

# 運用報告書 (全体版)

第18期<決算日2025年1月14日>

## マネックス資産設計ファンド<育成型>

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目指します。	
主要投資対象	マネックス資産設計ファンド<育成型>	以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	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) 銘柄を主要投資対象とします。
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の株式を主要投資対象とします。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている (または採用予定の) 不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
運用方法	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券®を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場 (これに準ずるものを含みます。) されている不動産投資信託証券とします。
		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1月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利益 (評価益を含みます。) 等の中から、利子配当等収益の範囲内で、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。

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<育成型>」は、2025年1月14日に第18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

<https://www.am-one.co.jp/>

## マネックス資産設計ファンド<育成型>

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			株式組 入率	株式先 物率	債券組 入率	新株予 約権付 社債比	債券先 物率	投資信 託受益 証券組 入率	純資産 総額
	円	円	%							
14期(2021年1月12日)	14,212	0	3.7	54.4	1.5	30.7	—	—	11.7	12,539
15期(2022年1月11日)	16,149	0	13.6	50.1	0.8	33.2	—	—	14.1	14,705
16期(2023年1月11日)	15,577	0	△3.5	47.4	2.0	36.2	—	—	12.7	14,933
17期(2024年1月11日)	18,619	0	19.5	52.0	2.1	30.7	—	—	13.9	18,041
18期(2025年1月14日)	20,504	0	10.1	52.4	1.7	32.8	—	—	12.0	19,650

(注1) 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2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含む場合があります。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投資指数先物を含む場合があります。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドは、国内外の株式、債券及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目指します。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、ベンチマーク及び参考指数を定めておりません。

(注6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 ( 転 換 社 債 ) 率	債 先 比	券 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 率
	円	騰 落 率							
(期 首) 2024年 1 月11日	18,619	—	52.0	2.1	30.7	—	—	—	13.9
1 月 末	18,890	1.5	53.5	1.5	30.1	—	—	—	13.4
2 月 末	19,398	4.2	54.7	1.4	29.4	—	—	—	13.0
3 月 末	19,995	7.4	50.9	1.4	34.1	—	—	—	12.2
4 月 末	19,999	7.4	50.7	1.8	34.1	—	—	—	12.2
5 月 末	20,101	8.0	51.5	1.6	33.7	—	—	—	12.0
6 月 末	20,664	11.0	52.0	1.7	33.1	—	—	—	11.9
7 月 末	20,216	8.6	51.3	1.7	33.4	—	—	—	12.3
8 月 末	19,969	7.3	50.6	1.5	37.6	—	—	—	12.5
9 月 末	19,984	7.3	50.3	1.6	33.6	—	—	—	12.5
10月 末	20,616	10.7	51.3	1.6	32.9	—	—	—	12.5
11月 末	20,527	10.2	51.9	1.3	32.7	—	—	—	12.5
12月 末	20,979	12.7	52.9	1.7	32.6	—	—	—	12.0
(期 末) 2025年 1 月14日	20,504	10.1	52.4	1.7	32.8	—	—	—	12.0

(注1) 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。

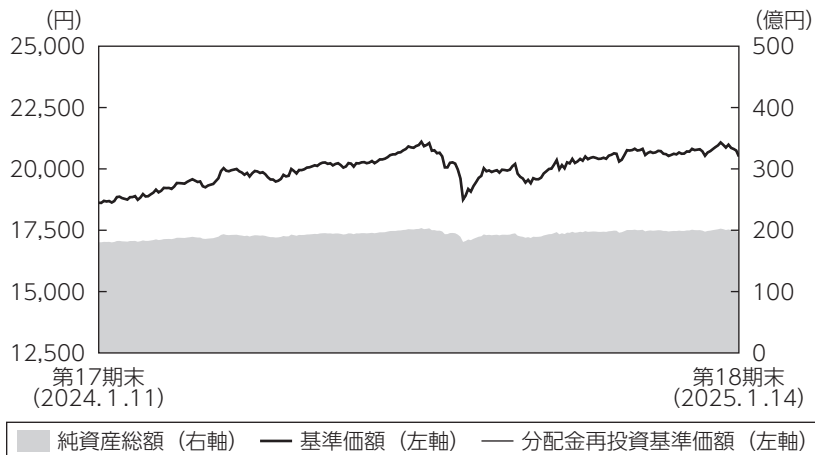
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含む場合があります。

(注4) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

### 基準価額等の推移



第18期首：18,619円  
 第18期末：20,504円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率：10.1%  
 (分配金再投資ベース)

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

### 基準価額の主な変動要因

日銀の金融政策正常化の動きの中で国内の長期金利が上昇（債券価格は下落）したこと、それに伴い国内リートも下落したこと、米大統領選挙でトランプ氏が勝利したこと等を背景に海外の長期金利が上昇したことがマイナスに寄与しました。一方、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内外の株式市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	10.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.7%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△4.3%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.4%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	△5.6%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.4%

## 投資環境

国内株式市場は、期初から2024年3月にかけては、円安米ドル高の進行や海外株式市場の堅調さなどを要因として上昇しました。その後、ほぼ横ばいの推移となりましたが、8月上旬には円高米ドル安の進行や米国景気の先行き不安などを受けて一時的に急落する場面もありました。その後は、自民党総裁選挙、トランプ次期米国大統領の政策や為替動向などを材料にしつつ、一進一退の値動きとなりました。

先進国株式市場は上昇しました。期初からハイテク関連の新製品開発報道や堅調な業績が好感され多くの市場が上昇しました。その後、米ハイテク株の下落などにより調整する場面も見られましたが、F R B（米連邦準備理事会）議長が2024年9月の利下げを示唆したことから反発し、利下げ後も更なる利下げ期待から高値圏で推移しましたが、12月以降はF R Bが2025年の利下げ回数を2回に半減させたことから米欧長期金利が上昇し、株式市場は調整して期末を迎えました。

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2024年7月にかけては、マイナス金利政策解除などの日銀の金融政策正常化の動きの中で利回りは上昇しました。8月初めに米景気後退懸念を背景としたリスク回避の動きから大幅に利回りが低下（債券価格は上昇）した後、期末にかけては堅調な米雇用統計の結果や米大統領選挙を受けた米国金利の上昇や、日銀の利上げ観測、2025年度の国債発行計画における発行増額などを受けて利回りが上昇しました。

先進国債券市場では、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が利下げを開始したことなどを受けて、利回りが低下する局面もありましたが、堅調な雇用統計、米大統領選挙でトランプ氏が勝利したことなどで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）が利下げを実施しましたが、米国の金利上昇につられ利回りは上昇しました。

国内リート市場は下落しました。期初は日銀の金融政策正常化への警戒感から軟調に推移しましたが、2024年3月の金融政策決定会合で先行き不透明感が払拭されると反発しました。8月には急速な円高や景気後退懸念でリスク回避の動きが強まり下落しましたが、自律反発狙いの買いや日銀副総裁のハト派的な発言により反発しました。その後、米国の利下げ観測の後退や日銀による追加利上げへの警戒感が相場の重しとなり、軟調に推移しました。

外国リート市場は騰落まちまちの結果となりました。期前半は米国の利下げ観測が後退し、上値の重い展開となりました。2024年7月から8月にかけて日米などの株式市場では調整がありましたが、リート市場では米長期金利の低下が下支えとなり影響は限定的でした。その後は利下げへの期待が高まった米国やオーストラリアなどは上昇したものの、期末にかけては米欧で長期金利が上昇したことなどからリート市場は調整しました。

為替市場では円は主要通貨に対してまちまちの動きとなりました。米ドル／円相場は、期初から内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安米ドル高が進んだ後、2024年7月に入ると日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気後退懸念等から急速に円高米ドル安が進みました。その後、米景気後退懸念が和らいだこと等から円高米ドル安が縮小しました。その他主要通貨においても、期初から円安現地通貨高が進んだ後、2024年7月に入ると急速に円高現地通貨安が進みましたが、その後は円高現地通貨安が縮小しました。

## 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おり、2024年4月に変更しました。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、年1回の基本資産配分比率の見直し時を除いてはリバランスを行いませんでした。

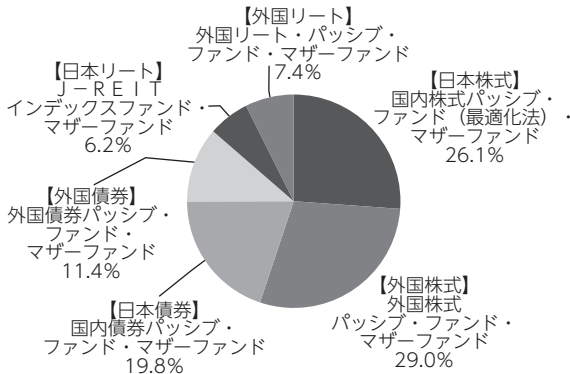
### <基本資産配分比率>

日本株式：25% 外国株式：28% 日本債券：23% 外国債券：12% 日本リート：6% 外国リート：6%

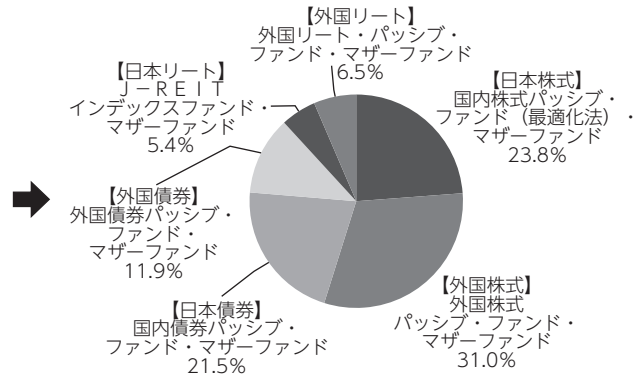
### 【運用状況】

#### ○マザーファンド組入比率

##### 期首（前期末）



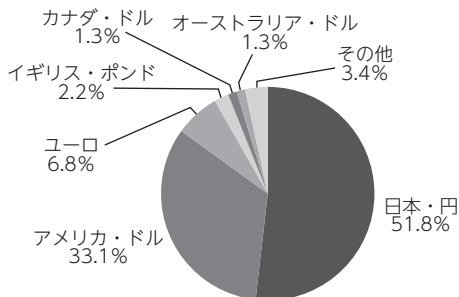
##### 期末



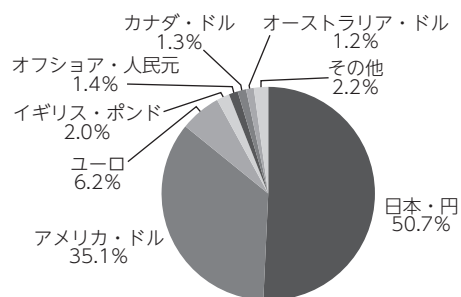
(注) 組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

#### ○通貨別組入比率

##### 期首（前期末）



##### 期末



(注1) 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) 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。

### ●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

配当落ち以外の場合では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、期中の投資行動としましても、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）に連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行いました。

## 分配金

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配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	当期
	2024年1月12日 ～2025年1月14日
当期分配金（税引前）	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	12,056円

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

マザーファンドの組入比率については、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、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、原則としてリバランスを行いません。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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近づけることにより、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運用を行います。期中の投資行動では、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。



## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第18期		項目の概要
	(2024年1月12日 ～2025年1月14日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	111円	0.554%	(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20,036円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	( 58)	(0.288)	
(販売会社)	( 44)	(0.222)	
(受託会社)	( 9)	(0.044)	
(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)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(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	0.002	(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)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.001)	
(d) その他費用	3	0.014	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 2)	(0.008)	
(監査費用)	( 1)	(0.004)	
(その他)	( 0)	(0.002)	
合計	115	0.573	

(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。

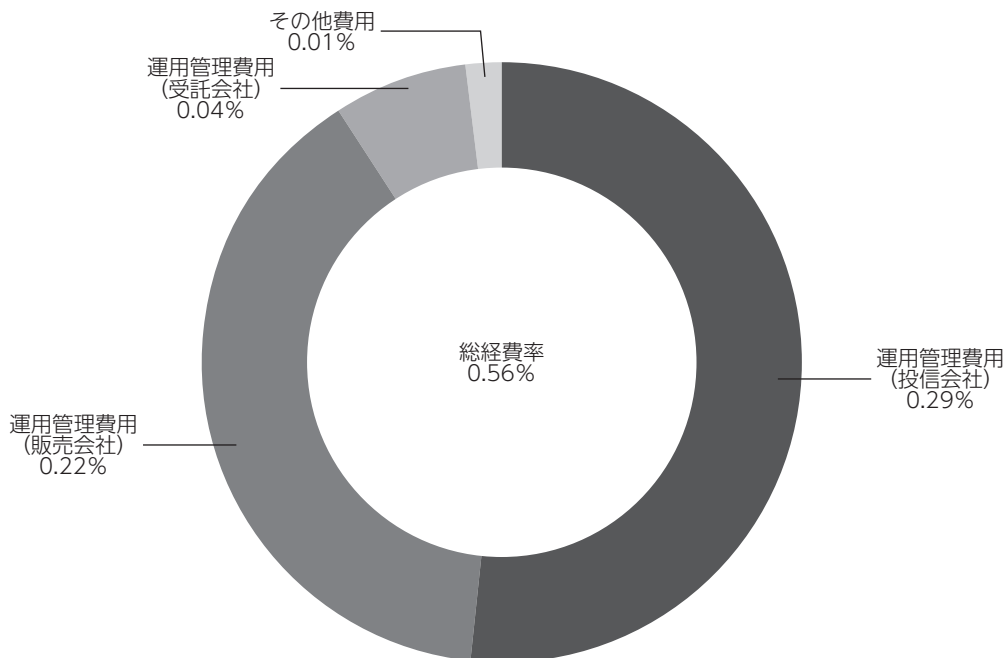
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.56%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（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

