円	411,122,217円	419,490,252円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,852,328	7,140,540	6,493,945
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)	99,750,197	91,313,085	100,572,495
外国株式パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	122,571,888	113,289,728	101,479,730
国内債券パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	113,976,338	114,229,571	127,606,054
外国債券パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	28,623,316	27,964,541	29,654,348
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)	28,156,339	26,716,751	29,351,170
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーフアンド(評価額)	31,402,893	30,468,001	24,332,510
(B) 負 債	1,571,452	877,889	922,324
未 払 収 益 分 配 金	497,440	501,844	498,663
未 払 解 約 金	673,567	—	25,534
未 払 信 託 報 酬	397,649	373,411	395,342
そ の 他 未 払 費 用	2,796	2,634	2,785
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	431,761,847	410,244,328	418,567,928
元 本	331,626,761	334,562,724	332,442,384
次 期 繰 越 損 益 金	100,135,086	75,681,604	86,125,544
(D) 受 益 権 総 口 数	331,626,761口	334,562,724口	332,442,384口
1 万口当たり基準価額(C／D)	13,020円	12,262円	12,591円

(注) 第88期末における元本額は331,204,771円、当作成期間（第89期～第91期）中における追加設定元本額は8,633,053円、同解約元本額は7,395,440円です。

■損益の状況

〔自 2021年11月12日
至 2022年 1 月11日〕〔自 2022年 1月12日
至 2022年 3月11日〕〔自 2022年 3月12日
至 2022年 5月11日〕

項 目	第 89 期	第 90 期	第 91 期
(A) 配 当 等 収 益	△203円	△157円	△82円
受 取 利 息	10	3	－
支 払 利 息	△213	△160	△82
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,227,881	△24,324,915	11,694,422
売 買 益	1,492,156	17,216	12,801,725
売 買 損	△2,720,037	△24,342,131	△1,107,303
(C) 信 託 報 酬 等	△400,445	△376,045	△398,127
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△1,628,529	△24,701,117	11,296,213
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	110,513,508	108,219,614	81,966,177
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△8,252,453	△7,335,049	△6,638,183
(配 当 等 相 当 額)	(15,060,224)	(16,344,878)	(16,940,183)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,312,677)	(△23,679,927)	(△23,578,366)
(G) 合 計(D + E + F)	100,632,526	76,183,448	86,624,207
(H) 収 益 分 配 金	△497,440	△501,844	△498,663
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	100,135,086	75,681,604	86,125,544
追 加 信 託 差 損 益 金	△8,252,453	△7,335,049	△6,638,183
(配 当 等 相 当 額)	(15,061,551)	(16,346,167)	(16,944,327)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△23,314,004)	(△23,681,216)	(△23,582,510)
分 配 準 備 積 立 金	110,551,505	110,450,759	110,560,014
繰 越 損 益 金	△2,163,966	△27,434,106	△17,796,287

(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 89 期	第 90 期	第 91 期
(a) 経 費 控 除 後 の 配 当 等 収 益	535,437円	572,377円	2,005,539円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0
(c) 収 益 調 整 金	15,061,551	16,346,167	16,944,327
(d) 分 配 準 備 積 立 金	110,513,508	110,380,226	109,053,138
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	126,110,496	127,298,770	128,003,004
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	3,802.78	3,804.93	3,850.38
(g) 分 配 金	497,440	501,844	498,663
(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 89 期	第 90 期	第 91 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「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を 1 兆円から 3 兆円とする約款変更を行いました。

(2021年12月21日)

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」および「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を 1 兆円から 3 兆円とする約款変更を行いました。

(2022年 3 月15日)

- 当ファンドが投資対象とする「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の約款において、投資対象を「東京証券取引所第一部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。これに伴い、投資態度においても所要の変更を行いました。

なお、上記約款変更は東京証券取引所の市場区分の再編に伴うもので商品としての同一性が失われるものではありません。

(2022年 4 月 4 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20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7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20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年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			
16期（2018年2月7日）	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期（2019年2月7日）	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期（2020年2月7日）	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期（2021年2月8日）	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期（2022年2月7日）	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

（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（㈱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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱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、㈱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）。

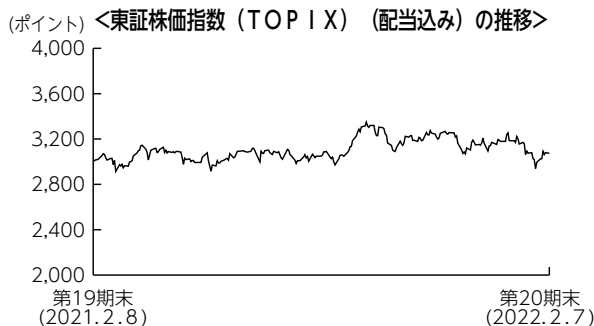
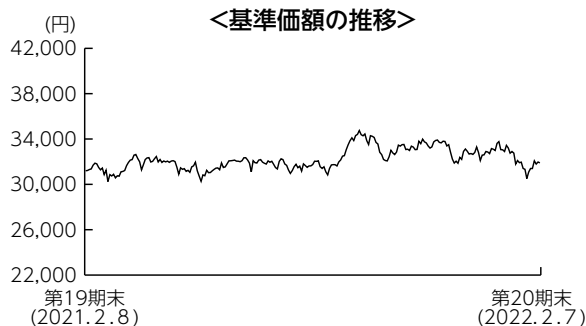
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 8 日	円 31,202	% －	ポイント 3,006.47	% －	% 97.7	% 2.3
2 月 末	30,248	△3.1	2,914.58	△3.1	99.0	1.1
3 月 末	31,972	2.5	3,080.87	2.5	96.2	4.0
4 月 末	31,068	△0.4	2,993.46	△0.4	96.5	3.5
5 月 末	31,493	0.9	3,034.76	0.9	96.6	3.4
6 月 末	31,864	2.1	3,070.81	2.1	96.0	4.0
7 月 末	31,172	△0.1	3,003.91	△0.1	97.2	2.8
8 月 末	32,156	3.1	3,099.08	3.1	97.1	2.9
9 月 末	33,562	7.6	3,234.08	7.6	96.3	3.8
10 月 末	33,082	6.0	3,188.28	6.0	96.8	3.4
11 月 末	31,886	2.2	3,073.26	2.2	84.8	1.0
12 月 末	32,994	5.7	3,179.28	5.7	97.1	3.4
2022 年 1 月 末	31,401	0.6	3,025.69	0.6	95.8	4.2
(期 末) 2022 年 2 月 7 日	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

2021年9月には菅前首相の自民党総裁選への不出馬表明を受けて、新たな政策への期待の高まりから基準価額は上昇しました。その後は、中国不動産開発大手の中国恒大集団の信用リスク懸念、米国での金融引き締めによる金利上昇への警戒感の高まり、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大等を要因として基準価額は下落しました。

投資環境

期初から2021年8月までは、国内の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月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

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	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



期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.5%
2	輸送用機器	8.5
3	情報・通信業	7.8
4	化学	6.4
5	サービス業	5.7
6	卸売業	5.5
7	銀行業	5.4
8	機械	5.1
9	医薬品	4.7
10	小売業	4.1

○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	3.0%
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	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174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2.2%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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
国 内 上 場		192,672.8 (6,584.913)	479,219,336 (-)	161,731.513	395,856,402

(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 144,564	百万円 142,625	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	875,075,739千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	369,108,651千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7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 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期	
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額	
株 式	百万円 3,678	百万円 3,163	百万円 3,133	

(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 1,300

(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)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B)／(A)	2.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ信託銀行、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
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
極洋	5.4	7.2	22,824	矢作建設工業	16.7	20.5	15,641	DM3井製菓ホールディングス	9.5	13.7	27,578
日本水産	148.6	199.7	103,844	ビーエス三菱	12.2	15.4	9,548	塩水精糖	14.4	19.9	4,258
マルハニチロ	25.2	31.4	78,468	日本ハウスホールディングス	25.6	31.7	14,360	日新製糖	4.5	7.6	13,148
雪国まいたけ	9.9	14.8	17,863	大東建設	40.5	47.2	636,256	森永製菓	27.8	34.8	128,412
カネコ種苗	4.6	4.9	7,408	新日本建設	15.9	19.9	15,004	中村屋	2.5	2.6	8,710
サカタのタネ	19.2	24	78,600	N I P P O	30.8	—	—	江崎グリコ	32.7	40.7	153,846
ホクト	13.6	17	33,320	東亜道路工業	2.4	2.6	13,052	名糖産業	5.6	6.9	11,460
ホクリヨウ	2.3	3.4	2,363	前田道路	22.9	—	—	井村屋グループ	6.8	8.6	19,169
鉱業 (0.3%)				日本道路	3.6	4.6	38,180	不二家	7.6	8.5	19,371
住石ホールディングス	27.8	35.1	4,773	東亜建設工業	9.9	11.5	27,933	山崎製パン	89	110.7	179,887
日鉄鉱業	3.7	4.6	28,474	日本国土開発	36.3	45.5	24,115	第一屋製パン	2.9	3.5	1,858
三井松島ホールディングス	6.7	8.3	12,640	若築建設	6.7	7.7	13,213	モロゾフ	1.7	3.7	10,175
I N P E X	590.1	800.9	940,256	東洋建設	41.6	51.7	29,882	亀田製菓	6.9	8.6	33,669
石油資源開発	21	23.5	66,951	五洋建設	157.5	182.7	116,745	寿スビリッツ	11.4	14.3	78,364
K&Qエナジーグループ	7.7	9.9	15,246	世紀東急工業	17.9	22.4	18,256	カルビー	54.1	67.3	164,817
建設業 (2.3%)				福田組	4.3	5	21,950	森永乳業	21.9	27.4	149,604
ヒノキヤグループ	4	4.5	9,292	住友林業	87.2	118	240,602	六甲バター	8	11	16,280
ジョー・ボンドホールディングス	22.9	28.5	143,925	日本基礎技術	11.7	12.7	7,975	ヤクルト本社	81.6	109.4	633,426
ミライト・ホールディングス	55.7	64.4	121,265	巴コーポレーション	16.8	20.7	10,060	明治ホールディングス	78.5	97.6	704,672
タマホーム	9.7	12.1	29,717	大和ハウス工業	342.4	425.6	1,442,358	雪印メグミルク	28.6	35.6	73,407
サンヨーホームズ	2.2	2.5	1,827	ライト工業	21.3	29	53,679	プリマハム	16.8	18.6	44,807
日本アーク	6.4	8.1	5,070	積水ハウス	402.2	500	1,164,500	日本ハム	45.4	56.5	237,865
ファーストコーポレーション	4.9	6.4	4,454	日特建設	9.9	9.8	6,997	林兼産業	3.6	3.8	1,919
ベステラ	3	4	5,024	北陸電気工事	6.6	9.8	8,065	丸大食品	11.8	14.8	22,555
Robot Home	29.9	33.3	7,425	ユアテック	21.3	26.5	18,470	S F o o d s	10.7	13.3	43,424
キャンディル	2.8	3.8	1,862	日本リーテック	7.7	9.6	13,468	柿安本店	4.1	5.2	13,577
スペースビューホールディングス	19.6	—	—	四電工	1.7	5.2	8,361	伊藤ハム&コホールディングス	76.7	95.7	64,310
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.9	4,555	中電工	17.1	21.3	45,219	サッポロホールディングス	40.5	50.4	112,644
第一カッター興業	4	5.1	7,063	関電工	60.4	75.2	65,424	アサヒグループホールディングス	259.3	347.2	1,656,144
安藤・間	102.9	99.1	86,514	きんでん	80.2	103.1	166,506	キリンホールディングス	503.3	542.4	1,020,796
東急建設	47	58.5	40,131	東京エニシス	12.3	15.5	15,035	宝ホールディングス	87.9	100.4	111,845
コムシスホールディングス	56.9	64.4	175,683	トーエネック	3.8	4.7	15,110	オエノホールディングス	34.2	43	14,534
ピーアールホールディングス	19	27.1	9,674	住友電設	10.5	11.5	25,587	養命酒造	4	5.1	8,981
高松コンストラクショングループ	10.1	12.6	25,263	日本電設工業	20.4	25.4	37,134	コトコト 飲料・食品・ホールディングス	90.8	103.7	141,757
東建コーポレーション	4.9	5.5	50,655	エシオスグループ	56.2	69.8	162,424	サントリー食品インターナショナル	79.5	98.7	443,163
ソネック	1.7	2.3	2,366	新日本空調	9.8	12.2	24,790	ダイドグループホールディングス	6.7	7.7	37,345
ヤマウラ	7.2	10.3	10,186	九電工	26.1	35.6	109,470	伊藤園	36.1	45	279,900
オリエンタル白石	—	67.8	16,339	三機工業	26.3	30.2	42,823	キーコーヒー	11.8	14.8	30,532
大成建設	115.4	133.2	508,158	日揮ホールディングス	123.6	141.9	160,914	ユニカフェ	3.9	5	4,790
大林組	370.8	460.9	434,167	中外炉工業	4.1	4.7	7,562	ジャパンフーズ	1.5	1.7	2,050
清水建設	347.3	431.8	338,099	ヤマト	11.9	13.8	9,784	日清オイログループ	15.3	18.7	56,287
飛島建設	10.5	12.3	13,161	太平電業	8.2	10.4	28,797	不二製油グループ本社	29	32	74,560
長谷工コーポレーション	121.3	137.3	200,183	高砂熱学工業	33.5	41.7	79,104	かどや製油	1	1.1	4,411
松井建設	14.7	18.4	13,082	三晃金属工業	1.6	1.7	4,236	Jーオイルミルズ	5.6	14.2	24,026
銭高組	1.2	1.7	6,834	朝日工業社	2.1	3.3	9,543	キッコーマン	85.4	106.3	932,251
鹿島建設	271.6	337.9	465,964	明星工業	24.1	29.9	20,989	味の素	282.3	325.9	1,055,590
不動テトラ	9.1	9.8	15,278	大気社	18	22.6	63,777	ブルドックソース	—	6.4	12,524
大東建設	4.9	5	6,680	ダイダン	8.2	10.3	23,257	キュービー	66	77.6	186,007
鉄建建設	7.5	10.3	18,797	日比谷総合設備	12.2	14.9	28,161	ハウス食品グループ本社	44.4	55.3	161,531
西松建設	26.5	28	104,580	フィル・カンパニー	2.1	2.8	3,166	カゴメ	48.5	56	161,840
三井住友建設	89.4	103.8	44,426	テスホールディングス	—	8.5	11,313	焼津水産化学工業	4.8	5.1	4,625
大豊建設	8.1	6.8	25,092	インプロエ・ホールディングス	—	196.5	207,111	アリアケジャパン	10.9	13.5	77,625
前田建設工業	92.9	—	—	OS J Bホールディングス	54.1	—	—	ビエトロ	1.2	1.2	2,152
佐田建設	6.7	10.2	4,773	東洋エンジニアリング	15.4	19.4	12,959	エバラ食品工業	2.4	2.5	7,075
ナカノフード建設	9.7	10.9	3,738	レイズネクスト	20	22.6	25,515	やまみ	1.1	1.7	3,010
奥村組	20.4	27.1	86,584	食料品 (3.4%)				ニチレイ	56.5	67.3	176,056
東鉄工業	16	21.5	52,481	ニッポン	35	43.5	72,949	東洋水産	61	71	342,220
イチケン	2.7	3.5	6,594	日清製粉グループ本社	134.1	167	273,212	イトーヨーカドーホールディングス	4.2	5.7	13,110
富士ビー・エス	5	5.9	2,891	日東富士製粉	0.6	1.6	6,392	大冷	1.5	2	3,816
浅沼組	4.4	5.2	28,132	昭和産業	10.1	14.3	38,181	ヨシムラ・フード・ホールディングス	6.7	7.9	4,005
戸田建設	154.1	191.4	142,401	鳥越製粉	10.8	13.7	8,863	日清食品ホールディングス	46.5	57.9	518,784
熊谷組	17.1	23.5	69,842	中部飼料	14.6	16.7	16,983	永谷園ホールディングス	6	6.9	13,461
北野建設	1.9	2.9	6,194	フィード・ワン	16.2	20.2	14,503	一正蒲鉾	4	6.2	4,811
植木組	1.6	4.1	6,076	東洋精糖	1.7	1.8	1,845	フジッコ	13	13.8	26,896
				日本甜菜製糖	6.4	8.1	13,737	ロック・フィールド	12.8	16	24,704

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
日本たばこ産業	千株	千株	千円	共和レザー	千株	千株	千円	トリケミカル研究所	千株	千株	千円
ケンコーマヨネーズ	636.5	791.4	1,851,876	昭和電工	6.8	9.2	6,127	ADEK A	9.8	14.9	44,342
からべや日洋ホールディングス	7.3	8.5	11,517	住友化学	87.9	124.8	297,398	日油	53.3	66.3	167,473
なとり	7.8	9.6	18,240	住友精化	911.2	1,057.7	619,812	新日本理化	43.6	49.2	252,888
イフジ産業	6.9	8.1	16,200	日産化学	5.7	6.4	21,184	花王	19	23.6	5,923
ビッグルスコーポレーション	2.3	2.5	2,350	ラサ工業	63.9	78.4	516,656	第一工業製薬	8.7	11	8,987
ファーマーズ	2.8	7.2	11,419	クレハ	3.8	5	8,095	石原ケミカル	283.1	325.3	1,709,126
ユーグレナ	—	14	22,848	多木化学	9.9	11.5	103,960	日華化学	3.9	5.4	15,660
紀文食品	51.2	75	54,750	テイカ	4.5	5.6	29,400	ニイタカ	3	7.5	9,915
ミヨシ油脂	—	8.6	8,187	石原産業	8.4	10.8	14,850	三洋化成工業	4.3	5	4,015
理研ビタミン	4.4	6.2	6,869	片倉コープアグリ	20.6	23.8	27,631	有機合成薬品工業	2.4	3	6,849
繊維製品 (0.5%)	11.2	15.4	26,257	日本書達	2.4	2.5	2,875	大日本塗料	6.9	8.6	44,118
片倉工業	15.6	13.8	33,092	東ソー	16.2	18.4	63,204	日本ペイントホールディングス	9.2	10.3	2,811
グンゼ	8.5	9.6	37,008	トクヤマ	178.9	207.7	396,083	関西ペイント	13.2	17.8	14,453
東洋紡	45.8	56.9	74,254	セントラル硝子	34.3	46	90,666	神東塗料	95.5	541.2	459,478
ユニチカ	33.8	39.2	11,956	東亞合成	22	23.5	49,514	中国塗料	130.1	149.3	342,792
富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	大阪ソーダ	70.7	80.1	90,352	日本特殊塗料	9.3	10	1,540
倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	関東電化工業	11.9	13.5	40,567	藤倉化成	27.9	34	30,668
シキボウ	6.6	7.9	7,244	デンカ	27.3	31.6	34,033	太陽ホールディングス	8.7	10.9	9,156
日本毛織	38.1	43.4	38,929	信越化学工業	42.2	52.4	190,474	D I C	16	18.3	8,820
ダイトウボウ	19.3	23.8	21,18	日本カーバイド工業	214.1	247.4	4,693,178	サカタインクス	8.5	21.2	68,158
トア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	堺化学工業	4.2	5.2	7,082	東チンキ&Cホールディングス	48.9	60.9	182,517
ダイドーリミテッド	16.6	20.5	2,870	第一稀元素化学工業	8.1	10	20,310	T & K T O K A	25.3	28.7	28,183
帝国繊維	13	16.3	32,811	エア・ウォーター	11.7	13.4	15,276	富士フイルムホールディングス	24.5	30.5	58,712
帝人	109	135.4	187,393	日本酸素ホールディングス	118.1	136.2	238,350	資生堂	9.4	11.7	10,120
東レ	838.4	1,042.5	699,309	日本化学工業	95.3	138.5	316,195	ライオン	207.8	258.5	1,967,702
サカイオーベックス	3.1	—	—	東邦アセチレン	3.2	4.6	12,134	高砂香料工業	235	273.9	1,642,578
住江織物	2.1	3.4	6,504	高圧ガス工業	1.9	2.6	3,302	マンダム	153.7	177.6	268,708
日本フェルト	5.5	5.9	2,643	チタン工業	58.4	72.6	74,632	ミルボン	7.4	10.3	28,953
イチカワ	1.3	1.4	1,937	四国化成工業	18.5	23.1	17,278	ファンケル	24.7	30.9	39,644
日東製綱	1.3	1.7	2,459	戸田工業	1.5	1.7	2,774	コサセ	15.8	18.3	99,735
アツギ	9.3	11.5	6,704	ステラ ケミファ	15.5	19	26,600	コーセー	43	59.6	185,356
ダイニッ	3.6	3.8	2,728	保土谷化学工業	2.4	3.2	9,968	コタセ	22.2	27.7	304,146
セーレン	28.5	29.6	61,952	日本触媒	6.3	7.2	17,978	シーボン	7	9.4	14,720
ソト	4	6.2	5,139	大日本精化工業	3.4	4.6	24,012	ボーラ・オルビスホールディングス	1.3	1.4	2,525
東海染工	1.3	1.4	1,605	ナカバ	21	24.2	144,716	ノエビアホールディングス	50.5	62.8	108,895
小松マテリア	19.1	23.6	29,877	三菱化学	9.6	12	27,108	アジパルホールディングス	10	12.6	63,252
ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	J S R	30	37.3	145,843	新日本製薬	3	3.5	3,846
ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	東京応化工業	116	133.8	285,529	エステー	2.4	4	5,300
クラフティアホールディングス	2.4	2.5	590	大阪有機化学工業	100	130.8	397,632	アグロ カネショウ	7.7	9.5	14,601
T S Iホールディングス	34.7	47.9	15,807	K Hネオケム	116.2	134.4	463,680	コニシ	4.5	5	6,515
マツカコーポレーション	3.7	4.6	5,409	ダイセル	19.9	23.3	147,955	長谷川香料	19.5	24.1	38,222
ワールド	15.1	18.9	22,264	積水樹脂	10.7	12.2	36,429	星光PMC	20.5	25.5	61,786
三陽商会	6	6.9	5,954	旭有機材	774.1	962.6	807,910	小林製薬	6.9	8.6	5,633
ナイガイ	3.8	4.1	1,160	ニチバン	19.1	23.7	72,640	荒川化学工業	33.1	41.3	391,111
オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	リケンテクノス	155.5	207.2	181,507	メック	9.9	12.3	13,849
ルックホールディングス	4	4.6	6,076	大倉工業	18.2	22.8	121,752	日本高純度化学	8.1	11	33,880
キムラタン	68.3	79.9	1,518	積水化成成品工業	244.9	301.3	583,618	タカラバイオ	3.3	4.1	10,569
ゴールドウイン	19.1	26	158,340	アイカ工業	104.5	129.8	175,489	J C U	31	38.5	88,280
デサント	19.8	28.1	97,085	宇部興産	32.2	40.1	127,317	新田セラチン	13.3	16.6	75,613
キング	4.6	6.7	3,463	三菱ケミカルホールディングス	58.4	67.8	147,058	O A Tアグリオ	7.7	9.3	6,045
ヤマトインターナショナル	10.6	13.3	3,790	タイガースポリマー	19.1	21.9	43,843	デクセリアルズ	2.3	3.2	6,425
パルプ・紙 (0.2%)				ミライアル	25.2	31.4	17,552	アース製薬	33	38.2	118,420
特種東海製紙	7.2	8.9	37,291	ダイキアクシス	6.6	8.1	17,528	北興化学工業	8.9	12.1	71,027
王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	ダイキョーニシカワ	6.2	8.6	14,852	大成ラミック	10.9	13.8	10,874
日本製紙	51.1	69	81,213	竹本容器	28.2	35.4	16,142	クミアイ化学工業	3.7	4.6	12,962
三菱製紙	17.1	21.3	6,794	森六ホールディングス	5.5	7.5	15,037	日本農業	48.8	54.8	44,223
北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	和利	15.6	19.6	8,800	前澤化成工業	21.2	26.4	14,018
中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	日本化薬	2.2	3.5	12,075	未来工業	8.2	9.4	11,637
巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	カーリットホールディングス	6.7	8.5	3,714	J S P	16.5	21.5	21,414
大王製紙	56	69.6	133,284	日本精化	3.7	4.7	6,974	エフピコ	75.7	89	775,190
阿波製紙	3	4	1,324	扶桑化学工業	4.3	5.6	3,925		14	19.1	18,106
レンゴー	119.4	136.3	117,763		24.5	30.7	18,696		12.4	15.5	5,766
トーモク	7.2	9	15,849		4.2	5.3	4,202		18.9	22.9	4,854
ザ・バック	8.7	11	29,931		6.3	7.9	15,634		10.6	13.2	54,978
化学 (6.6%)					1.7	3.6	18,504		7.8	9.5	11,789
北の達人コーポレーション	41.4	51.4	11,205		71.6	113.4	132,224		4.3	5.5	8,475
クラレ	182.3	210.4	217,764		11.5	14.3	10,052		4	5.6	3,931
旭化成	767.5	954.1	1,064,775		8.4	11.6	24,070		7	8.7	13,685
					9.1	12.9	61,081		21.8	27	91,125

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
天馬	千株	千株	千円	バンドー化学	千株	千株	千円	日本軽金属ホールディングス	千株	千株	千円
信越ポリマー	8.9	11.6	30,206	ガス・石炭 (0.8%)	20.9	24	21,216	三井金属鉱業	31.9	36.7	65,582
東リ	18.2	26.4	29,409	日東紡績	17.5	22	64,658	東邦亜鉛	31.6	39.4	128,444
ニフコ	31.1	38.8	8,691	A G C	108.6	135.1	680,904	三菱マテリアル	6.5	8.1	19,658
バルカー	43.4	49.1	168,413	日本板硝子	59.8	70.5	32,853	住友金属鉱山	77.2	95.9	199,951
ユニ・チャーム	9.7	12	30,336	石塚硝子	2.1	2.5	5,107	DOWAホールディングス	149.4	185.8	998,303
ジョーエィコーポレーション	250.8	283.4	1,248,377	日本山村硝子	5.3	5.7	4,474	古河機械金属	29.6	39.7	205,646
医薬品 (4.9%)	2.6	4	2,648	日本電気硝子	43.8	59.1	166,130	エス・サイエンス	19.3	24.1	30,438
協和キリン	119	172.7	504,802	オハラ	4.7	5.9	6,549	大坂チタニウムテクノロジーズ	54.7	69	1,587
武田薬品工業	983.7	1,155.5	3,978,386	住友大阪セメント	21.3	27.3	96,505	東邦チタニウム	12	16.7	14,345
アステラス製薬	1,025.1	1,274.7	2,576,806	太平洋セメント	70	83.5	192,634	U A C J	20.9	26.2	23,946
日本住友製薬	87.6	90.9	112,897	日本ヒューム	11	15.4	10,641	C K サンエツ	17.7	22.2	51,415
塩野義製薬	148.7	184.8	1,475,443	日本コンクリート工業	25.4	29.1	8,235	古河電気工業	2.1	3.2	12,848
わかもと製薬	14.3	17.6	5,332	三谷セキサン	5.5	6.9	44,988	住友電気工業	36.4	45.2	99,666
あすか製薬	13.4	—	—	アジアパイルホールディングス	18.5	23.3	10,298	フジクラ	407.9	543.6	848,559
日本新薬	33.5	38.5	294,140	東海カーボン	115.5	123.2	141,310	昭和電線ホールディングス	141.1	162	100,440
ヒオフェルミン製薬	2.2	—	—	日本カーボン	6.5	7.6	30,324	東京特殊電線	11.3	12.6	23,927
中外製薬	369.8	460	1,867,140	東洋炭素	7	9.5	27,559	タツタ電線	1.5	1.7	4,921
科研製薬	20.2	23.1	94,825	リタケカンパニリミテド	6.6	8.2	36,982	カネレ電気	20.6	25.7	11,590
エーザイ	130.6	176.1	1,012,927	T O T O	84.5	105	512,925	平河ヒューテック	2.2	2.8	4,253
ロート製薬	56.3	75.5	241,977	日本碍子	130	159.3	296,616	リコー	6.5	8.2	9,585
小野薬品工業	271.5	337.6	955,576	日本特殊陶業	90	111.9	246,739	アーレスティ	14.2	17.9	20,083
久光製薬	34.4	38.8	142,784	ダントーホールディングス	8.6	9.5	3,344	アサヒホールディングス	14.6	15.4	5,836
持田製薬	16.4	18.7	69,564	M A R U W A	4.1	5.1	70,482	金属製品 (0.6%)	21.9	58.3	128,376
参天製薬	205.7	274.1	362,086	品川リファクトリーズ	2.8	3.5	13,772	稲葉製作所	6.7	8.3	10,665
扶桑薬品工業	3.8	5.2	11,679	黒崎博磨	2	2.7	11,947	宮地エンジニアリンググループ	3.8	4.6	14,628
日本ケミファ	1.2	1.2	2,547	ヨータイ	8.6	9.4	12,097	トーカロ	30.2	37.6	49,632
ツムラ	39.5	45.7	153,552	イソライト工業	5.3	6.6	7,906	アルファ	4.5	4.8	5,294
日医工	33.4	45.6	34,063	東京薬業	15.7	19.4	5,975	S U M C O	149.6	223.9	444,217
キッセイ薬品工業	20.9	26.2	61,805	ニッカトー	5.4	6.8	4,168	川田テクノロジーズ	2.4	3	11,910
生化学工業	20.9	26	24,700	フジミインコーポレーテッド	9.5	11.9	79,135	R 5 Technologies	3.8	4.7	26,555
栄研化学	20.8	25.9	46,309	クニミネ工業	3.8	4.9	4,914	ジェイテックコーポレーション	1	1.6	2,529
日本水産	4.6	5.9	5,823	エーアンドエーマテリアル	2.4	3.2	2,880	信和	6.4	9.1	7,543
鳥居薬品	7.4	8	25,120	ニチアス	29.9	34.2	88,749	東亜建設グループホールディングス	74.5	92.6	140,659
J C R ファーマ	33.3	41.5	84,328	ニチハ	16.5	20.5	53,669	ホッカンホールディングス	6	8.2	11,627
東和薬品	17.1	21.1	61,823	鉄鋼 (0.8%)	—	—	—	コロナ	6.8	8.6	7,731
富士製薬工業	8.1	9.1	10,090	日本製鉄	558.1	650.6	1,279,730	横河ブリッジホールディングス	20.1	25	51,000
沢井製薬	25.9	—	—	神戸製鋼所	213.7	271.2	154,312	駒井ハルテック	2.4	2.9	6,878
ゼリア新薬工業	21.5	26.9	51,325	中山製鋼所	17.1	23.1	10,418	高田機工	0.8	0.7	1,989
第一三共	1,015	1,155.4	2,727,321	合同製鐵	6.3	7.9	10,657	三和ホールディングス	110.2	137.1	164,794
キョーリン製薬ホールディングス	26.1	29.6	54,967	ジェイ エフ イー ホールディングス	338.2	392.6	602,641	文化シヤッター	34.6	46.4	47,699
大幸薬品	14.5	22.3	14,338	東京製鐵	45.6	49.6	56,891	三協立山	15	18.9	11,623
ダイト	7.5	9.4	26,479	共英製鋼	13.1	16.5	25,789	アルインコ	7.8	10.9	9,919
大塚ホールディングス	245.8	305.5	1,249,800	大和工業	24.9	28	104,160	東洋シヤッター	2.4	2.5	1,357
大正製薬ホールディングス	28.1	35	199,150	東京鐵鋼	4.5	6.4	8,652	L I X I L	161	228.9	575,912
ペプサドリーム	60.1	77.1	155,742	大阪製鐵	6.3	7.9	9,653	日本フィルコン	8.5	10.9	5,831
あすか製薬ホールディングス	—	16.8	17,421	淀川製鋼所	15.9	19.3	50,373	ノーリツ	24.3	28	45,780
サワイグループホールディングス	—	32.2	145,061	丸一鋼管	37.9	51.5	136,063	長府製作所	12	14.9	28,980
石油・石炭製品 (0.4%)	—	—	—	モリ工業	3.5	4.5	11,403	リンナイ	22.7	27.4	277,014
日本コークス工業	100.5	123.8	17,332	大同特殊鋼	19.1	23.8	102,340	ダイニチ工業	5.7	7.2	5,133
ニチレキ	14	18.9	24,381	日本高周波鋼業	4	4.2	1,428	日東精工	15.1	18.4	9,568
ユシロ化学工業	6.8	7.9	8,500	日本冶金工業	9.1	10.8	31,968	三洋工業	1.3	1.4	2,532
ピービー・カストロール	4.3	5.5	7,155	山陽特殊製鋼	14	15	33,135	岡部	24.1	27.8	20,822
富士石油	28.8	39.4	10,086	愛知製鋼	6.6	8.2	21,197	ジーテクト	14.6	18.2	26,080
M O R E S C O	4.5	5.1	5,997	日立金属	110.3	156.7	327,189	東邦レ	21.9	27.1	33,360
出光興産	131.2	163.3	502,147	日本金属	2.9	3.6	3,880	高周波熱練	22.3	25.9	15,306
E N E O S ホールディングス	1,778.3	2,210.8	1,036,201	大平洋金属	7.8	8.9	26,619	東京製鋼	8.2	8.9	7,885
コスモエネルギーホールディングス	37.3	42.6	101,217	新日本電工	75.3	93.6	30,513	サンコール	10.3	12.9	7,198
ゴム製品 (0.7%)	—	—	—	栗本鐵工所	5.4	6.8	10,608	モリテックスチール	9	11.4	3,693
横浜ゴム	68.4	85	145,350	短 技	1.3	2.3	2,178	パイオラックス	17.3	21.6	38,750
TOYO TIRE	62.2	77.5	126,557	日本鑄鉄管	1.4	1.6	1,601	エイチワン	11.6	14.4	9,432
ブリヂストン	314.4	423.6	2,201,872	三菱製鋼	8.8	9.2	11,546	日本発条	116.4	133.7	120,330
住友ゴム工業	106	132.1	156,934	日亜鋼業	17.8	19.5	5,401	中央発條	1	7.2	5,724
藤倉コンポジット	10.8	11.9	9,674	日本精線	1.7	2.5	11,200	アドパネクス	1.6	2.2	3,260
オカモト	7.3	8.8	36,168	エンビロ・ホールディングス	5.1	4.8	8,016	立川プラインド工業	5.3	6.7	7,370
フコク	4.4	6.6	6,355	シンニッタン	14.5	18	4,230	三益半導体工業	9.1	11.5	27,370
ニッタ	12.2	15.3	43,084	新家工業	3.1	3.8	6,429	機械 (5.3%)	—	—	—
住友理工	22.8	28.7	17,220	非鉄金属 (0.8%)	—	—	—	日本ドライケミカル	3	3.8	6,623
三ツ星ベルト	14.4	17.9	38,234	大紀アルミニウム工業所	17.7	22	32,186	日本製鋼所	35.5	44.1	165,375