	当 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	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	3,069	15,000	113,614	549,875
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	-	-	61,304	539,087
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	711,053	880,000	56,185	68,902
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	74,017	175,000	15,870	37,380
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	4,214	10,000	8,417	19,371
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	-	-	99,622	194,329

■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	
	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	204,683,933千円	308,130,618千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	569,546,723千円	1,503,678,265千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.35	0.20

(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（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

### 【マネックス資産設計ファンド（育成型）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	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	343千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	14千円
(B)／(A)	4.3%

(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	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 121,170	百万円 860	% 0.7	百万円 83,513	百万円 11,498	% 13.8

平均保有割合 0.8%

(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	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,188	百万円 769	百万円 7,853

#### (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 387

### 【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 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 607,173	百万円 69,127	% 11.4	百万円 619,640	百万円 94,904	% 15.3

平均保有割合 0.8%

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 62,900	百万円 38,388	% 61.0	百万円 80,536	百万円 45,721	% 56.8
不動産投信指数先物取引	19,253	14,395	74.8	19,456	14,534	74.7

平均保有割合 0.6%

(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	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 4,051

## 【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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループ、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

	期首 (前期末)	当 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	1,077,856	967,311	4,633,423
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	661,374	600,069	6,043,121
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	2,838,349	3,493,217	4,177,189
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	893,929	952,077	2,309,929
J-R E I Tインデックスファンド ・マザーファンド	472,721	468,518	1,043,671
外国リート ・パッシブ ・ファンド ・マザーファンド	690,441	590,818	1,256,612

## ■投資信託財産の構成

2025年1月14日現在

項 目	当 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	4,633,423	23.5
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	6,043,121	30.6
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	4,177,189	21.2
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	2,309,929	11.7
J-R E I Tインデックスファンド ・マザーファンド	1,043,671	5.3
外国リート ・パッシブ ・ファンド ・マザーファンド	1,256,612	6.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	262,729	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	19,726,679	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2025年1月14日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,814,094,623千円、99.9%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは269,284,469千円、99.0%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは105,803,024千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2025年1月14日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=157.57円、1カナダ・ドル=109.61円、1オーストラリア・ドル=97.43円、1香港・ドル=20.24円、1シンガポール・ドル=115.05円、1ニュージーランド・ドル=88.24円、1イギリス・ポンド=192.39円、1イスラエル・シェケル=43.399円、1スイス・フラン=171.87円、1デンマーク・クローネ=21.64円、1ノルウェー・クローネ=13.80円、1スウェーデン・クローナ=14.00円、1メキシコ・ペソ=7.633円、100韓国・ウォン=10.76円、1オフショア・人民元=21.447円、1マレーシア・リンギット=35.004円、1ポーランド・ズロチ=37.794円、1ユーロ=161.43円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年1月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	19,726,679,876円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	262,729,728
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	4,633,423,972
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	6,043,121,585
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	4,177,189,974
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,309,929,950
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	1,043,671,817
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,256,612,850
(B) 負 債	76,492,580
未 払 解 約 金	20,956,814
未 払 信 託 報 酬	55,143,488
そ の 他 未 払 費 用	392,278
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	19,650,187,296
元 本	9,583,440,544
次 期 繰 越 損 益 金	10,066,746,752
(D) 受 益 権 総 口 数	9,583,440,544口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	20,504円

## ■損益の状況

当期 自2024年1月12日 至2025年1月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	373,318円
受 取 利 息	377,335
支 払 利 息	△4,017
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,803,111,814
売 買 益	2,168,565,956
売 買 損	△365,454,142
(C) 信 託 報 酬 等	△107,965,775
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,695,519,357
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,628,199,078
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,743,028,317
(配 当 等 相 当 額)	(4,229,164,295)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,486,135,978)
(G) 合 計(D+E+F)	10,066,746,752
次 期 繰 越 損 益 金(G)	10,066,746,752
追 加 信 託 差 損 益 金	2,743,028,317
(配 当 等 相 当 額)	(4,230,296,117)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,487,267,800)
分 配 準 備 積 立 金	7,323,718,435

(注) 期首における元本額は9,689,713,223円、当期中における追加設定元本額は866,477,277円、同解約元本額は972,749,956円です。

(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	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	364,069,790円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,331,449,567
(c) 収 益 調 整 金	4,230,296,117
(d) 分 配 準 備 積 立 金	5,628,199,078
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	11,554,014,552
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	12,056.23
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、先物取引等の指  
図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12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22期（決算日 2024年2月7日）

（計算期間 2023年2月8日～2024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22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	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
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
18期 (2020年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
21期 (2023年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
22期 (2024年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982
22期 (2024年2月7日)	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	2.5	542,130

(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）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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）。

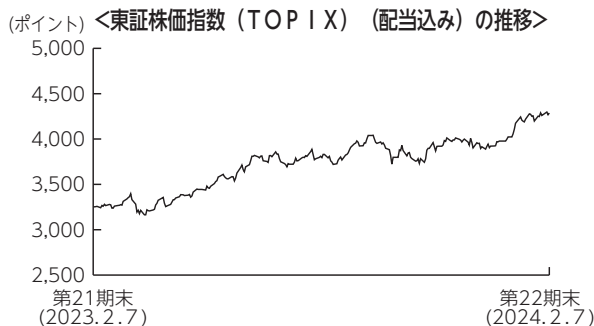
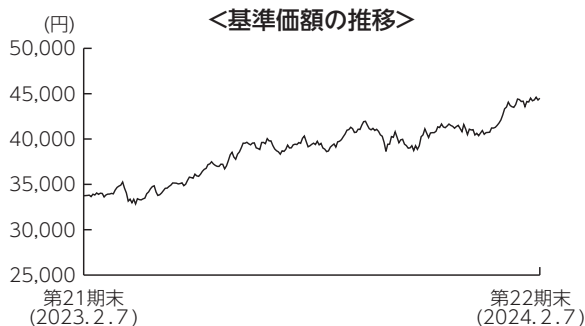
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2023年 2月7日	円 33,751	% -	ポイント 3,251.81	% -	% 98.0	% 1.9
2 月 末	33,931	0.5	3,269.12	0.5	98.8	1.3
3 月 末	34,508	2.2	3,324.74	2.2	96.1	4.4
4 月 末	35,438	5.0	3,414.45	5.0	97.9	2.4
5 月 末	36,715	8.8	3,537.93	8.8	97.3	2.8
6 月 末	39,491	17.0	3,805.00	17.0	98.4	1.7
7 月 末	40,083	18.8	3,861.80	18.8	97.5	2.5
8 月 末	40,253	19.3	3,878.51	19.3	97.5	2.6
9 月 末	40,464	19.9	3,898.26	19.9	97.6	2.6
10 月 末	39,253	16.3	3,781.64	16.3	97.3	2.7
11 月 末	41,378	22.6	3,986.65	22.6	97.7	2.4
12 月 末	41,289	22.3	3,977.63	22.3	96.9	3.2
2024年 1 月 末	44,516	31.9	4,288.36	31.9	97.8	2.1
(期 末) 2024年 2月7日	44,494	31.8	4,286.44	31.8	97.6	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（2023年2月8日から2024年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は44,494円となり、前期末比で31.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

日米の長期金利差などを要因として円安ドル高が進行したことや、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や海外投資家による日本株買いなどを要因として日本株が大きく上昇したことから、基準価額も上昇しました。

### 投資環境

国内株式市場は、期初から2023年3月末までは、日米の金融政策、欧米での金融機関の破綻などを要因として一進一退の展開となりました。その後、4月から9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀による金融緩和の継続、好調な企業決算や欧米投資家による日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。その後、中東情勢の緊迫化などを要因として一時的に下落する場面もありましたが、期末にかけては円安ドル高の流れを受けて上昇しました。

### ポートフォリオについて

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

【運用状況】 (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

### ○組入上位10業種

#### 期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	17.3%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.3
4	銀行業	6.4
5	化学	6.1
6	卸売業	5.9
7	医薬品	5.2
8	サービス業	5.2
9	機械	5.2
10	小売業	4.4



#### 期末

No.	業種	比率
1	電気機器	16.9%
2	輸送用機器	8.9
3	情報・通信業	7.4
4	卸売業	7.1
5	銀行業	6.9
6	化学	5.8
7	機械	5.2
8	サービス業	4.5
9	医薬品	4.4
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	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161銘柄	



#### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.8%
2	ソニーグループ	日本・円	2.7
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.3
4	キーエンス	日本・円	1.7
5	東京エレクトロン	日本・円	1.6
6	三菱商事	日本・円	1.6
7	日立製作所	日本・円	1.5
8	日本電信電話	日本・円	1.5
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.5
10	信越化学工業	日本・円	1.4
組入銘柄数		2,148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31.8%上昇しました。

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

### 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	1	0.001	
期中の平均基準価額は38,764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 (2023年2月8日から2024年2月7日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		68,285.4 (56,521.786)	152,756,646 (-)	58,527.986	124,543,615

(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 122,918	百万円 121,163	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	277,300,261千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	438,574,353千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.63

(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（2023年2月8日から2024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				
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

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		当 期 末 保 有 額
	買 付 額	売 付 額	
株 式	百万円 1,537	百万円 1,475	百万円 5,468

### (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 198

### (4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,122千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B) / (A)	0.1%