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
三浦工業	千株	千株	千円	千円	帝国電機製作所	千株	千株	千円	千円	三菱重工業	千株	千株	千円	千円
タフミ	50.6	63	207,585	8.3	東京機械製作所	8.3	10.6	13,939	10.6	I H I	185.7	231	737,583	231
ツガミ	39.6	49.2	70,060	4.3	新東工業	28.2	32.6	22,689	32.6	サノヤホールディングス	79.5	91.8	214,353	91.8
オクワ	24.2	31.9	41,629	10.4	澁谷工業	10.4	12.8	32,256	12.8	スター精密	15.5	17	2,227	17
芝浦機械	13.6	16.9	81,458	20.5	アイチコーポレーション	20.5	21.7	17,967	21.7	電気機器 (18.0%)	18.2	22.8	33,288	22.8
アマダ	171.2	229.4	251,651	30.1	小森コーポレーション	30.1	37.5	26,100	37.5	日清紡ホールディングス	72	89.8	88,812	89.8
アイダエンジニアリング	30.7	38.2	39,498	9.2	鶴見製作所	9.2	11.5	19,630	11.5	イビデン	56.8	77.2	465,516	77.2
滝澤鉄工所	3.9	4.8	5,726	1.9	住友精密工業	1.9	2.4	4,524	2.4	ユニカミノルタ	239.4	320.9	159,808	320.9
F U J I	46.6	67	168,103	6	日本ギア工業	6	6	1,578	6	ブラザー工業	144.3	179.5	398,490	179.5
牧野フライズ製作所	13.7	16	60,320	1.9	石井鐵工所	1.9	2.7	7,641	2.7	ミネベアミツミ	203.7	253.4	676,831	253.4
オーエスジー	57.6	67.3	136,551	49	荏原製作所	49	61.1	338,494	61.1	日立製作所	568.4	707.2	4,163,993	707.2
ダイジェット工業	1	1.1	1,083	1.2	石井鐵工所	1.2	1.2	3,584	1.2	東芝	—	256.9	1,233,120	256.9
旭ダイヤモンド工業	31	38.3	23,133	12.2	西島製作所	12.2	13.5	12,433	13.5	三菱電機	1,182.4	1,470.1	2,072,841	1,470.1
DMG森精機	73.9	86.3	149,557	12.4	北越工業	12.4	14	12,600	14	富士電機	71.2	88.6	526,284	88.6
ソディック	25.6	32.2	25,599	150.6	ダイキン工業	150.6	187.4	4,194,949	187.4	東洋電機製造	4.7	5.9	5,658	5.9
ディスコ	15.9	21.5	693,375	3.8	オルガノ	3.8	4.2	32,550	4.2	安川電機	127.3	158.4	760,320	158.4
日東工器	5.7	8.1	13,024	4.4	トーヨーカネツ	4.4	5.5	14,069	5.5	シンフォニア テクノロジー	15.4	17.7	22,319	17.7
日進工具	4.6	11.6	16,576	64	栗田工業	64	79.7	379,770	79.7	明電舎	20	24.9	61,104	24.9
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	16.9	榎本チェイン	16.9	19.4	62,856	19.4	オリジン	2.6	4	5,032	4
富士ダイス	6.4	6.8	4,182	4.6	大同工業	4.6	6.7	6,231	6.7	山洋電気	5.7	6.6	32,802	6.6
豊和工業	6.5	7.9	6,557	9.8	木村化工機	9.8	12.2	9,064	12.2	デンヨー	10.1	12.6	21,092	12.6
OKK	4.8	5.6	4,244	20	アネスト岩田	20	23	18,653	23	P H Cホールディングス	—	16.9	27,124	16.9
石川製作所	3	3.9	5,752	65.1	ダイフク	65.1	81	690,930	81	東芝テック	12.7	16	79,120	16
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613	2.9	サムコ	2.9	3.6	8,067	3.6	芝浦メカトロニクス	2.1	2.7	22,464	2.7
津田駒工業	2.4	3.4	1,975	6.4	加藤製作所	6.4	6.9	5,837	6.9	マブチモーター	32.7	34.1	122,760	34.1
エンシュウ	2.4	3.5	2,289	1.7	油研工業	1.7	1.8	3,117	1.8	日本電産	284.6	381.1	3,803,759	381.1
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	57	タダノ	57	77	74,998	77	ユ・エム・シー・エレクトロニクス	7	6.6	2,534	6.6
オプトラン	14.6	18.3	42,016	40.8	Fジテック	40.8	54.6	147,420	54.6	トレックス・セミコンダクター	6.4	7.5	19,740	7.5
N Cホールディングス	3.1	4.1	6,629	27.4	C K D	27.4	43.4	89,317	43.4	東光高岳	6	8.2	11,783	8.2
イワキ	7.6	9.4	9,428	10	キート	10	12.6	21,256	12.6	ダブル・スコープ	23.2	42.3	33,163	42.3
フリュー	11.5	12.8	16,473	32.9	平和	32.9	41.1	78,090	41.1	ダイヘン	12.9	16.1	64,319	16.1
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221	9.2	理想科学工業	9.2	12.3	27,416	12.3	ヤーマン	19.3	24	21,456	24
日阪製作所	14.8	18.3	15,060	28	S A N K Y O	28	31.8	96,513	31.8	J V Cケンウッド	101.9	119.5	22,346	119.5
やまびこ	22.6	28.3	29,941	13.2	日本金銭機械	13.2	15	9,660	15	ミキエンジニアリング	11	13.3	10,374	13.3
野村マイクロ・サイエンス	—	3.9	16,282	7.6	マースグローバルホールディングス	7.6	9.4	15,199	9.4	I P E X	5.5	6.9	11,854	6.9
平田機工	5.5	6.9	39,054	8.1	フクシマガリレイ	8.1	10.3	43,105	10.3	日新電機	27.7	34.7	50,696	34.7
ベガスミシン製造	12.2	15	8,565	5.1	オーイズミ	5.1	5.4	2,133	5.4	大崎電気工業	23.4	26.8	12,810	26.8
マルマエ	4.3	6	14,268	5.6	ダイコク電機	5.6	6.9	8,583	6.9	オムロン	98.4	122.4	1,006,984	122.4
タツモ	4.9	6.9	9,694	19.7	竹内製作所	19.7	22.4	63,212	22.4	日東工業	17.3	19.6	30,830	19.6
ナプテスコ	68.9	82.9	290,564	31	アマノ	31	38.5	84,199	38.5	I D E C	15.9	18.3	42,639	18.3
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	16.5	J U K I	16.5	20.5	15,723	20.5	正興電機製作所	2.7	4.6	4,774	4.6
レオン自動機	11.4	15.6	16,270	16.5	サンデン	16.5	20.4	3,957	20.4	不二電機工業	2.3	3.4	3,672	3.4
S M C	34.6	43.1	2,754,521	10.6	ジャノメ	10.6	12.5	9,062	12.5	ジー・エス・ユアサ コーポレーション	42.4	47.9	108,733	47.9
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530	16.3	マックス	16.3	19.7	34,947	19.7	サクサホールディングス	2.8	2.9	3,822	2.9
ユニオンツール	4.4	5.5	20,405	30.4	グローリー	30.4	37.7	78,755	37.7	メルコホールディングス	4.1	3.3	12,490	3.3
オイレシ工業	16.5	20.5	33,066	11	新晃工業	11	13.8	25,267	13.8	テクノメディカ	2.8	3.5	5,533	3.5
日精工・エス・ピー機械	3.4	4.9	14,327	19	大和冷機工業	19	21.2	23,977	21.2	ダイヤモンズエレクトロニクスホールディングス	3.4	4.1	4,374	4.1
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	107.5	セガサミーホールディングス	107.5	145.9	302,158	145.9	日本電気	150.2	186.9	949,452	186.9
技研製作所	10.3	12.8	49,792	4.5	日本ビストンリング	4.5	5.4	7,225	5.4	富士通	106.4	132.4	2,133,626	132.4
日本エアテック	3.8	6.8	7,459	5.5	リケン	5.5	6.4	17,299	6.4	沖電気工業	47.9	59.8	53,521	59.8
カワタ	3.2	4.7	5,010	16	T P R	16	19.9	29,631	19.9	岩崎通信機	4.4	6.3	5,134	6.3
日精樹脂工業	9.2	10.4	10,649	22.5	ツバキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657	32.2	電気興業	5.7	7.9	18,264	7.9
オカダアイオン	3.8	4.7	6,909	37.2	ホシザキ	37.2	43	373,240	43	サンケン電気	13.8	13.8	65,274	13.8
ワイエイシイホールディングス	4.6	5.7	7,022	9.8	大豊工業	9.8	12	8,592	12	ナカヨ	1.9	2.2	2,494	2.2
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068	242.6	日本精工	242.6	276.6	206,620	276.6	アイホン	6.8	8.5	18,156	8.5
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356	272.6	N T N	272.6	314.8	73,348	314.8	ルネサスエレクトロニクス	508.7	796.7	1,000,655	796.7
日立建機	55.3	58.9	172,577	113.3	ジェイテクト	113.3	140.9	147,663	140.9	セイコーエプソン	146.6	182.4	335,980	182.4
日工	17.6	20.4	12,444	11	不二越	11	12.6	53,109	12.6	ウコム	85.5	114	101,688	114
巴工業	4.8	5.9	13,044	32.2	日本トムソン	32.2	40.2	24,964	40.2	アルバック	21.8	29.3	172,870	29.3
井関農機	11.8	13.7	18,303	73.7	T H K	73.7	83	233,977	83	アクセル	4.9	6.3	6,545	6.3
T O W A	11	12.6	30,769	7.9	ユーシン精機	7.9	11.7	8,154	11.7	E I Z O	10	11.5	42,435	11.5
丸山製作所	2.4	3.2	4,793	4.2	前澤給装工業	4.2	11.4	11,149	11.4	ジャパンディスプレイ	404	500	19,000	500
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526	14.7	イーグル工業	14.7	18.3	19,599	18.3	日本信号	27.6	37.5	33,975	37.5
ローツェ	5.2	7.4	75,924	7.3	前澤工業	7.3	8.9	5,936	8.9	京三製作所	25.4	31.6	13,272	31.6
タカキタ	4.3	5	3,050	12.1	日本ビラー工業	12.1	14.9	46,190	14.9	能美防災	15.7	19.5	40,540	19.5
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	36.6	キッツ	36.6	49.7	33,000	49.7	ホーチキ	8.6	10.9	13,178	10.9
荏原実業	2.9	6.9	15,035	154.2	マキタ	154.2	179	711,883	179	星和電機	5.9	7.2	3,916	7.2
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	45.7	ミヅエ&Sホールディングス	45.7	53	19,610	53	エレコム	13.5	33.7	46,000	33.7
月島機械	21.8	27.3	28,310	93.7	日立造船	93.7	124.3	92,354	124.3	パナソニック	1,260.9	1,568.1	1,884,072	1,568.1

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
シャープ	千株	千株	千円		カシオ計算機	千株	千株	千円		本田技研工業	千株	千株	千円	
アンリツ	136.8	167.6	208,997		ファナック	95.1	106.5	148,780		スズキ	930.9	1,157.5	3,938,972	
富士通ゼネラル	71	94.6	149,562		日本シイエムケイ	103.8	129.1	2,875,057		S U B A R U	234.4	336.2	1,614,768	
ソニーグループ	36.2	39.9	97,994		エンプラス	25.5	28.9	16,241		安永	338.8	421.2	847,665	
T D K	740.6	921.1	11,661,126		ローム	5.3	3.6	9,478		ヤマハ発動機	5.7	7.2	6,278	
帝国通信工業	57.1	213	970,215		浜松ホトニクス	4	19.9	24,297		T B K	167.1	191.9	532,906	
タムラ製作所	5.6	6.7	9,112		三井ハイテック	49.2	65.8	604,044		エフセディ	11.8	16.9	6,929	
アルプスアルパイン	42.3	56.8	36,749		新光電気工業	84.8	105.5	612,955		豊田合成	16	22.3	37,664	
池上通信機	96.5	129.9	164,713		京セラ	11.6	14.6	124,100		菱三工業	38.2	47.4	106,507	
日本電波工業	4	5	3,215		太陽誘電	39.7	43.2	214,920		ヨロズ	18.5	23.1	17,094	
鈴木	11.5	13.3	16,651		村田製作所	180.2	206.9	1,416,437		エフ・シー・シー	1.6	1.7	1,723	
メイコー	5.3	6.8	5,882		双葉電子工業	52.5	71.3	377,177		ティ・エス テック	10.3	11.5	6,428	
日本トリム	—	12	44,700		ニチコン	347.3	431.9	3,556,264		ジャムコ	10.2	13.9	14,011	
ローランド ディー・ジー	2.5	2.9	8,816		K O A	20.3	25.1	16,892		精密機器 (2.7%)	19.3	24	34,248	
フォスター電機	7	8.7	22,985		小糸製作所	4.6	5.5	6,897		デルモ	44.3	59.1	1,533,054	
S M K	12.4	14.8	11,928		ミツバ	37.1	46.3	55,467		クリエートメディック	27.4	62.1	97,000	
ヨコオ	3.1	3.5	7,570		SCREENホールディングス	11.9	14	26,082		島津製作所	7	8.6	7,146	
ティアック	8.7	10.9	28,656		キャノン電子	16.3	22.3	32,290		J M S	362.5	416	1,724,320	
ホシデン	7.3	23.5	3,125		リコー	17.6	17.7	9,062		グボテック	4.2	4.3	4,166	
ヒロセ電機	32.2	35.4	42,480		象印マホービン	80.7	80.7	472,095		長野計器	38.2	44.1	37,529	
日本航空電子工業	18.2	22.8	393,984		MUTOHホールディングス	21.7	27	11,205		バイ・テクノロジ	6.8	8.6	13,837	
T O A	27	33.7	61,738		東京エレクトロン	20.5	25.6	288,000		愛知時計電機	152.2	189.3	779,916	
マクセル	14	16	12,432		輸送用機器 (8.7%)	10.9	13.7	22,084		インターアクション	10	12.3	7,576	
古野電気	23.4	29.3	36,039		トヨタ紡織	587.5	730.5	2,043,939		オーバル	3.1	3.3	858	
ユニデンホールディングス	15.1	17.4	18,339		芦森工業	300.7	408.1	400,754		東京精密	8.5	10.8	14,450	
スミダコーポレーション	3	3.3	11,913		ユニプレス	31.9	39.8	58,625		マニ	5.5	6.4	21,760	
アイコム	4.9	5.5	12,980		豊田自動織機	1.2	1.2	2,510		ニコン	7.5	9.4	9,559	
リオン	5	5.6	12,280		モリタホールディングス	69.3	93.3	5,156,691		オリンパス	1.2	3.7	7,074	
本多通信工業	9.4	11.9	5,712		三機工業	34.5	60	130,800		理研計器	5.9	7.5	14,685	
船井電機	13.4	—	—		デンソー	2.4	2.5	2,242		タムロン	10.7	13.3	3,564	
横河電機	118.3	147.2	274,969		東海理化電機製作所	19.3	21.9	17,936		H O Y A	19.9	24.8	112,592	
新電元工業	4.5	5.6	18,900		川崎重工業	95.7	119.2	1,060,880		シード	47	58.6	96,865	
アズビル	80	86.2	359,023		名村造船所	19	23.6	29,854		ノーリツ鋼機	180.4	224.5	292,972	
東亜ディーケーケー	6.1	7.6	6,878		日本車輛製造	32.7	38.8	59,946		イー・アンド・ディ	59.5	69.1	102,682	
日本光電工業	48.9	60.9	188,790		日産自動車	260.4	323.7	2,751,450		朝日インテック	654.2	771.1	1,744,999	
チノール	3.8	4.8	7,862		いすゞ自動車	31.2	38.8	59,946		シチズン時計	10.5	12	63,000	
共和電業	13	14.9	5,632		トヨタ自動車	91.9	107.3	233,055		リズム	9.5	11.5	28,911	
日本電子材料	4.3	7.2	16,516		日野自動車	35.7	43.7	8,827		大研医器	234.6	287	4,439,890	
堀場製作所	23.4	27.3	165,165		三菱自動車工業	4.3	5.5	11,000		メニコン	5.2	6.9	3,608	
アドバンテスト	87.9	109.3	1,007,746		エフテック	15.7	19.5	19,929		シンシア	10.6	13.2	27,508	
小野測器	4.3	6.9	3,312		レシップホールディングス	1.6	1.7	1,847		松風	9.9	13.4	12,730	
エスベック	10.5	12	24,168		G M B	1,394.4	1,733.9	1,038,432		セイコーホールディングス	124.4	161.2	312,728	
キーエンス	116	133.2	7,826,832		ファルテック	342.6	461.4	687,947		ニプロ	149.2	172.1	86,910	
日置電機	5.7	7	44,240		武蔵精密工業	1,197.8	7,450.7	16,954,067		その他製品 (2.3%)	3.1	4.6	6,026	
シスメックス	92.2	124.4	1,316,774		日産車体	147.7	183.6	194,616		中本バックス	9.5	12	6,324	
日本マイクロニクス	20.6	25.6	38,476		新明和工業	437.1	544.1	171,935		スノーピーク	18.1	48.8	132,540	
メガチップス	11.9	13.8	57,339		極東開発工業	8.4	10.3	5,562		トラザク	1.2	1.8	957	
O B A R A GROUP	7	6.8	22,236		トビー工業	4.6	5.7	3,192		糖美堂	5.5	6.4	12,268	
澤藤電機	1.3	1.8	2,649		ティラド	2.2	2.8	2,282		二ホンフラッシュ	16.6	20.7	45,602	
原田工業	5	7.5	7,357		曙ブレーキ工業	2.3	2.9	2,105		永大産業	88.1	109.6	117,052	
コーセル	14.4	16.3	13,219		タチエス	26.4	32.7	57,421		アートネイチャー	3.1	4.2	7,274	
イリソ電子工業	9.9	12.3	52,152		N O K	17.3	21.7	15,428		バウマンホールディングス	7	19.3	44,548	
オプテックスグループ	19.4	24	35,256		フタバ産業	33.3	41.7	38,072		トラザク	6.4	8.1	8,245	
千代田インテグレイ	5.1	6.4	11,936		K Y B	20.4	27.3	39,666		前田工業	3	5	2,065	
アイ・オー・データ機器	4.4	5.5	4,713		大同メタル工業	9.8	12.1	13,467		永大産業	10.1	12.6	13,393	
レーザーテック	51.9	64.5	1,435,447		プレス工業	3.7	4.2	11,919		アイフィスジャパン	13	16.3	51,426	
スタンレー電気	82.9	102.8	274,064		ミクニ	64.1	80.6	13,863		共立印刷	10.4	13.9	60,812	
岩崎電気	4.3	5.4	12,144		太平洋工業	18.1	25.7	31,122		S H O E I	15.4	19.3	17,427	
ウシオ電機	60.6	75.3	139,079		河西工業	57.2	71.2	9,207		パイロットコーポレーション	20.9	24.9	104,829	
岡谷電機産業	8.9	9.3	2,929		アイシン	29.6	36.8	487,342		萩原工業	6.7	9.6	11,529	
ヘリオス テクノ ホールディング	11.2	12.9	3,715		マツダ	13.2	15.4	406,954		トッパン・フォームズ	21.2	—	—	
エノモト	3.3	4	6,408		今仙電機製作所	24.6	28.5	5,712		フジインバータナショナル	24.3	35.7	76,540	
日本セラミック	12	13.8	34,610			58.5	73							
遠藤照明	6.7	6.9	6,817			16.1	19.6							
古河電池	8.4	10.7	13,171			24.8	30.8							
双信電機	5.8	6.4	3,718			16.2	17.7							
山一電機	7.6	10.8	23,630			86.5	107.7							
図研	7.7	9.5	28,376			370.8	461.4							
日本電子	21.6	30.8	192,500			10.4	9.6							

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
タカラトミー	52.9	61.5	71,586	東日本旅客鉄道	208.1	258.8	1,799,954	東海運	7.9	8.6	2,631
広済堂ホールディングス	8.1	9	6,993	西日本旅客鉄道	105.3	178.4	880,939	エーアイディー	7.2	8.8	12,786
エステールホールディングス	4	4	2,552	東海旅客鉄道	98.3	122.1	1,825,395	内外トランスライン	4.1	5.4	10,481
タカノ	4.5	5.4	3,758	西武ホールディングス	142.4	191.8	227,474	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
プロネクス	10.3	11.5	12,443	鴻池運輸	19	23.5	27,518	情報・通信業 (8.0%)			
ホクシン	8.5	11	1,705	西日本鉄道	32.8	40.7	103,296	NECネットエスアイ	38.3	47.8	82,789
ウッドワン	3.4	4.6	4,590	ハマキョウレックス	9.1	10.6	30,390	クロスキャット	3	3.9	6,438
大建工業	8	8.7	18,661	サカイ引越センター	5.5	6.9	30,291	システナ	41.4	205.8	74,088
凸版印刷	179.6	223.5	488,124	近鉄グループホールディングス	111.9	139.3	475,709	デジタルアーツ	6.8	7.9	51,508
大日本印刷	142.8	173.8	476,038	阪急阪神ホールディングス	149.3	174.1	600,645	日鉄ソリューションズ	17.3	20.9	75,344
共同印刷	3.7	4.6	12,479	南海電気鉄道	53.1	62.3	143,788	キューブシステム	6.2	7.5	6,982
N I S S H A	24.3	30.2	44,877	京阪ホールディングス	49.9	62.1	172,079	WOW WORLD	1.8	2.2	2,598
光村印刷	0.8	0.7	987	神戸鉄道	2.8	3.3	10,741	コア	4.9	6.4	9,888
TAKARA & COMPANY	5.8	7.4	13,912	名古屋鉄道	92.1	114.5	209,420	ラウーンホールディングス	8.2	10.3	12,318
アシックス	104.6	129.9	310,720	山陽電気鉄道	8.1	11	22,000	ソリトシステムズ	5.8	7.3	9,300
ツツミ	3	3.8	7,079	アルプス物流	—	9.9	10,038	ソフトクリエイティブホールディングス	4.5	6.4	24,128
ローランド	6.9	10.3	44,856	日本通運	38.8	—	—	T I S	116	137.6	379,638
小松ウオール工業	3.7	4.3	7,942	ヤマトホールディングス	15.7	195.2	484,681	JNSホールディングス	5.5	6.7	2,767
ヤマハ	70.3	85.5	459,135	山丸	28.7	36.6	149,145	電算システム	4.3	—	—
河合楽器製作所	3.3	4.1	12,209	丸連	7.6	8.3	2,008	グリー	71.1	65.7	55,647
クリナップ	11.4	14	7,462	丸全昭和運輸	9.1	11.5	36,627	GMOベババ	0.8	1.5	3,427
ビジョン	75.9	89	195,889	セコグループホールディングス	61.9	69.9	64,587	コエーテックホールディングス	23.7	46.1	190,623
オリバー	2.4	—	—	トナミホールディングス	2.3	3.4	12,546	三菱総合研究所	5	6.3	24,223
兼松サステック	0.6	0.6	990	ニッコンホールディングス	37.6	46.8	99,216	ボルテージ	2.8	4	1,312
キングダム	10.2	12.3	10,750	日本石油輸送	0.9	1.1	2,905	電算	1	1.1	2,476
リンテック	25.4	31.6	81,496	福山通運	14.4	23	83,950	AGS	6.1	7.2	5,803
イトーキ	23.3	26.8	9,326	セイノホールディングス	83.9	94.9	108,660	ファインデックス	9.7	12.1	11,240
任天堂	67.7	83	4,854,670	エスライン	3	3.2	2,870	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836
三菱鉛筆	19.5	24.2	29,741	神奈川中央交通	2.5	3.4	11,424	K L a b	21.2	26.3	11,440
タカラスタンダード	24.5	30.5	41,541	日立物流	24.7	26.9	144,184	ホムトウイン・ビストロホールディングス	15.4	20.9	20,628
コクヨ	56.6	70.5	119,850	丸和運輸機関	23.6	29.5	34,220	イーブイクリエイティブジャパン	1.9	—	—
ナカバシ	12.1	14	7,224	C&Fロジホールディングス	11.4	14.3	19,347	ネクソン	293.1	325.4	761,110
グローブライド	5.7	13.2	35,970	九州旅客鉄道	86.4	107.8	262,277	アイスタイル	35.3	43.7	8,871
オカムラ	45.4	50.6	60,517	S Gホールディングス	211.7	263.3	622,441	エムアールホールディングス	3	16.4	12,956
美津濃	11.7	14.7	33,236	N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	—	48.2	325,350	エイチーム	8	9.9	7,365
電気・ガス業 (1.1%)				海運業 (0.6%)				エンゲモ			
東京電力ホールディングス	1,002.3	1,100.2	392,771	日本郵船	93.6	116.4	1,080,192	テクノスジャパン	10.9	15.5	9,935
中部電力	361.8	449.8	504,675	商船三井	66.4	77.1	669,999	e n i s h	8.9	11.2	5,084
関西電力	448	557	595,990	川崎汽船	34.5	42.9	288,717	コロプラ	5.9	8.8	3,176
中国電力	170.7	229.8	200,615	N Sユニテッド海運	5.4	7.7	27,373	オルトプラス	38	47.3	32,069
北陸電力	108.1	134.6	71,607	明治海運	12.3	16.5	13,447	ブロードリーフ	6.8	11.2	3,550
東北電力	276.8	343.8	249,255	飯野海運	52.4	64.5	35,668	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,953
四国電力	98.2	132.5	103,880	共栄タンカー	2.2	2.5	2,310	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644
九州電力	261	303	249,369	乾汽船	5.9	9.4	22,080	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046
北海道電力	110.3	127.8	64,283	空運業 (0.4%)				システム情報	8.5	10.9	10,235
沖縄電力	23	31.4	44,117	日本航空	272.7	319.2	730,968	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984
電源開発	94	125.2	246,644	ANAホールディングス	302.1	353.8	914,926	じげん	28.2	40.6	12,504
エフオン	7.2	8.9	4,823	パスコ	2.2	2.8	3,687	アイキューブ	6.3	14.7	11,848
イーレックス	17.3	21.7	31,877	食・酒・観光業 (0.2%)				エンクレージ・テクノロジ	2.2	3.4	1,846
レノバ	19.9	28.7	42,906	トランコム	3.4	4	29,680	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248
東京瓦斯	227.3	281.8	647,858	日新	9	11.3	18,825	ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140
大阪瓦斯	214.1	266.1	542,045	三菱倉庫	38.7	44.1	123,921	フィックスターズ	12.2	15.4	11,180
東邦瓦斯	58.1	67.5	212,625	三井倉庫ホールディングス	11.9	14.9	35,298	CARTA HOLDINGS	4.7	5.7	11,052
北海道瓦斯	6.6	7.6	11,384	住友倉庫	40.3	49.2	102,483	オブティム	8.1	10	10,030
広島ガス	25.4	29.1	10,417	滋澤倉庫	6.3	8.5	18,122	セレス	3.8	5.3	10,054
西部ガスホールディングス	13.3	16.6	36,188	東陽倉庫	16.8	22.8	7,204	S H I F T	5.2	7.3	149,650
静岡ガス	33.5	38.4	38,246	日本トランスシティ	25.1	30.8	19,681	ディーガイア	12.3	12.7	21,272
メタウォーター	13.4	15.3	30,890	ケイビシ	1.7	2.8	3,875	セック	1.7	2.3	5,101
陸運業 (3.0%)				中央倉庫	6.4	8.8	8,544	日本アジアグループ	11.2	—	—
S B Sホールディングス	8.7	11	35,970	川西倉庫	2.1	2.9	3,169	テクノトリックス	17.9	24.3	38,102
東武鉄道	123.2	143.6	407,680	安田倉庫	9.6	12	11,520	プロシージャ	3.4	4.9	6,615
相鉄ホールディングス	40.5	47	100,298	ファイズホールディングス	2	2.9	1,771	ガホー・オンライン・エンターテイメント	27.9	37.5	91,612
東急	298.1	370.8	579,931	東洋埠頭	3	3.2	4,678	GMOペイメントゲートウェイ	24.6	28	278,880
京浜急行電鉄	151.8	188.7	223,609	宇徳	8.5	—	—	ザッパラス	4.6	5.6	2,671
小田急電鉄	189.4	218.7	444,398	上組	62.4	76.7	171,961	システムリサーチ	3.4	4	7,040
京王電鉄	66	76.3	392,945	サンリツ	2.3	4	3,360	インターネットイニシアティブ	30.9	38.5	149,765
京成電鉄	88.6	102.5	328,000	キムラユニティー	3.5	4	5,436	ざくらインターネット	12.2	15.4	7,792
富士急行	16.1	17.6	68,552	キユーソー流通システム	2.9	7.3	6,570	ウインクス	3.2	4.2	3,465
新京成電鉄	3	3.4	6,810	近鉄エクスプレス	21.2	26.3	78,374	GMOグローバルサイン・ホールディングス	2.5	3.3	11,715
								S R Aホールディングス	6.2	7.2	21,124

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
システムインテグレータ	千株	千株	千円	EDULAB	千株	千株	千円	日本電信電話	千株	千株	千円
朝日ネット	3.2	4.8	2,654	東海ソフト	1.1	—	—	KDDI	1,357.1	1,509.2	5,054,310
eBASE	9.4	13.3	8,246	ウイングアーク1st	1.4	2.4	2,198	ソフトバンク	930.4	1,051.8	3,938,991
アバント	13.8	17.2	9,718	ビット・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	8.2	11,422	エムティイーアイ	1,054.5	2,185.1	3,148,729
アドソル日進	12.4	15.5	17,654	サバーワークス	2	3.4	6,613	GMOインターネット	13.7	16.6	234,558
ODKソリューションズ	4.1	5.1	8,445	東名	—	2.6	6,125	ファイバーゲート	11.4	14.2	8,037
フリービット	2	3	1,911	ウィッツ	0.6	1.5	1,426	アイネット	41.5	51.1	127,443
コムチュア	6.9	8.6	7,808	トピラシステムズ	0.4	1.2	1,555	アイネット	3.7	4.7	5,649
サイバーコム	10.7	16.2	47,968	Sansan	1.1	2.9	2,375	アイネット	2.9	3.5	1,004
アステリア	2.1	2.4	2,613	Link-U	—	51.3	62,842	KADOKAWA	31.3	78.7	179,672
アイル	8.3	10.4	9,318	ギフティ	0.7	2.7	2,033	学研ホールディングス	15.6	20.2	21,593
マークラインズ	6.5	8	10,040	ベース	5.2	12.6	13,759	ゼンリン	21	23.4	24,242
メディカル・データ・ビジョン	4.8	7.4	17,915	JMDC	1	2.6	11,414	昭文社ホールディングス	4.4	4.6	2,014
gumi	13.2	18.3	18,702	フォーカスシステムズ	—	13.5	66,892	インプレスホールディングス	10	11.7	2,468
ショーケース	16	20	11,720	グレスコ	7.7	9.6	8,937	アイネット	6	7.6	9,750
モバイルファクトリー	2.4	3.4	1,557	フジ・メディア・ホールディングス	7.9	10.7	18,136	松竹	7.6	9.5	114,570
テラスカイ	2.4	3.3	3,392	オービック	120.1	139	174,167	東宝	68.5	85.2	405,978
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3.7	5.2	7,638	ジャストシステム	36.6	45.6	859,104	東映	3.8	4.7	82,720
PCIホールディングス	5.1	6.4	7,756	TDCソフト	16.5	20.5	101,065	エヌ・ティ・ティ・データ	309	384.2	866,755
パイプHD	4.4	6.6	6,903	Zホールディングス	10.2	12.6	13,154	ビー・シー・エー	1.7	8.6	13,261
アイビシー	2.4	2.8	7,210	トレンドマイクロ	1,593.8	2,096.9	1,214,314	ビジネスブレイン太田昭昭	4	5.1	8,828
ネオジャパン	1.9	2.6	1,716	IDホールディングス	61.9	77.1	472,623	DTS	24	27.7	71,743
PR TIMES	2.2	4	4,300	日本オラクル	4.5	9.4	7,980	スワフ・エンタテインメント・ホールディングス	49.5	67.1	397,903
ラクス	2.4	3.2	8,995	アルファシステムズ	23.5	23.4	195,624	シーエーシー	12.2	15.4	16,755
ランドコンピュータ	—	49.6	108,723	フューチャー	3.1	3.3	12,292	カプコン	49.7	136.1	393,737
ダブルスタンダード	1.5	2.5	2,052	CAC Holdings	14	30.5	44,560	アイ・エス・ビー	5.3	6.8	6,283
オープンドア	1.5	4.5	11,101	SBCテクノロジーズ	7.5	8.6	11,567	ジャステック	7.3	8.6	8,969
マイネット	6.9	8.6	14,258	オービックビジネスコンサルティング	4.2	6.4	15,507	S C S K	26.8	100	195,600
アカツキ	3.8	5.1	2,565	伊藤テクノソリューションズ	3.3	4.5	3,253	日本システムウェア	3.8	5.4	11,496
ベネフィックスジャパン	4.6	6.4	18,835	アイティフォー	11.9	13.9	60,395	アイネス	11.3	13.2	19,813
Ubicomホールディングス	0.9	1.1	2,327	東計電算	52.9	65.7	193,552	T K C	9.8	24.4	72,614
カナミックネットワーク	3	3.9	8,853	エックスネット	15.1	17.4	13,519	富士ソフト	12.3	15.4	77,000
ノムラシステムコーポレーション	10.6	15.4	6,976	大塚商会	1.8	1.7	8,117	N S D	37.3	46.5	96,487
チェンジ	5.1	7.6	1,938	サイボウズ	2.2	2.5	2,407	コナミホールディングス	42.1	52.4	366,800
シンクロ・フード	16.2	26.5	37,683	電通国際情報サービス	62.8	78	333,450	群中コンピュータホールディングス	5.3	6.7	19,999
オークネット	6.9	7.5	2,347	ACESS	13.5	19.4	27,819	J B C Cホールディングス	7.8	9.8	14,719
キャピタル・アセット・プランニング	6.1	7.7	11,711	デジタルガレージ	14.4	20.8	72,696	ミロク情報サービス	11.5	12.7	16,344
セグエグループ	1.5	2.9	2,293	エイムシステムズ	10.8	16.4	9,626	ソフトバンクグループ	920.5	865	4,627,750
エイトレード	2.9	3.8	2,200	ウェザーニューズ	19.1	23.8	88,774	卸売業 (5.6%)			
AOI TYO HOLDINGS	2.2	2.2	4,639	C I J	19.2	24	15,696	ボウスイ	0.6	0.6	501
マクロミル	12	—	—	ビジネスエンジニアリング	3.4	4.5	35,640	高千穂交易	4.7	5.9	9,410
ビーグロー	23.6	29.5	32,509	日本エンタープライズ	7.9	9.8	7,947	オルパルスクエアホールディングス	1.6	1.7	2,502
ユーザローカル	2.3	3.4	3,910	WOWOW	1.2	1.7	5,873	伊藤忠食品	2.4	3	14,835
デモナ	3.6	4.6	10,718	スカラ	11.6	14.9	2,547	エレマテック	9.4	11.7	12,296
ニーズウェル	1.8	3.3	1,402	インテリジェント ウェイブ	5.7	7	12,173	J A L U X	3.3	4.1	10,487
マネーフォワード	2.5	3.4	2,077	IMAGICA GROUP	10.3	12.7	8,509	あらた	9.3	11.6	44,660
サインポスト	2.2	3.4	2,077	ネットワンシステムズ	6.9	8.7	4,845	トーマンデバイス	1.6	2.4	15,408
電算システムホールディングス	—	22	109,340	システムソフト	10	12.2	7,112	東京エレクトロニクス	3.8	4.2	22,638
ソルグシーズ	2.6	4.6	4,135	アルゴグラフィックス	47.3	55	150,315	フィールズ	10.2	12.6	6,363
フェイス	—	6	15,768	マーベラス	25.5	30.8	3,172	双日	641.6	159.9	306,368
プロトコーポレーション	4.4	12.2	5,099	エイベックス	9	11.4	35,454	アルフレッサ ホールディングス	120.7	160.8	272,877
ハイマックス	3.6	4	2,664	日本ユニシス	18.2	22.8	16,507	横浜冷凍	30.8	41.4	35,728
野村総合研究所	10.4	15.4	19,404	兼松エレクトロニクス	19.9	24.9	33,316	神栄	1.6	2	1,794
サイバネットシステム	2.9	4	4,788	都築電気	40.3	45.1	141,388	ラサ商事	6.5	8.2	8,495
CEホールディングス	211.8	278.9	1,126,756	TBSホールディングス	6.4	8	30,800	アルコニック	12.3	15.4	20,851
日本システム技術	8.2	10.3	6,509	日本テレビホールディングス	4.3	7.5	10,515	神戸物産	80.4	112.5	396,562
インテリジェントホールディングス	6.2	7.6	3,655	朝日放送グループホールディングス	76.9	87.7	159,877	ハイパー	2	2.3	1,101
東邦システムサイエンス	2.1	2.9	6,342	テレビ朝日ホールディングス	96.6	120.4	159,891	あい ホールディングス	16.7	20.6	36,647
ソースネクスト	14.4	16.6	30,892	スカパーJ S A Tホールディングス	12.1	14.9	10,549	ディープイェックス	4	4.8	4,992
インフォコム	3	4.1	3,813	テレビ東京ホールディングス	35.8	34.7	55,832	ダイワホールディングス	10.6	70.4	115,596
シンプレックス・ホールディングス	54.7	61.7	9,810	日本 B S 放送	76.3	122	55,022	マクニコ・富士エレクトロニクス	27.7	34.5	93,046
HEROZ	10.6	15.9	30,925	ビジョン	8.5	10.6	21,571	ラクト・ジャパン	5.1	5	9,895
ラクス	—	16.8	34,809	ワイヤレスゲート	4.1	5.3	5,803	グリムス	2.5	6.6	14,031
I P S	3.2	4	3,708	USEN-NEXT HOLDINGS	14.2	24.6	25,682	メディアスホールディングス	20.6	25.2	20,286
F I G	9.4	15.9	57,876	コネクシオ	3.1	3.6	1,702	レスタールホールディングス	9.2	11	10,527
システムサポート	2.1	4	7,356	日本通信	4.4	13.8	34,817	ジョーテックホールディングス	6.8	8.5	7,556
イーンソル	12.6	16	4,528	クロップス	4.8	5.5	1,826	大光	12.2	13.8	26,937
アルティア・ネットワークス	3.4	4.3	4,136		6.7	10.4	14,653		2.3	3.6	4,186
	6.2	8.7	4,732		10.2	119.8	23,840		4.9	6.8	4,583
	12.8	18.3	25,180		2.3	2.9	2,549		3.5	3.6	4,755