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



銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
ケンコーマヨネーズ		千株	千円	クラレ	千株	千円	ダイキョーニシカワ	千株	千株	千円	ダイキョーニシカワ	千株	千株	千円	
からべや日洋ホールディングス	9.3	9.9	18,087	217.3	213.4	331,410	30.1	30.1	24,008	30.1	32.4	24,008	30.1	32.4	
なとり	9.9	9.6	27,273	853.9	990.8	1,028,945	4.1	4.1	2,038	4.1	2.6	2,038	4.1	2.6	
イフジ産業	8.6	9.1	19,810	7.1	3.8	3,066	6.9	6.9	21,796	6.9	7.6	21,796	6.9	7.6	
ファーマフーズ	2.2	1.2	1,696	3.8	1.8	1,713	8.9	8.9	15,004	8.9	10.5	15,004	8.9	10.5	
ユーグレナ	20.7	20.7	20,637	132.1	141.5	417,778	104.3	111.9	142,616	104.3	111.9	142,616	104.3	111.9	
紀文食品	86.6	89.6	58,956	1,014.5	1,086.7	334,160	12.3	15.8	15,452	12.3	15.8	15,452	12.3	15.8	
ビックルホールディングス	10.5	12.5	14,650	5.8	6.9	34,362	7.8	9.7	27,460	7.8	9.7	27,460	7.8	9.7	
ミヨシ油脂	7.9	8.4	10,878	64.9	68.8	422,569	12.7	15.5	71,145	12.7	15.5	71,145	12.7	15.5	
理研ビタミン	4.2	2.5	3,312	ラサ工業	5.3	5.6	12,773	18.3	17.8	67,551	18.3	17.8	67,551	18.3	17.8
繊維製品 (0.4%)	11.6	12.5	29,025	クレハ	11.7	32	90,400	47.7	51.1	146,989	47.7	51.1	146,989	47.7	51.1
片倉工業	12.6	13.5	24,124	多木化学	5.4	5.7	18,069	42.3	44.2	313,820	42.3	44.2	313,820	42.3	44.2
グンゼ	10.2	10.4	57,824	テイカ	9.2	12.7	17,957	16.8	8.9	1,797	16.8	8.9	1,797	16.8	8.9
東洋紡	59	63.3	70,516	石原産業	24.7	24.3	38,078	8.7	9.1	8,153	8.7	9.1	8,153	8.7	9.1
ユニチカ	41.4	47.3	7,804	片倉コープアグリ	2.5	1.6	1,788	333	331.2	1,903,737	333	331.2	1,903,737	333	331.2
富士紡ホールディングス	5.4	6.4	27,392	日本曹達	14.7	17.3	99,821	5	5.8	17,202	5	5.8	17,202	5	5.8
倉敷紡績	10.2	10.4	31,824	東ソー	182.6	195.5	374,089	6.3	6.6	12,526	6.3	6.6	12,526	6.3	6.6
シキボウ	6.8	7.7	9,255	トクヤマ	44.1	47.3	106,827	5	2.6	2,371	5	2.6	2,371	5	2.6
日本毛織	36	37.5	52,650	セントラル硝子	21.9	15.6	45,411	2.2	1.3	2,459	2.2	1.3	2,459	2.2	1.3
ダイトウボウ	21.5	10.4	936	東亜合成	68.5	70.5	108,534	8.5	9	37,620	8.5	9	37,620	8.5	9
トア紡コーポレーション	4.2	2.5	1,085	大阪ソーダ	8.2	10.2	111,078	9.2	5.2	1,497	9.2	5.2	1,497	9.2	5.2
グイドーリミテッド	18.6	9.4	5,499	関東電化工業	26.4	28.3	25,724	16.9	16.3	18,842	16.9	16.3	18,842	16.9	16.3
帝国繊維	15.4	16.5	35,475	デンカ	49.7	53.3	130,105	605.1	777.7	905,242	605.1	777.7	905,242	605.1	777.7
帝人	131.6	140.7	191,914	信越化学工業	230.7	1,328.1	7,740,166	125.3	143.5	336,507	125.3	143.5	336,507	125.3	143.5
東レ	916.3	981.2	732,465	日本カーバイド工業	4.6	6.2	9,684	10.4	5.3	673	10.4	5.3	673	10.4	5.3
住江織物	2.5	1.3	3,140	堺化学工業	10.4	11.1	21,356	22.4	30.1	58,604	22.4	30.1	58,604	22.4	30.1
日本フェルト	6.7	3.7	1,602	第一稀元素化学工業	12.5	16	15,536	7.7	4.7	6,392	7.7	4.7	6,392	7.7	4.7
イチカワ	1.5	0.8	1,420	エア・ウォーター	129	138.2	281,098	18.6	16.8	7,879	18.6	16.8	7,879	18.6	16.8
日東製網	1.3	0.7	1,096	日本薬業ホールディングス	132.6	142.1	589,430	20.7	25.5	78,030	20.7	25.5	78,030	20.7	25.5
アツギ	7.1	4.5	2,493	日本化学工業	4.5	5.3	10,414	53.5	57.2	160,245	53.5	57.2	160,245	53.5	57.2
ダイニツク	3	2.1	1,478	東邦アセチレン	2.6	6.9	2,587	30.3	32.6	46,324	30.3	32.6	46,324	30.3	32.6
セーレン	26.4	28.3	69,561	日本パーカライジング	67.8	65.3	80,580	26.7	31.9	88,426	26.7	31.9	88,426	26.7	31.9
ソトー	3.9	2.1	1,446	高圧ガス工業	20.1	21.4	18,489	12.2	14	19,698	12.2	14	19,698	12.2	14
東海染工	1.3	0.6	493	チタン工業	1.4	0.9	1,011	262.7	272	2,674,304	262.7	272	2,674,304	262.7	272
小松マテール	19.9	21.2	16,620	四国化成ホールディングス	16.2	18.7	32,893	285.8	306.2	1,292,164	285.8	306.2	1,292,164	285.8	306.2
ワコルホールディングス	26.3	30	104,220	戸田工業	3.1	3.3	5,336	164.3	191.9	250,333	164.3	191.9	250,333	164.3	191.9
ホギメディカル	18.4	19.3	65,523	ステラ ケミファ	8	7.9	25,991	9.3	11	39,985	9.3	11	39,985	9.3	11
クラウディアホールディングス	2.7	1.5	609	保土谷化学工業	3.9	4.6	16,491	29.5	31.7	41,685	29.5	31.7	41,685	29.5	31.7
T S Iホールディングス	48.8	47.6	32,368	日本触媒	20.8	21.3	118,917	20.3	19.9	69,291	20.3	19.9	69,291	20.3	19.9
マツカコーポレーション	3.3	2	3,420	大日精化工業	9.6	10.2	27,907	59.9	64.1	142,109	59.9	64.1	142,109	59.9	64.1
ワールド	17.5	20.7	41,193	カネカ	31.3	37.2	132,990	27.9	29.8	279,643	27.9	29.8	279,643	27.9	29.8
三陽商会	4.6	5.5	15,581	三菱瓦斯化学	102.1	109.4	257,746	11.6	13.5	21,181	11.6	13.5	21,181	11.6	13.5
ナイガイ	4.1	2.1	548	三井化学	112.7	120.8	501,320	1.5	0.9	1,342	1.5	0.9	1,342	1.5	0.9
オンワードホールディングス	88.5	86.3	46,774	J S R	127.7	159.5	634,810	70.2	75.2	115,657	70.2	75.2	115,657	70.2	75.2
トクホホールディングス	3.5	4.1	11,020	東京応化工業	23.9	69.9	245,978	12.2	13.1	67,858	12.2	13.1	67,858	12.2	13.1
キムラタン	72.8	42.8	770	大阪有機化学工業	10.3	12.3	36,961	3	1.6	1,489	3	1.6	1,489	3	1.6
ゴールドウイン	24.3	25.9	244,159	三菱ケミカルグループ	922.8	1,070.7	921,123	7.8	8.4	15,002	7.8	8.4	15,002	7.8	8.4
デサント	23.5	25.2	83,160	K Hネオケム	22.7	22.3	52,851	—	2.9	6,820	—	2.9	6,820	—	2.9
キング	9.4	2.5	1,740	ダイセル	201	188.3	272,281	—	7.2	6,098	—	7.2	6,098	—	7.2
ヤマトインターナショナル	5.8	5.1	1,545	住友ベークライト	20.2	20.5	153,114	10.6	11.3	17,277	10.6	11.3	17,277	10.6	11.3
パルプ・紙 (0.2%)				積水化学工業	279.7	294.3	606,258	5.5	5.9	7,782	5.5	5.9	7,782	5.5	5.9
特種東海製紙	6.1	8	31,520	日本ゼオン	82	100.4	128,662	22.9	42.4	55,925	22.9	42.4	55,925	22.9	42.4
王子ホールディングス	569.8	610	351,482	アイカ工業	34.5	37	128,760	28.4	28	92,820	28.4	28	92,820	28.4	28
日本製紙	71.1	82.6	113,657	UBE	70.4	69.7	176,166	6.4	—	—	6.4	—	—	6.4	—
三菱製紙	15.1	8.8	5,447	積水樹脂	19.9	21.9	56,414	39.8	42.7	271,572	39.8	42.7	271,572	39.8	42.7
北越コーポレーション	86.4	72	98,856	タキロンシーアイ	30.2	37.4	23,262	11.7	12.4	13,912	11.7	12.4	13,912	11.7	12.4
中越パルプ工業	4.7	2.6	5,220	旭有機材	9.1	9.7	36,908	11.2	12.1	52,574	11.2	12.1	52,574	11.2	12.1
大王製紙	60.3	64.7	73,952	ニチパン	8.5	7.9	13,919	3.4	3.3	8,880	3.4	3.3	8,880	3.4	3.3
阿波製紙	2.9	1.8	864	リケンテクノス	29.5	31.6	30,999	36.9	39.5	48,506	36.9	39.5	48,506	36.9	39.5
レンゴー	124.6	133.4	137,402	大倉工業	6.4	6.8	20,400	15.5	16.4	62,238	15.5	16.4	62,238	15.5	16.4
トーモク	7.9	8.5	19,507	積水化成成品工業	18.7	20.7	9,480	7.5	4.4	3,335	7.5	4.4	3,335	7.5	4.4
ザ・パップ	10.1	10.9	36,842	群栄化学工業	2.7	3.4	11,900	5	4.8	9,115	5	4.8	9,115	5	4.8
化学 (5.9%)				タイガースポリマー	5.8	3	2,946	39.5	36.8	197,395	39.5	36.8	197,395	39.5	36.8
北の達人コーポレーション	57.6	61.7	14,314	ミライアル	3.7	2.2	3,344	12.4	13.3	61,047	12.4	13.3	61,047	12.4	13.3
				ダイキアクシス	4.4	2.7	1,935	13.8	14.8	15,554	13.8	14.8	15,554	13.8	14.8



銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
大成ラミック		千株	千円		千株	千円			千株	千円		千株	千円		
クマイ化学工業	4.3	4.2	12,978	ビービー・カストロール	4.6	2.5	2,165	丸一鋼管	42.9	46	175,766	丸一鋼管	42.9	46	
日本農業	54.5	58.3	49,088	富士石油	27.9	42.7	15,799	モリ工業	2.9	2.6	12,701	モリ工業	2.9	2.6	
アキレス	25.1	26.9	18,372	MORESCO	4	2.3	3,302	大同特殊鋼	10.7	95.1	159,625	大同特殊鋼	10.7	95.1	
有沢製作所	8.9	9.3	14,563	出光興産	152.1	814.3	663,328	日本高周波鋼業	4.2	2.7	1,495	日本高周波鋼業	4.2	2.7	
日東電工	22.4	25.7	28,861	ENEOSホールディングス	2,473.4	2,321.7	1,380,714	日本冶金工業	10.3	11	46,860	日本冶金工業	10.3	11	
レック	99.4	94.2	1,211,412	コスモエネルギーホールディングス	54.1	43.5	262,522	山陽特殊製鋼	13.9	15	33,135	山陽特殊製鋼	13.9	15	
三光合成	17.1	18.8	19,627	<b>ゴム製品 (0.7%)</b>				愛知製鋼	8.2	8.7	30,145	愛知製鋼	8.2	8.7	
きもと	18.1	18.5	12,358	横浜ゴム	77.9	74.2	263,039	日本金属	2.8	1.9	1,675	日本金属	2.8	1.9	
藤森工業	10.8	10.7	2,257	TOYO TIRE	78.6	84.3	215,470	大平洋金属	10	12.9	17,518	大平洋金属	10	12.9	
前澤化成工業	8.8	11.6	46,458	ブリヂストン	437.2	429.2	2,721,557	新日本電工	9.0	75.4	21,338	新日本電工	9.0	75.4	
未来工業	5	9.4	15,087	住友ゴム工業	134.2	143.8	250,212	栗本鐵工所	6.7	7	25,690	栗本鐵工所	6.7	7	
ウェアロックホールディングス	3.7	5.3	25,943	藤倉コンポジット	8.7	11.3	16,283	虹 技	1.7	0.9	1,345	虹 技	1.7	0.9	
J S P	9.6	2.4	1,634	オカモト	7.6	6.9	33,637	日本鋳鉄管	1.4	0.8	942	日本鋳鉄管	1.4	0.8	
エフピコ	25.9	10.3	22,000	フコク	7.2	7.7	11,526	三菱製鋼	8.8	11.2	18,715	三菱製鋼	8.8	11.2	
天馬	11.7	27.7	81,659	ニッタ	13.9	14.9	55,055	日亜鋼業	13.3	7.4	2,464	日亜鋼業	13.3	7.4	
信越ポリマー	25.4	10.7	24,695	住友理工	26.7	22.8	27,405	日本精練	2	2.1	11,571	日本精練	2	2.1	
東リ	27.6	31.6	50,876	ミツ星ベルト	20	17.8	84,995	エンビロ・ホールディングス	8.7	11.9	7,032	エンビロ・ホールディングス	8.7	11.9	
ニフコ	49.4	14.4	5,745	パンドー化学	21.8	21.8	38,368	シンニッタン	13.7	8.6	2,356	シンニッタン	13.7	8.6	
バルカー	11.5	43.9	166,468	<b>ガス・土石製品 (0.7%)</b>				新家工業	2.7	1.5	4,807	新家工業	2.7	1.5	
ユニ・チャーム	285.2	12.3	52,152	日東紡績	16.3	18.6	93,372	<b>非鉄金属 (0.7%)</b>							
ショーエイコーポレーション	3.8	305.5	1,605,402	AGC	139.3	130.8	742,551	大紀アルミニウム工業所	20	19.2	23,596	大紀アルミニウム工業所	20	19.2	
<b>医薬品 (4.5%)</b>		2.1	1,289	日本板硝子	69.8	69.9	42,499	日本軽金属ホールディングス	38.1	44.2	76,112	日本軽金属ホールディングス	38.1	44.2	
協和キリン	165.4	1.9	1,123	石塚硝子	1.9	1.1	3,861	三井金属鉱業	4.1	43.9	213,529	三井金属鉱業	4.1	43.9	
武田薬品工業	1,211.6	4.4	3,508	日本山村硝子	4.4	2.4	3,508	東邦亜鉛	8.4	9.8	10,966	東邦亜鉛	8.4	9.8	
アステラス製薬	1,312.1	55.8	59.8	日本電気硝子	55.8	59.8	210,675	三菱マテリアル	94	108	299,268	三菱マテリアル	94	108	
住友ファーマ	101.5	6.5	7	オハラ	6.5	7	8,085	住友金属鉱山	163.4	174.9	700,299	住友金属鉱山	163.4	174.9	
塩野義製薬	175	19.3	24.4	住友大阪セメント	19.3	24.4	91,378	DOWAホールディングス	31.7	37.3	189,633	DOWAホールディングス	31.7	37.3	
わかもと製薬	11.5	87.2	86.7	太平洋セメント	87.2	86.7	269,897	古河機械金属	20.6	20	38,400	古河機械金属	20.6	20	
日本新薬	32.3	12.5	12.8	日本ヒューム	12.5	12.8	11,571	エス・サイエンス	76.5	41.9	921	エス・サイエンス	76.5	41.9	
中外製薬	428.6	27.3	28.4	日本コンクリート工業	27.3	28.4	13,433	大塚チウムテクノロジーズ	20.6	26.2	73,124	大塚チウムテクノロジーズ	20.6	26.2	
科研製薬	23.4	5.8	5.9	三谷セキサン	5.8	5.9	30,916	東邦チタニウム	25.5	31.2	58,032	東邦チタニウム	25.5	31.2	
エーザイ	166.6	21.8	20.8	アジアパルホールディングス	21.8	20.8	16,889	UACJ	19.7	21.2	87,874	UACJ	19.7	21.2	
ローゼン製薬	132.6	114.9	135.3	東海カーボン	114.9	135.3	139,494	C K サンエツ	2.6	2.7	10,395	C K サンエツ	2.6	2.7	
小野薬品工業	264.2	7.8	7.8	日本カーボン	7.8	7.8	34,476	古河電気工業	46.9	50.2	138,526	古河電気工業	46.9	50.2	
久光製薬	30.4	8.6	10.3	東洋炭素	8.6	10.3	51,706	住友電気工業	486.4	564.4	1,170,283	住友電気工業	486.4	564.4	
持田製薬	16.4	6.8	8.1	リタケカン(仁)リミテド	6.8	8.1	63,909	フジクラ	151.1	177.9	220,951	フジクラ	151.1	177.9	
参天製薬	257.6	90.4	96.8	TOTO	90.4	96.8	362,322	SWCC	15.8	16.9	52,728	SWCC	15.8	16.9	
扶桑薬品工業	4.3	162	170.6	日本硝子	162	170.6	317,316	タツタ電線	28.8	26.8	18,438	タツタ電線	28.8	26.8	
日本ケミファ	1.2	104.2	122.8	日本特殊陶業	104.2	122.8	519,321	カナレ電気	2	1.1	1,860	カナレ電気	2	1.1	
ツムラ	43.1	8.7	4.3	ダントーホールディングス	8.7	4.3	4,076	平河ヒューテック	8.2	9.6	13,113	平河ヒューテック	8.2	9.6	
キッセイ薬品工業	21.2	5.1	5.4	MARUWA	5.1	5.4	165,780	リョービー	15	16.1	44,452	リョービー	15	16.1	
生化学工業	26.2	18.1	18.1	品川フラクトリーズ	3.8	18.1	36,905	アーレスティ	13.8	7.4	5,683	アーレスティ	13.8	7.4	
栄研化学	22.2	2.8	3	黒崎播磨	2.8	3	38,670	AREホールディングス	57.1	56.8	110,135	AREホールディングス	57.1	56.8	
鳥居薬品	7.3	9.2	9.1	ヨータイ	9.2	9.1	13,276	<b>金属製品 (0.5%)</b>							
JCRファーマ	46.3	7	7	東京薬業	11.6	7	3,619	稲葉製作所	8.3	7.5	11,377	稲葉製作所	8.3	7.5	
東和薬品	21.1	5.6	3	ニッカトール	5.6	3	1,746	宮地エンジニアリンググループ	3.9	7.6	26,676	宮地エンジニアリンググループ	3.9	7.6	
富士製薬工業	8.9	10.9	39.4	フジミコーポレートッド	10.9	39.4	132,975	トーカロ	38.7	43.6	66,664	トーカロ	38.7	43.6	
ゼリア新薬工業	19	3.6	1.9	クニミネ工業	3.6	1.9	1,934	アルファ	4.5	2.4	3,844	アルファ	4.5	2.4	
そーせいグループ	-	2.4	1.4	エーアンドエーマテリアル	2.4	1.4	1,939	SUMCO	268.1	268	605,680	SUMCO	268.1	268	
第一三共	1,192.7	34.6	37.1	ニチアス	34.6	37.1	127,624	川田テクノロジーズ	3.3	3.6	27,324	川田テクノロジーズ	3.3	3.6	
杏林製薬	29.7	17.1	18.4	ニチハ	17.1	18.4	60,812	RS Technologies	9.4	10.1	28,300	RS Technologies	9.4	10.1	
大幸薬品	24.8	34.6	37.1	<b>鉄鋼 (1.0%)</b>				ジェイテックコーポレーション	1.7	1.2	2,440	ジェイテックコーポレーション	1.7	1.2	
ダイト	9.6	630.7	675.6	日本製鉄	630.7	675.6	2,408,514	信和	6.8	4.3	3,276	信和	6.8	4.3	
大塚ホールディングス	313.3	283.2	303.4	神戸製鋼所	283.2	303.4	627,431	野村製鋼グループホールディングス	93.2	86.6	208,186	野村製鋼グループホールディングス	93.2	86.6	
大正製薬ホールディングス	30.4	29	34.6	中山製鋼所	29	34.6	32,627	ホッカンホールディングス	7.5	7.4	13,704	ホッカンホールディングス	7.5	7.4	
ペプシドリーム	66.4	7	8.5	合同製鐵	7	8.5	49,810	コロナ	7.8	8.6	8,195	コロナ	7.8	8.6	
セルソース	-	376.4	419.6	JFEホールディングス	376.4	419.6	973,681	横河アリッジホールディングス	18.6	23.6	67,189	横河アリッジホールディングス	18.6	23.6	
あすか製薬ホールディングス	14	39.6	42.5	東京製鐵	39.6	42.5	73,992	駒井ハルテック	2.1	1.2	2,511	駒井ハルテック	2.1	1.2	
サワグルホールディングス	31.3	16.1	17.3	共英製鋼	16.1	17.3	37,056	高田機工	0.6	0.5	1,832	高田機工	0.6	0.5	
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>		23.2	28.5	大和工業	23.2	28.5	241,366	三和ホールディングス	129.6	151.6	357,548	三和ホールディングス	129.6	151.6	
日本コープス工業	123.5	6.7	6.7	東京製鐵	6.7	6.7	36,046	文化シャッター	40.6	39.5	58,776	文化シャッター	40.6	39.5	
ニチレキ	16.3	6.6	7	大阪製鐵	6.6	7	15,456	三協立山	16.1	19	17,347	三協立山	16.1	19	
ユシロ化学工業	7.1	16.1	17.2	淀川製鋼所	16.1	17.2	67,768	アルインコ	10.8	11.5	11,994	アルインコ	10.8	11.5	
		11.7	9.9	中部鋼鉄	11.7	9.9	24,146	東洋シャッター	2.2	1.5	1,096	東洋シャッター	2.2	1.5	

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	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額	
LIXIL	千株	千株	千円		タツモ	千株	千株	千円		マースグループホールディングス	千株	千株	千円		
日本フィルコン	205.2	235.5	461,580		ナプテスコ	7.5	8.9	27,501		フクシマガリレイ	8.2	7.5	20,287		
ノーリツ	8.2	4.4	2,415		三井海洋開発	86.5	92.7	261,367		オーイズミ	10.1	9.7	49,567		
長府製作所	20.7	25	39,425		レオン自動車	17.3	18.7	42,710		ダイコク電機	4.6	2.5	1,125		
リンナイ	14.1	15	31,575		S M C	14.6	17.1	25,667		竹内製作所	7.5	7.3	26,207		
ダイニチ工業	25.5	72.2	234,577		ホンソカワミクロン	44.7	44.2	3,495,336		アマノ	25	26.8	136,144		
日東精工	6.5	3.5	2,467		ユニオンツール	10.6	9.5	43,937		J U K I	19.1	41.9	153,521		
三洋工業	20.6	21.9	11,979		瑞光	6.1	6.5	21,287		サンデン	21.4	22.8	10,510		
岡部	1.4	0.8	2,628		オイレス工業	—	10.6	19,758		ジャノメ	18.3	9.8	1,871		
ジーテクト	22.6	26.9	21,439		日精工業	19.3	20.1	41,767		マックス	14.1	15	10,785		
東プレ	15.7	19.2	40,569		技研製作所	6.3	5.9	24,750		グローリー	17	20.8	65,312		
高周波熱錬	24.9	26.6	59,451		日本エアータック	19.6	21	44,604		新晃工業	35.7	35.4	104,500		
東京製綱	22.8	23.3	24,651		カワタ	14.3	13.9	28,592		大和冷機工業	13.8	14.9	43,746		
サンコール	8.4	9.8	13,308		日精樹脂工業	7	6.9	8,438		セガサミホールディングス	21.2	22.7	34,640		
モリテックスチール	11.1	13.4	6,432		オカダアイオン	3.6	2	2,056		日本ピストンリング	110.8	131.9	288,069		
パイオラックス	9.4	6.1	1,756		ワイエイシホールディングス	10.3	11	12,848		T P R	4.2	—	—		
エイチワン	19.4	18.7	49,816		小松製作所	3.8	2.2	5,992		ツバキ・ナカシマ	5.5	—	—		
日本発条	14.7	15.5	13,919		住友重機械工業	5.2	5.5	12,787		大豊工業	15.8	18.7	39,344		
中央発條	124.7	133.5	165,540		日立建機	646	692.2	2,975,767		日本精工	34	29.7	22,156		
アドパネクス	7.8	11.2	8,366		日工	81.5	87.4	343,744		N T N	88.7	87.1	468,336		
立川ブラインド工業	1.5	0.8	859		巴工業	54.9	58.8	248,547		ジェイテクト	12.1	12.8	10,636		
三益半導体工業	6.4	6.8	10,077		井関農機	20.6	21.9	16,665		不二越	253	273.4	217,981		
機械 (5.3%)	10.8	13.6	43,588		丸山製作所	6	5.8	21,054		ユーション精機	271.8	320.3	90,773		
日本ドライケミカル	3	1.6	4,659		北川鉄工所	12.9	13.8	16,449		前澤給装工業	122.7	131.4	182,974		
日本製鋼所	38	40.7	95,461		クボタ	14	16.4	126,772		イーグル工業	10.2	10.9	36,951		
三浦工業	57.6	61.7	172,358		荏原実業	2.2	1.1	3,053		前澤工業	33.7	40.3	23,938		
タクマ	42.4	49.9	86,227		三菱化工機	5.4	5.8	8,642		日本ピラー工業	T H K	79.6	85.2	229,230	
ツガミ	30.6	32.8	39,655		月島ホールディングス	7.2	7.7	140,294		キッツ	10.8	11.8	8,106		
オークマ	13.8	12.9	89,113		帝国電機製作所	3.6	2.2	1,093		マキタ	9.8	11.3	15,368		
芝浦機械	13.7	14.7	49,612		新東工業	729.6	772	1,711,910		スター精密	15.3	16.3	28,036		
アマダ	220	235.6	374,368		アイチコーポレーション	6.6	7.8	25,038		サナヤホールディングス	7.1	4.2	4,544		
アイエンジニアリング	28.4	34.2	28,864		小森コーポレーション	4.4	5.2	19,162		スター精密	12.8	13.7	63,568		
TAKISAWA	3.3	—	—		鶴見製作所	20	20	27,160		東芝	50.7	49.5	60,439		
F U J I	60	69.5	171,943		日本ギア工業	10	10.4	30,014		三菱電機	171.5	168.4	641,267		
牧野フライス製作所	15.3	16.3	93,073		酒井重工業	2.9	1.7	795		東芝	63.2	73.3	55,194		
オーエスジー	65.8	65.1	130,427		西島製作所	12.9	13.9	34,485		三菱重工業	11.3	130.3	131,212		
ダイジェット工業	1.3	0.7	578		北越工業	12.9	13.9	34,485		I H I	241.1	258.2	2,674,952		
旭ダイヤモンド工業	38.5	34	29,444		石井鐵工所	19.6	20.6	22,783		日立製作所	86.9	109.9	302,719		
DMG森精機	83.6	89.5	292,844		西島製作所	31.9	36.4	46,555		サナヤホールディングス	16.8	9.6	1,392		
ソディック	37.9	35.9	25,848		加藤製作所	10.5	11.3	40,115		スター精密	26	27.5	47,630		
ディスコ	22.1	71.1	3,046,635		油研工業	4	2.5	1,667		日清紡ホールディングス	112.1	111	138,139		
日東工器	6.8	7.2	14,212		タダノ	56.4	60.6	574,912		イビデン	79	77	556,094		
日進工具	11.6	13.7	14,138		フジテック	1	0.8	2,166		コニカミノルタ	307.8	329.8	158,996		
パンチ工業	10.7	6.4	2,771		C K D	12	12.7	31,686		ブラザー工業	184.2	197.3	520,378		
富士ダイス	5.9	8.7	6,194		大同工業	13.8	14.8	36,304		ミネベアミツミ	239.8	256.9	749,248		
豊和工業	6.6	3.6	2,782		ダイキン工業	164.6	176.3	3,731,389		日立製作所	670.5	709.7	8,317,684		
ニデックオーケーケー	5	—	—		オルゴン	19	17.7	113,811		東芝	265.3	—	—		
石川製作所	3.1	1.7	1,955		トーヨーカネツ	5.3	5	21,375		三菱電機	1,425	1,643.6	3,311,854		
リケンN P R	—	16	43,872		栗田工業	77.1	82.6	454,217		富士電機	83.8	89.8	726,482		
東洋機械金属	8.5	5.4	3,877		樫本チエイン	19.5	20.9	97,498		東洋電機製造	3.9	2.3	2,410		
津田駒工業	2.3	1.2	465		木村化工機	5	2.9	2,177		安川電機	163.4	160.4	852,686		
エンシュウ	2.6	1.5	1,059		アネスト岩田	10.5	11.3	8,226		シノフニアテクノロジー	15.2	16.3	35,925		
島精機製作所	21.9	23.5	32,994		ダイフク	23.4	22.8	29,617		明電舎	20.9	27.4	76,062		
オプトラン	2.4	24.3	42,330		サムコ	71.1	249.2	714,581		オリジン	2.8	1.5	1,830		
N Cホールディングス	20.5	1.6	2,560		加藤製作所	4.5	4	18,840		山洋電気	6	6.4	37,248		
イワキ	9.3	9.8	22,628		油研工業	5.8	3.3	5,016		デンヨー	10.5	11.3	25,820		
フリュー	14.4	13.9	17,903		タダノ	1.7	1.1	2,550		P H Cホールディングス	19.2	27.6	41,565		
ヤマシンフィルタ	32.8	35.5	12,815		フジテック	72.6	85	99,917		K O K U S A I E L E C T R I C	—	57.1	227,258		
日阪製作所	13.3	16.1	16,051		C K D	50.5	34.5	125,925		ソシオネクスト	14.1	107.2	393,745		
やまびこ	22.5	24.1	38,969		平和	38.1	40.9	103,027		東芝テック	20.6	18.9	60,669		
野村マイクロ・サイエンス	4.6	5	66,250		理想科学工業	45.8	43.7	95,877		芝浦メカトロニクス	2.7	8.4	63,924		
平田機工	6.6	7.1	49,629		S A N K Y O	12.3	11.8	35,636		マブチモーター	34.3	72.6	184,186		
P E G A S U S	15.3	16.3	7,237		日本金銭機械	27.1	34	306,000		ニデック	334.9	326	1,782,894		
マルマエ	6.7	6.4	11,532			15.2	17.8	25,703		ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9.9	9.3	3,227		