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
TOKAIホールディングス	千株	千株	千円	TOUGホールディングス	千株	千株	千円	J Kホールディングス	千株	千株	千円
黒谷	56.6	70.4	63,219	スターゼン	1.8	2.3	6,175	日伝	10.7	11.7	11,629
Cominix	3.3	4	2,548	山善	4.3	10.9	22,868	北沢産業	9.7	12.1	26,111
三洋貿易	1.7	1.8	1,317	椿本興業	45.5	60.9	60,839	杉本商事	7.3	7.6	1,725
ビューティガレージ	11.6	14.7	15,199	住友商事	1.7	2.3	9,487	因幡電機産業	5.9	6.6	14,242
ワイン・パートナーズ	1.9	2.5	7,800	内田洋行	734.9	913.9	1,678,377	東テック	31.1	38.7	99,962
ミタチ産業	8.5	10.9	10,823	三菱商事	4.6	6.3	28,948	ミスミグループ本社	3.9	4.6	11,145
シッパヘルスケアホールディングス	3	4	3,604	第一実業	709	1,085.1	4,289,400	アルテック	146	181.7	630,499
明治電機工業	20.6	46.5	119,551	キヤノンマーケティングジャパン	5.3	6.7	28,542	タキヒヨー	8.8	10.3	3,162
デリカフーズホールディングス	3.1	4.7	5,757	西華産業	28.9	35.9	89,821	蔵王産業	4	4.1	5,781
スターティアホールディングス	5.2	6	3,222	佐藤商事	6.2	7.9	12,687	スズケン	1.9	2.2	4,037
コメダホールディングス	2.3	3.4	2,590	菱洋エレクトロ	10	12.1	14,023	ジェコス	49.3	56.6	200,647
ピーバンドットコム	25.4	31.6	67,782	東京産業	8.8	8.6	17,397	グローセル	8.2	10.8	8,640
アセンテック	1.5	2.4	1,521	ユアサ商事	11	13.2	9,438	小売業(4.2%)	12.9	17.1	7,609
富士興産	2.9	4.9	3,474	神鋼商事	12	13.8	40,020	ローソン	29.5	32.1	154,240
協栄産業	3.5	3.8	3,689	トルク	2.7	3.4	12,750	サンエー	8.8	11	44,935
フルサト・マルカホールディングス	1.5	1.7	2,618	阪和興業	5.8	6	1,272	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577
ヤマエグループホールディングス	—	14	30,716	正栄食品工業	23.2	28.9	95,370	エービーシー・マート	18.1	22.7	118,040
小野建	—	9.8	10,201	カナデン	7.5	9.4	38,352	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319
南陽	10.7	14.3	24,238	菱電商事	9.6	12	12,060	アスクル	10.1	32.7	54,249
佐島電機	2.1	2.3	4,473	フルサト工業	8.4	11.6	20,218	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445
エコートレーディング	7.4	9.1	8,399	岩谷産業	6.3	—	—	アダストリア	16.1	15.5	27,125
伯東	2.6	2.9	1,722	ナイス	27.9	34.8	183,744	ジーフット	7.6	10	3,170
コンドーテック	7.1	8.7	19,783	昭光通商	4.7	5.1	9,205	シー・ヴィ・エス・バイエリア	2	2.3	869
中山福	9.2	11.6	11,982	ニチモウ	3.4	—	—	くら寿司	6.9	15.1	55,115
ナガイレーベン	7.1	7.6	3,108	極東貿易	1.6	2.4	6,182	キャンドウ	5.6	5.3	10,780
三菱食品	15.5	19.3	40,916	アステナホールディングス	3	4.1	10,893	アイケイ	2.5	4	1,544
松田産業	12.9	14.2	45,298	三菱石油	15.2	20.3	8,363	バルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878
第一興商	8.5	10.7	25,209	稲畑産業	28.7	35.6	32,716	エディオン	49.3	66.3	73,924
メディカルホールディングス	17.3	27.5	91,850	G S Iクレオス	27.9	31.8	64,617	サウコーポレーション	23.9	29.6	18,766
S P K	116.7	156.2	339,266	明和産業	2.8	6.9	7,741	ワッツ	5.2	7.2	4,960
視原電気ホールディングス	5.2	6	7,668	クワザホールディングス	10.8	13.3	14,856	ハローズ	4.4	6.7	18,900
アズワン	4.4	5.4	10,675	ヤマエ電野	4.4	4.6	2,865	フジオードグループ本社	9.8	12.3	16,605
スズデン	8.3	21.1	129,132	ワキタ	8.5	—	—	あみやき亭	2.5	3.4	9,860
尾家産業	3.5	5.3	10,732	東邦ホールディングス	22.9	31	31,434	ひらまつ	21.9	30.8	5,821
シモジマ	3	3.2	3,184	サンゲツ	37.3	46.5	87,373	大黒天物産	2.7	4.7	22,419
ドウシシャ	6.5	9	9,117	ミツウロコグループホールディングス	31.5	38.4	60,364	ハニーズホールディングス	9.1	11.5	11,879
小津産業	11	13.8	20,920	シオネンホールディングス	17.1	21.3	21,917	フューライズホールディングス	3.3	4	2,860
高速	2.3	2.5	4,920	伊藤忠エネクス	4.3	5.4	17,685	アルペン	8.9	11.2	23,990
たけがし	6.3	8.8	12,944	サンリオ	26	32.1	33,448	ハバ	3.6	4.8	2,836
リックス	3.5	5.6	8,092	サンワ テクノス	32.6	44.9	105,290	クオールホールディングス	15.7	17.8	23,745
丸文	2.2	2.5	3,875	リョーサン	7.6	8.8	11,915	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528
ハピネット	10.6	12.7	9,258	新光商事	12.8	16	36,576	ビックカメラ	69	85.7	88,271
橋本総業ホールディングス	9.7	12.1	18,452	トーホー	15.9	22	19,162	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,587
日本ライフライン	2	3	6,027	三信電気	5.4	6.8	7,289	ベッパーフードサービス	13.2	19.7	6,934
タカショー	37.6	42.9	42,942	東陽テクニカ	6.4	6.8	11,131	Monotaro	82.8	183.1	337,087
マルカ	7.4	11	7,271	モスフードサービス	12.2	14.3	15,015	東京一番フーズ	2.6	4	2,372
I DOM	3.8	—	—	加賀電子	16.5	19.1	57,777	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365
進和	39.3	43.9	29,544	ソーダニッカ	10.5	13.1	12,833	きりりホールディングス	3.4	4.1	1,455
エスケイジャパン	7	8.7	17,748	立花エレクトロ	11.3	15.1	43,427	アークランドサービスホールディングス	9.7	10.8	23,727
ダイエー	2.7	3.3	1,382	フォアバル	8.7	11.7	18,532	J. フロント リテイリング	139	172.8	185,932
シークス	5	6.3	12,814	P A L T A C	4.3	6.6	6,177	ドット・ビレスホールディングス	18.4	25	40,125
田中商事	14.8	20.6	27,047	三谷産業	18.7	20.3	89,624	マツキヨコカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528
オーハンテクニカ	3.1	3.3	2,128	太平洋興発	15.6	17.1	5,232	ブロンコビルー	6.1	8.3	18,467
白鋼	6.2	8.2	11,693	西W i s m e t t a cホールディングス	5.1	5.6	3,662	ZOZO	68.7	99.8	306,386
ダイコー通産	3.6	4.7	12,502	ヤマシタヘルスケアホールディングス	2.6	3.4	10,642	トレジャー・ファクトリー	3.4	4.3	4,089
伊藤忠商事	1.1	1.7	2,012	コア商事ホールディングス	1.1	1.2	2,354	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216
丸紅	814.6	1,012.8	3,766,603	国際紙パルプ商事	3.3	10.9	6,714	ココカラファイン	10.4	—	—
高島	1,148.1	1,428.3	1,684,679	ヤマタネ	25.5	30	9,450	三好伊勢ホールディングス	203.4	253.3	236,582
長瀬産業	1.6	2.3	5,444	ヤマト建材リース	5.3	6.9	11,102	H a m e e	2.9	3.8	4,111
蝶理	65.5	79.6	144,872	日鉄物産	0.9	1.1	1,967	マーケットインタープライズ	—	1.1	860
豊田通商	7.5	8.2	14,678	泉州電業	8.3	10.4	55,224	ウエルシアホールディングス	61.5	76.6	239,758
三共生興	116.9	145.3	717,782	トラスコ中山	3.3	4.1	25,953	クワイエットSDホールディングス	17.1	21.3	66,988
兼松	18	19.6	11,074	オートバックセブエン	26.7	30.2	75,349	丸善CH1ホールディングス	15.4	18.9	6,898
ツカモトコーポレーション	46.5	53.9	69,800	モリト	43.2	48.8	68,954	ミサワ	2.4	3	1,965
三井物産	1.7	1.8	2,354	加藤産業	9	10.9	7,957	ティーライフ	1.7	2	2,630
日本紙パルプ商事	945.5	1,124.4	3,333,846	北恵	16.9	21	69,090	イー・ピーホールディングス	1.9	2.2	965
カメイ	6.1	7.7	30,684	イノテック	3.2	4	3,472	チムニー	3.5	4.6	5,349
東都水産	15.2	17.1	17,698	イエローハット	6.6	8.7	12,815	シュッピン	7.9	12	12,948
	1.4	0.6	2,361		21.9	25.1	42,017				

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
オイシックス・ラ・大地	11.5	20.8	53,185	千株	千円		ピーシーデボコーポレーション	13.6	16.9	4,867	千株	千円		パローホールディングス	23.8	32.1	72,225	千株	千円	
ネクスステージ	19.9	29.3	85,907				菅番屋	8.2	10.3	48,049				藤久	2.7	—	—			
ジョイフル本田	34.2	42.4	64,660				トップカルチャー	4.8	5.5	1,545				ベルク	5.8	6.4	34,496			
鳥貴族ホールディングス	3.3	5.3	9,714				P L A N T	3.1	3.6	2,390				大 庄	6.3	8	8,256			
ホットランド	8.6	11	14,069				スギホールディングス	23.2	28.9	194,786				ファーストリテイリング	15.6	19.4	1,242,570			
すかいらーくホールディングス	130.4	186.9	280,536				葉王堂ホールディングス	5.1	7.3	17,571				サンドラッグ	43.8	54.5	162,628			
SFPホールディングス	5.7	7.2	10,188				ウィアホールディングス	14.2	19.3	2,952				サックスバー ホールディングス	10	13.8	7,120			
綿半ホールディングス	8.8	11	14,289				スクロール	16.6	22.3	20,159				ヤマザワ	2.6	2.9	4,738			
ヨシダホールディングス	2.3	2.9	6,252				ヨンドーホールディングス	10.8	13.3	23,368				やまや	2.5	3	7,482			
コナミデジタルエンタテインメント	33.9	42.3	45,684				木曽路	15.3	19.3	42,884				ペルーナ	25	31.1	23,418			
ゴルフダイジェスト・オンライン	6	7.6	8,109				SRSホールディングス	14.6	20	16,260				銀行業 (5.6%)						
B E E N O S	5.4	7.5	13,702				千趣会	20.9	26.4	9,794				島根銀行	4.3	4.5	2,533			
あさひ	8.6	12	17,112				タカキュー	9.9	12.9	1,380				じもとホールディングス	8	10.8	7,430			
日本調剤	7.1	8.8	12,883				リテールパートナーズ	14.1	17.6	22,792				めぐみフィナンシャルグループ	604.6	751.7	208,220			
コスモス薬品	11.8	14.7	207,270				ケーヨー	21.6	26.9	22,918				東京きらびフィナンシャルグループ	14.6	18.3	30,707			
トーエル	5.7	6.8	5,861				上新電機	13.7	16.6	35,275				九州フィナンシャルグループ	238	296.3	135,705			
オンリー	2.6	—	—				日本瓦斯	19.2	70.4	117,004				ゆうちょ銀行	330.8	342.8	402,447			
セブン&アイ・ホールディングス	455.6	566.6	3,282,880				ロイヤルホールディングス	20.3	24.9	46,961				富士第一銀行	28.6	35.7	11,424			
クニエイト・レストランツ・ホールディングス	62.5	77.1	58,596				東天虹	0.6	0.6	562				コンソリア・フィナンシャルグループ	709.7	828	416,484			
ツルハホールディングス	25.4	31.6	288,192				いなげや	13	18	25,416				西武フィナンシャルホールディングス	77.6	94.6	80,788			
サマルホールディングス	9.1	11.5	18,285				チヨダ	12.2	14	10,668				関西みらいフィナンシャルグループ	54.8	—	—			
フェリシモ	2.6	3.4	4,372				ライフコーポレーション	8.8	13.5	41,242				三十三フィナンシャルグループ	10.2	13.7	21,344			
トリドールホールディングス	28.8	35.9	83,682				リンガーハット	14.4	17.9	40,650				美野北フィナンシャルグループ	19	23.6	65,584			
TOKYO BASE	10.4	13.2	5,913				Mr Ma x HD	15.9	18.2	11,156				ひろぎんホールディングス	172.2	214.3	150,652			
ウィルバスホールディングス	1.9	2.5	2,425				テンアライド	11.7	15.3	4,758				おきなわフィナンシャルグループ	—	13.1	30,418			
JMホールディングス	8.8	9.8	16,787				AOKIホールディングス	23.1	28	16,856				十六フィナンシャルグループ	—	19.5	47,541			
サツドラホールディングス	1.5	7.4	4,684				オークワ	18.2	22.8	21,500				北都フィナンシャルホールディングス	—	13.4	42,880			
アレナホールディングス	6.7	11.2	12,208				コメリ	18	22.4	61,219				新生銀行	95.1	94.6	221,458			
株式会社中ホールディングス	3	3.9	8,037				青山商事	25.7	29.7	20,582				あおぞら銀行	69.4	81	222,912			
パロックスジャパンリミテッド	8.1	10.6	9,508				しまむら	13.5	16.8	176,904				三井住友フィナンシャルグループ	7,977.2	9,093.4	6,731,844			
クサリのアオキホールディングス	11.6	14.4	98,928				はせがわ	5.2	8	2,408				りそなホールディングス	1,267.6	1,659.4	901,386			
力の源ホールディングス	5.4	7.7	4,319				高島屋	84.7	105.3	117,725				三井住友トラスト・ホールディングス	220.5	274.1	1,162,184			
FOOD & LIFE COMPANIES	63.9	84.7	300,685				松屋	25.4	29.1	21,155				三井住友フィナンシャルグループ	807.1	1,003.6	4,351,609			
メディカルシステムネットワーク	10.2	14.2	7,668				エイ・ツー・オー リテイリング	55	68.5	56,992				千葉銀行	388.8	483.8	381,718			
一家ホールディングス	—	2.7	1,422				近鉄百貨店	4.5	5.5	14,756				群馬銀行	239.8	277.9	112,271			
藤久ホールディングス	—	3.5	2,688				丸井グループ	98.5	114.3	259,918				武蔵野銀行	17.3	21.6	41,752			
はるやまホールディングス	6.1	6.9	3,519				アグリアル リテイリング	9.7	11.4	37,848				千葉興業銀行	29.8	34.5	10,005			
ノジマ	20.7	23.4	58,125				井筒屋	6.3	6.9	2,732				筑波銀行	48.4	56.9	11,778			
カッパ・クリエイト	16.4	20.4	27,478				イオン	448.1	557.2	1,481,594				七十七銀行	36.6	45.5	73,164			
ライトオン	8.8	11.2	8,064				イズミ	23.6	26.3	86,395				青森銀行	9	11.3	22,249			
ジーンズメイト	3.6	—	—				平和堂	21.5	26.8	52,474				秋田銀行	7.1	9.4	17,343			
良品計画	154.5	166.7	293,892				フジ	14.1	17.6	32,929				山形銀行	13	16.3	16,348			
三城ホールディングス	14.9	15.7	3,940				ヤオコー	13.2	16.5	109,560				岩手銀行	7.6	9.4	18,593			
アドヴァングループ	12	14.9	14,125				ゼビオホールディングス	14	19.7	18,064				東邦銀行	104.1	121.4	26,950			
アルビス	3.7	4.8	10,502				ケーズホールディングス	103.7	133.4	165,282				東北銀行	5.9	7.5	8,047			
コナカ	14.1	16.9	5,965				Olympicグループ	6	7.9	5,609				みちのく銀行	7.5	9.5	8,540			
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.2	2,026				日産東京販売ホールディングス	14.3	22.8	5,198				ふくおかフィナンシャルグループ	105.1	122	289,018			
G-7ホールディングス	6.9	16.2	24,526				シルバークライフ	1.6	3	3,264				静岡銀行	283.9	353.2	323,531			
イオン北海道	15.6	25.7	29,400				一家ダイニングプロジェクト	1.1	—	—				十六銀行	14.6	—	—			
ゴジマ	19.9	24.8	13,392				Genky DrugStores	5.1	6.4	22,848				スルガ銀行	101.6	127	63,627			
ヒマラヤ	4.3	5.1	5,232				ナリス・インターナショナル	2.3	3.4	3,910				八十二銀行	262.3	326	144,418			
コーナン商事	16.6	20.6	72,821				フックオフグループホールディングス	6.8	8.8	9,160				山梨中央銀行	13.6	16	15,472			
エコス	4.3	5.4	11,334				ギフト	1.1	2.4	5,904				千代田共立銀行	23	28.8	60,307			
ワタミ	15.3	17.6	16,227				アインホールディングス	16.9	19.4	115,818				福井銀行	10	12.5	18,587			
マルシェ	3	4	1,760				元気寿司	3.2	4.1	10,455				北國銀行	10.9	—	—			
パルパティフィ・インターナショナルホールディングス	232.8	289.5	480,859				ヤマダホールディングス	390.2	528.8	210,462				清水銀行	4.9	6.3	10,508			
西松屋チェーン	25.5	31.7	47,264				アークランドサカモト	18.2	22.8	34,884				富山銀行	1.9	2.2	4,818			
ゼンショーホールディングス	62.5	70.8	195,903				ニトリホールディングス	46.3	57.6	936,000				滋賀銀行	23.3	27.3	62,844			
幸楽苑ホールディングス	7.3	9.2	12,493				グルメ軒屋	8.4	12	12,144				南都銀行	17	22.8	46,603			
ハークスレイ	2	6.3	3,024				愛眼	7.6	8.1	1,417				百五銀行	105.2	140	51,380			
サイゼリヤ	17.2	21.5	59,340				ケーユーホールディングス	6	7.9	8,121				京都銀行	41.7	51.9	295,311			
VTホールディングス	43.9	54.6	24,897				吉野家ホールディングス	38.2	50.6	121,035				紀陽銀行	41.3	49.2	77,390			
魚力	3.5	3.9	7,979				松屋フーズホールディングス	5.6	7	25,375				ほくほくフィナンシャルグループ	77.5	90.5	87,061			
ポプラ	3.3	4.6	648				サガミホールディングス	15.7	22.3	24,061				山陰合同銀行	73.6	86.3	58,597			
フジ・コーポレーション	3.1	7.9	9,345				関西フードマーケット	8.8	11	11,506				中国銀行	100.4	116	110,316			
ユナイテッドアローズ	13.2	15.1	27,240				王将フードサービス	7.7	9.5	56,525				鳥取銀行	4	4.2	5,191			
ハイドイ日高	16.8	20.9	35,927				プレナス	13.2	16.4	33,029				伊予銀行	154.6	192.3	120,956			
YU-MA CREATION HOLDINGS	6.4	8.6	1,720				ミニストップ	8.7	11.2	16,497				百十四銀行	12.2	15.4	27,273			
コロワイド	38.6	59.5	100,436				アークス	22.1	27.7	60,940				四国銀行	16.7	22.3	18,419			

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	価 額		株 数	株 数	評 価	価 額		株 数	株 数	評 価	価 額
阿波銀行	千株	千株	千円		プレミアグループ	千株	千株	千円		テオーシー	千株	千株	千円	
大分銀行	17.8	22.3	52,895		ネットプロダクションホールディングス	5.4	7.5	28,575		東京楽天地	22.9	26.2	19,807	
宮崎銀行	6.8	8.6	17,277		クレディセゾン	—	33	34,155		レオパレス 2 1	2	2.3	8,878	
佐賀銀行	7.3	9.1	20,138		芙蓉総合リース	68	92.9	122,999		スターツコーポレーション	96.5	150.2	30,640	
沖縄銀行	6.7	8.6	13,330		みずほリース	12.2	15.3	118,116		フジ住宅	13.8	19.9	50,426	
琉球銀行	10.7	—	—		東京センチュリー	18	22.6	74,015		空港施設	13.6	17.2	11,438	
セブン銀行	25.4	31.6	26,923		日本証券金融	27.1	28.1	165,228		明和地所	12.1	15	8,220	
みずほフィナンシャルグループ	389	430.4	109,321		アイフル	49.4	57.1	51,332		ゴールドクレスト	5.5	7	4,305	
高知銀行	4.2	4.3	3,388		リコーリース	195.2	243	83,349		エスリード	10.5	11.5	21,781	
山口フィナンシャルグループ	145.4	168.7	124,669		イオンフィナンシャルサービス	9.2	12.8	48,960		日神グループホールディングス	4.6	5.7	9,707	
長野銀行	3.9	4.9	6,443		アコム	71.3	78.8	97,002		日本エスコン	17.6	23.6	11,634	
名古屋銀行	9.4	10.9	34,989		ジャックス	234.5	286	90,090		タカラレーベン	21.1	27.3	20,857	
北洋銀行	176	218.8	58,200		オリエントコーポレーション	12.8	16.1	50,634		AVANTIA	48.6	61	19,398	
愛知銀行	3.9	5.3	25,758		日立キャピタル	315.1	391.5	48,154		イオンモール	6.6	7.7	6,545	
中京銀行	4.3	5.3	9,227		オリックス	27.5	—	—		毎日コムネット	58.4	72.7	121,336	
大光銀行	3.5	3.6	5,623		三菱HCキャピタル	723.4	880.3	2,175,661		ファースト住建	3.5	5.4	3,704	
愛媛銀行	16.5	20.5	19,987		九州リースサービス	262.4	535.7	333,741		ランド	5	5.6	6,552	
トマト銀行	4.5	5.7	6,218		日本取引所グループ	6.5	7.9	4,771		カチタス	624.6	787.3	7,873	
京葉銀行	49.7	62.5	32,625		イー・キャランティ	315	367.1	877,736		トーセイ	28.9	35.9	120,624	
栃木銀行	56.1	70.5	16,779		アサックス	13.3	21.2	40,788		穴吹興産	16.1	20	20,820	
北日本銀行	3.7	4.7	8,347		NECキャピタルソリューション	6.5	8.5	5,737		サンフロンティア不動産	2.7	3.4	6,616	
東和銀行	20.5	25.9	14,892		不動産業 (1.9%)	4.8	6.2	13,559		FJネクストホールディングス	14.1	20	20,840	
福島銀行	13.2	16.8	4,233		いちご	129.6	161.7	44,305		インテリックス	11.6	14.6	14,483	
大東銀行	5.9	7.4	5,624		日本駐車場開発	115.5	158	21,488		ランドビジネス	2.7	3.5	2,163	
トモニホールディングス	90.1	112.3	38,968		スター・マイカ・ホールディングス	6.1	8	10,056		サンクススタグループ	4.4	6	1,452	
フィデアホールディングス	114	13.2	18,994		SREホールディングス	1.3	3.5	14,315		グランディハウス	3.8	5	5,290	
池田泉州ホールディングス	133.5	165.8	32,828		ADワクスグループ	22.5	30	4,200		日本空港ビルデング	8.1	10.3	5,222	
証券・商品先物取引業 (0.8%)					ヒューリック	247.2	346.1	374,134		サトーパース (5.9%)	37.2	55.3	290,878	
FPG	35.8	48.8	43,724		三栄建築設計	4.7	5.9	9,569		明豊ファシリティアワークス	5.3	6.6	4,831	
ジャフコム	5.9	11.3	13,164		野村不動産ホールディングス	70.7	75	208,575		日本工営	7.1	8.3	25,024	
マーズリアルエステイト	4.8	—	—		三井住友銀行ホールディングス	23.7	29.9	13,604		LI FUL L	39.4	43	9,933	
マーズリアルエステイト	—	5.1	2,789		サムティ	16.5	23.4	49,865		ミクシィ	21.6	32.1	75,691	
SBIホールディングス	143	178.9	543,856		ディア・ライフ	16.4	18.9	10,054		ジェイエイシリアルグループ	7.5	11.5	23,230	
日本アジア投資	10.1	11.5	2,058		コーセーアールイー	3.5	4.6	2,686		日興証券ホールディングス	92.6	230.5	398,073	
ジャフコム グループ	17.9	55.7	96,639		地主	7.3	9.2	16,127		メンバーズ	3.3	4.2	11,806	
大和証券グループ本社	873.3	1,086	777,684		フルサンスコーポレーション	19.1	18.9	38,631		中広	1.2	1.2	462	
野村ホールディングス	1,780.3	2,214.1	1,198,935		THEグローバル社	7.3	9.1	1,583		UTグループ	16.3	20.3	71,354	
岡三証券グループ	99.2	113.8	44,268		ハウスコム	1.2	1.2	1,455		アイティメディア	3.7	6.7	10,994	
丸三証券	34.6	42.9	23,423		日本管理センター	6.2	7	6,818		タケエ	12.5	—	—	
東洋証券	38.2	46.8	7,394		サンセイラントディック	3.5	4.6	3,716		E・Jホールディングス	4.4	7.5	8,595	
東海証券	123.8	165.7	69,428		エストラスト	1.3	1.4	830		夢見ヒュークスグループ	14.1	45.7	76,227	
光世証券	3	2.9	1,383		フージャースホールディングス	19	18.8	12,859		コジダカホールディングス	26.8	37.5	24,112	
水戸証券	31.2	38.7	10,874		オープンハウスグループ	36.7	46.1	261,848		アルトナー	2.8	3.6	3,200	
いちよし証券	23.2	27.3	18,591		東急不動産ホールディングス	316.7	426.9	277,485		パソナグループ	12.2	15.3	38,295	
松井証券	57.1	71.2	58,170		飯田グループホールディングス	97.2	121	296,934		CDS	2.4	2.5	3,945	
マネックスグループ	104.4	118	62,658		イーブランド	2.3	2.5	3,465		リンクアンドモチベーション	20.7	31	14,570	
極東証券	15.7	19.5	14,917		ムゲンエステート	7.3	9.4	4,587		GCA	14.6	—	—	
岩井コスモホールディングス	11.9	13.7	19,289		ビーロッド	5.4	9.9	4,732		エス・エム・エス	38.4	47.8	152,482	
アイジェ証券グループ	21.1	24	22,056		ファーストプラザーズ	2.2	3.5	2,845		サニサイドアップグループ	4	5.1	3,717	
マネポートナズグループ	12.8	15.4	3,341		And Doホールディングス	5.6	7.2	6,148		パソナホールディングス	113	140.5	417,285	
スパークス・グループ	53.8	66.7	17,342		シーアールイー	3	4	6,848		リニカル	6.5	8.1	5,532	
小林洋行	3	3.2	678		プロパティエージェンツ	1.9	1.7	2,703		クックパッド	35.6	44.1	11,554	
保険業 (2.3%)					ケイアイスター不動産	3.6	6.6	45,870		エスクリ	3.6	6.2	2,132	
かんぽ生命保険	144.5	145.9	315,435		アグレ都市デザイン	2.1	2.5	3,005		アイ・ケイ・ケイホールディングス	5.6	6.7	3,912	
SOMPOホールディングス	205.6	238.1	1,338,122		グッドコムアセット	5.5	6.4	7,046		学情	3.9	5.6	5,516	
アニコム ホールディングス	32.8	44.4	34,010		ジェイ・エス・ビー	2.2	3	8,841		スタジオアリス	5.7	6.4	13,785	
MS&ADインシュアランスホールディングス	283.3	325.2	1,349,580		テンポインバージョン	3.3	4.1	3,513		シミツホールディングス	5.6	8	12,528	
第一生命ホールディングス	616	713.7	1,973,737		グローバル・リンク・マネジメント	2	2.7	2,281		エポコ	2.8	3.3	2,336	
東京海上ホールディングス	386.6	477.6	3,384,751		フェイスネットワーク	—	1.4	1,789		NJS	2.8	2.9	5,713	
T&Dホールディングス	348.4	376.3	687,123		パーク 2 4	62.5	77.8	134,905		総合警備保障	45	55.9	228,072	
アドバンスクリエイト	2.4	7	7,161		パラカ	3.1	4	6,484		カクコム	83.5	103.1	259,812	
その他金融業 (1.2%)					宮越ホールディングス	4.4	5.5	5,214		アイロムグループ	4	5	9,995	
全国保証	30.3	34.7	176,623		三井不動産	531.4	660.9	1,646,962		セントレア・ホールディング	8.3	9.1	7,034	
あんしん保証	—	4.9	1,396		三菱地所	766	952.8	1,609,279		サイネックス	2.2	2.5	1,517	
ジェイリース	3.8	4.9	7,967		平和不動産	20	24.9	100,098		ルネサンス	7	9.8	10,495	
イントラスト	3.3	6.3	3,893		東京建物	114.9	143.1	247,133		ディップ	17.6	24.7	82,374	
日本モーゲージサービス	5.9	8.2	8,724		ダイビル	30.1	—	—		デジカルホールディングス	7.8	9.6	12,758	
CASA	3.2	5.1	4,309		京阪神ビルディング	20.1	22.6	31,504		新日本科学	13.7	17.1	28,659	
アルヒ	17.1	21.3	23,004		住友不動産	262.1	304.3	1,082,699		ツクイホールディングス	26.7	—	—	

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
キャリアデザインセンター	千株	千株	千円	リソルホールディングス	千株	千株	千円	プロレド・パートナーズ	千株	千株	千円
ベネフィット・ワン	2.5	3.6	4,194	テクノプロ・ホールディングス	0.9	1.6	7,000	and factory	1.6	3	2,436
エムスリー	41.2	51.2	153,548	アトラグループ	22.5	84.1	295,191	テノ・ホールディングス	1	3.3	1,214
ツカギ・グローバルホールディング	199.3	247.9	1,042,667	インターワークス	2.5	2.6	676	フロンティア・マネジメント	0.9	2	1,206
プラス	9.5	8.5	2,380	アイ・アールジャパンホールディングス	3.5	4.5	1,687	ゴパ・ホールディングス	2	3.6	2,350
アウトソーシング	1.5	2.2	1,392	Keep Per 技研	4.6	6.6	32,505	ビアラ	0.6	2.3	1,258
ウェルネット	64.7	80.5	108,514	ファーストロジック	7.3	9	16,929	ギークス	0.6	2.9	3,204
ワールドホールディングス	11.5	14.3	6,263	三機サービス	2.2	2.9	2,166	カープスホールディングス	1.5	2.6	3,803
ティーン・エヌ・エー	3.9	5.6	13,484	Gunosy	2.3	3	2,907	フォーラムエンジニアリング	31	38.7	27,244
情報堂DYYホールディングス	47.8	53.6	95,783	デザインワン・ジャパン	6.8	8.8	6,274	FAST FITNESS JAPAN	5.8	9.9	8,613
ぐるなび	157.2	195.6	350,124	イー・ガーディアン	3.5	3.6	673	ダイレクトマーケティングミックス	—	2	4,224
タカミヤ	19.6	22.9	8,724	リブセクス	4.9	5.6	14,795	ポピンズホールディングス	4.4	15.2	21,964
ジャパネットホスピタリティシステム	14.1	17.6	7,128	ジャパネットマテリアル	6.2	8.7	1,400	LITALICO	2.3	3.4	8,493
ファンコミュニケーションズ	8.9	9.4	8,610	ベクトル	34.8	43.2	71,625	アドバテッジシステムマネジメント	—	11.5	35,190
ライク	31.3	35.1	13,267	ウチヤマホールディングス	14	19.7	20,448	リログループ	5.7	7.2	5,184
ビジネス・ブレイクスルー	3	3.8	6,805	チャーム・ケア・コーポレーション	5.8	7.4	2,412	東祥	61.7	76.9	158,337
エス・グループ	5.1	5.5	2,304	キャリアリンク	8.4	10.6	12,084	TREホールディングス	7.1	10.6	16,472
WDBホールディングス	28.9	39.7	39,342	IBJ	3.6	5.1	8,573	人・夢・技術グループ	—	19.4	28,731
手間いらず	5.2	6.6	18,513	アサンテ	9.1	11.5	8,728	エイチ・アイ・エス	—	5.6	10,102
ティア	1.1	1.8	8,496	N・フィールド	4.1	6.4	10,419	共立メンテナンス	16.4	31.3	64,165
CDG	7.2	8.7	3,801	M&Aキャピタルパートナーズ	7.6	—	—	イデックスホールディングス	3.2	4.1	11,836
アドウェイズ	1.3	1.4	1,912	ライオンシステムホールディングス	4.5	5.6	13,904	建設技術研究所	18.7	25	103,875
パルコム	13.7	20.9	15,863	ER1ホールディングス	9.3	11.6	55,042	長 大	11.8	14.6	18,804
インフォマート	7.5	11.2	39,032	アビスト	4.3	5.4	8,262	スバース	7.3	8.5	20,102
JPホールディングス	114.3	153.9	97,880	シグマシステムホールディングス	2.8	4	4,660	燃ホーディングス	7.7	10.4	9,505
エコナックホールディングス	32.6	35.7	8,246	ウィルグループ	1.8	2.2	6,435	スバル興業	4.5	—	—
EPSホールディングス	20.7	26	2,288	エスコロー・エージェンツ・ジャパン	6.2	8.6	19,049	東京デリアル	4.7	6.3	9,714
CLホールディングス	15.3	—	—	メドピア	8.2	10.4	13,176	タナベ経営	0.7	0.7	5,537
プラステック・インターナショナル	2.7	3	3,594	レアジョブ	16.6	18.9	3,553	ナガワ	4.6	5.4	6,615
アミューズ	42.2	52.4	37,832	リクルートホールディングス	5.3	10.9	30,498	よみうりランド	2.2	4.8	3,028
ドリームインキュベータ	6.2	7.7	16,216	エラン	1.6	2.8	2,282	東京競馬	3.6	4.6	43,608
クワイック	3.5	3.9	8,088	土本管理総合試験所	809.3	1,083.7	6,140,244	常盤興産	0.6	—	—
TAC	7	9.6	15,801	ネットマーケティング	15.6	19.4	19,826	カナモト	7.3	10.7	46,224
ケネディクス	6.3	8.6	1,952	日本郵政	5.7	6.9	2,187	東京ドーム	4.7	5.4	7,317
電通グループ	32.3	—	—	ベルシテム24ホールディングス	5.4	6.9	3,029	西尾レントオール	19.9	24.8	57,015
ティクアンドザ・ニーズ	127	144.8	605,988	鎌倉新書	855.3	1,834.3	1,880,157	アゴラ ホスピタリティ・グループ	44.5	—	—
ぴあ	5.2	6.7	6,880	SMN	18.9	20.1	28,642	トランス・コスモス	10.4	12.9	36,894
イオンファンタジー	3.2	4.9	16,415	一蔵	11.4	16	8,400	NTT-CTホールディングス	71.2	75.2	1,654
シーティーエス	4.3	5.4	11,718	LITALICO	2.4	3.4	2,046	日本管財	10.8	17.9	57,101
ネクシースグループ	12.6	16	12,976	グローバルキッズCOMPANY	1.7	2.3	899	トーカイ	48.3	60.2	57,671
H.U. グループホールディングス	3.5	5	3,445	エアトリ	4.6	—	—	白洋舎	4.4	6.2	15,196
アルプス技研	31.7	36.7	108,411	アトラエ	2.1	2.7	2,130	セコム	6	8.7	12,754
サニックス	10	12.6	23,347	ストライク	6.1	9	27,270	セントラル警備保障	12.2	15.1	42,083
ダイオーズ	17.7	24.4	4,733	ソラスト	3.4	9.8	20,482	丹青社	11	12.5	22,887
日本空調サービス	2.2	3.5	3,475	セラク	4.2	5.3	21,995	メイテック	1	1.7	2,050
オリエンタルランド	12.2	15	11,730	インソース	27.7	34.5	36,570	応用地質	111.3	138.5	1,147,749
ダスキン	120.1	166.1	3,474,812	ベイカレント・コンサルティング	3.5	4.6	5,602	船井総研ホールディングス	5.4	6.8	16,109
明光ネットワークジャパン	26.2	32.6	89,650	Orchestra Holdings	9.4	13.7	26,112	進学会ホールディングス	21.1	28.7	20,635
ファルコホールディングス	14.2	16.5	9,322	アイモバイル	7.4	9.9	402,435	オオバ	13.8	17	113,900
秀英予備校	5.4	6.8	14,048	キャリアインデックス	2.5	2.8	7,834	いであ	13.2	16	34,160
田谷	2.8	3.6	1,519	MS-Japan	4	4	4,660	学究社	23.1	28.8	66,643
ラウンドワン	1.7	1.8	991	船場	4.6	4.8	3,609	パネッセルホールディングス	4.9	5.1	1,672
リゾートトラスト	38.5	39.2	57,310	グレイステクノロジー	4.5	5.7	5,061	イオンディライト	7.9	10.2	7,405
ビー・エム・エル	51.7	64.4	123,390	フルテック	1.6	1.7	1,269	ナック	2.7	3.9	6,953
ワタベウェディング	14.6	18.2	66,339	グリーンズ	5.7	—	—	ダイセキ	3.4	4.7	7,219
りらあコミュニケーションズ	1.7	—	—	ツナググループホールディングス	44.5	71,422	—	ステップ	41.4	46.8	106,516
リソー教育	17.1	21.3	21,917	GAMEMITH	2.2	2,893	—	合計	124,117.8	161,644	387,140,847
早稲田アカデミー	57.3	64.3	26,105	ソウルドアウト	4.2	5.3	2,501	銘柄数<比率>	2,183銘柄	2,174銘柄	<97.4%>
ユー・エス・エス	4.4	8	8,104	MS&Consulting	1.7	3.4	1,030				
東京個別指導学院	126.4	157.3	299,656	ウェルビー	3.5	4.3	1,917				
サイバーエージェント	9.9	12.3	7,699	エル・ディー・エス	2.7	3.5	3,174				
楽天グループ	69.6	346.2	508,221	ミダックホールディングス	1.9	2.4	1,576				
クリーク・アンド・リバーサ	526.6	721.4	705,529	日総工業	—	9.1	11,129				
モーニングスター	5.8	7.5	13,087	キュービーネットホールディングス	0.8	1.8	4,152				
デー・オー・ダブリュ	12.4	24.7	14,424	RPAホールディングス	2.4	6.2	15,710				
山田コンサルティンググループ	19.8	24.8	7,489	スプリックス	8.7	11	8,558				
セントラルスポーツ	6.6	7.5	8,565	マネジメントソリューションズ	5.2	6.6	11,180				
フルキャストホールディングス	4.2	5.2	12,844		12.8	19.7	7,052				
エン・ジャパン	9.8	12	26,460		3.2	4	5,788				
	20.1	22.9	66,341		5.5	6.9	22,770				

(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 10,035		百万円 －

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
株式	千円 387,140,847	% 96.9	
コール・ローン等、その他	12,580,070	3.1	
投資信託財産総額	399,720,917	100.0	

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	399,670,143,174円
コ	株	11,420,891,042
株	未	387,140,847,090
未	差	11,243,540
入	収	655,237,202
入	委	441,924,300
入	配	2,333,527,720
入	証	909,720
入	約	2,332,618,000
(B) 負	債	397,336,615,454
未	払	124,570,625,521
未	払	272,765,989,933
純	資	124,570,625,521円
元	次	31,896円
受	益	
1	万	
口	当	
た	り	
基	準	
価	額	
(C/D)		

(注1)	期首元本額	102,105,610,506円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
	追加設定元本額	163,179,331,486円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
	一部解約元本額	140,714,316,471円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,092,602円
(注2)	期末における元本の内訳		4資産分散投資・モドルクラス<DC年金>	105,875,155円
	MHAMスリーウェイクオープン	561,857,238円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	985,477円
	MHAM TOP I Xオープン	2,725,686,605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)	22,944,960円
	MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	7,087,968,915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)	23,431,080円
	One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253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)	21,508,092円
	D IAM国内株式バッシブ・ファンド	4,704,569,337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)	14,273,870円
	MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,424,028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)	22,637,856円
	MITO ラップ型ファンド (中立型)	23,972,661円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI2021-04 (適格機関投資家限定)	193,585,816円
	MITO ラップ型ファンド (積極型)	78,308,323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	41,677,610円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	28,249,023円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	84,110,969円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,103,225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) 21-07	68,984,011円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,896,115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) 21-08	47,924,787円
	たわらノーロード TOP I X	1,306,069,812円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	22,733,018円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,033,861,326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) 21-09	49,987,822円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	40,906,841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) 21-12	70,694,127円
	たわらノーロード バランス (標準型)	262,619,504円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	329,597,803円
	たわらノーロード バランス (積極型)	394,664,404円	D IAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	34,825,039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)	3,669,806円	日米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)	116,640,502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)	174,139,046円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	39,121,859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)	434,342,242円	リスクコントロール世界8資産/バランスファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	7,907,522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)	283,511,087円	D IAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	57,045,218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)	405,598,982円	D IAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	101,888,672円
	たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	705,164円	D IAM国際分散/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,956,036円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,916,286円	D IAM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	26,722,042円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	36,588,931円	D IAM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,712,676円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,020,593円	D IAM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,338,373円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	19,092,798円	D IAM世界/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	7,152,634円
	D IAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円	D IAM世界/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,835,196円
	One グローバルバランス	5,199,858円	D IAM/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	557,427,217円
	D IAM/バランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,065,319,872円	D IAM/バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	634,827,723円
	D IAM/バランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,512,005,009円	D IAM/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,809,585,772円
	D IAM/バランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,794,173,475円	D IAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	31,302,882円
	D IAM DC バランス30インデックスファンド	343,318,358円	D IAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	31,388,733円
	D IAM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円	D IAM アスク グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	301,727,428円
	D IAM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187円	D IAM世界アセット/バランスファンドVA (適格機関投資家限定)	74,733,048円
	マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,317,366円	D IAM世界/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,406,645円
	マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,055,563,450円	D IAM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	349,638,985円
	マネックス資産設計ファンド エポリューション	18,529,124円	D IAM世界アセット/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,826,049円
	D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	304,544,955円	D IAM世界アセット/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	73,311,471円
	D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	306,459,778円	D IAM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	173,199,524円
	D IAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	545,764,310円	D IAM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	237,769,545円
	投資のソムリエ	13,743,021,171円	D IAM世界/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	38,321,734円
	クルーズコントロール	128,837,057円	D IAM国内/バランス30VA (適格機関投資家限定)	18,177,991円
	投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円	D IAM世界アセット/バランスファンド7VA(121) (適格機関投資家限定)	291,737,796円
	D IAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円	D IAM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)	936,557,239円
	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円	D IAM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)	1,240,495,959円
	D IAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,701,235円	D IAM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)	49,936,955円
	D IAMコア資産設計ファンド (積極型)	5,513,567円	動的パッケージ・アセット・ファンド<DC年金>	19,960,341円
	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円	コア資産形成ファンド	13,478,680円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円	MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	692,612,483円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	41,503,360円	MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	65,067,969円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円	MHAM動的パッケージ・アセット・ファンド (適格機関投資家限定)	2,686,127,829円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,618,660円	MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,050,559,819円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円	期末元本合計	124,570,625,521円
	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円	(注3) 担保資産	
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円	代用として担保を提供している資産はありません。	
	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円		

■損益の状況

当期 自2021年2月9日 至2022年2月7日

項 目					当 期
(A)	配当	等配	収当	益	7,296,744,510円
	受取		金当		7,292,821,896
	受取	利	息		44,549
	その	他の	収益	金	6,677,036
	支払	利	息		△2,798,971
(B)	有価証券	売買	損益		△7,496,155,473
	売買		益		39,449,298,775
	売買		損		△46,945,454,248
(C)	先物取引	等取引	損益		654,522,360
	取引	引	益		1,686,367,190
	取引	引	損		△1,031,844,830
(D)	当期損益	金(A + B + C)			455,111,397
(E)	前期繰越	損益	金		216,481,029,551
(F)	解約差損益	金			△309,165,756,529
(G)	追加信託差損益	金			364,995,605,514
(H)	合計(D + E + F + G)				272,765,989,933
	次期繰越	損益	金(H)		272,765,989,933

(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20期（決算日 2022年2月15日）

（計算期間 2021年2月16日～2022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20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年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
	円	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			
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
20期(2022年2月15日)	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8	642,642

(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

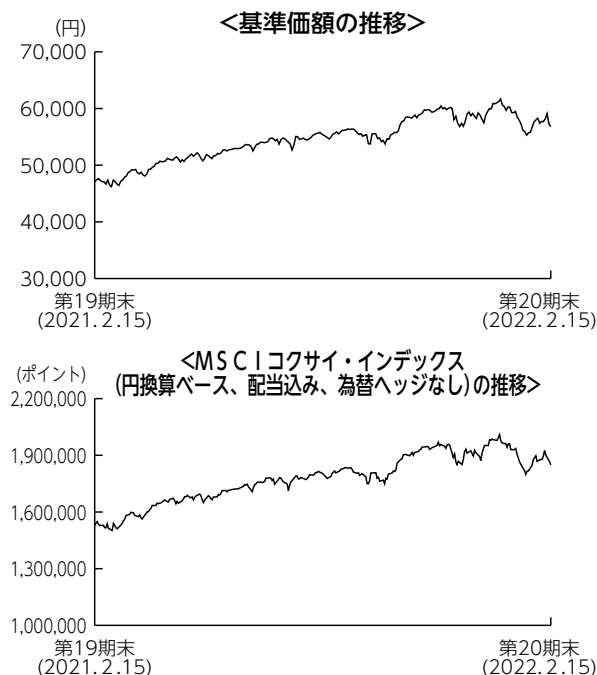
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 15 日	円 47,083	% ー	ポイント 1,529,401.79	% ー	% 95.5	% 2.5
2 月 末	46,501	△1.2	1,513,956.06	△1.0	95.5	2.4
3 月 末	49,621	5.4	1,611,609.95	5.4	94.8	3.1
4 月 末	51,949	10.3	1,687,947.89	10.4	94.9	3.0
5 月 末	52,709	11.9	1,713,776.65	12.1	95.8	2.2
6 月 末	54,024	14.7	1,757,211.68	14.9	94.2	3.6
7 月 末	54,788	16.4	1,782,621.67	16.6	95.5	2.3
8 月 末	56,137	19.2	1,826,693.61	19.4	95.9	1.8
9 月 末	54,830	16.5	1,784,539.69	16.7	90.4	1.7
10 月 末	58,844	25.0	1,915,338.44	25.2	95.7	2.2
11 月 末	58,620	24.5	1,907,177.99	24.7	94.2	3.1
12 月 末	61,010	29.6	1,986,097.70	29.9	95.7	2.9
2022 年 1 月 末	56,736	20.5	1,847,457.63	20.8	95.5	2.3
(期 末) 2022 年 2 月 15 日	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8

(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（2021年2月16日から2022年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は56,820円となり、前期末比で20.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

金融緩和策の急速な転換への懸念や新型コロナウイルス変異株の感染拡大などにより、先進国株式市場が調整する場面はあったものの、新型コロナウイルスへの警戒感後退や経済活動正常化への期待などから主要国の株式市場が上昇したことに加え、為替市場でも米ドルなど多くの通貨が対円で上昇したことがプラス寄与となり、当ファンド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。前半は新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動正常化や、米国の経済対策法案への期待などから堅調に推移しました。その後はインフレ加速への懸念や、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから下落する場面もありましたが、良好な企業

決算や新型コロナウイルスへの警戒感後退などから堅調に推移しました。期末にかけては金融緩和策の急速な転換への懸念や、ウクライナ情勢の緊迫化を受け不安定な値動きとなりました。

為替市場では、米ドルは新型コロナウイルス変異株の感染拡大による景気悪化への懸念などからリスク回避姿勢が強まり、対円で弱含む局面もありましたが、経済活動正常化やインフレ率上昇により金融緩和策の転換が意識されたことなどから対円で上昇しました。ユーロやイギリスポンドなども対円で上昇しました。

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	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



期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.8%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.5
3	銀行	6.4
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
5	メディア・娯楽	6.1
6	資本財	5.8
7	小売	5.1
8	各種金融	4.7
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	ヘルスケア機器・サービス	4.5

（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G I C S（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20.9%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		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 受 益 証 券) (投 資 証 券)	3円 (3) (0) (1) (0) (0)	0.006% (0.005) (0.000) (0.001) (0.000) (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、組入有効証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 受 益 証 券) (投 資 証 券)	14 (14) (0) (0)	0.025 (0.025) (0.000) (0.000)	(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)	22 (0) (22)	0.040 (0.000) (0.040)	(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	39	0.071	
期中の平均基準価額は54,626円です。			

(注 1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注 2) 比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2021年 2 月 16 日から 2022年 2 月 15 日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 204,724.74 (△1,530.59)	千アメリカ・ドル 2,595,140 (△5,237)	百株 172,588.72	千アメリカ・ドル 2,211,299
	カ ナ ダ	百株 24,833.91 (423.14)	千カナダ・ドル 166,598 (△95)	百株 22,900.88	千カナダ・ドル 140,622
	オーストラリア	百株 42,059.1 (683.68)	千オーストラリア・ドル 102,911 (△235)	百株 41,195.94	千オーストラリア・ドル 88,861
	香 港	百株 47,840 (511.64)	千香港・ドル 227,627 (△99)	百株 42,535.6	千香港・ドル 192,452
	シ ン ガ ポ ー ル	百株 17,787 (2,093.13)	千シンガポール・ドル 11,615 (△444)	百株 14,922.13	千シンガポール・ドル 9,359
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	百株 2,577.86 (－)	千ニュージーランド・ドル 1,704 (－)	百株 1,816.58	千ニュージーランド・ドル 1,007
	イ ギ リ ス	百株 196,421.44 (△153.18)	千イギリス・ポンド 115,835 (1,106)	百株 178,461.82	千イギリス・ポンド 102,958

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	イ ス ラ エ ル	百株 1,689.86 (-)	千イスラエル・シュケル 7,297 (-)	百株 1,206.41	千イスラエル・シュケル 5,097
		百株 12,180.84 (-)	千スイス・フラン 103,265 (△222)	百株 11,124.7	千スイス・フラン 89,715
		百株 3,322.56 (1,469.61)	千デンマーク・クローネ 197,176 (-)	百株 3,551.28	千デンマーク・クローネ 179,121
		百株 3,334.59 (-)	千ノルウェー・クローネ 49,197 (-)	百株 2,771.78	千ノルウェー・クローネ 38,408
		百株 20,824.18 (6,804.24)	千スウェーデン・クローナ 405,047 (-)	百株 17,585.4	千スウェーデン・クローナ 316,601
	ユ ー ロ	百株 749.41 (-)	千ユーロ 5,589 (-)	百株 631.07	千ユーロ 4,649
		百株 11,228.93 (950.19)	千ユーロ 62,517 (△86)	百株 9,414.88	千ユーロ 51,688
		百株 1,043.4 (-)	千ユーロ 6,196 (-)	百株 889.01	千ユーロ 5,172
		百株 1,209.38 (-)	千ユーロ 2,642 (-)	百株 854.02	千ユーロ 1,800
		百株 17,424.9 (1,088.41)	千ユーロ 102,391 (-)	百株 17,283.63	千ユーロ 91,357
		百株 16,409.95 (1,451.76)	千ユーロ 87,638 (△343)	百株 15,207.49	千ユーロ 77,479
		百株 824.54 (-)	千ユーロ 856 (-)	百株 406.68	千ユーロ 507
		百株 31,251.38 (22,513.82)	千ユーロ 23,204 (△77)	百株 49,233.07	千ユーロ 19,370
		百株 35,574.5 (-)	千ユーロ 17,142 (△2)	百株 36,788.57	千ユーロ 14,890
		百株 5,643.53 (-)	千ユーロ 8,720 (-)	百株 5,301.59	千ユーロ 7,189
		百株 497.64 (-)	千ユーロ 2,000 (-)	百株 365.79	千ユーロ 1,468

(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	ス イ ス	証券 －	千スイス・フラン －	証券 87,844 (－)	千スイス・フラン 28 (－)

(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	
	□ 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
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7.915 (－)	1,611 (－)	6.133 (－)	1,247 (－)
BOSTON PROPERTIES INC	4.07 (－)	473 (－)	2.216 (－)	274 (－)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	－ (－)	－ (－)	22.693 (－)	657 (－)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	81.1 (－)	686 (－)	58.509 (－)	493 (－)
PROLOGIS INC	46.303 (－)	6,342 (－)	40.623 (－)	5,636 (－)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9.677 (－)	2,226 (－)	8.65 (－)	2,022 (－)
CAMDEN PROPERTY TRUST	12.453 (－)	1,811 (－)	11.656 (－)	1,653 (－)
EQUINIX INC	6.083 (－)	4,781 (－)	5.373 (－)	4,212 (－)
DUKE REALTY TRUST	12.617 (－)	708 (－)	9.24 (－)	546 (－)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28.217 (－)	5,245 (－)	25.02 (－)	4,595 (－)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.092 (－)	988 (－)	2.464 (－)	802 (－)
EQUITY RESIDENTIAL	30.821 (－)	2,566 (－)	31.532 (－)	2,583 (－)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23.858 (－)	795 (－)	19.455 (－)	665 (－)
SBA COMMUNICATIONS CORP	6.199 (－)	2,128 (－)	5.486 (－)	1,933 (－)
WELLTOWER INC	32.254 (－)	2,651 (－)	29.921 (－)	2,444 (－)
IRON MOUNTAIN INC	3.849 (－)	175 (－)	－ (－)	－ (－)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22.487 (－)	1,784 (－)	22.001 (－)	1,743 (－)
HOST HOTELS & RESORTS INC	44.413 (－)	716 (－)	32.749 (－)	518 (－)
MID AMERICA	5.789 (－)	1,109 (－)	4.944 (－)	931 (－)
REALTY INCOME CORP	41.631 (18.05)	2,829 (－)	35.88 (－)	2,454 (－)

	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
REGENCY CENTERS CORP	3.639	260	3.473	270
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	38.514	2,062	37.282	1,986
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	21.117	2,879	17.329	2,452
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	10.449	3,254	9.007	2,855
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	5.79	1,099	4.394	857
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	19.098	1,052	13.711	712
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	23.728	1,062	21.319	914
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	48.016	1,759	39.928	1,479
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	8.076	1,464	6.463	1,122
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	19.54	3,025	15.672	2,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	76.011	1,576	75.842	1,601
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	50.845	783	52.553	814
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	23.054	1,081	17.984	838
	(△25.604)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	28.174	7,568	23.609	6,307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	20.944	1,621	17.027	1,295
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	47.749	1,885	43.017	1,704
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	5.738	100
	(5.738)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	43.226	1,246	32.427	906
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	4.337	241	4.071	223
	(-)	(-)	(-)	(-)
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
MIRVAC GROUP	84.707	247	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	49.06	236	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	49.463	231	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	119.11	1,246	126.88	1,329
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	122.45	2,770	112.622	2,653
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	179.768	543	120.66	390
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	212.6 (-)	14,716 (-)	213.1 (-)	14,405 (-)
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	295.4 (57.741)	611 (89)	291.6 (-)	604 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	478 (-)	1,446 (△6)	522 (-)	1,533 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	- (-)	- (-)	192.1 (-)	272 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	473 (-)	849 (△4)	258.6 (-)	480 (-)
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
BRITISH LAND CO PLC	76.052 (-)	389 (-)	70.101 (-)	371 (-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.185 (-)	127 (-)	- (-)	- (-)
SEGRO PLC	53.28 (-)	602 (-)	33.876 (-)	385 (-)
ユーロ（フランス）	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	1.093 (-)	145 (-)	- (-)	- (-)
KLEPIERRE	- (-)	- (△17)	- (-)	- (-)

(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 213,419	百万円 216,105	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	744,105,008千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	572,165,051千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.30

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月16日から2022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	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	
AMAZON.COM INC	380.64	444.06	137,806	15,905,674	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,585.92	1,727.2	21,206	2,447,661	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	567.35	654.52	1,404	162,118	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	39.87	42.71	1,240	143,170	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	798.02	873.09	11,363	1,311,548	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,053.11	1,223.07	13,976	1,613,112	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	429.77	464.19	22,003	2,539,594	ソフトウェア
CHUBB LTD	406.4	429.3	8,674	1,001,252	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	198.54	216.51	5,271	608,471	化学
ALLEGHANY CORP	12.63	12.56	844	97,447	保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	—	—	—	バイオテクノロジー
ALLSTATE CORP	283.81	305.8	3,816	440,487	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	627.86	674.78	12,597	1,453,999	コングロマリット
AMGEN INC	524.53	552.91	12,400	1,431,220	バイオテクノロジー
HESS CORP	247.76	269.32	2,551	294,467	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	616.15	655.69	12,612	1,455,699	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	450.17	484.16	4,172	481,588	電力
AFLAC INC	582.83	624.14	4,008	462,629	保険
AMERICAN INTL GROUP	754.5	830.45	4,898	565,422	保険
AMERCO	9.29	9.29	536	61,889	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	335.79	518.67	7,986	921,799	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	192.19	—	—	—	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	653.14	696.42	4,631	534,532	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	374	422.88	3,794	437,912	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	79.7	83.94	2,661	307,237	ソフトウェア
APPLE INC	15,286.24	16,106.99	272,014	31,395,953	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	818.51	881.06	11,617	1,340,909	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	95.36	111.8	2,545	293,797	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	517.45	544.75	4,146	478,604	食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	92.78	—	—	—	電力
AMEREN CORP	222.73	254.36	2,165	249,926	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	66.51	62.95	784	90,508	電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	75.7	—	—	—	自動車部品
AUTODESK INC	198.42	214.23	4,860	561,042	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	386.31	413.9	8,359	964,905	情報技術サービス
AUTOZONE INC	21.6	20.86	4,014	463,378	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	76.27	80.95	1,471	169,841	容器・包装
BALL CORP	288.47	315.98	2,915	336,548	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,250.78	1,292.71	40,627	4,689,201	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	702.98	794.62	4,884	563,772	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	443.26	484.18	4,137	477,529	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	260.87	280.24	7,535	869,765	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	200.08	226.36	2,946	340,062	電気設備
VERIZON COMM INC	3,685.67	4,048.08	21,564	2,488,930	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	125.11	128.04	1,145	132,251	保険
BEST BUY CO INC	215.6	212.38	2,137	246,697	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	18.59	23.24	1,443	166,569	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	273.93	286.66	3,480	401,667	ホテル・レストラン・レジャー

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	
FIRSTENERGY CORP	478	518.27	2,111	243,701	電力
BOEING CO	481.42	542.08	11,385	1,314,154	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	111.11	112.38	1,343	155,106	専門サービス
BORGWARNER INC	219.38	209.23	894	103,262	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,290.98	1,387.96	5,930	684,527	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	117.19	123.82	1,104	127,492	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	106.87	107.92	1,803	208,104	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.08	22.29	3,156	364,326	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,018.55	2,157.51	14,414	1,663,701	医薬品
ONEOK INC	392.84	420.2	2,643	305,158	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	80.93	74.44	1,011	116,694	保険
UNITED RENTALS INC	61.81	69.35	2,172	250,737	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	261.13	310.48	4,195	484,246	総合公益事業
FEDEX CORP	224.18	247.48	5,653	652,576	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	87.62	103.4	2,208	254,871	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	262.07	581.23	4,377	505,221	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	260.85	297.33	1,973	227,767	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	971.36	599	69,174	メディア
CSX CORP	686.59	2,203.61	7,474	862,723	陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	314.16	785.16	1,823	210,517	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	166.23	203.34	895	103,336	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	196.41	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	146.75	164.21	3,840	443,218	飲料
CARDINAL HEALTH INC	247.18	290.05	1,516	175,054	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	471.45	763.02	1,629	188,112	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	486.12	532.89	10,651	1,229,446	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	102.58	1,330	153,538	ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	99.33	115.3	1,175	135,687	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	921.88	913	105,445	各種電気通信サービス
CERNER CORP	272.58	285.28	2,614	301,809	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,725.45	2,913.79	44,432	5,128,385	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	212.87	245.63	2,396	276,616	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128.72	144.65	1,728	199,477	保険
CINTAS CORP	80.99	89.31	3,308	381,917	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,769.58	4,107.04	21,841	2,520,915	通信機器
CLOROX COMPANY	117.85	114.55	1,637	188,999	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,644.71	4,005.62	24,306	2,805,410	飲料
COPART INC	186.28	203.22	2,494	287,871	商業サービス・用品
COGNEX CORP	146.77	162.62	1,028	118,717	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	712.97	784.14	6,215	717,346	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	256.86	265.14	4,542	524,311	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	52.03	55.04	1,692	195,352	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	210.39	227.63	880	101,624	電力
COMCAST CORP-CL A	4,081.73	4,460.29	21,141	2,440,183	メディア
CONAGRA BRANDS INC	461.45	454.72	1,605	185,267	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	298.44	340.89	2,830	326,646	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	259.36	272.38	1,699	196,142	総合公益事業
COOPER COS INC	50.31	47.32	1,851	213,742	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	165.13	169.84	839	96,858	飲料
CORNING INC	710.11	838.66	3,462	399,679	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	133.82	847	97,785	容器・包装

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		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	
HEICO CORP-CL A	62.36	74.77	855	98,761	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	137.18	139.26	3,055	352,714	機械
DR HORTON INC	322.07	327.87	2,719	313,905	家庭用耐久財
DANAHER CORP	572.81	625.65	16,986	1,960,569	ライフサイエンス・ツール/サービス
MOODY'S CORP	151.99	163.35	5,283	609,865	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	470.43	512.62	4,420	510,252	情報技術サービス
TARGET CORP	449.86	474.94	9,905	1,143,330	複合小売り
DEERE & CO	267.97	286.89	11,110	1,282,327	機械
MORGAN STANLEY	1,216.65	1,330.94	13,651	1,575,650	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	191.36	215.52	2,555	294,946	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	34.38	412.01	2,718	313,810	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,619.66	1,767.79	26,667	3,077,918	娯楽
DOLLAR TREE INC	219.16	231.67	3,172	366,222	複合小売り
DOVER CORP	126.52	141.72	2,283	263,614	機械
OMNICOM GROUP	196.63	203.13	1,721	198,675	メディア
DTE ENERGY CO	177.93	184.19	2,137	246,713	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	642.05	753.03	7,526	868,712	電力
DARDEN RESTAURANTS INC	109.02	133.37	1,912	220,774	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	614.91	628.16	3,654	421,817	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	6,976.37	7,384.33	35,016	4,041,603	銀行
CITIGROUP INC	1,867.17	1,979.43	13,155	1,518,383	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	122.29	133.26	1,608	185,631	化学
EATON CORP PLC	364.97	390.25	5,938	685,414	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	246.39	268.13	3,809	439,702	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	214.2	226.45	701	80,945	メディア
ECOLAB INC	230.5	252.97	4,627	534,056	化学
PERKINELMER INC	97.55	118.35	2,143	247,422	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	251.42	275.61	3,676	424,357	娯楽
SALESFORCE.COM INC	815.12	953.48	19,679	2,271,445	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	411	47,526	保険
EMERSON ELECTRIC CO	522.99	583.88	5,486	633,277	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	115.03	124.29	1,317	152,034	ガス
ENTERGY CORP	171.95	188.13	1,965	226,910	電力
EOG RESOURCES INC	540.41	567.51	6,436	742,858	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	103.22	116.63	2,577	297,470	専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	202.15	226.64	6,886	794,834	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	139.42	163.66	1,751	202,138	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,789.44	4,127.07	32,595	3,762,184	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	114.16	121.83	1,410	162,763	化学
NEXTERA ENERGY INC	1,752.42	1,911.83	14,323	1,653,210	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	32.46	38.74	1,549	178,868	資本市場
FAIR ISAAC CORP	24.82	28.1	1,439	166,186	ソフトウェア
ASSURANT INC	55.23	55.23	894	103,262	保険
FASTENAL CO	504.82	549.13	2,851	329,071	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	636.46	666.81	3,216	371,193	銀行
M&T BANK CORP	114.32	121.75	2,196	253,519	銀行
FISERV INC	514.04	576.52	5,643	651,379	情報技術サービス
FORD MOTOR CO	3,423.19	3,805.63	6,644	766,923	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	276.05	839	96,859	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,269.73	1,425.79	6,052	698,577	金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	-	11.92	917	105,937	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	179.22	200.01	3,067	354,010	保険
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	202.22	1,082	124,963	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	215.99	231.98	4,898	565,410	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	538.66	588.18	3,977	459,124	食品
GENUINE PARTS CO	133.93	136.11	1,729	199,608	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,130.1	1,218.49	7,446	859,439	バイオテクノロジー
GARTNER INC	75.22	88.55	2,555	294,941	情報技術サービス
MCKESSON CORP	142.89	150.01	4,060	468,642	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	552.38	2,433.72	59,059	6,816,599	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,857.77	1,070.26	10,338	1,193,294	コングロマリット
VWV GRAINGER INC	42.34	41.48	1,934	223,289	商社・流通業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	—	309.23	1,708	197,194	ソフトウェア
HALLIBURTON CO	774.83	838.43	2,713	313,152	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	345.68	386.22	3,189	368,076	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	293.78	329.9	11,884	1,371,687	資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	189.69	193.75	4,259	491,575	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	113.83	121.84	1,152	132,977	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	115.16	143.58	1,088	125,599	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	36.23	35.96	500	57,725	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	136.22	152.45	3,100	357,810	食品
HP INC	1,251.84	1,162.73	4,245	489,972	コンピュータ・周辺機器
F5 INC	55.29	55.57	1,076	124,301	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	120.24	123.36	1,460	168,523	容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	352.9	1,192	137,632	通信機器
HOLOGIC INC	240.09	243.1	1,709	197,280	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	963.81	1,028.3	36,150	4,172,538	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	162.88	198.15	1,783	205,857	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	262.54	290.21	1,377	158,972	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	490.65	611.05	1,644	189,789	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	34.21	898	103,747	建設関連製品
HUMANA INC	119.37	125.74	5,276	609,019	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	75.44	87.52	1,684	194,444	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	938.57	1,419.2	2,228	257,172	銀行
BIOGEN INC	144.18	143.44	3,071	354,493	バイオテクノロジー
IDEX CORP	72.94	73.32	1,405	162,211	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	275.8	307.86	6,747	778,781	機械
INTUIT INC	233.97	266.2	14,083	1,625,495	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	77.82	82.25	4,157	479,914	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	—	—	—	バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	218.91	230.51	3,491	402,939	建設関連製品
INTEL CORP	3,802.57	3,947.83	18,783	2,168,023	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	199.06	239.91	3,157	364,433	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	319.83	343.88	1,589	183,489	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	353.17	369.48	1,296	149,599	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	110.33	131.48	1,586	183,121	専門サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	68.74	77.48	1,318	152,187	情報技術サービス
INCYTE CORP	159.42	179.58	1,185	136,840	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,351.55	2,569.27	42,547	4,910,787	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	334.76	328	2,284	263,717	保険
KLA CORPORATION	141.3	147.87	5,399	623,224	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	560.14	624.62	3,264	376,761	石油・ガス・消耗燃料

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	
KELLOGG CO	219.54	265.78	1,720	198,629	食品
KEYCORP	875.97	916.12	2,373	273,968	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	308.61	326.7	4,324	499,137	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	136.68	147.89	11,244	1,297,808	資本市場
KROGER CO	712.62	684.81	3,128	361,137	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	130.86	138.76	7,746	894,075	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	33.02	44.17	1,841	212,560	電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	84.38	105.55	1,551	179,108	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	141.53	152.64	1,688	194,939	情報技術サービス
PLUG POWER INC	—	526.24	1,129	130,405	電気設備
LENNAR CORP	258.81	264.83	2,399	276,903	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	771.11	791.98	18,586	2,145,309	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	—	269.67	1,483	171,282	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	180.9	170.02	1,206	139,210	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	633.18	709.53	15,183	1,752,448	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	284.52	292.04	3,948	455,755	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	225.05	244.24	9,451	1,090,875	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	217.59	223.94	1,368	158,003	保険
LOWE'S COS INC	679.92	674.34	15,236	1,758,621	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	733.73	787.03	6,197	715,357	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	458.5	387	1,727	199,440	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	215.14	249.05	2,500	288,603	食品
MCDONALD'S CORPORATION	664.19	727.78	18,441	2,128,485	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	215.72	233.63	8,894	1,026,606	資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	34.16	42.82	1,255	144,868	保険
MARKEL CORPORATION	12.01	14.47	1,787	206,344	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	561.91	605.91	6,527	753,400	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	442.08	495.58	7,518	867,778	保険
MASCO CORP	231.51	232.33	1,330	153,518	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	52.58	58.93	2,174	251,016	建設資材
METLIFE INC	679.99	714.43	5,010	578,288	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235.91	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,200.14	1,313.85	13,441	1,551,475	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	696.43	756.57	6,166	711,684	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,175.45	1,287.35	13,259	1,530,435	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	2,257.06	2,465.91	18,856	2,176,453	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	366.51	413.6	2,426	280,029	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	85.88	92.82	2,531	292,129	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	6,425.29	6,957.86	205,256	23,690,747	ソフトウェア
MICRON TECH INC	999.6	1,090.85	9,802	1,131,390	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	218.94	533.22	3,795	438,133	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	612.87	—	—	—	半導体・半導体製造装置
3M CO	515.39	566.66	8,953	1,033,446	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	59.63	857	98,984	家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	—	136.39	1,719	198,413	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	—	54.58	1,787	206,274	ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	150.06	163.01	3,485	402,275	通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	83.46	—	—	—	陸運・鉄道
ILLUMINA INC	131.34	142.46	4,693	541,705	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	465.91	516.15	3,427	395,571	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	80.58	97.13	840	96,995	バイオテクノロジー