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
トレッサ・セミコンダクター		千株	千円	マクセル	千株	千円	キャノン電子	千株	千株	千円	キャノン電子	千株	千株	千円	
東光高岳	6.5	7.6	13,056	古野電気	29.9	32.6	51,182	15.1	16.2	33,712	キャノン	749	729.3	2,980,649	
ダブル・スコープ	8.4	8.9	21,119	スマダコポレーション	18	19.2	39,052	リコー	342.2	366.6	465,398	象印マホービン	40.8	39.7	56,413
ダイヘン	45.1	42.3	30,709	アイコム	12.6	19.8	22,928	MUTOHホールディングス	1.7	0.9	1,874	東京エレクトロン	96.3	309.5	8,814,560
ヤーマン	12.5	14.8	95,756	リオン	5.4	5.7	20,491	イノテック	9.1	9.7	18,119	輸送用機器(9.1%)			
JVCケンウッド	23.8	28.7	28,814	横河電機	5.7	6.1	15,512	トヨタ紡織	57.5	61.6	145,468	トヨタ紡織	2.3	1.3	3,120
ミマキエンジニアリング	125.5	116.6	76,606	新電元工業	150.9	161.6	472,356	芦森工業	24.5	26.2	29,055	ユニプレス	24.5	26.2	29,055
IPEX	13.1	14	13,440	アズビル	5.3	5.6	17,640	豊田自動織機	99.8	124.7	1,685,320	モリタホールディングス	24	25.7	39,603
日新電機	7.6	10.2	17,911	東亜ディーケーケー	95.4	100.6	463,061	三機工業	20.9	22.3	19,824	デンソー	281.6	1,206.3	3,042,891
大崎電気工業	33	-	-	日本光電工業	63.1	62.7	249,984	東海理化電機製作所	38.6	41.2	94,677	川崎重工業	102.9	119.4	418,735
オムロン	126.3	112.8	625,137	チノー	5.7	6.1	14,609	名村造船所	31.2	36.4	49,140	日産自動車	1,939.1	1,973.1	1,211,680
日東工業	18.6	19.9	84,973	共和電業	11.6	6.1	2,580	日本車輛製造	5.3	4.8	10,972	いすゞ自動車	396.9	425.1	868,904
IDEC	20.3	21.8	60,669	日本電子材料	9	9	17,208	三菱ロジスネクスト	21.8	23.3	36,441	トヨタ自動車	7,495.9	8,028.6	26,173,236
正興電機製作所	4.6	2.2	2,457	堀場製作所	30.3	27.9	344,983	近畿車輛	1.5	0.9	1,806	日野自動車	175.8	219.9	102,473
不二電機工業	2.5	1.3	1,492	アドバンテスト	107.5	418.9	2,561,573	三菱自動車工業	532.6	570.4	259,931	エフテック	8.3	4.5	3,091
ジーエス・ユアサ コーポレーション	45.3	57.6	148,348	小野測器	4.5	2.7	1,242	レップホールディングス	4.7	2.8	1,878	レップホールディングス	4.7	2.8	1,878
サクサホールディングス	2.6	1.5	4,252	エスベック	10.9	11.7	29,881	GMB	2.4	1.3	1,635	GMB	2.4	1.3	1,635
メルコホールディングス	3.7	4.6	14,950	キーエンス	136.5	146.3	9,389,534	ファルテック	2.1	1.3	726	武蔵精密工業	33.3	35.7	61,368
テクノメディカ	3.3	3.5	6,685	日置電機	7.1	6.9	45,126	日産車体	24.1	14.8	14,518	日産車体	24.1	14.8	14,518
ダイキンエレクトリックホールディングス	4.5	5.5	3,839	シスメックス	117.7	126.2	960,760	新明和工業	42.9	42.1	49,088	新明和工業	42.9	42.1	49,088
日本電気	195	193.9	1,835,069	日本マイクロニクス	22.5	26.3	109,934	極東開発工業	24.2	24.2	58,007	トビー工業	11.1	11.9	34,867
富士通	137.4	135.9	3,125,020	メガチップス	11.2	11.6	55,100	トビラド	3.4	3.2	12,080	トビラド	3.4	3.2	12,080
沖電気工業	62.3	66.8	71,876	OBARA GROUP	6.4	8	31,520	曙ブレーキ工業	83.3	89.1	10,157	曙ブレーキ工業	83.3	89.1	10,157
岩崎通信機	5.4	3.1	2,154	澤藤電機	1.4	0.8	1,047	タチエス	21.6	27	53,460	タチエス	21.6	27	53,460
電気興業	5.5	6.6	15,635	原田工業	5.5	2.9	2,180	NOK	53	56.8	116,553	NOK	53	56.8	116,553
サンケン電気	12.8	13.7	106,860	コーセル	16.4	15.6	22,807	フタバ産業	36.5	39.2	38,376	フタバ産業	36.5	39.2	38,376
ナカヨ	2.1	1.1	1,261	イリソ電子工業	12.6	13.4	40,803	カヤバ	13.1	14.1	71,064	カヤバ	13.1	14.1	71,064
アイホン	8.4	8	22,936	オプテックスグループ	25.1	26.8	47,168	大同メタル工業	26.6	28.6	16,330	大同メタル工業	26.6	28.6	16,330
ルネサスエレクトロニクス	899.7	963.8	2,288,061	千代田インテグレ	4.7	5.7	15,600	プレス工業	60.8	58.4	39,303	プレス工業	60.8	58.4	39,303
セイコーエプソン	183.6	189.5	448,546	レーザーテック	62.5	67	2,674,640	ミクニ	14	8.2	4,108	ミクニ	14	8.2	4,108
ワコム	109.2	112.3	83,438	スタンレー電気	97.1	93.6	248,929	太平洋工業	31.3	33.5	50,116	太平洋工業	31.3	33.5	50,116
アルバック	32.7	32.4	244,911	岩崎電機	4.4	-	-	河西工業	16.1	10.3	1,936	河西工業	16.1	10.3	1,936
アクセル	4.5	5.9	13,440	ウシオ電機	71.3	74.3	152,835	アイシン	105.4	112.8	595,358	アイシン	105.4	112.8	595,358
EIZO	10.1	10.8	53,460	岡谷電機産業	9.8	5	1,430	マツダ	451.5	483.6	919,807	マツダ	451.5	483.6	919,807
ジャパントディスプレイ	528.8	636.3	12,726	ハリオス テクノ ホールディング	11.1	6.5	3,458	今仙電機製作所	7.7	4.1	3,075	今仙電機製作所	7.7	4.1	3,075
日本信号	31.4	33.7	32,183	エノモト	3.1	1.8	2,921	本田技研工業	1,109.7	3,565.6	6,098,958	本田技研工業	1,109.7	3,565.6	6,098,958
京三製作所	29.9	30.9	14,368	日本セラミック	13.9	11.9	31,475	スズキ	250.8	268.5	1,942,597	スズキ	250.8	268.5	1,942,597
能美防災	18.7	20	46,040	遠藤照明	5.4	2.9	4,428	SUBARU	432	453.4	1,403,273	SUBARU	432	453.4	1,403,273
ホーチキ	10.3	11	23,386	古河電池	10.1	10.7	10,047	安永	5.4	2.8	1,909	安永	5.4	2.8	1,909
星和電機	5.2	2.9	1,392	双信電機	5	2.6	767	ヤマハ発動機	214.5	631.9	896,982	ヤマハ発動機	214.5	631.9	896,982
エレコム	32.9	35.3	59,551	山一電機	11.9	13.1	28,767	TBK	11.7	7	2,961	TBK	11.7	7	2,961
パナソニック ホールディングス	1,628.6	1,744.5	2,495,507	図研	11.9	12.7	51,752	エクセディ	22.2	23.9	68,712	エクセディ	22.2	23.9	68,712
シャープ	166	248.9	214,576	日本電子	34.2	36.6	243,353	豊田合成	39.8	41.9	123,730	豊田合成	39.8	41.9	123,730
アンリツ	97.1	104	121,108	カシオ計算機	101.6	105.6	133,108	三菱工業	22.6	24.2	35,283	三菱工業	22.6	24.2	35,283
富士通ゼネラル	39.1	41.9	87,990	ファナック	133.9	713	2,812,785	盟和産業	1.5	0.9	931	盟和産業	1.5	0.9	931
ソニーグループ	965.7	1,034.3	14,790,490	日本シイエムケイ	29	31.1	23,387	日本プラス	9.5	5.5	3,327	日本プラス	9.5	5.5	3,327
TDK	218.4	233.8	1,776,646	エンプラス	4	4.3	46,827	ヨロズ	12.6	13.7	13,672	ヨロズ	12.6	13.7	13,672
帝国通信工業	6.2	6.5	12,668	大真空	16.6	21.8	19,140	エフ・シー・シー	24.3	25.9	54,131	エフ・シー・シー	24.3	25.9	54,131
タムラ製作所	59.1	58.8	31,810	ローム	63.1	270.3	719,538	シマノ	55.8	59.1	1,245,532	シマノ	55.8	59.1	1,245,532
アルプスアルパイン	123.1	131.9	141,133	浜松ホトニクス	109.5	117.3	661,102	ティ・エス テック	62.5	52	100,568	ティ・エス テック	62.5	52	100,568
池上通信機	4	2	1,796	三井ハイテック	14.1	12.9	95,382								
日本電波工業	16.5	17.7	21,169	新光電気工業	48.3	51.7	281,765								
鈴木	7.4	7.9	9,875	京セラ	212.1	908.5	1,887,408								
メイコー	15.1	14.7	67,326	太陽誘電	66.5	71.2	244,287								
日本トリム	3.1	3.3	10,923	村田製作所	414	1,330.3	3,976,931								
ローランド ディー・ジー	7.7	8.1	31,509	双葉電子工業	25.8	27.8	14,066								
フォスター電機	12.8	10.9	12,327	北陸電気工業	4.5	2.4	3,381								
SМК	3.3	3.8	9,500	ニチコン	27.9	38.4	48,384								
ヨコオ	10.9	13	18,564	日本ケミコン	13.5	15.6	21,871								
ティアック	18.8	10.6	1,049	KOA	20.6	22.1	32,199								
ホシデン	33	33.6	60,312	市光工業	19.7	26.4	15,892								
ヒロセ電機	22.8	21.8	354,032	小糸製作所	164.2	151.5	305,727								
日本航空電子工業	28.3	35.3	86,732	ミツバ	25.6	27.4	30,907								
TOA	15.7	16.8	18,900	SCREENホールディングス	23.3	50	817,250								