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	
NETAPP INC	198.04	212.2	1,862	215,016	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	333.17	404.89	1,008	116,457	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	726.65	774.43	4,983	575,190	金属・鉱業
NOVAVAX INC	－	78.86	631	72,916	バイオテクノロジー
NVR INC	3.05	3.38	1,682	194,199	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,116.09	1,245.17	17,630	2,034,896	繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	46.44	47.87	1,063	122,719	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	229.57	242.35	6,598	761,594	陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	305.69	328.72	2,702	311,911	電力
NISOURCE INC	314.27	420.35	1,194	137,836	総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	173.65	200.11	2,431	280,647	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	136.98	148.6	5,804	669,934	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	3,503.46	4,001.7	23,149	2,671,953	銀行
NUCOR CORP	288.6	282.85	3,319	383,107	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	191.9	231.2	2,702	311,922	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	417.51	430.6	6,680	771,043	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	852.06	902.66	3,721	429,554	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	87.12	95.78	2,815	324,959	陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	－	－	－	電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	65.76	66.72	4,410	509,055	専門小売り
ORACLE CORP	1,782.61	1,632.21	12,886	1,487,336	ソフトウェア
PACCAR INC	304.46	359.38	3,341	385,677	機械
PTC INC	94.33	110.92	1,241	143,271	ソフトウェア
EXELON CORP	853.23	956.45	4,036	465,860	電力
PARKER HANNIFIN CORP	119	125.93	3,792	437,702	機械
PAYCHEX INC	298.42	313.87	3,718	429,216	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	65.29	73.03	3,692	426,235	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	713.2	734.82	2,083	240,444	電力
PEPSICO INC	1,235.16	1,349.24	22,491	2,596,007	飲料
PENTAIR PLC	155.64	163.39	963	111,189	機械
PFIZER INC	4,971.81	5,460.72	27,194	3,138,775	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	229.37	215.43	972	112,190	水道
CONOCOPHILLIPS	1,233.91	1,306.12	11,957	1,380,137	石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,239.99	1,524.96	1,720	198,540	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	181.44	222.38	4,982	575,071	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,673.74	1,796.13	8,996	1,038,412	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	382.89	415.17	8,493	980,277	銀行
BROWN & BROWN INC	203.08	217.93	1,437	165,962	保険
GARMIN LTD	123.65	145.29	1,754	202,506	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	206.85	230.64	3,442	397,363	化学
IPG PHOTONICS CORP	33.53	33.53	491	56,765	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	394.44	429.9	21,777	2,513,503	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	200.07	218.51	3,149	363,527	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	119.26	124.93	1,627	187,870	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,223.79	2,369.3	37,136	4,286,284	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	528.87	569.36	6,047	697,964	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	445.03	490.59	3,177	366,752	総合公益事業
PULTE GROUP INC	243.05	238.14	1,138	131,438	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	271.25	283.31	4,163	480,553	情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,010	1,096.16	18,100	2,089,204	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	107.44	197.29	2,159	249,299	資本市場

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	
EXACT SCIENCES CORP	139.11	179.82	1,408	162,572	バイオテクノロジー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	40.52	—	—	—	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	95.04	101.93	6,355	733,568	バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	60.97	—	—	—	保険
RESMED INC	132.86	140.92	3,292	379,982	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,226.62	1,379.88	7,985	921,670	銀行
SEAGEN INC	102.96	128.63	1,601	184,853	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	343.83	370.32	1,719	198,409	保険
ROSS STORES INC	311.97	342.98	3,233	373,184	専門小売り
ROLLINS INC	185.67	191.56	590	68,186	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	91.27	103.18	4,562	526,605	コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	107.18	111.67	2,996	345,900	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	158.79	212.92	1,761	203,359	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	110.04	128.97	1,090	125,843	化学
ACCENTURE PLC-CL A	568.7	618.55	20,172	2,328,341	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,278.63	1,364.94	9,027	1,041,978	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	117.94	124.53	2,725	314,573	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	221.48	241.52	4,124	476,042	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	557.29	599.27	6,681	771,220	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	36.87	39.84	10,141	1,170,579	ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,309.4	1,365.54	5,366	619,409	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,376.29	1,406.74	12,342	1,424,598	資本市場
POOL CORP	35.32	43.36	1,955	225,677	販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	181.87	200.7	2,347	271,004	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	133.04	135.81	1,369	158,052	食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	102.94	611	70,575	資本市場
ANTHEM INC	226.07	238.09	10,570	1,220,045	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	138.36	149.22	2,091	241,431	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	250.38	257.42	1,909	220,428	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	73.88	243.75	6,592	760,958	化学
CENTENE CORP	509.9	563.86	4,624	533,726	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	45.32	56.17	3,491	402,946	銀行
SMITH (A.O.) CORP	113.51	140.37	999	115,403	建設関連製品
SNAP-ON INC	48.25	57.83	1,218	140,643	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	372.26	375.64	4,349	502,066	保険
ADVANCE AUTO PARTS	62.26	56.94	1,277	147,397	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	350.41	362.4	2,176	251,220	電力
SOUTHERN CO	923.98	1,035.27	6,817	786,847	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,215.55	1,291.44	8,136	939,065	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	117.91	132.2	599	69,243	旅客航空輸送業
AT&T INC	6,363.97	6,960.38	16,739	1,932,097	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,721.63	1,886.45	25,782	2,975,771	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	140.26	153.85	2,528	291,806	機械
STATE STREET CORP	324.04	351.58	3,469	400,437	資本市場
STARBUCKS CORP	1,049.03	1,144.57	10,718	1,237,175	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	219.29	1,351	155,937	金属・鉱業
STRYKER CORP	304.36	331.3	8,297	957,686	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	394.98	430.24	17,062	1,969,299	娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	552.31	1,628	187,927	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	158.87	873	100,797	陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	133.81	147.52	4,351	502,221	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)	当期		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	
SYSCO CORP	421.71	496.62	4,071	469,965	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	105.44	346.96	9,754	1,125,856	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	40.02	44.66	1,417	163,577	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	1,057.57	901	103,999	医薬品
TERADYNE INC	142.84	154.54	1,735	200,327	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	818.5	895.92	14,556	1,680,054	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	194.86	206.83	1,418	163,668	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	354.62	382.78	21,481	2,479,363	ライフサイエンス・ツール／サービス
GLOBE LIFE INC	105.78	91.68	953	110,081	保険
DAVITA INC	64.97	64.97	738	85,224	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	104.62	109.61	2,388	275,707	専門小売り
BIO-TECHNE CORP	—	42.2	1,745	201,472	ライフサイエンス・ツール／サービス
TRIMBLE INC	224.42	260.37	1,714	197,891	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	34.73	39.35	1,838	212,228	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	249.8	277.88	2,636	304,307	食品
UGI CORP	200.72	184.69	692	79,917	ガス
UNION PACIFIC CORP	605.64	637.38	15,459	1,784,353	陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,372.1	1,472.36	13,776	1,590,126	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	849.87	920.02	43,645	5,037,592	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	77.37	1,022	118,073	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	81.39	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	287.12	356.87	2,137	246,686	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	493.63	570.34	1,997	230,597	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	239.38	250.92	5,802	669,669	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	121.7	126.76	2,330	269,042	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	668.71	704.44	3,336	385,067	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,264.14	1,502.63	20,127	2,323,142	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	383.57	406.53	5,763	665,208	商業サービス・用品
WATERS CORP	52.11	57.5	1,828	211,078	ライフサイエンス・ツール／サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	204.18	1,248	144,132	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	70.09	71.03	2,725	314,551	ライフサイエンス・ツール／サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	103.06	99.44	1,366	157,733	食品
VAIL RESORTS INC	35.9	41.8	1,134	130,957	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	258.67	293.01	1,548	178,768	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	162.57	170.97	1,495	172,627	機械
WHIRLPOOL CORP	56.56	57.37	1,128	130,194	家庭用耐久財
SKYWORX SOLUTIONS INC	153.31	159.24	2,145	247,626	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	86.39	120.04	1,105	127,549	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	100.97	110.34	1,897	218,960	資本市場
CME GROUP INC	321.8	348.92	8,345	963,193	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,125.35	1,163.01	3,498	403,777	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	236.91	287.85	1,547	178,643	販売
ALLIANT ENERGY CORP	228.29	238.72	1,357	156,694	電力
WEC ENERGY GROUP INC	290.02	305.23	2,735	315,763	総合公益事業
CARMAX INC	142.09	152.87	1,696	195,780	専門小売り
XILINX INC	214	253.18	4,934	569,595	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,081.5	1,168.23	7,942	916,757	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	45.61	56.09	2,391	276,060	電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,087	620	71,638	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	206	204	1,228	141,815	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	—	—	—	コングロマリット

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	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	102.39	108.82	1,617	186,717	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	—	56.1	1,858	214,564	銀行
CBRE GROUP INC	296.17	323.38	3,175	366,564	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	145.97	404	46,634	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	855.82	974.23	2,388	275,716	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	36.41	38.08	1,640	189,305	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	37.37	40.44	1,752	202,255	半導体・半導体製造装置
T-MOBILE US INC	499.8	607.01	7,618	879,336	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	302.77	367.69	1,699	196,109	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	325.92	385.15	1,718	198,353	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32.09	39.59	1,466	169,221	資本市場
CELANESE CORP	115.88	109.17	1,683	194,260	化学
DEXCOM INC	87.06	93.5	3,805	439,225	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	153.62	130.68	384	44,374	メディア
EXPEDIA GROUP INC	115.08	136.45	2,690	310,524	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	202.05	1,443	166,649	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	106.14	108.96	3,279	378,479	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23	943	108,933	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	487.85	551.66	6,886	794,888	資本市場
LIVE NATION	138.04	153.12	1,765	203,717	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	23.26	27.13	4,242	489,726	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	47.45	50.93	3,212	370,770	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	798.24	858.46	32,120	3,707,306	情報技術サービス
WESTERN UNION CO	353.67	448.68	888	102,537	情報技術サービス
OWENS CORNING	99.65	97.4	881	101,705	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	128.66	123.03	1,074	124,052	専門サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	188	21,747	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	99.59	117.8	1,706	196,931	情報技術サービス
DELTA AIR LINES INC	147.23	147.23	617	71,320	旅客航空輸送業
INSULET CORP	55.66	64.81	1,591	183,687	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	269.75	286.45	3,556	410,498	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	289.3	318.46	4,570	527,568	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	45.05	54.04	1,213	140,083	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	108.17	114.58	3,593	414,783	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	74.64	213.2	2,634	304,100	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	40.41	43.13	4,826	557,050	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	45.38	52.74	1,912	220,754	専門小売り
INVESCO LTD	334.43	369.04	842	97,200	資本市場
MSCI INC	76.17	79.74	4,249	490,523	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,392.7	1,520.6	16,611	1,917,245	タバコ
VISA INC	1,505.8	1,644.41	37,055	4,276,903	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	484.8	709.52	2,703	312,011	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	169.15	173.37	2,566	296,213	水道
DISCOVERY INC-C	304.21	303.88	891	102,871	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	595.87	618.96	4,899	565,521	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	117.44	127.87	1,141	131,707	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,859.92	1,960.57	3,370	388,990	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	172.22	170.83	1,524	175,995	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	246.36	261.91	2,623	302,749	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.84	34.82	631	72,847	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	146.41	156.99	1,961	226,442	ソフトウェア

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EPAM SYSTEMS INC	53.33	53.99	2,310	266,678	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC	53.66	76.58	439	50,690	不動産管理・開発
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	148.14	—	—	—	資本市場
HCA HEALTHCARE INC	236.31	250.49	5,897	680,635	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	136.44	146.24	2,805	323,756	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	52.57	61.52	875	101,049	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	78.06	73.99	1,810	208,963	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	149.86	169.47	2,910	335,986	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	243.75	258.51	4,805	554,614	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	116.67	136.87	1,017	117,423	専門サービス
LEAR CORP	46.81	52.16	872	100,683	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	104.72	105.27	1,269	146,507	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	202.43	215.54	1,619	186,930	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	218.25	225.66	4,526	522,502	複合小売り
FORTINET INC	121.46	134.08	4,161	480,282	ソフトウェア
HORIZON PHARMA PLC	189.86	204.15	1,969	227,359	バイオテクノロジー
TESLA INC	667.04	819.66	71,782	8,285,141	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	54.02	59.93	1,620	187,073	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	101.63	122.17	1,758	202,953	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,164.31	1,267.27	6,133	707,938	自動車
XPO LOGISTICS INC	76.14	—	—	—	陸運・鉄道
ALLY FINANCIAL INC	338.57	374.66	1,811	209,037	消費者金融
VOYA FINANCIAL INC	135.03	—	—	—	各種金融サービス
APTIV PLC	236.97	260.18	3,554	410,209	自動車部品
PHILLIPS 66	399.51	424.28	3,840	443,280	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	71.72	86.28	815	94,077	ソフトウェア
META PLATFORMS INC	2,150.14	2,321.43	50,537	5,833,041	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	168.96	185.72	4,455	514,244	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	157.27	2,051	236,830	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	172.89	192.63	11,164	1,288,600	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	84.6	94.41	4,918	567,745	ソフトウェア
WORKDAY INC	155.26	186.02	4,333	500,218	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,581.52	1,721.56	24,618	2,841,445	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	426.6	460.53	9,046	1,044,111	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	383.72	854	98,675	メディア
CDW CORP	127.68	129.43	2,279	263,072	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	381.27	404.34	1,377	159,001	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	119	158.35	3,099	357,694	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	62.46	77.32	1,010	116,586	ソフトウェア
SNAP INC	822.23	1,027.74	4,071	469,979	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	418.52	3,202	369,585	ソフトウェア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	195.46	221.57	1,380	159,298	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	83.24	421	48,671	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	143.46	725	83,767	メディア
OKTA INC	106.51	116.92	2,214	255,607	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	130.42	167.75	1,099	126,877	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	572.74	779.09	2,223	256,639	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	131.81	—	—	—	食品
ALTICE USA INC-A	215.06	—	—	—	メディア
BROADCOM INC	360.27	398.94	23,081	2,664,109	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	67.99	73.05	1,228	141,782	ソフトウェア

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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MONGODB INC	41.88	61.01	2,623	302,746	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	56.02	68.61	1,540	177,852	専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	358.24	404.49	1,016	117,322	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	118.32	132.96	3,030	349,786	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	690.05	829.81	2,961	341,826	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	159.85	906	104,647	電気設備
EVERGY INC	210.39	223.98	1,386	160,048	電力
ALLEGION PLC	90.22	89.24	1,055	121,880	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	114.54	133.6	934	107,863	ソフトウェア
STERIS PLC	73.9	96.49	2,185	252,305	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	152.47	185.2	2,236	258,176	ソフトウェア
WIX.COM LTD	49.18	55.67	626	72,363	情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	281.7	687	79,301	ソフトウェア
KKR & CO INC	472.67	503.37	3,048	351,905	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	—	—	—	医薬品
FUTU HOLDINGS LTD ADR	—	47.58	209	24,229	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	155.78	209	2,969	342,760	ソフトウェア
MODERNA INC	240.31	334.13	4,760	549,439	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	258.78	266.16	4,030	465,195	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	186.32	213.87	769	88,816	ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	—	571.24	1,013	117,030	娯楽
CIGNA CORP	331.16	331.11	7,457	860,793	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	205.86	277.83	1,628	187,913	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	647.07	722.56	4,395	507,309	化学
AMCOR PLC	1,461.49	1,618.22	1,872	216,098	容器・包装
PINTEREST INC	420.97	521.77	1,289	148,810	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	178.7	254.18	834	96,314	レジャー用品
FOX CORP-A	317.51	346.81	1,479	170,802	メディア
FOX CORP-B	130.09	150.8	584	67,445	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	—	408.46	672	77,599	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	130.78	182.31	3,292	380,022	ソフトウェア
CHEWY INC	65.86	90.68	477	55,084	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	445.09	486.39	1,719	198,507	ライフサイエンス・ツール/サービス
LYFT INC	—	245.89	983	113,494	陸運・鉄道
DYNATRACE INC	159.49	194.17	829	95,740	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	132.18	225.54	2,380	274,791	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	70.65	98.86	815	94,067	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	750.77	798.71	3,577	412,906	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	375.35	422.26	3,367	388,679	機械
INMODE LTD	—	55.11	251	29,005	ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	838.27	1,191.09	4,119	475,528	陸運・鉄道
CORTEVA INC	686.39	717.05	3,649	421,258	化学
MATCH GROUP INC	215.66	253.22	2,881	332,540	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	325.12	—	—	—	ソフトウェア
BILL.COM HOLDINGS INC	—	78.3	1,879	216,897	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	585.87	665.78	8,069	931,353	資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	32.02	263	30,379	インターネット販売・通信販売
CARLYLE GROUP INC	125.09	170.2	796	91,877	資本市場
10X GENOMICS INC	53.12	76.67	685	79,130	ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	130.21	183.67	3,018	348,408	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	—	209.24	2,220	256,309	コンピュータ・周辺機器

銘柄	株数	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	
UPSTART HOLDINGS INC	—		20.8	217	25,111	消費者金融
INGERSOLL RAND INC	312.82		405.29	2,180	251,668	機械
PAYCOM SOFTWARE INC	43.3		52.5	1,815	209,490	ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	—		177.12	1,109	128,076	自動車
PPD INC	108.28		—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
ASANA INC	—		71.34	489	56,535	ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	—		53.67	577	66,647	ソフトウェア
AON PLC	208.07		220.29	6,165	711,619	保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	—		547.34	656	75,808	消費者金融
BENTLEY SYSTEMS INC	—		160.02	624	72,086	ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	—		39.76	776	89,602	資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	—		92.04	402	46,423	情報技術サービス
IAC/INTERACTIVECORP	70.64		72.5	954	110,189	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	—		227.11	3,853	444,730	ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	100.21		119.15	1,386	160,062	ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	—		318.81	1,533	177,030	電力
ROYALTY PHARMA PLC	103.61		355.64	1,390	160,538	医薬品
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—		235.77	1,304	150,621	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,128.66		1,248.58	1,876	216,598	医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—		218.14	1,771	204,518	ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	146.71		334.59	742	85,732	ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	28.05		203.94	5,937	685,283	情報技術サービス
DOORDASH INC	—		109.22	1,060	122,418	インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	—		91.44	155	17,973	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	50.42		218.59	2,684	309,870	通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—		371.77	2,439	281,616	各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	—		1,532.71	2,032	234,576	ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	344.11		367.14	3,957	456,805	専門サービス
FNF GROUP	245.67		254.51	1,216	140,415	保険
MARVELL TECHNOLOGY INC	—		794.17	5,380	621,017	半導体・半導体製造装置
ROBINHOOD MARKETS INC	—		198.72	265	30,619	資本市場
LUCID GROUP INC	—		421.36	1,156	133,449	自動車
CATALENT INC	146.73		174.39	1,725	199,207	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	454.91		599.85	2,641	304,840	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	415.03		435.54	2,337	269,748	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57		34.57	529	61,119	ソフトウェア
WAYFAIR INC	55.43		69.59	989	114,224	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.07		174.12	2,889	333,468	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	37.41		43.07	2,351	271,369	ソフトウェア
QORVO INC	101.68		111.07	1,436	165,771	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	29.47		24.25	361	41,762	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	131.89		145.2	2,207	254,786	メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18		—	—	—	化学
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	42.57		49.59	1,235	142,645	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	145.4		165.74	1,332	153,745	情報技術サービス
KORNIT DIGITAL LTD	—		49.78	489	56,485	機械
ETSY INC	102.37		117.13	1,670	192,850	インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	167.6		189.9	1,910	220,453	専門サービス
BLOCK INC	335.06		489.39	5,463	630,602	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	477.57		506.8	4,019	463,981	化学
CARVANA CO	53.47		77.35	1,087	125,550	専門小売り

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	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC		182.96	215.37	1,227	141,640	飲料
TELADOC HEALTH INC		104.54	147.9	1,047	120,928	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO		227.78	262.97	1,204	138,981	容器・包装
KRAFT HEINZ CO		568.79	640.01	2,213	255,516	食品
NOVOCURE LTD		74.08	97.72	770	88,967	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP		259.81	329.64	2,144	247,496	機械
WASTE CONNECTIONS INC		247.78	261.86	3,126	360,903	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A		269	293.14	79,456	9,170,832	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO		1,162.57	1,231.01	2,076	239,694	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC		1,000.53	1,086.55	12,399	1,431,174	情報技術サービス
SEA LTD ADR		—	132.32	1,709	197,273	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC		352.77	343.46	1,165	134,545	各種金融サービス
SUNRUN INC		100	162.13	366	42,291	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C		133.76	156.65	909	104,993	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C		267.96	280.94	76,022	8,774,501	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC		61.93	77.59	2,129	245,764	ソフトウェア
CABLE ONE INC		3.92	5.42	813	93,881	メディア
LINDE PLC		470.49	503.98	14,792	1,707,329	化学
ATHENE HOLDING LTD		118.47	—	—	—	保険
ROKU INC		95.87	119.01	1,892	218,432	娯楽
AVALARA INC		71.02	78.24	776	89,636	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC		129.32	124.76	7,584	875,421	メディア
VISTRA CORP		380.32	397.58	858	99,119	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>	278,491.28 592銘柄	309,096.71 608銘柄	3,769,273 —	435,049,586 <67.7%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD		205.78	455.67	3,042	275,894	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC		784.79	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP		1,559.61	1,736.87	4,663	422,885	金属・鉱業
ATCO LTD		71.93	—	—	—	総合公益事業
BALLARD POWER SYSTEMS INC		—	212.72	251	22,780	電気設備
BANK OF MONTREAL		584.93	630.76	9,381	850,695	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		1,094.36	1,191.19	11,020	999,374	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA		291.32	326	3,339	302,800	銀行
BCE INC		149.59	72.75	483	43,836	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT		1,159.24	1,379.3	9,951	902,415	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC		281.92	281.92	888	80,604	医薬品
SAPUTO INC		253.95	253.95	755	68,485	食品
BLACKBERRY LTD		466.71	466.71	409	37,158	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO		561.93	622.22	1,103	100,037	総合公益事業
CGI INC		198.59	229.85	2,458	222,955	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC		153.58	153.58	981	89,019	容器・包装
CAE INC		250.06	304.43	967	87,730	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP		326.27	346.76	959	87,006	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B		315.43	373.08	2,458	222,979	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		409.56	436.21	7,043	638,742	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		1,007.58	1,152.17	7,725	700,530	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A		48.62	58.89	1,068	96,912	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD		91.19	97.93	343	31,116	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO		634.82	691.09	10,810	980,316	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC		843.17	—	—	—	金属・鉱業

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	159.11	208.15	1,025	92,997	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	252.61	258.68	1,456	132,063	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	589	53,431	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,278.09	1,185.75	867	78,707	金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	99.63	94.52	690	62,637	商業サービス・用品
FORTIS INC	452.28	452	2,584	234,406	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	496.94	569.14	2,014	182,646	金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	1,011	91,698	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	252.5	252.5	1,003	91,037	保険
IMPERIAL OIL LTD	215.42	220.66	1,241	112,593	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,830.5	1,964.79	10,372	940,544	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	60.69	53.66	243	22,086	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,716.81	1,892.5	5,119	464,210	保険
LOBLAW CO LTD	151.36	154.86	1,560	141,480	食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	788.73	4,152	376,563	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	270.24	302.02	2,946	267,161	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	518.08	570.83	3,900	353,695	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23.98	23.2	1,505	136,482	保険
METRO INC	207.6	227.64	1,534	139,171	食品・生活必需品小売り
EMERA INC	224.33	238.36	1,401	127,049	電力
ONEX CORP	66.46	64.89	595	54,028	資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	187.66	187.66	572	51,901	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	465.51	564.39	2,363	214,337	保険
QUEBECOR INC-B	160.42	160.42	493	44,760	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,270.82	1,394.86	20,225	1,834,045	銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	122.36	906.81	8,307	753,304	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	434.84	426.01	1,603	145,405	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,308.06	1,431.08	5,415	491,050	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	643.1	643.1	767	69,629	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	438.24	1,997	181,172	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	150.49	167.4	2,169	196,700	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	74.17	93.88	1,066	96,699	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,612.38	1,778.19	18,896	1,713,564	銀行
TC ENERGY CORP	824.24	949.79	6,328	573,863	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	72	92.98	1,158	105,064	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	61.84	78.86	1,101	99,878	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	125.15	179.01	3,242	294,021	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	409.93	470.07	2,539	230,265	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	18.64	19.31	4,105	372,330	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	176.52	186.23	3,394	307,771	金属・鉱業
B2GOLD CORP	1,016.75	—	—	—	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	202.85	—	—	—	資本市場
TOURMALINE OIL CORP	—	323.64	1,497	135,762	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	166.68	237.72	737	66,911	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	144.97	144.97	503	45,616	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	239.44	240.53	666	60,395	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	504.1	564.42	2,386	216,447	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	269.06	264.38	1,684	152,738	複合小売り
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,197.09	1,344.22	2,683	243,300	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	175.68	234.9	853	77,364	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
TMX GROUP LTD	50.58	47.97	638	57,875	資本市場

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	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		218.4	—	—	—	金属・鉱業
IVANHOE MINES LTD		—	619.3	699	63,402	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD		418.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD		506.3	555.64	5,191	470,751	化学
TFI INTERNATIONAL INC		—	89.99	1,223	110,963	陸運・鉄道
SSR MINING INC		180	—	—	—	金属・鉱業
LIGHTSPEED COMMERCE INC		—	113.46	415	37,676	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC		101.94	129.91	2,103	190,733	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC		122.78	116.6	947	85,939	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC		164.85	164.85	630	57,193	商業サービス・用品
NUVEI CORP		—	49.6	391	35,496	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP		108.45	108.45	477	43,290	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CANADA		107.22	179.4	434	39,433	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		251.76	264.43	1,922	174,299	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC		97.39	109.46	11,810	1,070,947	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP		35.03	32.93	636	57,700	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP		186.34	186.34	199	18,113	医薬品
HYDRO ONE LTD		273.4	357.38	1,151	104,448	電力
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	35,759.37 87銘柄	38,115.54 86銘柄	251,560 — <3.5%>	
(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		168.54	171.34	1,089	89,695	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		2,577.13	2,757.53	7,776	640,061	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION		3,180.22	3,565.97	8,515	700,913	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,535.17	1,622.22	3,690	303,769	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD		3,644.09	3,896.81	1,582	130,223	各種電気通信サービス
AMP LTD		3,024.14	—	—	—	各種金融サービス
ASX LTD		191.62	189.26	1,569	129,172	資本市場
BHP GROUP LTD		2,637.49	3,064.96	14,812	1,219,254	金属・鉱業
AMPOL LTD		209.46	209.46	677	55,773	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT		380.4	516.04	1,189	97,947	情報技術サービス
CSL LIMITED		407.66	464.24	11,307	930,681	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD		57.45	58.28	789	64,970	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP		2,508.16	2,937.86	3,769	310,248	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD		526.93	—	—	—	飲料
COCHLEAR LTD		55.33	58.75	1,116	91,912	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		1,328.6	1,463.6	908	74,811	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,589.4	1,728.88	17,295	1,423,610	銀行
RIO TINTO LIMITED		338.59	359.15	4,366	359,410	金属・鉱業
APA GROUP		1,182.05	1,182.05	1,182	97,294	ガス
ARISTOCRAT LEISU		517.17	620.13	2,494	205,345	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT		2,251.8	2,694.3	1,271	104,674	保険
TPG TELECOM LTD		287.19	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		398.39	462.46	2,159	177,725	建設資材
ORICA LTD		413.11	413.11	608	50,052	化学
CIMIC GROUP LTD		87.09	—	—	—	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD		621.16	621.16	623	51,332	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD		496.93	469.46	882	72,606	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT		1,160.56	1,422.58	1,240	102,104	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD		298.21	337.36	6,552	539,312	資本市場
SUNCORP GROUP LTD		1,174.54	1,202.9	1,411	116,139	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	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,998.19	3,188.61	9,702	798,649	銀行
NEWCREST MINING LTD		732.02	868.79	2,059	169,478	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,978.95	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
QANTAS AIRWAYS LIMITED		622.82	1,074.83	570	46,977	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED		1,448.68	1,336.24	1,697	139,682	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		934.04	966.92	870	71,628	金属・鉱業
REECE LTD		—	303.19	605	49,811	商社・流通業
SANTOS LTD		1,596.18	3,333.93	2,573	211,848	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE		401.48	406.13	1,523	125,390	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		84.06	247.11	655	53,940	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD		2,056.49	2,145.97	1,115	91,850	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD		1,015.75	1,094.81	5,897	485,443	複合小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD		861.96	906.41	2,486	204,645	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,117.03	1,204.4	4,084	336,163	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		99.95	155.53	283	23,337	資本市場
SEEK LTD		358.36	361.4	1,003	82,636	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD		—	60.86	615	50,664	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES		1,650.66	1,650.66	427	35,189	電力
AGL ENERGY LTD		490.76	—	—	—	総合公益事業
BRAMBLES LTD		1,271.66	1,300.28	1,224	100,818	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD		328.61	328.61	415	34,188	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD		1,409.64	1,502.3	594	48,967	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD		1,501.5	1,381.66	500	41,168	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD		576.67	759.03	806	66,411	飲料
XERO LTD		104.98	140.63	1,532	126,170	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD		—	228.52	627	51,650	各種消費者サービス
AFTERPAY LTD		183.22	—	—	—	情報技術サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA		—	1,195.74	749	61,710	食品・生活必需品小売り
MEDIBANK PVT LTD		2,831.54	2,831.54	900	74,114	保険
SOUTH32 LTD(AUD)		4,123.45	4,093.17	1,854	152,619	金属・鉱業
COLES GROUP LTD		1,210.32	1,227.26	2,002	164,857	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		136.04	136.04	621	51,116	ソフトウェア
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	65,373.59 58銘柄	66,920.43 55銘柄	146,885 —	12,090,177 <1.9%>	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH		329	—	—	—	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,640	1,640	2,692	39,827	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,038.6	—	—	—	銀行
CLP HOLDINGS LTD		1,345	1,620	12,935	191,319	電力
PCCW LTD		3,310	—	—	—	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		495	535	2,725	40,314	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		1,090.4	1,164.4	50,930	753,267	資本市場
MTR CORP		1,260	1,375	5,878	86,937	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD		657	758	12,726	188,229	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		1,154.5	1,204.5	4,185	61,905	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,345	1,460	7,285	107,751	電力
HONG KONG & CHINA GAS		9,132.92	11,754.56	14,223	210,358	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		1,970	2,000	9,150	135,328	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,175	3,535	11,241	166,258	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,630.66	1,630.66	5,348	79,105	不動産管理・開発
SINO LAND CO		2,554	5,054	5,195	76,841	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	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,085	1,385	13,510	199,822	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	495	495	2,393	35,397	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,285	1,320	17,608	260,434	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,660	1,660	3,585	53,031	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	—	2,172	3,492	51,655	専門小売り
AIA GROUP LTD	10,872.27	11,750.27	102,462	1,515,418	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	4,450	4,841	71,607	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,988	2,520	5,544	81,995	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	—	1,330	4,176	61,765	海運業
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,188	32,363	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,497.5	1,517.5	5,455	80,685	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD	1,474	2,038	5,319	78,670	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,812	26,805	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,506	1,506	3,471	51,340	飲料
WH GROUP LTD	8,970	8,970	5,139	76,017	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,553.32	2,563.32	15,315	226,521	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,248.32	1,863.32	9,745	144,130	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	76,797.49 82,613.53	350,582 —	5,185,109 <0.8%>	
(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	1,095	418	35,843	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,557	1,766	6,569	562,942	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	259	22,270	不動産管理・開発
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	674	656	56,253	資本市場
CAPITALAND LTD	3,088.15	—	—	—	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,268	7,242	557	47,783	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,349	814	69,819	コングロマリット
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,716.53	3,209.53	4,281	366,882	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,768.22	8,084.22	2,061	176,647	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,608.5	1,580.5	823	70,560	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,024	1,113	3,639	311,869	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	295	25,334	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	421	762	65,368	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,814	1,814	823	70,570	食品
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	—	2,952.15	1,068	91,575	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	27,111.4 32,069.4	23,033 —	1,973,722 <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	1,102.26	1,102.26	796	60,909	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	494.49	462	35,337	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	—	—	—	食品
FISHER & PAYKEL	490.44	573.88	1,607	122,856	ヘルスケア機器・用品
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	2,629.43	1,156	88,425	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	357	27,319	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	1,241.62	1,241.62	607	46,404	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 >	5,897.74 6,659.02	4,988 —	381,252 <0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	317.98	352.61	489	76,550	金属・鉱業

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	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTAD GROUP	389.16	430.03	2,081	325,256	商社・流通業
SEVERN TRENT PLC	219.33	294.58	833	130,251	水道
BHP GROUP PLC	1,844.54	—	—	—	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	16,088.89	16,512.19	3,228	504,363	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	822.83	922.35	570	89,174	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	7,955.07	8,502.62	1,638	255,992	各種電気通信サービス
BHP GROUP LTD	—	2,059.88	5,184	810,060	金属・鉱業
BUNZL PLC	288.34	355.08	945	147,792	商社・流通業
AVIVA PLC	3,634.64	3,815.43	1,644	256,928	保険
CRODA INTERNATIONAL	125.68	136.93	1,002	156,689	化学
DIAGEO PLC	2,096.47	2,277.84	8,273	1,292,591	飲料
SCHRODERS PLC	113.54	113.54	366	57,316	資本市場
DCC PLC	78.98	106.84	679	106,132	コングロマリット
NATIONAL GRID PLC	3,068.81	3,522.37	3,786	591,610	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,971.59	2,114.6	672	105,095	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,737.49	3,096.99	1,858	290,324	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,065.85	2,127.07	7,251	1,132,924	タバコ
HALMA PLC	319.01	342.01	796	124,505	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	114.67	131.97	944	147,590	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	877.08	896.52	1,596	249,468	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	191.07	191.07	337	52,705	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,075.54	1,255.2	4,540	709,436	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,564.43	1,721.99	3,067	479,301	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	18,255.85	19,905.53	11,111	1,736,024	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,146.92	5,733.2	1,559	243,645	保険
UNILEVER PLC	2,351.36	2,528.12	9,632	1,504,925	パーソナル用品
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	2,302.12	—	—	—	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	677.14	677.14	707	110,504	水道
RSA INSURANCE GROUP LTD	954.87	—	—	—	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	311.66	322.09	604	94,507	食品
PEARSON PLC	650.09	637.46	398	62,267	メディア
PERSIMMON PLC	281.26	336.88	823	128,690	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,268.96	2,544.6	2,994	467,937	保険
RIO TINTO PLC	1,010.08	1,091.55	6,245	975,851	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	24,232.37	27,067.74	3,694	577,267	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	645.58	692.96	4,091	639,322	家庭用品
RELX PLC	1,741.63	1,892.62	4,237	662,078	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,697.66	1,934.06	963	150,605	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	6,709.69	7,958.64	936	146,354	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	4,230.54	5,723.46	1,388	216,941	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	497.89	483.93	727	113,602	資本市場
SSE PLC	886.46	999.67	1,524	238,187	電力
BP PLC	18,382.94	19,568.09	7,838	1,224,761	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	1,084.48	924.78	631	98,598	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	403.17	354	545	85,203	コングロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	65.74	76.48	916	143,151	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,400.93	2,427.25	1,335	208,654	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	64,953.56	69,189.54	3,577	558,885	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	3,467.94	3,467.94	527	82,466	家庭用耐久財
TESCO PLC	8,605.34	8,098.05	2,392	373,751	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	886.51	1,019.75	1,348	210,628	資本市場

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	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SMITH & NEPHEW PLC		769.28	880.29	1,061	165,869	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC		4,499.85	4,896.01	7,692	1,201,893	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC		275.89	317.95	2,185	341,476	資本市場
WPP PLC		1,115.98	1,134.03	1,353	211,465	メディア
ASTRAZENECA PLC		1,175.51	1,508.4	12,641	1,975,170	医薬品
WHITBREAD PLC		185.94	187.44	599	93,743	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC		138.42	161.39	833	130,213	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		389.5	387.64	760	118,888	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS		166.52	162.86	822	128,549	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC		1,902.05	1,828.62	507	79,225	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC		158.93	200.87	608	95,093	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS		115.81	105.59	431	67,358	家庭用耐久財
SHELL PLC-A SHS		3,777.76	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHELL PLC-B SHS		3,238.58	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		182	180.34	350	54,831	医薬品
AVEVA GROUP PLC		104.08	104.08	278	43,548	ソフトウェア
ABRDN PLC		2,063.13	2,063.13	489	76,492	資本市場
EXPERIAN PLC		803.76	893.61	2,560	400,004	専門サービス
MONDI PLC		471.7	458.75	855	133,638	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC		280.11	353.12	460	71,998	資本市場
FRESNILLO PLC NPR		173.85	—	—	—	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC		427.89	449.09	584	91,250	食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC		1,493.58	1,515.66	922	144,073	メディア
GLENCORE PLC		8,804.08	9,681.28	4,086	638,469	金属・鉱業
ENTAIN PLC		496.18	581.26	979	152,979	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC		487.65	—	—	—	金属・鉱業
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC		1,126.94	—	—	—	保険
COCA-COLA HBC AG		152.08	202.33	486	76,026	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		517.21	565.61	371	58,077	保険
FERGUSON PLC		205.31	216.07	2,367	369,827	商社・流通業
M&G PLC		2,049.4	2,591.17	549	85,907	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC		320.86	2,354.9	396	61,996	専門小売り
SHELL PLC		—	7,503.11	15,047	2,351,019	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC		980.62	1,046.24	667	104,323	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		4,246.75	4,701.29	714	111,648	コングロマリット
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	266,360.93 85銘柄	284,167.37 79銘柄	184,216 —	28,781,938 <4.5%>	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
BANK HAPOLIM BM		1,023.59	1,077.44	3,565	126,397	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM		1,307.03	1,436.45	4,918	174,370	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		17.6	21.98	1,238	43,910	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD		1,021.34	1,061.43	2,259	80,115	銀行
ICL GROUP LTD		494.11	680.48	2,206	78,236	化学
NICE LTD		55.35	61.29	5,225	185,261	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		104.44	167.84	2,047	72,594	銀行
AZRIELI GROUP		44.14	44.14	1,226	43,488	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数<比 率>	4,067.6 8銘柄	4,551.05 8銘柄	22,688 —	804,375 <0.1%>	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG		2,257.7	2,530.13	2,103	262,754	資本市場
LOGITECH INTL-REG		144.29	180.08	1,314	164,244	コンピュータ・周辺機器

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	千スイス・フラン	千円	
NESTLE SA-REGISTERED		2,570.32	2,745.36	32,203	4,023,451	食品
CIE FINANC RICHEMONT		474.14	508.16	6,654	831,395	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		628.85	680.16	23,275	2,907,987	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		34.67	41.22	917	114,639	機械
SIKA INHABER		123.63	138.38	4,097	511,933	化学
SGS SA-REG		5.4	6.13	1,579	197,291	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS		1,981.27	2,138.86	16,937	2,116,187	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R		42.59	42.59	683	85,405	保険
BARRY CALLEBAUT AG		2.65	3.29	687	85,909	食品
CLARIANT AG-REG		199.79	199.79	335	41,935	化学
SWISSCOM AG-REG		24.89	24.19	1,325	165,621	各種電気通信サービス
ABB LTD		1,657.76	1,605.91	5,042	630,017	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG		129.44	140.95	657	82,169	専門サービス
GEBERIT AG		31.81	35.39	2,109	263,528	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG		68.69	71.69	4,322	540,104	ライフサイエンス・ツール／サービス
LINDT & SPRUENGLI PART		0.95	1.1	1,108	138,533	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN		0.09	0.1	1,031	128,813	食品
GIVAUDAN-REG		8.12	9.01	3,230	403,566	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		135.85	147.34	6,527	815,503	保険
ROCHE HOLDING AG-BEARER		－	36.04	1,338	167,235	医薬品
HOLCIM LTD		478.95	511.47	2,593	323,988	建設資材
TEMENOS GROUP		57.23	67.53	730	91,290	ソフトウェア
BACHEM HOLDING AG		－	5	252	31,547	ライフサイエンス・ツール／サービス
SONOVA HOLDING AG		46.98	52.1	1,661	207,583	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG		45.18	49.34	1,248	156,024	海運業
STRAUMANN HOLDING AG		9.19	11.25	1,553	194,109	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B		24.41	29.91	859	107,325	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		45.92	45.92	254	31,755	繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN		16.63	14.94	330	41,326	機械
SWISS LIFE HOLDING AG		27.61	30.53	1,806	225,737	保険
BANQUE CANTONALE VAUD		25	－	－	－	銀行
VIFOR PHARMA AG		46.45	52.56	856	107,039	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING		8.27	6.16	562	70,305	化学
SWISS PRIME SITE AG		83.37	80.4	717	89,653	不動産管理・開発
PARTNERS GROUP HOLDING AG		16.58	21.76	2,706	338,205	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD		201.18	210.08	1,222	152,707	資本市場
SWISS RE LTD		248.71	292.13	2,864	357,906	保険
ALCON INC		429.61	485.73	3,446	430,635	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG		3,314.28	3,427.79	6,535	816,493	資本市場
VAT GROUP AG		－	24.12	819	102,400	機械
小 計	株 数 銘 柄 数	・ 金 額 ・ 銘 柄 数	15,648.45 39銘柄	16,704.59 41銘柄	148,505 －	18,554,267 <2.9%>
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B		99.74	104.57	10,765	188,826	飲料
A P MOLLER A/S		5.68	5.27	11,936	209,367	海運業
AP MOLLER MAERSK A		2.55	3.41	7,311	128,235	海運業
DANSKE BANK A/S		593.05	687.25	9,002	157,912	銀行
GENMAB A/S		61.9	62.51	13,745	241,103	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS		177.4	191.32	7,444	130,572	化学
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS		8.13	8.13	1,990	34,908	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B		1,540.44	1,640.82	105,521	1,850,840	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	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
GN STORE NORD A/S		128.95	104.48	3,823	67,072	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		181.27	979.91	15,952	279,814	電気設備
COLOPLAST-B		107.34	119.22	10,925	191,630	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S		190.49	198.61	25,044	439,284	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S		107.39	107.39	2,870	50,349	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S		48.4	—	—	—	医薬品
TRYG A/S		111.07	357.84	5,439	95,403	保険
PANDORA A/S		82.51	92.65	6,650	116,648	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S		93.36	89.84	4,288	75,228	化学
AMBU A/S B		141.56	141.56	1,705	29,919	ヘルスケア機器・用品
ORSTED A/S		164.71	192.05	12,586	220,775	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	3,845.94 19銘柄	5,086.83 18銘柄	257,006 —	4,507,892 <0.7%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA		435.37	432.02	10,161	132,094	食品
DNB ASA		807.09	—	—	—	銀行
NORSK HYDRO ASA		1,290.36	1,290.36	9,984	129,802	金属・鉱業
TELENOR ASA		630.38	674.35	9,258	120,364	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA		75.37	75.37	1,746	22,702	メディア
ORKLA ASA		652.83	694.4	5,862	76,207	食品
EQUINOR ASA		831.49	943.06	25,816	335,611	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		151.93	151.93	6,730	87,496	化学
AKER BP ASA		—	152.17	4,129	53,688	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		166.83	294.84	6,262	81,411	保険
ADEVINTA ASA		222.65	222.65	1,847	24,023	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA		—	895.96	19,003	247,043	銀行
SCHIBSTED ASA		74.45	74.45	1,514	19,686	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	5,338.75 11銘柄	5,901.56 12銘柄	102,317 —	1,330,132 <0.2%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS		564.89	636.97	31,695	389,856	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS		360.51	401.9	17,474	214,937	機械
ERICSSON LM-B SHS		2,649.68	2,794.5	32,175	395,763	通信機器
GETINGE AB-B SHS		—	244.21	8,667	106,604	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS		—	557.33	11,531	141,833	各種金融サービス
LUNDBERGS B		73.82	73.82	3,471	42,702	各種金融サービス
SKF AB-B SHS		348.49	322.28	6,055	74,484	機械
SANDVIK AB		1,034	1,143.71	26,637	327,635	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		1,449.9	1,664.38	20,072	246,890	銀行
SKANSKA AB-B SHS		316.53	319.68	7,624	93,779	建設・土木
SWEDBANK AB		798.25	893.78	15,061	185,262	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS		529.45	543.82	8,807	108,328	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		1,392.3	1,340.2	12,981	159,668	銀行
VOLVO AB-A SHS		—	236.91	5,041	62,009	機械
VOLVO AB-B SHS		1,305.9	1,342.82	28,320	348,336	機械
SWEDISH MATCH AB		138.45	1,583.29	11,026	135,620	タバコ
TELE2 AB-B SHS		470.55	460.83	6,020	74,055	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A		119.55	142.73	4,104	50,490	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C		114.03	119.4	3,371	41,473	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B		191.91	252.19	4,546	55,927	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS		240.98	483.54	5,751	70,746	商業サービス・用品

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	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
INVESTOR AB-B SHS		395.67	1,694.19	33,029	406,268	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS		688.14	662.7	11,793	145,058	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B		870.21	1,010.25	26,418	324,941	建設関連製品
TELIA CO AB		2,104.77	2,699.54	10,043	123,536	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB		147.39	207.62	7,019	86,341	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB		283.76	240.47	9,638	118,547	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB		283.92	279.3	7,932	97,565	機械
KINNEVIK AB-B		217.22	214.49	5,430	66,799	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER		89.67	114.01	6,687	82,260	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB		90.09	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		336.92	451.58	5,477	67,375	機械
NIBE INDUSTRIER AB		288.34	1,340.88	11,416	140,419	建設関連製品
HEXAGON AB-B SHS		265.34	1,852.43	22,738	279,684	電子装置・機器・部品
SAGAX AB		—	183.48	4,678	57,548	不動産管理・開発
EPIROC AB-A		607.5	593.63	11,273	138,658	機械
EPIROC AB-B		308.99	389.43	6,308	77,597	機械
ESSITY AB-B		521.43	576.54	15,249	187,568	家庭用品
EQT AB		209.34	300.03	10,171	125,103	資本市場
EMBRACER GROUP AB		—	491.42	4,155	51,118	娯楽
LIFCO AB		—	257.38	5,237	64,423	コングロマリット
EVOLUTION AB		136.41	161.47	17,115	210,524	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP		2,957.52	3,102.72	34,018	418,424	銀行
INVESTMENT AB LATOUR		149.45	149.45	3,987	49,044	コングロマリット
SINCH AB		—	562.99	5,393	66,339	ソフトウェア
小 計	株 数 銘 柄 数<比率>	23,051.27 38銘柄	33,094.29 44銘柄	545,655	6,711,557 <1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC		716.53	755.8	3,302	431,120	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		141.28	175.84	2,343	305,910	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A		147.3	149.68	1,607	209,883	食品
KINGSPAN GROUP PLC		134.52	143.07	1,244	162,509	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		208.7	242.28	1,139	148,765	容器・包装
小 計	株 数 銘 柄 数<比率>	1,348.33 5銘柄	1,466.67 5銘柄	9,636 —	1,258,190 <0.2%>	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE		531.76	575.35	6,691	873,618	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV		152.1	168.59	2,683	350,306	化学
ING GROEP NV-CVA		3,448.92	3,804.32	4,902	640,037	銀行
ASM INTERNATIONAL NV		—	42.71	1,167	152,398	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV		126.01	112.39	707	92,326	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		992.8	1,063.9	3,060	399,623	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV		226.83	245.94	2,291	299,136	飲料
AKZO NOBEL		179.59	187.17	1,717	224,184	化学
ASML HOLDING NV		380.98	403.14	22,563	2,945,922	半導体・半導体製造装置
AEGON NV		1,503.49	1,893.23	909	118,770	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV		829.19	886.59	2,596	338,983	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA		257.15	266.29	2,328	304,001	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV		541.76	650.99	2,545	332,323	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.		207.63	204.27	876	114,412	ライフサイエンス・ツール／サービス
VOPAK (KON.)		53.64	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
KONINKLIJKE KPN NV		3,478.24	3,414.47	1,051	137,304	各種電気通信サービス

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			
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	飲料 飲料 自動車 機械 インターネット販売・通信販売 食品 資本市場 商社・流通業 保険 バイオテクノロジー 娯楽 自動車 インターネット販売・通信販売 銀行 各種金融サービス 情報技術サービス		
HEINEKEN HOLDING NV-A		100.04	106.67	804	105,077			
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		553.04	553.04	574	75,020			
FERRARI NV		115.42	120.5	2,335	304,895			
CNH INDUSTRIAL NV		893.78	1,061.55	1,480	193,272			
PROSUS NV		442.19	906.79	6,150	803,042			
JDE PEET'S BV		73.08	73.08	191	25,065			
EURONEXT NV		—	96.19	795	103,796			
IMCD NV		—	53.59	757	98,933			
NN GROUP NV		252.74	281.24	1,418	185,209			
ARGENX SE		38.79	42.55	1,073	140,160			
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV		—	679.41	1,426	186,277			
STELLANTIS NV		1,769.58	1,962.48	3,206	418,665			
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV		108.36	160.29	615	80,350			
ABN AMRO BANK NV		342.51	343.82	443	57,871			
EXOR NV		99.66	99.66	719	93,891			
ADYEN NV		15.89	19.2	3,605	470,717			
小計	株数・金 銘柄数<比率>	17,715.17 28銘柄	20,479.41 31銘柄	81,691 —	10,665,597 <1.7%>			
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	化学 銀行 各種金融サービス 化学 保険 医薬品 食品・生活必需品小売り 各種金融サービス 各種電気通信サービス バイオテクノロジー 電力 飲料		
UMICORE		176.54	177.49	573	74,918			
KBC GROUPE		210.38	265.87	2,042	266,726			
SOFINA		13.82	13.82	469	61,347			
SOLVAY SA		71.83	69.31	736	96,192			
AGEAS		143.65	170.55	754	98,509			
UCB SA		105.71	127.78	1,085	141,705			
COLRUYT NV		46.73	46.73	168	21,988			
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		99.04	107.14	995	129,922			
PROXIMUS		137.39	137.39	247	32,296			
GALAPAGOS NV		34.26	—	—	—			
ELIA GROUP		28.62	28.62	325	42,560			
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		663.27	740.93	4,035	526,920			
小計	株数・金 銘柄数<比率>	1,731.24 12銘柄	1,885.63 11銘柄	11,436 —	1,493,086 <0.2%>			
(ユーロ…ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	金属・鉱業 ライフサイエンス・ツール/サービス エネルギー設備・サービス メディア 不動産管理・開発 航空貨物・物流サービス		
ARCELOR MITTAL (NL)		615.94	639.79	1,685	220,020			
EUROFINS SCIENTIFIC		113.3	139.43	1,185	154,733			
TENARIS SA		369.59	529.85	609	79,588			
SES FDR		288.47	—	—	—			
AROUNDTOWN SA		830.54	1,060.18	560	73,222			
INPOST SA		—	203.95	128	16,746			
小計	株数・金 銘柄数<比率>	2,217.84 5銘柄	2,573.2 5銘柄	4,169 —	544,311 <0.1%>			
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	化学 保険 総合公益事業 航空宇宙・防衛 食品 航空宇宙・防衛 ホテル・レストラン・レジャー 建設・土木		
AIR LIQUIDE		412	465.78	6,619	864,263			
AXA SA		1,694.93	1,895.06	5,225	682,257			
VEOLIA ENVIRONNEMENT		507.07	674.38	2,124	277,436			
DASSAULT AVIATION SA		2.95	29.5	340	44,408			
DANONE		543.15	632.31	3,462	452,067			
SAFRAN SA		280.36	333.08	3,737	488,010			
ACCOR SA		173.8	173.8	575	75,108			
BOUYGUES		214.17	202.22	649	84,776			

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	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	
BNP PARIBAS	1,017.91	1,099.14	6,787	886,135	銀行
THALES SA	105.13	104.48	867	113,301	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	149.12	155.19	2,996	391,251	情報技術サービス
NATIXIS	701.66	—	—	—	資本市場
EIFFAGE	84.65	84.77	813	106,248	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	185.95	253.45	1,604	209,462	メディア
FAURECIA	61.17	107.74	445	58,165	自動車部品
L'OREAL	224.47	245.54	8,670	1,131,957	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	248.73	270.69	18,136	2,367,866	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	708.07	345	45,094	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	148.02	162.26	2,348	306,648	自動車部品
PERNOD-RICARD	190.38	204.47	3,890	507,883	飲料
RENAULT SA	190.19	190.19	653	85,382	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.47	324	42,369	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	445.6	491.74	2,981	389,254	建設関連製品
SEB SA	22.18	24.39	328	42,925	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	695.95	788.64	2,665	347,969	銀行
VINCI S.A.	472.57	523.44	5,236	683,676	建設・土木
SODEXO	91.78	93.25	788	102,925	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	483.76	528.92	7,517	981,420	電気設備
VIVENDI SE	709.95	687.46	805	105,147	メディア
TOTALENERGIES SE	2,258.11	2,445.35	12,503	1,632,401	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	196.53	253.93	646	84,440	自動車部品
ORANGE	1,840.93	1,917.27	2,086	272,396	各種電気通信サービス
HERMES INTL	28.8	30.76	3,649	476,501	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	121.83	645.96	2,601	339,665	ソフトウェア
KERING	68.27	72.93	4,493	586,729	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	305	39,864	保険
CARREFOUR SA	499.26	611.89	1,052	137,447	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	89.72	—	—	—	情報技術サービス
SANOFI	1,014.54	1,108.56	10,220	1,334,443	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	76.86	71.51	360	47,092	娯楽
TELEPERFORMANCE	53.12	59.18	1,896	247,558	専門サービス
EURAZEO	52.29	30.08	212	27,687	各種金融サービス
ESSILORLUXOTTICA	249.84	278.64	4,582	598,292	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	986.85	1,149.26	1,558	203,464	銀行
ORPEA	49.32	49.32	182	23,850	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	206	26,926	各種金融サービス
ILIAD SA	10.46	—	—	—	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	46.12	466	60,846	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	23.87	24.56	865	112,998	ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,660.61	1,774.63	2,537	331,278	総合公益事業
ALSTOM	217.79	285.33	733	95,739	機械
ELECTRICITE DE FRANCE	547.78	415.49	338	44,134	電力
IPSEN SA	36.46	36.46	340	44,450	医薬品
ARKEMA SA	63.93	60.09	750	97,988	化学
LEGRAND SA	238.06	259.78	2,216	289,378	電気設備
ADP	23.13	23.13	299	39,061	運送インフラ
SCOR SE	156.67	—	—	—	保険
BUREAU VERITAS SA	298.1	298.1	730	95,392	専門サービス
GETLINK	376.46	415.25	574	75,006	運送インフラ

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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SUEZ SA	266.2	—	—	—	総合公益事業
EDENRED	214.88	248.65	953	124,530	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	80.92	80.92	292	38,213	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	223.86	235.7	1,071	139,955	情報技術サービス
AMUNDI SA	59.24	59.24	402	52,555	資本市場
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	株 数	—	19,593,711	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	172.02	184.33	4,260	556,288	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	312.17	329.21	3,048	397,967	自動車
COMMERZBANK AG	831.18	1,062.15	910	118,885	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	390.3	388.3	1,420	185,447	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	340	44,460	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	203	26,631	化学
HANNOVER RUECK SE	48.68	53.21	913	119,281	保険
GEA GROUP AG	118.38	164.92	670	87,484	機械
CONTINENTAL AG	103.36	97.95	859	112,243	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	869.75	959.37	4,912	641,432	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	126.49	159.12	1,360	177,582	自動車
MERCK KGAA	118.74	123.64	2,176	284,187	医薬品
RWE AG	592.73	644.26	2,352	307,186	総合公益事業
SAP SE	934.54	1,015.97	10,706	1,397,813	ソフトウェア
E.ON SE	2,098.42	2,086.41	2,491	325,247	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	86.02	103.66	730	95,345	家庭用品
SIEMENS AG-REG	686.52	746.31	10,411	1,359,263	コングロマリット
PUMA AG	92.39	104.48	918	119,876	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	887.08	948.61	5,005	653,559	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	162.41	175	1,286	167,978	家庭用品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	780.56	827.56	6,149	802,891	自動車
BASF SE	832.15	895.92	5,953	777,274	化学
BEIERSDORF AG	83.71	103.42	904	118,120	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	17.07	—	—	—	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	145.71	140.32	900	117,542	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	201.91	188.36	1,089	142,192	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	375.04	401.57	8,959	1,169,690	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	279.9	702.48	512	66,943	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	123.01	135.09	3,547	463,156	保険
VOLKSWAGEN AG	27.58	31.53	757	98,962	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	163.61	179.03	3,270	427,045	自動車
NEMETSCHEK SE	50.95	48.41	370	48,414	ソフトウェア
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,659.49	2,132.85	2,963	386,954	資本市場
BMW VORZUG	41.16	69.57	539	70,439	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,993.58	3,241.17	5,619	733,687	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	30.44	26.86	1,104	144,166	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,188.79	1,266.18	4,111	536,769	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4.79	4.79	326	42,613	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG	37.71	35.01	461	60,267	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	25.11	75.33	354	46,303	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	167.52	196.7	3,101	404,991	資本市場
LANXESS AG	68.56	71.94	371	48,559	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	48.73	48.07	931	121,660	航空宇宙・防衛

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	不動産管理・開発 化学 商社・流通業 化学 各種電気通信サービス 不動産管理・開発 機械 不動産管理・開発 機械 ヘルスケア機器・用品 ソフトウェア 電気設備 機械 インターネット販売・通信販売 インタラクティブ・メディアおよびサービス 化学 食品・生活必需品小売り 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 インターネット販売・通信販売					
DEUTSCHE WOHNEN		290.97	—	—	—						
SYMRISE AG		113.08	121.06	1,225	160,031						
BRENNTAG SE		140.44	163.1	1,249	163,072						
EVONIK INDUSTRIES AG		171.16	233.4	675	88,188						
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		983.85	983.85	260	34,026						
LEG IMMOBILIEN SE		59.34	61.13	688	89,907						
KION GROUP AG		59.03	75.08	586	76,557						
VONOVIA SE		454.51	700.86	3,315	432,906						
KNORR-BREMSE AG		68.6	68.6	604	78,906						
SIEMENS HEALTHINEERS AG		238.05	284.75	1,576	205,811						
TEAMVIEWER AG		136.68	—	—	—						
SIEMENS ENERGY AG		358.31	357.61	667	87,122						
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		—	378.31	1,186	154,918						
ZALANDO SE		147.56	208.57	1,287	168,069						
SCOUT24 SE		96.7	96.7	505	66,054						
COVESTRO AG		163.37	191.58	1,010	131,866						
HELLOFRESH SE		128.38	169.9	829	108,337						
UNIPER SE		182.03	104.27	406	53,092						
DELIVERY HERO SE		109.74	166.45	720	94,033						
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,034.34 61銘柄	24,688.56 59銘柄	124,078 —	16,199,712 <2.5%>						
(ユーロ…ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	食品・生活必需品小売り 電力 石油・ガス・消耗燃料					
JERONIMO MARTINS		195.17	331.35	644	84,142						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		2,386.62	2,686.36	1,074	140,292						
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		400.88	382.82	382	49,911						
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,982.67 3銘柄	3,400.53 3銘柄	2,101 —	274,346 <0.0%>						
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	電力 電気設備 石油・ガス・消耗燃料 各種電気通信サービス 電力 建設・土木 銀行 ガス 銀行 電力 専門小売り ガス バイオテクノロジー 建設・土木 銀行 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 情報技術サービス 建設・土木 運送インフラ 各種電気通信サービス					
IBERDROLA SA		5,508.72	5,945.92	5,436	709,848						
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		212.06	212.06	347	45,322						
REPSOL SA		1,359.9	1,502.89	1,753	228,946						
TELEFONICA S.A		4,558.87	5,375.23	2,353	307,313						
ENDESA S.A.		277.36	286.39	524	68,537						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		213.95	228.77	502	65,590						
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		5,782.51	6,440.62	3,691	481,912						
NATURGY ENERGY GROUP SA		236.12	162.89	400	52,252						
BANCO SANTANDER SA		15,869.57	16,741.54	5,601	731,360						
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA		345.96	462.37	786	102,744						
INDITEX		1,004.23	1,042.55	2,640	344,780						
ENAGAS		234.77	234.77	436	57,011						
GRIFOLS SA		235.18	306.87	443	57,853						
FERROVIAL SA		405.93	464.37	1,105	144,294						
CAIXABANK		3,073.31	4,097.23	1,348	176,046						
EDP RENOVAVEIS SA		—	279.72	475	62,084						
AMADEUS IT GROUP SA		411.18	467.67	2,821	368,429						
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS		213.57	—	—	—						
AENA SME SA		62.56	70.76	1,061	138,576						
CELLNEX TELECOM SAU		272.34	487.6	1,901	248,278						
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,278.09 19銘柄	44,810.22 19銘柄	33,633 —	4,391,186 <0.7%>						

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	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	975.69	1,117.77	2,051	267,865	保険
INTESA SANPAOLO	15,123.69	15,981.58	4,422	577,349	銀行
UNICREDIT SPA	1,939.1	2,056.36	3,089	403,415	銀行
ENI SPA	2,193.31	2,418.13	3,221	420,653	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	574.42	574.42	583	76,233	銀行
ENEL SPA	7,299.44	7,880.51	4,980	650,251	電力
SNAM SPA	1,712.94	1,989.63	944	123,310	ガス
TELECOM ITALIA SPA	7,626.75	8,325.8	343	44,893	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	—	—	—	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	452.99	457.18	739	96,547	運送インフラ
TERNA SPA	1,136.54	1,671.4	1,106	144,460	電力
RECORDATI SPA	103.03	103.03	461	60,236	医薬品
AMPLIFON SPA	113.72	113.72	395	51,579	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	223.28	218.22	600	78,463	電気設備
DIASORIN SPA	22.23	22.23	266	34,755	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	175.67	228.55	1,244	162,446	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	430.97	435.86	551	71,957	情報技術サービス
FINECOBANK SPA	538.18	652.74	1,011	132,008	銀行
POSTE ITALIANE SPA	400.15	557.49	601	78,572	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	233.44	232.81	206	26,979	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	46,251.5 20銘柄	45,037.43 19銘柄	26,822 —	3,501,981 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	240.85	238.04	630	82,358	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	349.35	486.12	496	64,832	機械
UPM-KYMMENE OYJ	448.29	559.82	1,837	239,881	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	532.5	555.48	1,009	131,811	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	448.22	499.85	2,214	289,103	保険
FORTUM OYJ	394.09	408.2	962	125,615	電力
NOKIA OYJ	5,185.32	5,106.9	2,489	325,043	通信機器
ELISA OYJ	136.42	136.42	691	90,266	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	367.96	432.9	1,627	212,456	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	298.9	319.56	1,750	228,551	機械
ORION OYJ	80.51	81.06	281	36,797	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	8,482.41 11銘柄	8,824.35 11銘柄	13,991 —	1,826,718 <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	170.07	951	124,255	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	69.24	69.16	650	84,877	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	301	39,426	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	242.04	315.46	1,319	172,324	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	179.11	195.72	509	66,489	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	717.31 5銘柄	849.16 5銘柄	3,732 —	487,372 <0.1%>
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	974,571.62 1,224銘柄	1,063,294.07 1,228銘柄	— —	598,417,771 <93.1%>

(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	
				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	—	—	—
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	87,844 1銘柄	— —銘柄	—	— <— %>

(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 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)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		12.006	13.788	2,531	292,214	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		12.947	14.801	1,730	199,789	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		22.693	—	—	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		127.559	150.15	1,079	124,604	0.0
PROLOGIS INC		66.35	72.03	10,468	1,208,313	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		12.329	13.356	3,180	367,120	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST		9.643	10.44	1,691	195,243	0.0
EQUINIX INC		7.992	8.702	5,824	672,315	0.1
DUKE REALTY TRUST		31.929	35.306	1,925	222,292	0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP		38.831	42.028	7,043	812,909	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		5.504	6.132	1,939	223,898	0.0
EQUITY RESIDENTIAL		35.108	34.397	2,955	341,111	0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		45.543	49.946	1,603	185,049	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP		9.838	10.551	3,263	376,725	0.1
WELLTOWER INC		38.411	40.744	3,246	374,661	0.1
IRON MOUNTAIN INC		24.591	28.44	1,241	143,283	0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		16.087	16.573	1,268	146,429	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		63.952	75.616	1,355	156,485	0.0
MID AMERICA		10.854	11.699	2,428	280,294	0.0
REALTY INCOME CORP		29.466	53.267	3,563	411,244	0.1
REGENCY CENTERS CORP		14.499	14.665	955	110,292	0.0
UDR INC		27.057	28.289	1,544	178,308	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		28.083	31.871	4,458	514,629	0.1
PUBLIC STORAGE		13.834	15.276	5,432	627,048	0.1
SUN COMMUNITIES INC		9.67	11.066	2,093	241,678	0.0
VENTAS INC		35.021	40.408	2,022	233,474	0.0
VORNADO REALTY TRUST		12.714	15.123	616	71,111	0.0
WEYERHAEUSER CO		64.096	72.184	2,953	340,840	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		12.385	13.998	2,718	313,775	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC		23.492	27.36	3,724	429,915	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST		53.911	54.08	1,123	129,706	0.0
AGNC INVESTMENT CORP		46.028	44.32	607	70,132	0.0
VEREIT INC		20.534	—	—	—	—
AMERICAN TOWER CORP		39.736	44.301	10,379	1,197,976	0.2
WP CAREY INC		15.529	19.446	1,474	170,174	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
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
INVITATION HOMES INC	50.475	55.207	2,285	263,800	0.0	
VICI PROPERTIES INC	47.083	57.882	1,629	188,129	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	1,135.78 37銘柄<1.8%>	1,233.442 35銘柄<1.8%>	102,365 —	11,814,981 —	— 1.8
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%
CANADIAN APT PPTYS REIT	7.954	8.22	456	41,361	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13.467	13.467	319	28,966	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	21.421 2銘柄<0.0%>	21.687 2銘柄<0.0%>	775 —	70,328 —	— 0.0
(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	414.125	1,031	84,875	0.0	
GPT GROUP	158.232	207.292	1,048	86,334	0.0	
STOCKLAND	194.018	243.481	954	78,560	0.0	
DEXUS	108.972	101.202	1,028	84,632	0.0	
GOODMAN GROUP	148.357	158.185	3,609	297,121	0.0	
VICINITY CENTRES	371.711	371.711	631	52,012	0.0	
SCENTRE GROUP	420.268	479.376	1,414	116,399	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	1,730.976 7銘柄<0.1%>	1,975.372 7銘柄<0.1%>	9,718 —	799,936 —	— 0.1
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	200.2	199.7	13,280	196,411	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	200.2 1銘柄<0.0%>	199.7 1銘柄<0.0%>	13,280 —	196,411 —	— 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	483.636	545.177	1,117	95,768	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292.606	248.606	703	60,287	0.0	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	—	—	—	—	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270.1	484.5	838	71,824	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	192.3	348	29,825	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	1,430.742 5銘柄<0.1%>	1,470.583 4銘柄<0.0%>	3,007 —	257,705 —	— 0.0
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC	69.819	75.77	407	63,737	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	55.843	74.028	583	91,233	0.0	
SEGRO PLC	100.956	120.36	1,486	232,242	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	226.618 3銘柄<0.1%>	270.158 3銘柄<0.1%>	2,478 —	387,213 —	— 0.1
(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA	3.67	4.763	530	69,212	0.0	
KLEPIERRE	17.099	17.099	404	52,819	0.0	
COVIVIO	4.663	4.663	337	44,077	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12.92	12.92	884	115,480	0.0	
小計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	38.352 4銘柄<0.0%>	39.445 4銘柄<0.0%>	2,156 —	281,590 —	— 0.0
合計	□ 数・金 額 銘柄 数<比率>	4,784.089 59銘柄<2.1%>	5,210.387 56銘柄<2.1%>	— —	13,808,167 —	— 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 8,545		百万円 －
	S & P / T S E 6 0 I X F U T	421		－
	S P I 2 0 0 F U T U R E S	264		－
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E	536		－
	D J E U R O S T O X X 5 0	1,772		－

(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

2022年2月15日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
株式	千円 598,417,771	% 92.9	
投資信託受益証券、投資証券	13,808,167	2.1	
コール・ローン等、その他	31,698,088	4.9	
投資信託財産総額	643,924,027	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、642,251,567千円、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、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.42円、1カナダ・ドル＝90.68円、1オーストラリア・ドル＝82.31円、1香港・ドル＝14.79円、1シンガポール・ドル＝85.69円、1ニュージーランド・ドル＝76.43円、1イギリス・ポンド＝156.24円、1イスラエル・シェケル＝35.452円、1スイス・フラン＝124.94円、1デンマーク・クローネ＝17.54円、1ノルウェー・クローネ＝13.00円、1スウェーデン・クローナ＝12.30円、1ユーロ＝130.56円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

項 目		当 期 末
(A) 資 産		663,074,590,376円
一 般 株 式	等 式(評価額)	8,092,389,228
信 託 受 益 証 券	(評価額)	598,417,771,479
資 信 託 受 益 証 券	(評価額)	1,057,641,470
収 入 配 入 当 金		12,750,525,590
入 収 委 託 証 金		37,918,383,393
		461,392,808
(B) 負 債		4,376,486,408
未 払 金		20,432,094,210
未 払 金		20,346,719,210
		85,375,000
(C) 純 資 産	総 額(A－B)	642,642,496,166
元 本		113,101,593,550
次 期 繰 越 損 益		529,540,902,616
(D) 受 益 権 越 損 益		113,101,593,550円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)		56,820円

(注1)	期首元本額	101,430,005,374円
	追加設定元本額	93,876,718,442円
	一部解約元本額	82,205,130,266円
(注2)	期末における元本の内訳	
	D I A M外国株式バッシブ・ファンド	3,311,871,905円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,512,255円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,337,563円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	57,023,138円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	20,046,091円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	11,721,611円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	11,183,927円
	たわらノーロード 先進国株式	29,209,837,872円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	379,011,003円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,783,685,914円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	582,139,859円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	67,491,775円
	たわらノーロード バランス (標準型)	540,044,742円
	たわらノーロード バランス (積極型)	666,401,105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)	881,601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)	148,165,312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)	439,640,001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)	332,155,340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)	491,044,760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)	1,241,327円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	18,750,438円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,399,492円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,200,746円
	たわらノーロード 全世界株式	228,421,540円
	D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,140,481,555円
	One DC 先進国株式インデックスファンド	2,232,942,901円
	One グローバルバランス	2,978,639円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	152,382,039円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	773,961,717円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,005,264,576円
	D I A M DC バランス30インデックスファンド	95,122,258円
	D I A M DC バランス50インデックスファンド	265,971,133円
	D I A M DC バランス70インデックスファンド	248,725,315円
	マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,541,627円
	マネックス資産設計ファンド (育成型)	686,570,224円
	マネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,490円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	172,284,428円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	172,035,194円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	304,995,876円
	投資のソムリエ	4,886,217,076円
	グルースコントロール	36,245,544円
	投資のソムリエ<DC年金>	294,714,139円
	D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	187,167,284円
	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	142,899,507円
	D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	31,756,762円
	D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	1,000,259円
	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	162,957,398円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,118,793,304円

ワールドアセットバランス (基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	434,831,464円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	26,209,400円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	12,968,412円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,345,477円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	39,369,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	95,606,011円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	361,901,590円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,502,748円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	25,023,763円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	11,301,608円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	9,568,065円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	29,534,589円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	622,063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)	126,295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)	83,555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)	1,732,862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)	13,744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)	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家限定)	557,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	57,490,733円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	75,883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)	958,242,351円
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	63,352,968円
D I A M外国株式バッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,191,786,446円
D I A M先進国株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,189,774,417円
外国株式バッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,052,411,163円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	73,837,834円
D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定)	8,226,089円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	206,917円
リスクコントロール世界8資産(バランスファンド) (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	2,898,910円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	31,546,987円
D I A Mグローバル・バランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	56,354,600円
D I A M国際分散(バランスファンド)30 V A (適格機関投資家限定)	2,722,727円
D I A M国際分散(バランスファンド)50 V A (適格機関投資家限定)	22,177,017円
D I A M国内重視(バランスファンド)30 V A (適格機関投資家限定)	1,568,925円
D I A M国内重視(バランスファンド)50 V A (適格機関投資家限定)	489,870円
D I A M世界(バランスファンド)40 V A (適格機関投資家限定)	3,953,136円
D I A M世界(バランスファンド)50 V A (適格機関投資家限定)	28,909,778円
D I A M(バランスファンド)25 V A (適格機関投資家限定)	204,390,999円
D I A M(バランスファンド)37.5 V A (適格機関投資家限定)	306,392,875円
D I A M(バランスファンド)50 V A (適格機関投資家限定)	998,858,127円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	86,555,947円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	51,952,941円
D I A M アサ グローバル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	332,991,420円
D I A M世界アセット(バランスファンド)V A (適格機関投資家向け)	13,689,728円
D I A M世界(バランスファンド)55 V A (適格機関投資家限定)	3,498,398円
D I A M世界アセット(バランスファンド)2 V A (適格機関投資家限定)	128,366,149円
D I A M世界アセット(バランスファンド)40 V A (適格機関投資家限定)	11,208,160円
D I A M世界アセット(バランスファンド)25 V A (適格機関投資家限定)	40,455,375円
D I A M世界アセット(バランスファンド)3 V A (適格機関投資家限定)	63,324,997円
D I A M世界アセット(バランスファンド)4 V A (適格機関投資家限定)	130,176,054円
期末元本合計	113,101,593,550円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月15日