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末						
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額				
ジャムコ	千株	千株	千円	共同印刷	千株	千株	千円	サカイ引越センター	千株	千株	千円	精工機器 (2.3%)	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
	6.6	7.1	10,792	NISSHA	3.8	4.1	13,940		6.5	16.2	42,816								
テルモ	426.5	408.8	2,073,842	光村印刷	0.6	0.5	779	近畿グループホールディングス	136.3	146	657,146								
クリエートメディック	4.2	2.1	1,871	TAKARA & COMPANY	8.8	8.6	24,355	飯飯神ホールディングス	181.7	194.7	887,832								
日機装	34.1	34.1	38,396	アシックス	126	124.6	585,620	南海電気鉄道	65.1	65.1	193,867								
日本エム・ディ・エム	8	11.6	8,444	ツツミ	2.4	2.4	5,220	京阪ホールディングス	56.3	80.5	288,914								
島津製作所	166.2	194.3	750,386	ローランド	10	10.8	52,164	神戸電鉄	3.7	4	11,508								
JMS	12.8	13.4	6,994	小松ウオール工業	5.1	6	19,410	名古屋鉄道	150.6	150.6	340,657								
クボテック	3.2	1.8	459	ヤマハ	86.1	92.2	316,891	山陽電気鉄道	10.3	11	24,057								
長野計器	9.9	10.6	24,348	河合楽器製作所	3.7	4.4	15,422	アルプス物流	10.9	11.7	22,101								
ブイ・テクノロジ	6.6	7.7	20,713	クリナップ	15.4	14.3	11,096	ヤマトホールディングス	174.5	186.9	451,550								
東京計器	10.4	11.2	20,798	ピジョン	86.9	93.1	149,565	山九	34.7	37.1	199,820								
愛知時計電機	5.4	6.3	16,304	兼松サステック	0.6	-	-	丸連	6.5	3.7	1,036								
インターアクション	6.4	8.8	9,900	キングジム	12.2	13	11,323	丸全昭和運輸	8.5	9	37,350								
オーバル	10.7	5.7	3,100	リントック	27.4	29.4	82,114	セウグループホールディングス	72.2	77.3	87,194								
東京精密	29.9	29.9	283,631	イトーキ	27.9	30	46,920	トナミホールディングス	2.5	3.2	14,864								
マニー	60.1	58.5	120,217	任天堂	861.9	923.1	7,725,423	ニッコホールディングス	43.7	46.7	148,926								
ニコン	212.3	211.4	319,108	三菱鉛筆	19.4	20.8	40,996	日本石油輸送	0.8	0.7	2,009								
トプコン	71.8	71.1	122,043	タカラスタンダード	26.4	30.8	57,934	福山通運	10.4	16.7	71,309								
オリンパス	853.3	900	1,930,500	コクヨ	65.7	59.9	141,573	セイノホールディングス	84.9	82.1	177,294								
理研計器	8.5	10.4	82,472	ナカバヤシ	15	15.7	8,478	エスライングループ本社	3.7	1.8	1,564								
タムロン	10.2	9	51,570	グロブライド	11	13.1	27,248	神奈川中央交通	3.9	4	12,440								
HOYA	291.5	287.8	5,295,520	オカムラ	41.1	44.1	96,005	AZ-COM <sup>株</sup> ホールディングス	32.9	37.3	56,770								
シード	6.2	3.3	2,646	美津濃	13.5	14.5	63,945	C&Fホールディングス	13.2	14.1	24,745								
ノーリツ鋼機	12.9	13.9	45,592	電気・ガス業 (1.4%)				九州旅客鉄道	96.3	103.2	348,093								
A&Dホンホールディングス	19.9	21.3	45,156	東京電力ホールディングス	1,230.6	1,318	1,005,502	S Gホールディングス	261.6	245.1	460,910								
朝日インテック	152.5	178.2	515,176	中部電力	503.1	538.8	1,057,395	NIPPON EXPRESSホールディングス	50.9	49.5	429,066								
シチズン時計	149.9	134.5	130,868	関西電力	527.1	564.6	1,080,362	海運業 (0.9%)											
リズム	3.8	1.5	5,355	中国電力	217.4	254	251,053	日本郵船	364.6	418.4	2,048,068								
大研医器	9.3	5.6	3,029	北陸電力	128.7	149.5	106,279	商船三井	240.2	316.8	1,674,288								
メニコン	46.9	50.3	107,013	東北電力	333.7	384.9	386,632	川崎汽船	116.1	117.2	823,330								
シンシャ	1.2	0.8	468	四国電力	116.5	136.2	140,830	NSユニテッド海運	7.3	7.9	40,211								
松風	6.2	6.6	17,721	九州電力	315	337	389,403	明海グループ	11.8	7.1	5,530								
セイコーグループ	21.2	20.4	54,835	北海道電力	131.7	141.2	89,873	飯野海運	50	53.6	72,306								
ニプロ	113.8	121.9	146,462	沖縄電力	31.9	37.3	40,768	共栄タンカー	2.2	1.2	1,225								
その他製品 (2.4%)				電源開発	102.8	120.1	308,596	乾汽船	17.3	17.1	18,365								
KYORITSU	17.6	9.7	1,959	エフオン	8.9	10.6	4,706	空運業 (0.4%)											
中本パックス	3.8	2.1	3,645	イーレックス	24.3	26	19,994	日本航空	334.8	358.5	1,001,111								
スノーピーク	23.3	20.8	17,700	レノバ	36.3	39	47,697	ANAホールディングス	370.8	397.2	1,287,722								
パワマウントヘッドホールディングス	31.6	30.4	81,016	東京瓦斯	288.6	309.1	1,021,575	パスコ	2.5	1.3	2,442								
トランザクション	10.5	9.6	23,654	大阪瓦斯	276.6	296.2	918,516	倉庫・運搬業 (0.1%)											
粧美堂	3.5	1.8	1,398	東邦瓦斯	53.8	63.3	189,108	トランコム	3.9	4.2	29,232								
ニホンフラッシュ	12.9	13.7	13,110	北海道瓦斯	8.2	8.7	19,992	日新	10.3	11.1	29,903								
前田工織	11.6	12.4	38,750	広島ガス	28.8	30.9	12,174	三菱倉庫	29.3	35.9	158,498								
永大産業	13	7.5	1,770	西部ガスホールディングス	12.8	15.3	29,024	三井倉庫ホールディングス	12.7	13.6	64,872								
アートネイチャー	14.1	13.2	10,520	静岡ガス	31.2	29.2	29,784	住友倉庫	37.5	39.4	99,169								
フルヤ金属	-	3.5	32,690	メタウオーター	17	17.5	37,275	滋潤倉庫	5.5	6.7	20,937								
バウダイナムホールディングス	124.7	400.6	1,212,215	陸運業 (2.7%)				東陽倉庫	16.4	1.7	2,669								
アイフイスジャパン	3.5	1.9	1,145	SBSホールディングス	12.2	13	32,162	日本トランスシティ	27.6	29.4	18,610								
SHOEI	14.4	33.1	64,611	東武鉄道	150	160.6	628,749	ケイヒン	2.2	1.1	2,125								
フランスベッドホールディングス	16.8	19	26,448	相鉄ホールディングス	45.1	52.3	148,139	中央倉庫	6.7	7.8	9,063								
パイロットコーポレーション	21.4	20.6	82,523	東急	382.7	410	704,995	川西倉庫	2.1	1.3	1,463								
萩原工業	9.1	9.8	14,592	京浜急行電鉄	154.8	180.9	234,265	安田倉庫	9.5	10	12,110								
フジシルインターナショナル	27.7	29.6	51,504	小田急電鉄	206.9	241.8	533,289	ファイズホールディングス	2.3	0.9	1,191								
タカラトミー	62.9	66.6	158,474	京王電鉄	72.2	70.3	294,416	東洋埠頭	3.5	1.9	2,644								
広済堂ホールディングス	8.2	37.6	27,786	京成電鉄	88	94.3	650,670	上組	65.3	67.4	228,620								
エステールホールディングス	2.9	1.7	1,113	富士急行	16.8	18	78,570	サンリツ	2.8	1.6	1,259								
タカノ	4.6	2.4	2,412	東日本旅客鉄道	231.6	268.6	2,417,400	キムラユニティ	5.9	3.1	5,031								
プロネクサス	11.4	15.2	19,319	西日本旅客鉄道	174.3	173.4	1,112,361	キューソー流通システム	7.3	6.6	6,039								
ホクシン	9.4	4.8	552	東海旅客鉄道	105.2	563.2	2,124,390	東海運	7.5	3.8	1,113								
ウッドワン	4	2.4	2,464	西武ホールディングス	165.1	176.9	375,028	エアイテイ	8.6	9.2	17,056								
大建工業	8	-	-	鴻池運輸	23.3	24.9	47,484	内外トランスライン	5	5.8	14,018								
TOPPANホールディングス	178.5	179.7	708,018	日本本紙	36.4	39.1	96,264	日本コンセプト	4.2	5.3	9,306								
大日本印刷	162	159.8	668,763	ハマキョウレックス	10.7	12.5	50,187	情報・通信業 (7.6%)											
								NECネットエスアイ	45.7	57.2	133,218								

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
クロスキャット		千株	千円	アドソル日進	千株	千株	千円	FIG	千株	千株	千円	FIG	千株	千株	千円
システム	7.8	9.3	10,918	ODKソリューションズ	5.8	6.2	9,901	システムサポート	14.1	7.6	2,287	システムサポート	5.3	5.7	10,847
デジタルアーツ	230.2	221.9	63,907	フリービット	2.7	1.3	782	イーノル	8.8	10.6	6,190	アルテリア・ネットワークス	12.7	-	-
日鉄ソリューションズ	8.7	9.3	39,246	コムチュア	7.1	6.4	9,158	東海ソフト	1.9	1.1	1,283	ウイングワーク1st	14.1	15.2	43,350
キューブシステム	23.4	25	124,375	サイバーコム	18.1	21.2	38,859	ホトコムソリューションズ・ホールディングス	3.7	3.9	4,539	サーバーワークス	2.8	3	12,120
コア	8.3	7.8	8,884	アステリア	2	-	-	東名	0.9	0.5	1,140	ヴィッツ	1.2	0.6	493
手間いらず	5.9	6.5	11,648	アイル	10.7	11.5	7,233	トビラシステムズ	3.1	1.9	1,654	Sansan	44.7	48.1	67,772
ラクーンホールディングス	2.3	2.5	6,695	マークラインズ	7.6	6.8	21,964	Link-U	2.3	1.6	1,014	ギフティ	14.9	12.9	19,866
ソリトンシステムズ	11.4	10.9	7,542	メディカル・データ・ビジョン	7.4	7.9	23,700	メドレー	13.7	19.7	90,915	JMDC	22.5	25	91,900
ソフトクリエイトホールディングス	7	7.6	10,716	gumi	20.4	17.5	11,095	フォーカスシステムズ	10	9.8	10,280	フレスコ	10.5	12	23,604
T I S	153.9	160.4	546,803	ショーケース	21.1	23.8	9,496	フブ・メディア・ホールディングス	131.4	140.9	276,938	オービック	45.7	49	1,099,315
テクミラホールディングス	5.6	3	1,422	モバイルファクトリー	3	1.5	499	ジャストシステム	19.7	21.1	62,329	TDCソフト	11.6	13.7	29,085
グリー	36.7	49.1	28,428	テラスカイ	2.6	1.4	1,016	LINEヤフー	1,948.4	2,087.7	904,600	トレンドマイクロ	79	69.3	572,279
GMOペパボ	2	1.8	2,149	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.9	6.3	9,620	IDホールディングス	9.3	9.9	16,780	日本オラクル	26.2	28.1	316,827
コーエーテックホールディングス	85.8	91.9	165,098	PC Iホールディングス	7.9	7.6	13,512	アルファシステムズ	4.3	3.9	12,246	フューチャー	34.1	31.3	53,303
三菱総合研究所	6.7	7.2	35,352	アイビーシー	1.9	1	468	CAC Holdings	8.6	7.9	14,180	S B テクノロジー	5.8	6.2	13,615
ホルテージ	3.6	1.8	487	ネオジャパン	4.5	4.9	5,169	トーセ	3.2	1.9	1,345	オービックビジネスコンсалタント	26.9	20.6	145,477
電算	0.8	0.8	1,197	PR TIME S	3.4	2.9	6,223	伊藤テクノソリューションズ	73.5	-	-	アイティフォー	18.2	18.8	22,729
AGS	5.3	2.7	2,459	ラクス	64.7	69.4	165,484	東計電算	2	4.1	15,088	エクセスネット	1.8	1	1,105
ファインデックス	10.7	11.6	11,774	ランドコンピュータ	3	3.1	2,749	大塚商会	77.6	72.7	434,964	サイボウズ	18.9	20.2	45,510
ブレインパッド	10.2	12.2	15,396	ダブルスタンダード	5.6	4.5	7,389	電通総研	16.6	17.8	96,654	ACCESS	16.2	15.2	12,768
K L a b	27.2	26.9	9,657	オーブントピア	9.6	8.5	8,007	デジタルガレージ	24.3	23.4	82,251	イーエムシステムズ	22.8	24.5	16,709
ホルトウィンホールディングス	23.4	25	12,125	マイネット	4	2.1	583	イーエムニューズ	4.2	4.5	22,995	C I J	11.4	24.4	16,714
ネクソン	354	328.2	948,662	アカツキ	6.5	7	17,528	ビジネスエンジニアリング	2.6	2.8	12,474	日本エンタープライズ	12.4	6.6	818
アイスタイル	39.8	47.8	19,550	ベネフィットジャパン	0.8	0.4	498	WOWOW	7.6	11	12,760	スカラ	12.7	13.5	10,260
エムアップホールディングス	16.7	18	17,964	Ubi comホールディングス	4.2	4.6	7,369	インテリジェント ウェイ	6.5	3.5	3,934	ANY COLOR	-	15.5	52,390
エイチーム	9.9	8.7	4,863	カナミックネットワーク	19.7	15.8	6,699	WOW WORLD GROUP	2.2	-	-	IMAGICA GROUP	11.2	14.7	10,216
エニゴモ	17.4	18.6	6,510	コムラシテックコーポレーション	11.7	7.1	809	ネットワンシステムズ	51	59.2	160,106	システムソフト	45.1	50.8	2,946
テクノスジャパン	10	5.8	3,700	チェンジホールディングス	33.5	31.9	43,830	アルゴラフィックス	12.6	13.5	56,025	マーベラス	22.3	23.8	17,635
enish	9.2	6.6	1,214	シンクロ・フード	7.6	4.1	2,681	エイベラス	23.2	25	35,225	B I P R O G Y	50.4	48	215,760
コソプラ	53.2	56.9	35,676	オークネット	6.7	5.4	11,485	エイベラス	23.2	25	35,225	兼松エレクトロニクス	8.5	-	-
オルトプラス	9.2	5.8	881	キャピタル・アセット・プランニング	2.4	1.3	978	都築電気	7.2	7.7	18,641	TBSホールディングス	70.2	73.7	297,748
ブロードリーフ	79.9	69.6	43,708	セブエグループ	3.3	2.1	1,936	日本テレビホールディングス	121.3	129.8	290,946	朝日ネット	14.8	15.8	9,938
クロス・マナティングループ	7.3	3.1	1,779	エイトレッド	1.9	1	1,416	アバントグループ	17.3	18.5	25,326	e B A S E	19.3	20.7	14,717
デジタルハーツホールディングス	8.6	9.1	9,500	マクロミル	26.8	28.8	22,320								
システム情報	12.1	-	-	ビーグリー	2.1	1.4	1,785								
メディアアドゥ	5.5	6.6	8,210	オロ	4.1	5.3	15,184								
じげん	39.9	42.8	22,256	ユーザーローカル	5	6.2	12,920								
ブイキューブ	16.4	17.5	5,285	テモナ	2.3	1.5	384								
エンカレッジ・テクノロジ	2.9	1.5	958	ニーズウェル	3.7	3.6	2,862								
サイバーリンクス	3.9	2.5	2,022	マネーフォワード	32.9	32.7	187,567								
ディー・エル・イー	8.8	4.6	846	サインポスト	4.7	2.5	1,280								
フィックスターズ	15.5	16.5	26,383	SUN ASTERISK	7.2	10.4	9,994								
CARTA HOLDINGS	6.4	6.9	10,736	プラスアルファ・コンсалティング	-	8.7	21,228								
オプティム	11.2	15.1	13,816	電算システムホールディングス	-	6.5	19,220								
セレス	5.5	5.9	7,351	APPIER GROUP	38.9	50.1	85,671								
S H I F T	10	9.7	266,604	ビジョナル	-	11.2	102,816								
ティーガイア	14.3	15.4	31,339	ソルクシーズ	10.2	5.3	2,141								
セック	1.7	1.8	9,180	フェイス	3.4	1.8	874								
テクマトリックス	25	26.8	50,946	プロトコルソリューション	17.1	16.1	21,960								
プロシップ	6	7.1	9,989	ハイマックス	4.3	4.5	6,309								
カホー・ワトライフ・エンターテインメント	41.9	38.2	94,984	野村総合研究所	280.9	324.9	1,374,327								
GMOペイメントゲートウェイ	31.3	29.3	258,250	サイバネットシステム	11.5	-	-								
ザップパラ	3.4	1.5	649	CEホールディングス	6.2	3.4	2,067								
システムリサーチ	4.2	5	17,125	日本システム技術	5.1	5.4	17,577								
インターネットエンアティブ	76.4	70.1	198,207	インテジホールディングス	15.5	16.6	28,552								
さくらインターネット	15.3	16.5	62,452	東邦システムサイエンス	3.5	5.5	6,897								
ヴィンクス	3.6	-	-	ソースネクスト	69.6	67.1	9,662								
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4.2	4.5	12,370	インフォコム	17.6	18.9	41,598								
SRAホールディングス	7	7.5	29,100	シンプルクス・ホールディングス	23	22.1	55,581								
システムインテグレータ	3.7	2	868	HEROZ	4.5	5.8	9,094								
朝日ネット	14.8	15.8	9,938	ラクスル	38.7	35.3	37,523								
e B A S E	19.3	20.7	14,717	マルカリ	61.8	71.4	174,037								
アバントグループ	17.3	18.5	25,326	I P S	4.4	4.2	8,513								

銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
テレビ朝日ホールディングス		千株	千円	ハイパー	千株	千円	シークス	千株	千円		千株	千円			
スカパーJ SATホールディングス	33.3	35.6	78,498	あい ホールディングス	2.5	1.6	20.5	22	34,342		20.5	22			
日本BS放送	121.3	113.9	94,878	ディー・ブイエックス	23.1	24.8	61,032	3.9	1.9		3.9	1.9			
ビジョン	9.8	10.6	35,139	ダイワボウホールディングス	3.5	1.9	2,036	7.2	8.1		7.2	8.1			
スマートバリュー	4.4	2.4	2,186	マツコホールディングス	59	68.5	215,364	0.7	1.9		0.7	1.9			
USEN-NEXT HOLDINGS	18.1	22.1	25,061	ラクト・ジャパン	35.4	36.6	295,179	1.4	0.7		1.4	0.7			
ワイヤレスゲート	3	1.9	750	グリムス	5.7	6	13,512	890.1	1,039.9		890.1	1,039.9			
コネクショ	12.3	16.4	68,634	バイタルケアエスターホールディングス	6	6.5	13,351	1,140.3	1,289.8		1,140.3	1,289.8			
日本通信	5.5	2.8	800	メディアスホールディングス	21.1	23.4	27,963	2.1	4.7		2.1	4.7			
クロップス	8.9	-	-	ハ洲電機	11.8	12.5	16,175	67.9	70.9		67.9	70.9			
日本電信電話	126.2	144.3	34,199	メデアスホールディングス	9.2	9	6,705	7.8	9.7		7.8	9.7			
KDDI	2.1	0.9	918	レスタールホールディングス	13.8	13.2	39,930	126.5	135.5		126.5	135.5			
ソフトバンク	1,754.4	43,620.3	7,999,963	ジオリーブグループ	2.7	1.6	2,134	20.7	21.5		20.7	21.5			
光通信	1,058	1,133.2	5,211,586	大光	5.2	3.6	2,300	56	64.7		56	64.7			
エムティーアイ	2,199.3	2,360	4,589,020	OCHIホールディングス	2.9	1.6	2,560	1.9	1		1.9	1			
GMOインターネットグループ	16.1	14.8	385,170	TOKAIホールディングス	71.3	84	84,420	1,056.8	1,165.6		1,056.8	1,165.6			
ファイバーゲート	12.5	10.1	6,201	黒谷	3.7	2.2	1,344	7.6	7.4		7.6	7.4			
アドマーケティングコミュニケーション	50.9	54.2	141,733	Cominix	2.4	1.4	1,188	15.4	16.4		15.4	16.4			
KADOKAWA	7.3	7.9	7,394	三洋貿易	14.9	17.5	22,505	0.6	0.4		0.6	0.4			
学研ホールディングス	3.1	1.8	423	ビューティガレージ	2.3	4.9	10,520	2	2.1		2	2.1			
ゼンリン	72.3	77.5	250,945	ワイン・パートナーズ	10.5	10.1	12,726	1.1	10.7		1.1	10.7			
昭文社ホールディングス	22.8	24.4	24,644	ミタチ産業	3.3	1.9	2,133	38.9	46.9		38.9	46.9			
インプレスホールディングス	23.3	25.1	21,435	シッパハルスケホールディングス	51.9	55.6	123,320	2.1	3.1		2.1	3.1			
アイネット	5.6	2.9	1,078	明治電機工業	5.5	5.8	8,479	894.6	936.3		894.6	936.3			
松竹	10.8	6.6	1,168	デリカフーズホールディングス	5.2	3	1,782	6.4	6.3		6.4	6.3			
東宝	8.4	8.9	17,132	スターティアホールディングス	2.5	1.8	2,842	903.1	3,065.3		903.1	3,065.3			
東映	7.8	7.6	77,558	コメダホールディングス	35.3	37.9	104,869	5.1	14.6		5.1	14.6			
NTTデータグループ	85.7	81.6	386,294	ピーバンドコム	1.7	0.9	363	33.4	35.8		33.4	35.8			
ピー・シー・エー	3.8	4.8	96,624	アセンテック	4.7	5.9	3,363	5.7	6.1		5.7	6.1			
ビジネスブレイン太田昭宏	429.6	383.4	800,730	富士興産	2.9	1.9	4,145	10.1	10.9		10.1	10.9			
DT S	7.8	8.4	13,255	協栄産業	1.1	0.7	2,093	12.3	14.7		12.3	14.7			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5.9	5.7	12,768	フルサト・マルカホールディングス	14.3	13.8	34,099	13.3	14.1		13.3	14.1			
シーイーシー	29.1	30.9	112,630	ヤマエグループホールディングス	8.2	8.7	27,013	13	12.1		13	12.1			
カプコン	68.8	67	416,606	小野建	13.4	15.4	28,490	3.6	3.9		3.6	3.9			
アイ・エス・ピー	19.2	18.5	30,691	南陽	2.5	1.4	3,102	6.6	3.7		6.6	3.7			
ジャスト	136	131.1	738,617	佐島電機	8	8.6	19,986	25.9	27.8		25.9	27.8			
S C S K	7	7.5	11,790	エコートレーディング	2.5	1.3	1,602	9.6	10.3		9.6	10.3			
N S W	8.4	9	11,934	伯東	8.3	8.9	51,798	11.7	11.6		11.7	11.6			
アイネス	111.7	102.6	272,043	コンドレーテック	11.1	11.9	14,399	11.6	12.5		11.6	12.5			
T K C	5.4	6.3	18,685	中山福	6.6	3.9	1,407	32.9	35.2		32.9	35.2			
富士ソフト	9.5	11.4	16,917	ナガイレーベン	18.2	19.6	45,942	3.5	2.1		3.5	2.1			
N S D	24.6	23.3	88,307	三菱食品	13.4	14.3	72,644	1.4	2.2		1.4	2.2			
コナミグループ	15.5	29.5	188,800	松田産業	10.9	11.8	31,222	8.7	9.2		8.7	9.2			
番井コンピュータホールディングス	48.8	52.3	140,373	第一興商	27.9	59.9	120,279	25	29		25	29			
J B C Cホールディングス	58.6	54.9	507,111	メディバルホールディングス	149.7	157.3	373,194	39.8	37.2		39.8	37.2			
ミロク情報サービス	9.5	9.1	23,241	S P K	6.4	6.9	13,882	29.2	30.6		29.2	30.6			
ソフトバンクグループ	9.9	9.7	38,121	萩原電気ホールディングス	5.5	6.6	33,990	8.5	8.3		8.5	8.3			
卸売業 (7.3%)	12.5	13.3	25,961	アズワン	21.2	24.2	133,027	19.2	18.3		19.2	18.3			
高千穂交易	791.6	723.4	4,787,461	スズデン	5.1	5.4	12,123	4.4	2.5		4.4	2.5			
オルパルシステムホールディングス	4.5	4.9	19,526	尾家産業	3.1	1.6	2,945	26.5	25.6		26.5	25.6			
伊藤忠食品	2	1.1	2,060	シモジマ	9.9	10.4	13,478	35.9	42.8		35.9	42.8			
エレマテック	2.7	3.5	27,405	ドウシシャ	15.3	14.3	30,358	36.3	35.6		36.3	35.6			
あらた	1.3	13.9	25,117	小津産業	2.9	1.5	2,479	18.6	19.8		18.6	19.8			
トーメンデバイス	11	23.7	73,588	高速	7.5	9.2	21,675	4.6	4.3		4.6	4.3			
東京エレクトロン デバイス	2.1	2.2	11,726	たけびし	5.6	5.9	11,859	35.8	38.4		35.8	38.4			
円谷フーズホールディングス	5.4	15.4	100,562	リックス	2.7	2.6	9,282	41	43.8		41	43.8			
双日	12.4	26.6	47,507	丸文	12.9	13.8	21,307	7.4	7.9		7.4	7.9			
アルフレックス ホールディングス	153.3	172.3	641,300	ハピネット	12.3	13.2	37,501	15.4	10.9		15.4	10.9			
横浜冷凍	144.9	155.3	371,865	機本総業ホールディングス	5.8	6.1	7,917	19.4	20.8		19.4	20.8			
神栄	39.4	42.1	46,731	日本ライフライン	42.3	45.4	59,519	6.2	6		6.2	6			
ラサ商事	1.8	1	1,712	タカショー	12.5	13.5	6,709	5.8	6.2		5.8	6.2			
アルコニック	5.8	6.3	10,621	I D O M	43.7	40.9	36,932	15.9	15.7		15.9	15.7			
神戸物産	19	20.4	28,580	進和	9.6	9.5	23,132	21.3	22.8		21.3	22.8			
	111.8	119.7	443,847	エスケイジャパン	3.2	1.7	1,207	11.8	14.1		11.8	14.1			
				ダイトロン	5.7	6.1	18,788	9.4	13.1		9.4	13.1			