項 目					当 期
(A)	配当	等配	収当	益	9,113,239,420円
	受取			金	9,080,104,798
	受取	取	利	息	12,472
	の	他	収	益	33,540,265
	支払		利	息	△418,115
(B)	有価証券	券	売買	損益	89,816,332,579
	売	買		益	130,353,926,209
	売	買		損	△40,537,593,630
(C)	先物取引	等	取引	損益	1,292,545,584
	取	引		益	2,927,958,743
	取	引		損	△1,635,413,159
(D)	その他		費用		△203,677,815
(E)	当期損益		金(A + B + C + D)		100,018,439,768
(F)	前期繰越		損益	金	376,135,937,658
(G)	解約差		損益	金	△371,018,562,768
(H)	追加信託		差損益	金	424,405,087,958
(I)	合計		計(E + F + G + H)		529,540,902,616
	次期繰越		損益	金(I)	529,540,902,616

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注3) (H)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

《お知らせ》

■信託金の限度額を 1 兆円から 3 兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

(2021年12月21日)

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19期（決算日 2022年2月14日）

（計算期間 2021年2月16日～2022年2月14日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月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				
15期 (2018年2月14日)	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
16期 (2019年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	355,598
17期 (2020年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
18期 (2021年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
19期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	—	553,303

（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

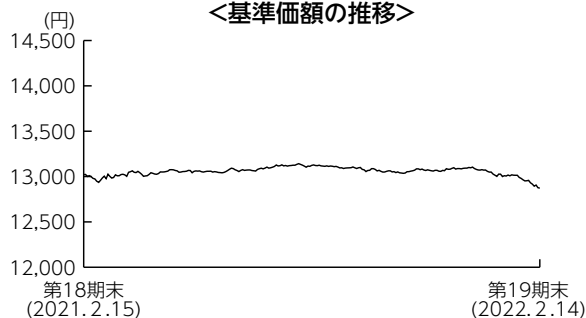
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2021 年 2 月 15 日	円 13,022	% —	ポイント 385.59	% —	% 99.2	% —	% —
2 月 末	12,936	△0.7	383.06	△0.7	99.5	—	—
3 月 末	13,025	0.0	385.72	0.0	99.7	—	—
4 月 末	13,049	0.2	386.44	0.2	99.8	—	—
5 月 末	13,054	0.2	386.62	0.3	99.9	—	—
6 月 末	13,061	0.3	386.90	0.3	99.8	—	—
7 月 末	13,125	0.8	388.81	0.8	99.7	—	—
8 月 末	13,114	0.7	388.46	0.7	99.4	—	—
9 月 末	13,069	0.4	387.12	0.4	105.3	—	—
10 月 末	13,054	0.2	386.72	0.3	100.2	—	—
11 月 末	13,086	0.5	387.65	0.5	99.6	—	—
12 月 末	13,057	0.3	386.84	0.3	100.4	—	—
2022 年 1 月 末	12,964	△0.4	384.06	△0.4	99.3	—	—
(期 末) 2022 年 2 月 14 日	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

＜基準価額の推移＞



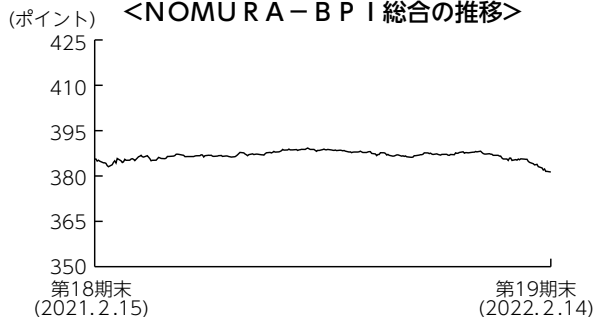
基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%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。期初は株式市場の上昇などを受けて基準価額は下落しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、国内景気の先行き不透明感が意識され基準価額は上昇しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手するとの観測が広がり基準価額は下落しました。

＜NOMURA-BPI総合の推移＞



投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初は株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。2021年3月から8月にかけては新型コロナウイルスの感染収束が見通せず、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）しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手するとの観測が広がり利回りは上昇しました。

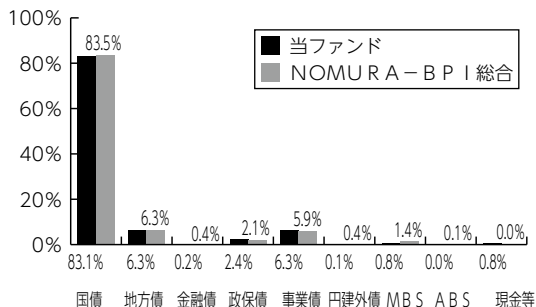
ポートフォリオについて

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。

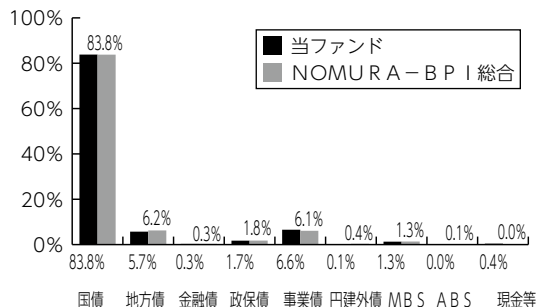
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

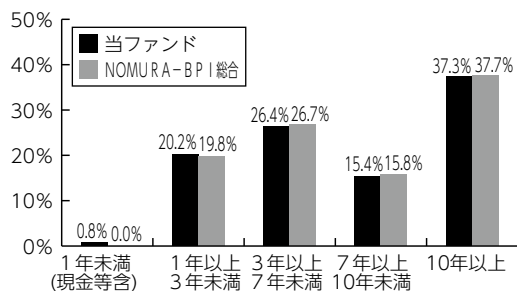


期末

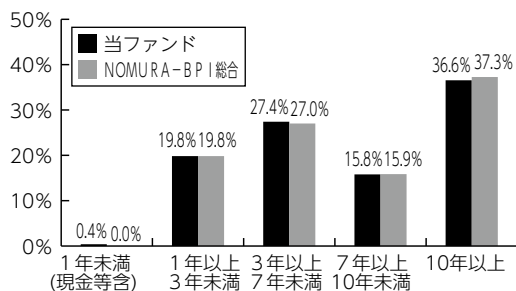


○残存年限別構成比

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1.1%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（2021年 2 月16日から2022年 2 月14日まで）

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 717,343,530	千円 471,488,133 (-)
	地方債証券	18,975,569	4,218,721 (-)
	特殊債証券	14,592,716	2,073,694 (297,842)
	社債証券	19,760,179	2,338,632 (-)

(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（2021年 2 月16日から2022年 2 月14日まで）

(1) 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 770,671	百万円 100,563	% 13.0	百万円 480,119	百万円 73,234	% 15.3

(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
公社債	百万円 304

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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	447,045,000	463,797,306	83.8	—	53.6	19.7	10.5
地 方 債 証 券	30,445,330	31,523,404	5.7	4.7	3.6	1.4	0.7
特 殊 債 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 券	27,481,000	27,644,946	5.0	0.1	2.4	1.9	0.7
合 計	531,923,315	551,087,616	99.6	4.8	63.0	24.2	12.5

(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	
4 2 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
4 2 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
4 2 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
4 2 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
4 2 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
4 2 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
4 3 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
4 3 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	50,000	52,841	2024/06/20

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	
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	3,820,000	3,863,280	2025/12/20

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 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	75,621 2025/12/20
8 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	182,998 2025/12/20
1 4 7 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,000,000	3,999,160 2026/03/20
3 4 2 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,980,000	3,994,606 2026/03/20
8 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	640,415 2026/03/20
8 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	131,235 2026/03/20
8 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	130,744 2026/03/20
1 4 8 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,900,000	3,898,284 2026/06/20
3 4 3 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,350,000	4,366,008 2026/06/20
8 8 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	648,504 2026/06/20
8 9 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,948 2026/06/20
1 4 9 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,200,000	4,196,136 2026/09/20
3 4 4 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,790,000	5,809,917 2026/09/20
9 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	516,910 2026/09/20
9 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	121,484 2026/09/20
1 5 0 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,300,000	1,298,102 2026/12/20
3 4 5 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,190,000	5,206,296 2026/12/20
9 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,275,826 2026/12/20
3 4 6 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,740,000	4,754,409 2027/03/20
9 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	406,837 2027/03/20
9 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	740,108 2027/03/20
3 4 7 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,030,000	5,044,737 2027/06/20
9 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	550,000	616,099 2027/06/20
9 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	133,142 2027/06/20
3 4 8 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,990,000	5,003,872 2027/09/20
9 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	660,000	739,160 2027/09/20
9 8 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	178,297 2027/09/20
3 4 9 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,430,000	4,441,606 2027/12/20
9 9 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	750,000	839,340 2027/12/20
3 5 0 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,210,000	5,221,045 2028/03/20
1 0 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	830,000	937,783 2028/03/20
1 0 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.4000	230,000	262,657 2028/03/20
3 5 1 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,600,000	4,608,694 2028/06/20
1 0 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.4000	500,000	573,740 2028/06/20
1 0 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	160,000	182,587 2028/06/20
1 0 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	124,138 2028/06/20
3 5 2 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,440,000	4,447,281 2028/09/20
1 0 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	640,000	725,280 2028/09/20
1 0 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	569,905 2028/09/20
3 5 3 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,810,000	4,816,541 2028/12/20
1 0 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	600,000	682,722 2028/12/20
1 0 8 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	690,000	775,739 2028/12/20
3 5 4 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,060,000	4,064,263 2029/03/20
1 0 9 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	350,000	394,908 2029/03/20
1 1 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	502,660 2029/03/20
3 5 5 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,310,000	4,311,551 2029/06/20
1 1 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	460,000	530,794 2029/06/20
1 1 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	740,000	848,491 2029/06/20
3 5 6 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,640,000	3,637,233 2029/09/20
1 回	利付国庫債券 (30年)	2.8000	110,000	132,286 2029/09/20

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	
113回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,170,000	1,345,862	2029/09/20
357回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,690,000	3,684,243	2029/12/20
114回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	820,000	946,895	2029/12/20
115回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	418,510	2029/12/20
2回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	118,144	2030/02/20
358回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,550,000	3,541,444	2030/03/20
116回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	530,000	618,329	2030/03/20
117回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,070,000	1,239,744	2030/03/20
359回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,260,000	4,245,942	2030/06/20
118回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	555,000	640,653	2030/06/20
119回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	470,000	534,775	2030/06/20
120回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	670,000	751,277	2030/06/20
360回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,040,000	4,022,830	2030/09/20
121回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	790,000	908,073	2030/09/20
122回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	650,352	2030/09/20
4回	利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	247,670	2030/11/20
361回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,000,000	3,977,320	2030/12/20
123回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,050,000	1,228,164	2030/12/20
124回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	600,000	696,576	2030/12/20
362回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,750,000	4,715,990	2031/03/20
125回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	709,350	2031/03/20
126回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	510,000	593,813	2031/03/20
127回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	623,905	2031/03/20
363回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,800,000	4,760,304	2031/06/20
128回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,370,000	1,587,227	2031/06/20
129回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	760,000	873,521	2031/06/20
364回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,400,000	4,356,528	2031/09/20
130回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	910,000	1,048,047	2031/09/20
131回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	790,000	902,401	2031/09/20
6回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	242,360	2031/11/20
365回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,300,000	1,285,583	2031/12/20
132回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	830,000	950,184	2031/12/20
133回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,030,000	1,189,093	2031/12/20
134回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	800,000	925,224	2032/03/20
135回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	640,000	733,862	2032/03/20
136回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	660,000	750,274	2032/03/20
137回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	800,000	918,800	2032/06/20
138回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,340,000	1,511,908	2032/06/20
139回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	920,000	1,047,318	2032/06/20
140回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,290,000	2,634,072	2032/09/20
8回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	232,380	2032/11/22
141回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,580,000	1,819,938	2032/12/20
142回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,500,000	1,743,615	2032/12/20
143回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,480,000	1,691,033	2033/03/20
144回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,310,000	1,482,697	2033/03/20
11回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	250,000	288,867	2033/06/20
145回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,350,000	2,715,354	2033/06/20
12回	利付国庫債券 (30年)	2.1000	230,000	276,696	2033/09/20
146回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,280,000	2,639,122	2033/09/20
13回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	150,000	179,062	2033/12/20

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	
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	2,350,000	2,696,319	2033/12/20	
14回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	340,000	422,810	2034/03/20	
148回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	2,210,000	2,512,084	2034/03/20	
15回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	260,000	327,298	2034/06/20	
149回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	2,270,000	2,583,441	2034/06/20	
16回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	240,000	302,973	2034/09/20	
150回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	2,440,000	2,750,685	2034/09/20	
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	270,000	338,447	2034/12/20	
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,460,000	2,713,675	2034/12/20	
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	400,000	497,632	2035/03/20	
152回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,340,000	2,582,494	2035/03/20	
19回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	280,000	349,154	2035/06/20	
153回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	2,620,000	2,926,068	2035/06/20	
20回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	330,000	420,977	2035/09/20	
154回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,690,000	2,969,356	2035/09/20	
21回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	310,000	388,023	2035/12/20	
155回 利付国庫債券 (20年)	1.0000	2,460,000	2,650,133	2035/12/20	
22回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	290,000	371,727	2036/03/20	
156回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,550,000	2,538,142	2036/03/20	
23回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	350,000	449,694	2036/06/20	
157回 利付国庫債券 (20年)	0.2000	2,430,000	2,346,553	2036/06/20	
24回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	270,000	347,706	2036/09/20	
158回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,690,000	2,706,543	2036/09/20	
25回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	330,000	416,394	2036/12/20	
159回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	2,480,000	2,526,475	2036/12/20	
26回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	620,000	792,521	2037/03/20	
160回 利付国庫債券 (20年)	0.7000	2,010,000	2,073,676	2037/03/20	
27回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,890,000	1,919,654	2037/06/20	
161回 利付国庫債券 (20年)	2.5000	620,000	805,206	2037/09/20	
28回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,820,000	1,846,317	2037/09/20	
162回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	2,070,000	2,097,303	2037/12/20	
29回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	770,000	1,003,825	2038/03/20	
163回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,680,000	2,668,074	2038/03/20	
30回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	2,310,000	2,296,116	2038/06/20	
164回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	860,000	1,112,083	2038/09/20	
31回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,830,000	1,873,151	2038/09/20	
165回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,970,000	1,950,300	2038/12/20	
32回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	880,000	1,126,734	2039/03/20	
166回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,680,000	1,632,976	2039/03/20	
33回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,950,000	1,858,096	2039/06/20	
167回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	720,000	912,038	2039/09/20	
34回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,420,000	1,348,971	2039/09/20	
168回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,740,000	1,649,206	2039/12/20	
35回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	970,000	1,248,263	2040/03/20	
169回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,510,000	1,453,586	2040/03/20	
36回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	2,120,000	2,036,472	2040/06/20	
170回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	1,180,000	1,462,456	2040/09/20	
37回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,990,000	1,907,454	2040/09/20	
171回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,930,000	1,879,820	2040/12/20	
38回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,200,000	1,532,796	2041/03/20	

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	
176回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,080,000	2,021,843	2041/03/20	
177回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,300,000	2,191,785	2041/06/20	
35回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,460,000	1,818,371	2041/09/20	
178回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,100,000	2,036,391	2041/09/20	
179回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	800,000	776,176	2041/12/20	
36回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	2,170,000	2,712,239	2042/03/20	
37回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	2,260,000	2,788,297	2042/09/20	
38回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,550,000	1,885,854	2043/03/20	
39回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,220,000	1,510,055	2043/06/20	
40回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	940,000	1,145,784	2043/09/20	
41回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,080,000	1,295,665	2043/12/20	
42回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,120,000	1,344,560	2044/03/20	
43回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,120,000	1,345,489	2044/06/20	
44回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,130,000	1,358,395	2044/09/20	
45回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,270,000	1,474,444	2044/12/20	
46回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,670,000	1,939,404	2045/03/20	
47回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,310,000	1,549,651	2045/06/20	
48回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,640,000	1,870,567	2045/09/20	
49回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,460,000	1,665,422	2045/12/20	
50回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,660,000	1,675,222	2046/03/20	
51回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,350,000	1,211,233	2046/06/20	
52回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	1,510,000	1,418,358	2046/09/20	
53回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,200,000	1,151,448	2046/12/20	
54回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,450,000	1,454,553	2047/03/20	
55回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,520,000	1,523,207	2047/06/20	
56回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,230,000	1,231,303	2047/09/20	
57回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,300,000	1,300,000	2047/12/20	
1回 利付国庫債券 (40年)	2.4000	110,000	151,087	2048/03/20	
58回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,670,000	1,666,392	2048/03/20	
59回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,520,000	1,478,884	2048/06/20	
60回 利付国庫債券 (30年)	0.9000	1,130,000	1,149,729	2048/09/20	
61回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,140,000	1,102,619	2048/12/20	
2回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	630,000	836,621	2049/03/20	
62回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	1,070,000	981,050	2049/03/20	
63回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,160,000	1,032,724	2049/06/20	
64回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,180,000	1,048,418	2049/09/20	
65回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,010,000	895,567	2049/12/20	
3回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	540,000	720,835	2050/03/20	
66回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,090,000	965,631	2050/03/20	
67回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,550,000	1,446,615	2050/06/20	
68回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,340,000	1,249,992	2050/09/20	
69回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,450,000	1,388,360	2050/12/20	
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	966,996	2051/03/20	
70回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,420,000	1,359,224	2051/03/20	
71回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,600,000	1,531,040	2051/06/20	
72回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,500,000	1,434,915	2051/09/20	
73回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	600,000	573,792	2051/12/20	
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	1,010,000	1,311,889	2052/03/20	
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	1,030,000	1,317,009	2053/03/20	
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	1,190,000	1,463,473	2054/03/20	

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回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	1,310,000	1,505,792
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,950,000	1,675,966
10回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,820,000	1,829,755
11回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,480,000	1,441,638
12回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,400,000	1,228,892
13回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,730,000	1,512,244
14回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	1,700,000	1,585,624
小 計		—	447,045,000	463,797,306
(地方債証券)		%	千円	千円
7 1 9回	東京都公募公債	0.8600	200,000	201,858
1 2 1回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	503,335
2 5 年度 4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	303,270
7 2 0回	東京都公募公債	0.8700	300,000	303,474
1回	東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	102,059
2 5 年度 4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	202,128
2 5 年度 2回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	404,956
3 7 4回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	304,038
2 5 年度 5回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	202,532
2 5 年度 6回	千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,271
2 9 回 1号	宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,134
1 2 7回	共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,134
1 2 8回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	303,459
2 5 年度 2回	島根県公募公債	0.6700	106,000	107,246
7 2 6回	東京都公募公債	0.7300	400,000	405,316
2 5 年度 8回	埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,289
2 5 年度 1 1回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	202,736
2 5 年度 2回	新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,322
1 3 2回	共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,345
2 0 8回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	303,732
2 6 年度 4回	札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,219
1回	兵庫県公募公債 (12年)	1.1000	300,000	307,608
2 6 年度 4回	神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,402
2 6 年度 5回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	405,720
4 8 8回	名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	456,633
2 6 年度 1回	相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,295
2 6 年度 1回	長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,361
2 6 年度 1回	静岡県公募公債	0.5150	100,000	101,332
2 6 年度 1 1回	京都府公募公債	0.4760	350,000	354,382
2 6 年度 1回	三重県公募公債	0.4560	100,000	101,188
2 6 年度 1回	浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,866
1 4 2回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	504,480
2 6 年度 3回	広島市公募公債	0.4290	100,000	101,177
2 6 年度 1 7回	兵庫県公募公債	0.4600	200,000	202,544
5回	東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	106,390
2 1 3回	神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,524
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	405,336
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	610,044
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	508,730
7回	東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	107,575
1回	静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	107,627

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	
27年度15回	愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,571	2025/11/27
153回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,575	2025/12/25
27年度9回	千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,122	2026/03/25
157回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,074	2026/04/24
9回	東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	220,570	2026/06/19
159回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,998	2026/06/25
1回	兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	214,114	2026/07/29
28年度6回	北海道公募公債	0.0700	100,000	99,977	2026/08/31
760回	東京都公募公債	0.0450	100,000	99,862	2026/09/18
10回	東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	330,960	2026/09/18
4回	京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	111,143	2026/09/18
413回	大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,723	2026/10/28
166回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	502,335	2027/01/25
28年度8回	福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,725	2027/02/24
419回	大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,392	2027/04/27
2回	静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	106,848	2027/06/25
5回	兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,010	2027/07/07
29年度4回	大阪市公募公債	0.1500	200,000	199,998	2027/09/21
174回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,972	2027/09/24
24年度1回	福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	106,797	2027/11/29
178回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	100,471	2028/01/25
179回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	502,535	2028/02/25
29年度6回	広島市公募公債	0.2300	300,000	301,341	2028/02/25
29年度13回	京都府公募公債	0.2000	109,330	109,626	2028/03/16
5回	兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	321,342	2028/05/26
783回	東京都公募公債	0.2200	110,000	110,413	2028/06/20
4回	静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	107,343	2028/06/23
30年度7回	神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	301,740	2028/09/20
第91回	川崎市公募公債	0.1850	200,000	200,260	2028/09/20
7回	静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	342,096	2028/09/21
30年度3回	広島県公募公債	0.2540	100,000	100,581	2028/09/25
30年度3回	堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067	2028/12/19
237回	神奈川県公募公債	0.1350	200,000	199,458	2028/12/20
20回2号	福岡県公募公債	2.0500	100,000	112,685	2028/12/20
6回	大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612	2028/12/20
17回	横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	112,820	2028/12/20
6回	北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	112,474	2028/12/20
30年度6回	福岡県公募公債	0.2000	200,000	200,406	2028/12/21
189回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,237	2028/12/25
30年度14回	北海道公募公債	0.1950	400,000	400,132	2028/12/28
18回	東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	114,282	2029/03/19
30年度19回	愛知県公募公債	0.1150	200,000	199,016	2029/03/28
30年度3回	岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	199,508	2029/03/29
194回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	298,275	2029/05/25
6回	川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	228,986	2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募公債	0.0290	200,000	197,594	2029/06/21
9回	兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	105,986	2029/07/13
11回	神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	113,800	2029/07/20
796回	東京都公募公債	0.0400	200,000	197,530	2029/09/20
令和元年度 9回	静岡県公募公債	0.0500	200,000	197,680	2029/09/20

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
令和元年度3回	横浜市公募債	0.0500	400,000	395,316 2029/10/16
令和元年度16回	兵庫県公募債	0.0500	200,000	197,652 2029/10/23
21回	東京都公募債 20年	2.1900	100,000	115,284 2029/12/20
17回	さいたま市公募債	0.1100	200,000	198,376 2029/12/25
令和元年度第8回	埼玉県公募債	0.1350	200,000	198,670 2030/01/30
21年度2回	福岡県公募債 (20年)	2.2300	100,000	115,890 2030/02/22
203回	共同発行市場公募債地方債	0.0950	100,000	99,013 2030/02/25
802回	東京都公募債	0.1300	400,000	396,980 2030/03/19
511回	名古屋市公募債 10年	0.0750	200,000	197,608 2030/03/27
令和2年度1回	京都府公募債	0.1350	400,000	397,116 2030/04/12
令和2年 2回	大阪府公募債	0.1310	300,000	297,588 2030/05/22
9回	埼玉県公募債 20年	2.1500	100,000	115,631 2030/05/24
8回	静岡県公募債 15年	0.8280	200,000	209,836 2030/06/07
令和2年度 10回	静岡県公募債	0.1350	100,000	99,073 2030/09/20
令和2年5回	福岡県公募債	0.1350	100,000	99,022 2030/10/23
36回2号	宮城県公募債 10年	0.1350	250,000	247,550 2030/10/28
令和2年度1回	福島県公募債	0.1350	200,000	197,936 2030/11/27
令和2年度1回	高知県公募債	0.1350	200,000	197,936 2030/11/27
22年度14回	愛知県公募債	2.0870	300,000	347,595 2030/12/13
9回	京都市公募債 20年	2.1430	200,000	232,738 2030/12/17
813回	東京都公募債	0.1790	300,000	297,897 2030/12/20
16回	神奈川県公募債 20年	2.0900	300,000	348,129 2031/01/24
464回	大阪府公募債 10年	0.0720	200,000	196,622 2031/01/28
令和2年度19回	北海道公募債	0.1450	100,000	98,897 2031/02/26
令和2年度14回	京都府公募債	0.2140	200,000	199,184 2031/03/12
令和2年 7回	広島県公募債	0.2140	200,000	199,182 2031/03/19
251回	神奈川県公募債 10年	0.1990	200,000	198,826 2031/03/20
令和2年度 14回	静岡県公募債	0.1400	200,000	197,780 2031/03/20
令和3年度1回	長野県公募債 10年	0.1900	200,000	198,682 2031/04/16
令和3年度2回	兵庫県公募債	0.1750	100,000	99,165 2031/04/25
467回	大阪府公募債 10年	0.1640	200,000	197,956 2031/04/28
469回	大阪府公募債 10年	0.1280	200,000	197,136 2031/06/27
令和3年 5回	千葉県公募債	0.1050	200,000	196,712 2031/09/25
472回	大阪府公募債 10年	0.1000	200,000	196,436 2031/09/29
19回	神奈川県公募債 20年	1.8180	100,000	114,954 2032/01/30
24年度2回	福岡県公募債 (20年)	1.6350	300,000	340,239 2032/08/16
10回	大阪府公募債 20年	1.7200	200,000	228,482 2032/09/24
24年度12回	神戸市公募債	1.7110	200,000	228,902 2032/12/17
14回	千葉県公募債 20年	1.1370	100,000	108,398 2033/04/15
13回	埼玉県公募債 20年	1.5990	100,000	113,533 2033/05/20
1回	東京都公募債 30年	2.2100	200,000	240,730 2033/06/20
14回	埼玉県公募債 20年	1.5460	300,000	340,266 2034/05/08
29回	横浜市公募債 20年	1.5280	100,000	113,263 2034/05/26
16回	名古屋市公募債 20年	1.5200	100,000	113,143 2034/06/09
5回	群馬県公募債 20年	1.5290	100,000	113,268 2034/06/16
17回	北九州市公募債 20年	1.5290	100,000	113,146 2034/06/20
15回	埼玉県公募債 20年	1.1660	100,000	108,996 2035/02/16
2回	横浜市の公募債 30年	2.4900	100,000	125,684 2035/03/20
18回	千葉県公募債 20年	1.1380	100,000	108,681 2035/04/13
17回	名古屋市公募債 20年	1.2030	100,000	109,504 2035/05/28

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	
13回	大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回	大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回	千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回	神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回	広島市公募公債	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回	札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回	仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回	福岡市公募公債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回	福岡市公募公債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回	兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回	福岡市公募公債	2.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年2回	広島県公募公債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回	札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回	川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回	愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回	東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回	愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回	広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回	埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回	島根県公募公債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回	京都市公募公債 30年定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回	神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	189,564	2051/06/20
小	計	—	30,445,330	31,523,404	—
(特殊債券)		%	千円	千円	
19回	政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	100,742	2023/03/15
55回	鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	504,550	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	503,365	2023/04/28
18回	国際協力機構債券	0.8680	100,000	101,155	2023/06/20
193回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回	政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	430,000	435,835	2023/07/31
116回	高速道路機構債	0.7220	100,000	101,136	2023/09/20
202回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回	政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	550,010	2024/01/19
7回	広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回	政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回	日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	101,219	2024/09/20
71回	鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,362	2024/11/27
21回	政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,357	2025/03/17
241回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回	政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,199	2025/04/25
21回	沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,941	2025/06/20
254回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,487	2025/08/29
127回	日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,949	2025/09/19
85回	中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,841	2025/10/21
172回	住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,676	2025/11/20
23回	国際協力銀行債券	2.0900	100,000	107,806	2025/12/19

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	
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	106,809	2025/12/19
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,957	2026/03/13
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	110,249	2026/03/20
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	100,104	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 1 0 年	0.0900	400,000	400,416	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	106,928	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	498,510	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	320,157	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,168	2026/12/14
3 0 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	100,296	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	211,904	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	301,767	2027/04/13
3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	801,656	2027/04/30
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,734	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,269	2027/07/16
2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,113	2027/11/19
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	100,231	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	107,376	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	299,130	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	301,425	2028/02/18
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	100,521	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	213,926	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.0700	200,000	225,488	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	106,336	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.2660	300,000	344,622	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.2660	300,000	345,489	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	212,340	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	228,672	2029/09/20
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	114,896	2029/12/28
7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	104,386	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	210,748	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	228,104	2030/10/29
1 2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	567,995	2030/10/31
1 3 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.1320	100,000	116,328	2031/01/28
9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	198,172	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	406,605	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	115,414	2031/09/19
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	114,749	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	229,494	2031/12/26
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.6800	100,000	113,574	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	114,784	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債券	1.7240	100,000	113,908	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.7020	200,000	227,792	2032/09/28
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	111,437	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	637,360	2033/12/20
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	112,737	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.5660	100,000	113,297	2034/04/28
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	327,033	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	107,835	2035/05/18
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	110,076	2035/06/20

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	
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.2980	200,000	220,534	2035/06/28
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	110,643	2035/06/29
1 7 1 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	192,904	2036/06/20
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	0.6690	100,000	101,313	2037/04/28
6 回 貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	29,689	2037/05/10
8 回 貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	20,925	2037/05/10
9 回 貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.1900	31,623	31,961	2037/05/10
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	202,422	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	261,262	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	33,411	34,022	2037/11/10
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	100,279	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	99,389	2038/04/20
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	100,551	2038/09/17
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	336,891	2040/07/27
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	119,376	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	51,467	2041/03/10
4 3 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	11,425	2041/06/10
4 4 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	54,809	2041/07/10
5 1 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	32,671	2042/02/10
1 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	53,085	53,678	2042/05/10
4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	10,979	11,161	2042/08/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	306,622	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	18,671	19,689	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	112,585	119,648	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	173,976	183,008	2045/05/10
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	115,645	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	24,221	25,431	2045/07/10
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	224,626	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	106,929	2045/12/20
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	109,865	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	21,048	22,067	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	25,107	26,249	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	26,331	27,540	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	211,822	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	35,764	37,405	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	80,552	83,805	2047/09/10
7 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	34,953	36,402	2048/09/10
8 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,074	42,429	2049/03/10
8 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	41,755	43,162	2049/05/10
8 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	45,545	47,063	2049/07/10
9 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	47,705	48,980	2049/11/10
9 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	52,914	53,535	2050/02/10
9 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	59,393	60,561	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	93,581	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	187,562	2050/06/20
9 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	61,621	63,305	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	186,310	2051/08/31
4 2 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	189,248	2051/10/31
1 1 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	228,276	226,942	2051/11/10
1 1 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,473	77,568	2052/02/10

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	
1 1 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	77,103	77,288	2052/03/10
1 1 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,191	77,317	2052/04/10
1 2 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	241,122	240,948	2052/11/10
1 2 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	241,002	240,671	2053/01/10
1 3 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	163,316	163,084	2053/03/10
1 3 1 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,409	244,643	2053/04/10
1 3 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,211	244,521	2053/05/10
1 3 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	424,330	425,004	2053/10/10
1 3 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	84,346	84,415	2053/12/10
1 4 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	87,002	86,223	2054/03/10
1 5 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	276,159	273,005	2055/03/10
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	122,990	2055/03/19
1 5 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	369,132	366,160	2055/05/10
1 6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	283,044	281,119	2055/09/10
1 6 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,907	289,478	2056/05/10
1 7 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	881,010	873,486	2056/07/10
4 1 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	183,480	2061/02/28
小 計	—	25,151,985	26,325,307	—
(金融債券)	%	千円	千円	
3 4 2 回 利附信金中金債 (5年)	0.1100	100,000	100,077	2023/05/26
い第 8 2 8 号 利付商工債	0.1400	100,000	100,101	2024/05/27
い第 8 4 3 号 利付商工債	0.1200	100,000	100,002	2025/08/27
3 6 9 回 利附信金中金債 (5年)	0.0600	400,000	399,584	2025/08/27
い第 8 5 1 号 利付商工債	0.0900	300,000	299,247	2026/04/27
3 7 7 回 利附信金中金債 (5年)	0.0400	300,000	299,247	2026/04/27
い第 8 5 4 号 利付商工債	0.0800	300,000	299,070	2026/07/27
い第 8 5 5 号 利付商工債	0.0800	200,000	199,324	2026/08/27
小 計	—	1,800,000	1,796,652	—
(普通社債券)	%	千円	千円	
1 4 回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	201,960	2023/03/20
1 0 回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	100,813	2023/03/20
4 7 回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	201,714	2023/03/20
3 0 1 回 北陸電力社債	1.1580	100,000	101,144	2023/03/24
5 回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	100,014	2023/06/06
2 3 回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	303,507	2023/06/09
2 5 回 N T T データ社債	0.9000	200,000	202,124	2023/06/20
2 7 3 回 四国電力社債	1.0000	200,000	202,312	2023/06/23
6 回 J X ホールディングス社債	1.1190	100,000	101,399	2023/07/19
3 7 7 回 中国電力社債	1.1210	400,000	406,036	2023/08/25
1 0 回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	309,228	2023/09/20
2 6 回 フランス相互証券会社銀行 (B F C M) 円債 (2018)	0.4430	100,000	100,225	2023/10/12
4 8 回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	101,521	2023/10/20
4 7 回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,166	2023/10/23
4 2 4 回 九州電力社債	1.2330	200,000	203,762	2023/11/24
5 6 回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	101,345	2023/12/20
1 3 回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	206,906	2023/12/20
3 8 回 電源開発社債	0.9780	300,000	304,485	2023/12/20
4 7 1 回 東北電力社債	1.1680	400,000	407,364	2023/12/25
4 2 6 回 九州電力社債	1.0640	400,000	407,084	2024/02/23
1 3 回 新生銀行社債	0.1500	200,000	199,664	2024/03/12

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	
1 6 回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	202,226	2024/03/19
1 4 回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,259	2024/03/19
4 9 回 住友化学社債	0.9440	100,000	101,598	2024/04/25
2 回 B P C E S A 円債社債 (ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,964	2024/06/28
4 2 8 回 九州電力社債	0.9360	100,000	101,795	2024/07/25
2 9 回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,123	2024/09/03
2 5 回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,909	2024/09/20
7 2 回 三菱地所社債	2.2800	100,000	105,384	2024/09/20
1 6 回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,361	2024/10/28
1 0 回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	202,522	2024/10/28
4 回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,794	2024/10/31
6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	202,624	2024/11/28
2 5 回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	202,578	2024/12/20
1 1 回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	202,466	2024/12/20
3 2 1 回 北海道電力社債	0.8860	261,000	265,865	2024/12/25
1 0 回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,257	2025/02/28
2 6 回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,738	2025/05/21
2 9 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,822	2025/06/11
1 2 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,975	2025/06/20
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	318,549	2025/06/20
4 9 7 回 関西電力社債	1.0020	100,000	102,562	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	212,108	2025/06/20
1 2 回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
2 7 回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
1 4 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,792	2025/12/19
2 6 回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	199,146	2026/03/18
4 2 回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,840	2026/03/24
9 6 回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,565	2026/04/15
1 6 3 回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,954	2026/04/15
2 8 回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	298,170	2026/04/21
4 9 3 回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,520	2026/05/25
1 0 6 回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,410	2026/05/26
2 4 回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,954	2026/06/03
4 0 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,434	2026/06/03
3 5 回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,050	2026/06/05
11 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債 (2016)	0.4000	100,000	99,418	2026/06/10
5 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	100,064	2026/06/19
7 9 回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	299,349	2026/06/19
8 3 回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	199,566	2026/06/19
6 9 回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	298,221	2026/06/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	131,178	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	103,449	2026/06/25
9 0 回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	199,556	2026/07/27
2 0 回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	299,763	2026/07/27
9 1 回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
6 2 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/18
1 7 回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,801	2026/09/18
4 8 8 回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,999	2026/10/23
3 3 回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

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	
3 4 回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16
1 2 回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24
25回 フランス相互信用組合銀行 (BFCM) 円債社債 (2017)	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	100,062	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	300,276	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	200,934	2028/06/06
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	100,028	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	113,448	2029/03/21
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12
1 4 回 プリDESTON社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	99,435	2030/06/25
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	198,448	2030/08/09
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	300,510	2030/12/13

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	
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	201,890	2032/01/23
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	99,513	2036/06/02
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	93,516	2060/12/17
小 計	—	27,481,000	27,644,946	—
合 計	—	531,923,315	551,087,616	—

■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 551,087,616	% 91.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	50,748,215	8.4
投 資 信 託 財 産 総 額	601,835,832	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月14日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資 産	等 価(評価額)	601,835,832,511円
コ ー ル ・ 公 社	債(評価額)	49,696,366,967
未 収 利 息		551,087,616,706
前 払 費 用		809,631,617
負 債	債 金	242,217,221
未 払 解 約		48,532,656,000
(B) 純 資 産	総 額(A - B)	48,532,656,000
元 次 期 繰 越 損 益	本 金	553,303,176,511
(D) 受 益 権 総 口 数		429,840,166,151
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)		12,872円

(注1) 期首元本額	209,919,027,595円
追加設定元本額	611,239,283,321円
一部解約元本額	391,318,144,765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	23,682,506,030円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	83,095,931円
M I T O ラップ型ファンド(中立的)	153,860,446円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	119,506,919円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	687,384,295円
グローバル8資産ラップファンド(中立的)	133,587,952円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893円
たわらノーロード 国内債券	15,834,399,947円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,521,507,162円
たわらノーロード バランス(堅実型)	886,604,365円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,507,222,733円
たわらノーロード バランス(積極型)	189,908,936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)	74,774,735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)	1,322,091,006円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,225,069,364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)	327,185,576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)	22,506,242円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	17,145,320円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	13,611,444円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	90,707,115円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,060,786円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	414,272円
D I A M国内債券インデックスファンド<D C年金>	14,277,651,015円
O n e グローバルバランス	8,911,633円
D I A M/バランス・ファンド<D C年金> 1 安定型	8,982,923,753円
D I A M/バランス・ファンド<D C年金> 2 安定・成長型	12,483,500,015円
D I A M/バランス・ファンド<D C年金> 3 成長型	5,178,995,984円
D I A M D C/バランス30インデックスファンド	2,189,166,701円
D I A M D C/バランス50インデックスファンド	2,329,357,704円
D I A M D C/バランス70インデックスファンド	390,282,840円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	87,660,620円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	3,040,981,442円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	11,707,847円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	4,303,183,102円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	1,576,117,456円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	340,130,669円
投資のソムリエ	86,470,476,048円
クルーズコントロール	331,216,116円
投資のソムリエ<D C年金>	5,215,918,149円
D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	4,612,393,810円
4資産分散投資・ハイクラス<D C年金>	738,611,977円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	1,459,012円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	4,619,684円
投資のソムリエ<D C年金>リスク抑制型	6,424,858,123円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	44,101,884,740円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	35,684,515円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	17,735,957円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	53,072,038円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	176,635,602円
4資産分散投資・スタンダード<D C年金>	2,233,253,084円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,448,159,838円
9資産分散投資・スタンダード<D C年金>	5,330,495,531円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	37,377,953円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	15,418,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	12,877,158円
4資産分散投資・ミドルクラス<D C年金>	327,852,051円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2065)	851,076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)	1,570,192,380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)	1,607,821,940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)	1,368,128,834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)	982,094,880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)	1,551,466,786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)	2,239,773,338円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式優待型) 21-06	1,216,964,056円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,398,783,514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)	8,901,727,961円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	463,351,202円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,068,944,514円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略(債券動向のアロケーション)	379,250,637円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	276,996,912円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I I(適格機関投資家限定)	3,244,504,751円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I I I(適格機関投資家限定)	3,251,938,545円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI V(適格機関投資家限定)	3,223,328,742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)	2,685,868,185円
リスクコントロール世界8資産(バランスファンド)(F O F 5用)(適格機関投資家専用)	51,300,165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)	165,802,939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)	98,585,137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)	27,788,034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)	97,096,530円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	34,365,367円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,318,042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)	25,972,068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)	126,573,725円
D I A M/バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,587,635,563円
D I A M/バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,301,884,615円
D I A M/バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,374,149,034円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2(適格機関投資家限定)	113,772,635円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	190,263,848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)	2,187,734,764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)	180,904,488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)	10,231,460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)	2,254,611,473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)	49,059,889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)	354,407,860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)	558,346,963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)	950,183,773円
D I A M世界アセット(バランスファンド)30VA(適格機関投資家限定)	298,351,041円
O n e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)	101,646,068円
コアアサリート戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,043,766,730円
動的パッケージファンド<D C年金>	382,409,178円
コア資産形成ファンド	333,573,020円
M H A M日本債券インデックスファンド(ファンダラップ)	227,460,602円
M H A M動的パッケージファンド(適格機関投資家限定)	42,573,117,520円
M H A M日本債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	46,106,741,798円
M H A M動的パッケージ4資産ファンド(適格機関投資家限定)	14,232,766,343円
期末元本合計	1,641,455,600円
	429,840,166,151円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	2,936,984,033円
	受		取	利 息	2,933,836,057
	そ	の	他	収 益	4,106,122
	支		払	利 息	△958,146
(B)	有	価	証	券 売 買 損 益	△10,450,257,321
	売			買 益	660,402,300
	売			買 損	△11,110,659,621
(C)	当	期	損	益 金(A + B)	△7,513,273,288
(D)	前	期	繰 越	損 益 金	63,427,095,992
(E)	解	約	差	損 益 金	△119,188,902,023
(F)	追	加	信 託	差 損 益 金	186,738,089,679
(G)	合			計(C + D + E + F)	123,463,010,360
	次	期	繰 越	損 益 金(G)	123,463,010,360

(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19期（決算日 2022年2月21日）

（計算期間 2021年2月23日～2022年2月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2002年12月10日から無期限です。
運 用 方 針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「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	債券先物率	純 資 産 額
	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期 (2018年2月21日)	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	—	217,863
16期 (2019年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	—	197,670
17期 (2020年2月21日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	—	130,803
18期 (2021年2月22日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—	137,037
19期 (2022年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—	141,964

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークは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）。

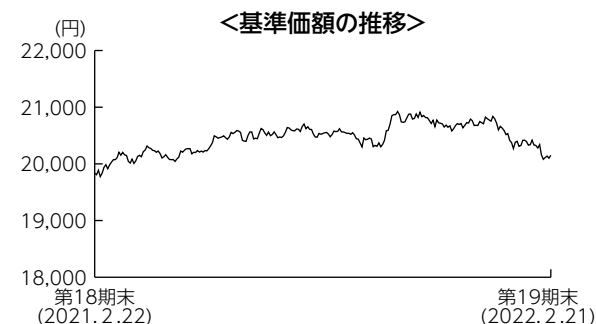
■当期中の基準価額と市況の推移

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 率 比	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 22 日	円 19,836	% —	ポイント 124,229.95	% —	% 98.4	% —
2 月 末	19,776	△0.3	124,359.44	0.1	99.0	—
3 月 末	20,213	1.9	126,595.03	1.9	95.3	—
4 月 末	20,206	1.9	126,569.17	1.9	97.6	—
5 月 末	20,477	3.2	128,227.80	3.2	98.9	—
6 月 末	20,443	3.1	128,117.08	3.1	97.7	—
7 月 末	20,584	3.8	128,989.36	3.8	98.8	—
8 月 末	20,579	3.7	128,937.19	3.8	98.7	—
9 月 末	20,439	3.0	128,115.00	3.1	98.8	—
10 月 末	20,879	5.3	130,788.36	5.3	98.8	—
11 月 末	20,647	4.1	129,217.14	4.0	98.6	—
12 月 末	20,775	4.7	130,157.13	4.8	99.3	—
2022 年 1 月 末	20,418	2.9	128,015.91	3.0	99.0	—
(期 末) 2022 年 2 月 21 日	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月23日から2022年2月21日まで）

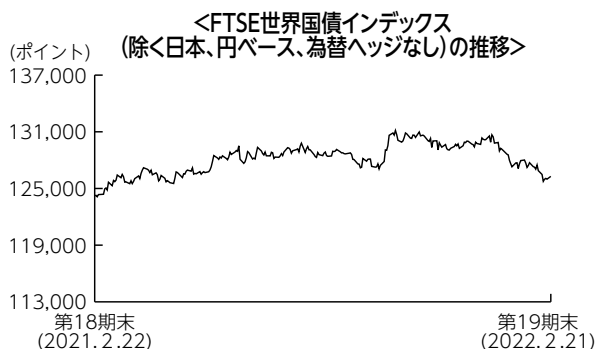


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,152円となり、前期末比で1.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

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

ポートフォリオについて

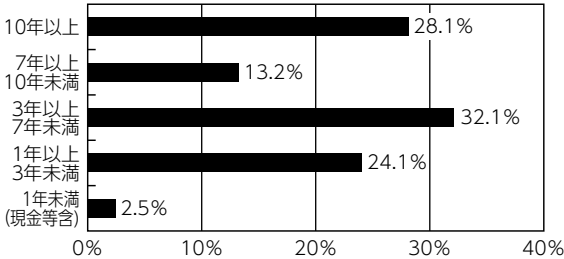
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

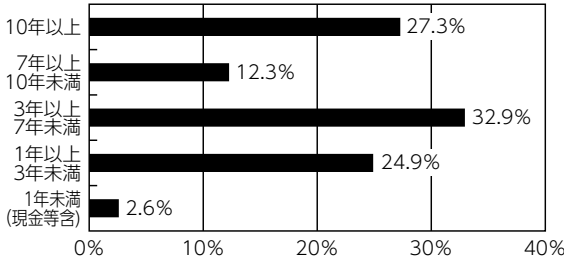
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国		当ファンド	世界国債インデックス	差
北米	米国	42.4%	43.3%	△0.9%
	カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
	計	44.3%	45.2%	△0.9%
中南米	メキシコ	0.8%	0.8%	0.0%
	計	0.8%	0.8%	0.0%
欧州	オーストリア	1.5%	1.6%	△0.1%
	ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
	フィンランド	0.6%	0.7%	0.0%
	フランス	10.6%	10.7%	△0.2%
	ドイツ	7.5%	7.7%	△0.2%
	アイルランド	0.8%	0.9%	0.0%
	イタリア	9.5%	9.8%	△0.3%
	オランダ	1.8%	1.9%	△0.1%
	スペイン	6.1%	6.1%	0.0%
	ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
	デンマーク	0.5%	0.5%	0.0%
	スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%
	英国	6.6%	6.6%	0.0%
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%
中近東	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%
現金など	イスラエル	0.4%	0.4%	0.0%
	計	0.4%	0.4%	0.0%
現金など		1.6%	—	—
合計		100.0%	100.0%	—

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.7%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

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

(注 1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注 2) 比率欄は「1 万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

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

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

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘 柄	当			期		未
	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,613	46,426	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	2,910	2,738	78,807	2028/04/25
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,240	64,471	2024/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	2,680	2,451	70,538	2025/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,180	2,068	59,511	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,343	67,436	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,250	2,097	60,362	2027/07/25
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	2,740	2,760	79,430	2023/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	194	5,590	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	1,000	967	27,838	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,900	2,362	67,981	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,400	1,190	34,246	2026/10/25
小計	—	—	24,380	23,028	662,640	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	600	715	93,311	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	270	289	37,710	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	320	344	44,947	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	710	831	108,340	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	596	77,813	2023/03/20
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	220	201	26,216	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	420	448	58,429	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	358	46,691	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	729	95,067	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	390	405	52,905	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	520	544	71,027	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	640	666	86,860	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	390	431	56,310	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	350	327	42,749	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	560	560	73,123	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	660	616	80,393	2031/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	450	436	56,912	2030/10/18
小計	—	—	8,040	8,505	1,108,814	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,130	1,820	237,294	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,140	1,731	225,699	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	610	507	66,184	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,107	144,358	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,060	1,590	207,300	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	980	1,197	156,063	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	400	366	47,727	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	630	628	81,879	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	1,310	1,321	172,313	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	270	265	34,662	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	920	918	119,747	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	450	464	60,613	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,130	1,155	150,680	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,130	1,194	155,728	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,280	1,298	169,317	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	980	1,019	132,861	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,000	1,038	135,341	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	792	103,283	2029/07/15

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

銘	柄	当		期			末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(ユーロ…フランス)					%		千	ユーロ		千	ユーロ	千円	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50		国	債	証	券	1.5000	2,000		2,153			280,743	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52		国	債	証	券	0.7500	1,890		1,661			216,658	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53		国	債	証	券	0.7500	650		564			73,560	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66		国	債	証	券	1.7500	820		934			121,829	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72		国	債	証	券	0.5000	600		409			53,334	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24		国	債	証	券	2.2500	1,980		2,095			273,231	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30		国	債	証	券	2.5000	3,240		3,783			493,197	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28		国	債	証	券	0.7500	3,270		3,369			439,218	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31		国	債	証	券	1.5000	3,090		3,351			436,918	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25		国	債	証	券	0.5000	2,490		2,541			331,291	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29		国	債	証	券	0.5000	2,220		2,240			292,119	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34		国	債	証	券	1.2500	2,540		2,676			348,849	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26		国	債	証	券	0.5000	2,770		2,823			368,124	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27		国	債	証	券	1.0000	2,460		2,568			334,893	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40		国	債	証	券	0.5000	1,270		1,168			152,287	2040/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23		国	債	証	券	1.7500	2,530		2,604			339,501	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36		国	債	証	券	1.2500	2,590		2,716			354,108	2036/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39		国	債	証	券	1.7500	1,690		1,931			251,834	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44		国	債	証	券	0.5000	740		658			85,778	2044/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国	債	証	券	4.2500	3,130		3,379			440,558	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債	証	券	6.0000	1,800		2,207			287,769	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債	証	券	2.7500	2,840		3,255			424,434	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債	証	券	4.0000	1,630		2,424			315,993	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債	証	券	5.7500	2,100		3,213			418,890	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24		国	債	証	券	1.7500	2,380		2,511			327,439	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債	証	券	1.0000	2,220		2,306			300,662	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債	証	券	0.2500	2,150		2,164			282,208	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債	証	券	0.7500	2,420		2,490			324,648	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31		国	債	証	券	0.0000	2,330		2,190			285,531	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30		国	債	証	券	0.0000	2,800		2,670			348,092	2030/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債	証	券	0.0000	2,550		2,465			321,428	2029/11/25
小計		—		—		95,460			106,041			13,823,543	—
(ユーロ…ドイツ)					%		千	ユーロ		千	ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24		国	債	証	券	6.2500	840		948			123,666	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債	証	券	5.6250	1,160		1,551			202,289	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債	証	券	6.2500	710		1,060			138,228	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債	証	券	5.5000	1,240		1,840			239,989	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債	証	券	4.0000	1,640		2,539			331,104	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債	証	券	0.5000	1,660		1,702			221,937	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債	証	券	0.5000	1,810		1,860			242,473	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,390		1,413			184,200	2029/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23		国	債	証	券	1.5000	920		939			122,528	2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債	証	券	0.5000	1,640		1,691			220,524	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24		国	債	証	券	1.7500	1,750		1,830			238,578	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債	証	券	0.2500	1,960		1,994			260,015	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31		国	債	証	券	0.0000	1,660		1,640			213,861	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30		国	債	証	券	0.0000	1,690		1,680			219,101	2030/02/15
BUNDESUBL 04/14/23		国	債	証	券	0.0000	1,030		1,037			135,296	2023/04/14
BUNDESUBL 04/05/24		国	債	証	券	0.0000	1,540		1,555			202,804	2024/04/05
BUNDESUBL 0.0 04/11/25		国	債	証	券	0.0000	1,250		1,261			164,486	2025/04/11
BUNDESUBL 0.0 04/10/26		国	債	証	券	0.0000	1,430		1,440			187,818	2026/04/10

銘	柄	当			期			末							
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日		
(ユーロ…ドイツ)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千	円	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24		国	債	証	券	1.5000	1,950			2,035		265,395			2024/05/15
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23		国	債	証	券	1.5000	1,650			1,693		220,794			2023/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35		国	債	証	券	0.0000	1,200			1,150		149,983			2035/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36		国	債	証	券	0.0000	1,350			1,282		167,216			2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債	証	券	6.5000	710			962		125,497			2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債	証	券	4.7500	1,100			1,438		187,564			2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債	証	券	4.2500	940			1,571		204,821			2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債	証	券	3.2500	890			1,406		183,381			2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債	証	券	2.5000	1,760			2,588		337,393			2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債	証	券	4.7500	1,140			2,048		267,093			2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債	証	券	4.7500	1,660			2,590		337,716			2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債	証	券	2.5000	1,890			2,844		370,749			2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52		国	債	証	券	0.0000	340			293		38,310			2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債	証	券	1.2500	1,820			2,202		287,112			2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債	証	券	1.0000	1,470			1,534		200,020			2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債	証	券	0.5000	2,000			2,061		268,687			2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26		国	債	証	券	0.0000	1,680			1,691		220,559			2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28		国	債	証	券	0.2500	1,810			1,840		239,894			2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23		国	債	証	券	2.0000	2,930			3,045		397,055			2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24		国	債	証	券	1.0000	1,340			1,387		180,840			2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29		国	債	証	券	0.0000	1,610			1,605		209,236			2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債	証	券	0.0000	1,720			1,515		197,499			2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31		国	債	証	券	0.0000	700			688		89,817			2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債	証	券	0.0000	400			354		46,263			2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30		国	債	証	券	0.0000	2,000			1,983		258,522			2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30		国	債	証	券	0.0000	500			497		64,872			2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31		国	債	証	券	0.0000	450			444		57,879			2031/08/15
BUNDESUBL 10/18/24		国	債	証	券	0.0000	1,130			1,141		148,776			2024/10/18
BUNDESUBL 10/13/23		国	債	証	券	0.0000	1,280			1,292		168,527			2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/09/26		国	債	証	券	0.0000	1,050			1,056		137,737			2026/10/09
BUNDESUBL 0.0 10/10/25		国	債	証	券	0.0000	1,400			1,412		184,079			2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25		国	債	証	券	0.0000	670			677		88,267			2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27		国	債	証	券	0.0000	1,200			1,202		156,812			2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28		国	債	証	券	0.0000	500			499		65,155			2028/11/15
小	計	—			—		69,560			78,033		10,172,441			—
(ユーロ…スペイン)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千	円	
SPAIN 6.0 01/31/29		国	債	証	券	6.0000	1,580			2,146		279,779			2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24		国	債	証	券	4.8000	1,130			1,239		161,636			2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37		国	債	証	券	4.2000	1,100			1,516		197,750			2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23		国	債	証	券	5.4000	1,160			1,224		159,683			2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25		国	債	証	券	0.0000	1,400			1,397		182,120			2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27		国	債	証	券	0.0000	350			340		44,369			2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28		国	債	証	券	0.0000	1,160			1,113		145,100			2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26		国	債	証	券	0.0000	800			789		102,872			2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25		国	債	証	券	1.6000	1,450			1,519		198,019			2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24		国	債	証	券	3.8000	1,190			1,293		168,562			2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27		国	債	証	券	1.5000	1,240			1,300		169,567			2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26		国	債	証	券	1.9500	1,270			1,353		176,490			2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28		国	債	証	券	1.4000	1,440			1,504		196,136			2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29		国	債	証	券	1.4500	1,170			1,223		159,528			2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32		国	債	証	券	0.7000	610			580		75,615			2032/04/30

銘	柄	当		期			末							
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日	
(ユーロ…スペイン)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千円	
SPAIN 0.5 04/30/30		国	債	証	券	0.5000	1,850		1,793		233,770			2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31		国	債	証	券	0.1000	1,190		1,087		141,787			2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23		国	債	証	券	0.0000	990		995		129,797			2023/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24		国	債	証	券	0.0000	860		860		112,236			2024/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26		国	債	証	券	5.9000	1,370		1,703		222,091			2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40		国	債	証	券	4.9000	970		1,494		194,794			2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41		国	債	証	券	4.7000	1,250		1,907		248,683			2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66		国	債	証	券	3.4500	920		1,238		161,501			2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25		国	債	証	券	4.6500	1,370		1,577		205,608			2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30		国	債	証	券	1.9500	1,460		1,580		206,074			2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32		国	債	証	券	5.7500	1,220		1,776		231,601			2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33		国	債	証	券	2.3500	1,240		1,383		180,316			2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28		国	債	証	券	1.4000	1,310		1,367		178,225			2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35		国	債	証	券	1.8500	1,200		1,268		165,354			2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24		国	債	証	券	0.2500	1,240		1,249		162,917			2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23		国	債	証	券	0.3500	1,420		1,434		187,009			2023/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37		国	債	証	券	0.8500	600		544		70,953			2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42		国	債	証	券	1.0000	130		115		15,067			2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27		国	債	証	券	0.8000	1,200		1,211		157,965			2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24		国	債	証	券	2.7500	1,540		1,655		215,832			2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28		国	債	証	券	5.1500	1,030		1,326		172,940			2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44		国	債	証	券	5.1500	910		1,514		197,484			2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46		国	債	証	券	2.9000	1,060		1,310		170,797			2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48		国	債	証	券	2.7000	930		1,112		145,026			2048/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71		国	債	証	券	1.4500	300		227		29,687			2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50		国	債	証	券	1.0000	1,170		950		123,969			2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25		国	債	証	券	2.1500	1,380		1,475		192,408			2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27		国	債	証	券	1.4500	1,500		1,570		204,667			2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26		国	債	証	券	1.3000	1,460		1,520		198,168			2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29		国	債	証	券	0.6000	1,180		1,159		151,089			2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23		国	債	証	券	4.4000	1,110		1,198		156,228			2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31		国	債	証	券	0.5000	1,100		1,036		135,128			2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40		国	債	証	券	1.2000	1,080		1,005		131,124			2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30		国	債	証	券	1.2500	1,370		1,399		182,486			2030/10/31
小	計	—		—		55,960		61,598		8,030,031			—	
(ユーロ…イタリア)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27		国	債	証	券	0.8500	1,300		1,291		168,400			2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24		国	債	証	券	0.0000	1,000		998		130,164			2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33		国	債	証	券	5.7500	1,280		1,783		232,520			2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37		国	債	証	券	4.0000	1,660		2,072		270,150			2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28		国	債	証	券	2.0000	1,430		1,497		195,200			2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25		国	債	証	券	0.3500	1,080		1,075		140,225			2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26		国	債	証	券	0.5000	1,400		1,386		180,688			2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47		国	債	証	券	2.7000	1,120		1,190		155,201			2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48		国	債	証	券	3.4500	1,020		1,227		159,980			2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24		国	債	証	券	4.5000	1,390		1,512		197,148			2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67		国	債	証	券	2.8000	590		597		77,858			2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72		国	債	証	券	2.1500	320		272		35,457			2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25		国	債	証	券	5.0000	1,790		2,031		264,838			2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26		国	債	証	券	4.5000	1,630		1,872		244,062			2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32		国	債	証	券	1.6500	1,320		1,307		170,477			2032/03/01

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

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

■投資信託財産の構成

2022年 2月21日現在

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

- (注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。
- (注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、141,683,656千円、99.8%です。
- (注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年 2月21日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝115.06円、1 カナダ・ドル＝90.31円、1 オーストラリア・ドル＝82.72円、1 シンガポール・ドル＝85.55円、1 イギリス・ポンド＝156.56円、1 イスラエル・シェケル＝35.899円、1 デンマーク・クローネ＝17.53円、1 ノルウェー・クローネ＝12.83円、1 スウェーデン・クローナ＝12.24円、1 メキシコ・ペソ＝5.678円、1 オフショア・人民元＝18.197円、1 マレーシア・リンギット＝27.471円、1 ポーランド・ズロチ＝28.774円、1 ユーロ＝130.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月21日)現在

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,932,936,286円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	10,339,634円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	40,206,625円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	116,655,366円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	57,288,539円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	34,587,798円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,681,845円
たわらノーロード 先進国債券	13,393,825,381円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	237,469,433円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,697,389,145円
たわらノーロード バランス (堅実型)	48,164,130円
たわらノーロード バランス (標準型)	234,951,241円
たわらノーロード バランス (積極型)	48,864,225円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	6,482,910円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	328,688,088円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	382,425,252円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	74,160,647円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	364,777円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,078,910円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	26,244,851円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,149,968円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,109,913円
D I A M外国債券インデックスファンド<D C年金>	6,296,983,167円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	579,039,841円
O n e グローバルバランス	6,106,309円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>1安定型	711,700,267円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>2安定・成長型	2,226,508,317円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>3成長型	2,403,942,419円
D I A M D Cバランス30インデックスファンド	398,546,899円
D I A M D Cバランス50インデックスファンド	832,352,900円
D I A M D Cバランス70インデックスファンド	708,824,350円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,028,565円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	469,729,710円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,691,463円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	134,924,668円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	124,156,154円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	214,713,670円
クルーズコントロール	314,234,233円

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

■損益の状況

当期 自2021年2月23日 至2022年2月21日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	2,669,252,055円
	受		取	利 息	2,669,419,651
	支		払	利 息	△167,596
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益				△631,639,253
	売		買	益	7,707,170,489
	売		買	損	△8,338,809,742
(C)	そ の 他 の 費 用				△18,689,995
(D)	当 期 損 益 金(A + B + C)				2,018,922,807
(E)	前 期 繰 越 損 益 金				67,952,264,861
(F)	解 約 差 損 益 金				△26,936,052,307
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金				28,481,485,128
(H)	合 計(D + E + F + G)				71,516,620,489
	次 期 繰 越 損 益 金(H)				71,516,620,489

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

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 率 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 率 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

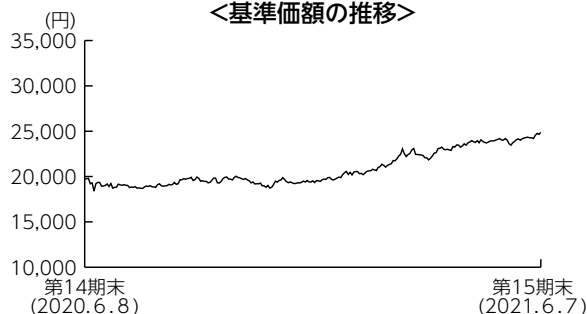
年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (配当込み) (ベンチマーク)		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2020 年 6 月 8 日	円	%	ポイント	%	%	%
	19,706	—	3,696.98	—	97.4	2.2
6 月 末	18,802	△4.6	3,525.99	△4.6	97.4	2.1
7 月 末	18,855	△4.3	3,535.10	△4.4	97.8	2.0
8 月 末	19,918	1.1	3,735.15	1.0	97.5	2.2
9 月 末	19,726	0.1	3,698.94	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＞



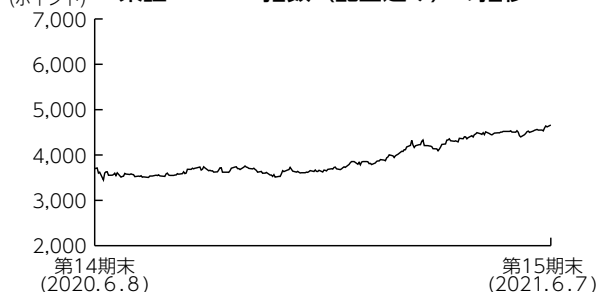
基準価額の推移

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
未	収	183,819,520
未	入	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	
期	額(A-B)	88,531,507,605
繰		35,599,014,873
越		52,932,492,732
損		35,599,014,873円
益		
金		
(D) 受	益	
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-2045)	11,396,430円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-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-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-2040)	8,346,602円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	4,119,891円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-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)	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 受 取 益	当 取 配 収 当 金	等 配 収 当 金	益		2,307,938,669円
受 取 利 息	取 利 息	配 収 当 金			2,308,456,061
そ の 他 収 益	の 他 収 益	配 収 当 金			915
支 払 利 息	払 利 息	配 収 当 金			1,000
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	有 価 証 券 売 買 損 益	等 配 収 当 金			△519,307
売 買 損 益	売 買 損 益	配 収 当 金			12,848,827,761
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	先 物 取 引 等 取 引 損 益	等 配 収 当 金			14,036,651,903
取 引 損 益	取 引 損 益	配 収 当 金			△1,187,824,142
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	当 期 損 益 金	等 配 収 当 金			356,830,240
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	前 期 繰 越 損 益 金	配 収 当 金			367,459,860
(F) 解 約 差 損 益 金	解 約 差 損 益 金	等 配 収 当 金			△10,629,620
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	追 加 信 託 差 損 益 金	配 収 当 金			15,513,596,670
(H) 合 計(D + E + F + G)	合 計	等 配 収 当 金			20,630,700,953
次 期 繰 越 損 益 金(H)	次 期 繰 越 損 益 金	配 収 当 金			△46,304,004,438
		等 配 収 当 金			63,092,199,547
		配 収 当 金			52,932,492,732
		等 配 収 当 金			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 総 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率		
10期(2017年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	百万円
	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）。

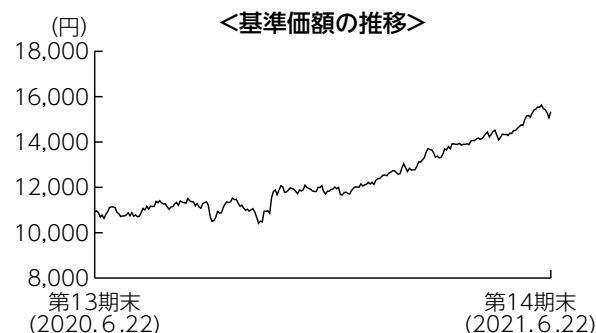
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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）

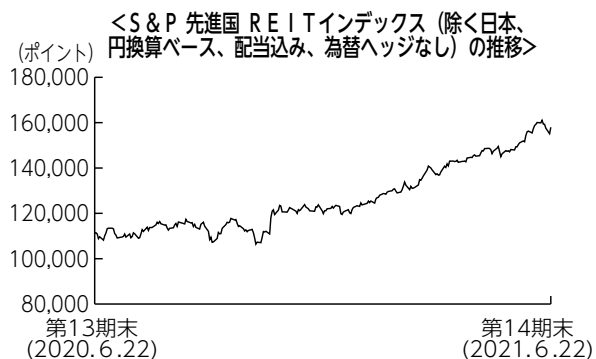


基準価額の推移

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 INVT TR	82.534	724	63.029	554
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	20.124	412	15.885	316
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHVIEW APARTMENT REIT	6.455	222	16.452	591
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	16.236	563	12.456	430
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40.38	404	30.455	304
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	36.382	534	28.574	427
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	63.35	893	50.078	694
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	81.702	1,033	61.954	781
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4.712	70	2.131	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	63.315	814	42.925	550
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	71.588	1,002	54.582	772
	(-)	(-)	(-)	(-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26.954	2,080	20.881	1,596
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	36.323	239	26.718	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHOICE PROPERTIES REIT	137.653	1,838	109.158	1,462
	(-)	(-)	(-)	(-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.257	150	3.429	73
	(-)	(-)	(-)	(-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37.226	573	27.11	425
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLAZA RETAIL REIT	30.759	112	10.148	33
	(-)	(-)	(-)	(-)

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

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
NATIONAL STORAGE REIT	843.968	1,643	608.162	1,163
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	32.489	105	9.185	28
	(-)	(-)	(-)	(-)
GDI PROPERTY GROUP	236.815	267	126.789	135
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME CONSORTIUM LTD	133.803	549	47.823	196
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	231.597	558	173.393	408
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRONGATE GROUP	479.341	657	223.193	301
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	4,384.993	11,752	3,491.308	9,302
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOMECO 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	
		口数	口数	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			%	
ARENA REIT		93.469	159.242	547	45,439			0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT		123.086	260.875	1,254	104,086			0.1	
APN INDUSTRIA REIT		41.907	73.145	234	19,415			0.0	
NATIONAL STORAGE REIT		280.409	516.215	1,047	86,924			0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD		50.661	73.965	241	20,062			0.0	
GDI PROPERTY GROUP		137.85	247.876	280	23,234			0.0	
HOME CONSORTIUM LTD		—	85.98	498	41,365			0.1	
RURAL FUNDS GROUP		101.989	160.193	397	32,954			0.0	
IRONGATE GROUP		—	256.148	371	30,808			0.0	
SCENTRE GROUP		1,543.922	2,437.607	6,874	570,202			0.7	
HOMECO DAILY NEEDS REIT		—	213.11	303	25,190			0.0	
CENTURIA OFFICE REIT		115.908	179.274	419	34,797			0.0	
AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD		—	176.463	538	44,644			0.1	
WAYPOINT REIT LTD		208.852	382.777	1,014	84,141			0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	8,802.655 25銘柄<6.6%>	15,356.239 31銘柄<6.9%>	65,264 —	5,413,690 —			— 6.9	
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円			%	
LINK REIT		608.02	977.72	76,066	1,080,145			1.4	
PROSPERITY REIT		361	597	1,779	25,262			0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		448	761	3,135	44,521			0.1	
CHAMPION REIT		602.07	937.07	4,216	59,878			0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		313	451	2,056	29,203			0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T		405	680	5,712	81,110			0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	2,737.09 6銘柄<1.9%>	4,403.79 6銘柄<1.7%>	92,966 —	1,320,122 —			— 1.7	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円			%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		839.66	2,169.309	4,555	373,509			0.5	
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT		881.66	1,544.76	4,526	371,098			0.5	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		840.979	—	—	—			—	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		698.59	1,006.99	1,470	120,542			0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		880.12	1,370.62	2,768	227,001			0.3	
STARHILL GLOBAL REIT		374.2	656.8	361	29,618			0.0	
ASCOTT TRUST		530.116	891.616	891	73,103			0.1	
KEPPEL REIT		553.6	951.5	1,094	89,715			0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST		208.3	622.9	1,501	123,082			0.2	
ESR REIT		636.53	1,148.73	470	38,615			0.0	
CDL HOSPITALITY TRUSTS		250.9	365.2	452	37,129			0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST		232.58	450.18	621	50,936			0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU		180.1	608.8	167	13,726			0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		140.595	216.895	307	25,252			0.0	
PARKWAY LIFE REIT		119.3	179	789	64,722			0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		615	2,759.1	176	14,477			0.0	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		455.82	913.12	2,556	209,626			0.3	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		644.6	1,028.2	2,200	180,406			0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		310.78	587.88	485	39,765			0.1	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		286.2	313.2	134	11,042			0.0	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		614.2	1,019	1,080	88,560			0.1	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		271.3	491.5	289	23,775			0.0	
SPH REIT		237	471.9	410	33,661			0.0	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT		275	—	—	—			—	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT		—	127.4	102	8,408			0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T		165.2	208.1	193	15,867			0.0	
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	36.294	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	327,881	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	34.448	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	73.46	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		%
GECINA SA		16.655	25.599	3,403	446,864	—	0.6
ICADE		8.117	14.526	1,077	141,518	—	0.2
ALTAREA		0.977	1.643	298	39,175	—	0.0
KLEPIERRE		60.564	93.81	2,133	280,094	—	0.4
COVIVIO		14.277	22.853	1,732	227,445	—	0.3
MERCIALYS		7.165	19.022	196	25,775	—	0.0
CARMILA SA		—	21.853	274	36,095	—	0.0
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		40.645	64.946	5,106	670,510	—	0.8
小 計	口数・金 額	148.4	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	68,001	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	—	0.0

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

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

(注2) 期末における元本の内訳

先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	77,345,015円
先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	47,730,002円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	4,079,406円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	12,324,186円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	15,806,473円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	44,427,031円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	26,820,444円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	21,242,218円
たわらノーロード 先進国リート	9,199,470,870円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,456,488,233円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	343,415,664円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,594,089,364円
たわらノーロード バランス (堅実型)	15,021,163円
たわらノーロード バランス (標準型)	269,589,574円
たわらノーロード バランス (積極型)	517,947,206円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	50,517,227円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	103,606,640円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	217,909,913円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,199,102円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,537,823円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	7,804,829円
One DC先進国リートインデックスファンド	668,657,524円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	18,528,218円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	584,044,636円
マネックス資産設計ファンド エゴリーション	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。