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
立花エレクトック		千株		千円	MonotaRO		千株		千円	アドヴァングループ		千株		千円
フォーバル	10.5	10.3	32,136		東京一番フーズ	204.7	219.3	302,962		アルビス	13.8	14.7	15,611	
PAL TAC	5.5	6.1	8,430		DDグループ	3.1	1.7	904		コナカ	4.7	5	13,345	
三谷産業	22.7	20.9	91,667		きちりホールディングス	8.3	4.4	6,688		ハウス オブ ローゼ	14	7.4	3,145	
太平洋興発	25.3	27	10,449		アーランドサービスホールディングス	3.1	1.8	1,848		G-7ホールディングス	1.7	0.9	1,457	
西WISMETACホールディングス	4.4	2.5	2,085		J.フロント リテイリング	11.8	-	-		イオン北海道	18	16.9	23,474	
ヤマタシメタカホールディングス	3.6	3.9	24,921		ドール・日レスホールディングス	179.5	177.5	266,871		コジマ	21.4	45.7	42,546	
コア商事ホールディングス	1	0.6	1,345		マツキョココカラ&カンパニー	25.6	27.4	58,882		ヒマラヤ	28	25.6	18,790	
KPPグループホールディングス	8.2	10.9	8,120		プロンコピレー	87.6	281.4	781,588		コーナン商事	4.1	2.2	2,057	
ヤマタネ	33.6	40	28,720		ZOZO	7.6	9.1	30,348		エコス	19.5	19	75,240	
丸紅建材リース	6.4	6.8	16,694		トレジャー・ファクトリー	95.5	98.6	331,986		ワタミ	5.4	5.7	14,335	
日鉄物産	0.8	0.5	1,429		物語コーポレーション	3.9	8.5	12,316		マルシェ	17.4	16.4	16,613	
泉州電業	9.9	-	-		三越伊勢丹ホールディングス	8	25.8	136,224		西松屋チェーン	4	2.5	607	
トラスコ中山	7.2	7.2	27,252		Hamee	243.1	260.5	509,928		サンヨーホールディングス	291.5	312.4	1,032,482	
オートバックスセブン	30.3	32.5	79,040		マーケットエンタープライズ	5	6.2	6,776		幸楽苑ホールディングス	32	30.4	64,873	
モリト	50.2	53.9	87,587		クリエイトSDホールディングス	1.3	0.6	616		ハーグスレイ	79	78.8	580,046	
加藤産業	10.4	11.1	15,717		丸善CHIホールディングス	74.9	80.2	210,244		V Tホールディングス	9.5	11.4	14,979	
北恵	17.5	19.2	89,376		エー・ピーホールディングス	23.8	21.9	70,737		ポプラ	4.5	2.4	2,179	
日伝	2.9	1.7	1,463		チムニー	15.4	8.3	2,705		フジ・コーポレーション	24	22.9	111,866	
杉本商事	25.5	24.6	46,321		シュッピン	2.4	1.5	928		ユナイテッドアローズ	54.8	58.8	31,281	
因幡電機産業	11.4	11.9	12,316		エー・ピーホールディングス	1.7	0.9	1,268		YU-WA CREATION HOLDINGS	4.5	5.4	13,046	
東テック	8.6	10.5	28,602		エー・ピーホールディングス	1.9	1.7	1,654		コロワイド	3.2	1.8	439	
ミスミグループ本社	7.1	4.2	1,302		サムニー	4	2.1	3,059		ビシーデッドコーポレーション	8.2	7.4	13,090	
アルテック	6.2	7.3	16,439		シュッピン	10.7	14	14,182		香雪屋	15.4	18.2	35,672	
タキヒヨー	37.4	40.1	140,350		オイシックス・ラ・大地	19.4	20.8	28,579		ハイデイド白濁	21.4	22.9	65,494	
蔵王産業	4.9	5.1	33,507		ネクステージ	32.9	35.3	84,296		YU-WA CREATION HOLDINGS	7.1	3.7	536	
スズケン	217.9	233.6	542,302		ジョイフル本田	42.8	45	87,390		コロワイド	66.6	66.5	154,047	
ジェコス	7.1	3.7	925		鳥貴族ホールディングス	5.4	5.7	21,004		ビシーデッドコーポレーション	15.7	-	-	
グローセル	3.1	1.6	1,929		ホットランド	11	11.8	23,847		トッポカルチャー	11.5	12.2	76,738	
小売業 (4.2%)	2.2	1.2	3,084		すかいらーくホールディングス	197.4	211.4	501,652		PLANT	4.2	2.2	345	
ローソン	44.9	58.9	271,941		SFPホールディングス	7.9	8.5	18,062		スギホールディングス	3.2	1.5	2,422	
サンエー	11	11.8	54,044		縮半ホールディングス	11.4	12	17,760		葉王堂ホールディングス	29.1	31.2	217,807	
カワチ薬品	21.4	12.1	32,827		ヨシダホールディングス	2.6	3.2	9,478		ヴァア・ホールディングス	8	7.6	19,486	
エービーシー・マート	11.1	67.7	176,561		コナチン・スーパーマーケットホールディングス	47.2	43.1	43,143		スクロール	17.9	10.2	1,560	
ハードオフコーポレーション	5.2	5.5	10,092		ゴルフダイジェスト・オンライン	6.5	7	4,340		ヨドシホールディングス	21.5	23	22,264	
アスコム	29.8	37.3	73,854		B E E N O S	8.2	6.3	9,097		木曾路	12.4	14.6	28,776	
ゲオホールディングス	15.2	17.4	41,394		あさひ	12.1	14.3	18,661		SRSホールディングス	21.9	23.4	61,167	
アズストリア	17.4	18.7	67,600		日本調剤	9.9	10.5	15,330		千趣会	23.8	25.5	29,860	
ジフット	6.8	5.7	1,692		コスモス薬品	14.2	13.1	209,600		タカキュー	27.1	28.4	7,838	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1.7	0.9	686		トール	5.8	3.1	2,458		リテールパートナーズ	9.2	-	-	
くら寿司	16.9	18.1	71,314		セブン&アイ・ホールディングス	497.8	533.1	3,238,049		ケーヨー	21.5	23	39,951	
キャンドゥ	5.2	5.5	14,778		クレスト・レストラン・ホールディングス	108.7	104.7	114,332		上新電機	23.4	-	-	
IKホールディングス	4	2.3	878		ツルハホールディングス	30.3	32.5	357,662		日本瓦斯	12.9	15.3	36,352	
バルグループホールディングス	14.1	30.4	69,403		サンマルクホールディングス	11.7	12.5	28,000		ロイヤルホールディングス	77.4	82	195,693	
エディオン	57.2	61.2	94,186		フェリシモ	2.9	1.5	1,375		東天紅	28	27.3	69,560	
サラーコーポレーション	30.3	32.5	26,097		トリドールホールディングス	35.9	43.4	195,213		いなげや	0.6	0.5	421	
ワッツ	6.3	3.3	1,940		TOKYO BASE	14.8	18.5	5,716		チヨダ	14.1	15	19,110	
ハローズ	6.6	7	30,065		ウエルグラスホールディングス	2.1	1.4	1,440		ライフコーポレーション	13.8	14.8	13,246	
フジオフードグループ本社	12.1	17.4	25,021		JMホールディングス	12.3	11.7	27,565		リンガーハット	12.6	16.2	60,993	
あみやき亭	3.5	3.7	16,668		サツドラホールディングス	5.8	2.8	2,251		Mr Ma x HD	18.6	20	48,060	
ひらまつ	27.2	16.4	4,428		アレザホールディングス	10.8	11.6	13,502		テンアライド	20.4	19.5	12,285	
大黒天物産	4.4	4.8	42,096		華かつ田中ホールディングス	3.8	4.1	8,077		AOKIホールディングス	13.7	9.1	2,884	
ハニースホールディングス	11.4	13.7	23,235		パロックスジャパンミテッド	9.4	12	9,828		オークワ	26.8	33.2	39,441	
ファーマライズホールディングス	2.9	1.6	1,046		クスリのアオキホールディングス	12.9	46.6	146,277		コメリ	23	23.8	77,588	
アルペン	11.9	12.7	25,501		力の源ホールディングス	7.4	7.9	11,502		青山商事	22.9	33.1	60,275	
ハブ	4.1	2.2	1,610		FOOD & LIFE COMPANIES	83	82.5	235,578		しまむら	16.9	18.2	293,475	
クオールホールディングス	19.9	21.3	34,655		メディカルシステムネットワーク	12.6	16.8	9,727		はせがわ	6.2	3.3	1,191	
ジンスホールディングス	8.6	9.2	37,996		一家ホールディングス	2.8	1.7	1,196		高島屋	108.9	106.9	235,393	
ビックカメラ	96	82.3	110,693		ジャパコラフドホールディングス	4	4.9	823		松屋	24.5	26.2	25,361	
DCMホールディングス	88.1	81.8	112,311		はるやまホールディングス	5.3	3.3	1,966		エイチ・ツー・オー リテイリング	70.3	68.5	124,533	
ベッパードサービス	30.2	35.8	3,329		カッパ・フリエイト	47.2	44.9	72,199		近鉄百貨店	4.6	6.6	16,962	
					ライトオン	9.7	5.2	2,168		丸井グループ	106.5	102.7	250,177	
					良品計画	186.3	168.9	356,885		アックス リテイリング	9.9	10.6	41,605	
					パルミキホールディングス	16.5	8.6	4,222		井筒屋	6.1	3.2	1,139	





銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末			銘柄	期首(前期末)			銘柄	当 期 末		
	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額		株	数	評 価 額
		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
野村不動産ホールディングス	84	80.1	299,493	インテリックス	3.1	1.5	847	CDG	1.4	0.8	989		1.4	0.8	989
三菱重工グループホールディングス	28.8	30.9	18,849	ランドビジネス	4.4	2.4	662	アドウエイズ	19.3	20.7	10,577		19.3	20.7	10,577
サムティ	21.4	22.9	57,295	サンテックスグループ	3.6	2.1	2,007	パリュエーコマース	10.5	13.2	16,209		10.5	13.2	16,209
ディ・ライフ	20.7	24.5	24,010	グランディハウス	10.1	10.8	7,106	インフォーマート	145.6	156	60,684		145.6	156	60,684
コーセーホールイー	3.7	2	1,826	日本空港ビルディング	47.6	50.9	299,444	J Pホールディングス	40.3	38.4	16,627		40.3	38.4	16,627
地主	10.2	11	24,882	サービス業 (4.6%)				エコナックホールディングス	22	5.8	748		22	5.8	748
ブレックスコーポレーション	17.6	22.9	39,021	明豊ファシリティワークス	6.3	3.3	3,111	CLホールディングス	3.9	3.5	3,272		3.9	3.5	3,272
THEグローバル社	7	4.3	1,659	日本工営	8.5	—	—	プレイステージ・インターナショナル	59	70.4	41,184		59	70.4	41,184
ハウスコム	2	1	907	L I F U L L	48	51.3	9,849	アミューズ	7.6	9.2	14,766		7.6	9.2	14,766
J P M C	6.8	8.3	9,495	M I X I	31.9	32.2	80,789	ドリムインキュベータ	4.3	5.2	15,782		4.3	5.2	15,782
サンセイラディック	3.7	1.9	2,093	ジェイエイシークルメント	12.7	54.3	37,412	クイック	10.7	10.4	25,126		10.7	10.4	25,126
エストラスト	1.5	0.7	451	日邦M&Aセンターホールディングス	240.8	239.5	219,286	T A C	6.8	3.3	627		6.8	3.3	627
フージャースホールディングス	20.6	22.2	25,374	メンバーズ	4.1	5.1	4,855	電通グループ	137.9	147.7	585,187		137.9	147.7	585,187
オープンハウスグループ	49.2	52.7	246,688	中広	1	1	413	テイクアンドグ・ニーズ	4.2	5.8	6,948		4.2	5.8	6,948
東急不動産ホールディングス	404.1	432.9	430,735	UTグループ	20.6	19.4	48,306	びあ	4.7	5	16,800		4.7	5	16,800
船舶グループホールディングス	117.8	138	295,251	アイティメディア	5.4	5.7	11,280	イオンファンタジー	6.1	5.4	13,224		6.1	5.4	13,224
イーブランド	1.9	1	1,587	ケアネット	—	23.1	16,331	シーティーエス	15.6	19	13,946		15.6	19	13,946
ムゲンエステート	7.9	4.3	4,949	E・Jホールディングス	8.2	8.8	14,722	N E X Y Z . G r o u p	3.8	2.1	1,465		3.8	2.1	1,465
ピーロッド	8.3	4.4	4,628	オープンアップグループ	42	45.1	104,541	H.U.グループホールディングス	41.1	44	117,832		41.1	44	117,832
ファーストブラザーズ	2.3	1.3	1,632	ミッドカホールディングス	42	45	42,120	アルプス技研	12.2	14.3	41,384		12.2	14.3	41,384
And Doホールディングス	8	8.7	9,726	アルトナー	3.1	2.8	6,168	サニックス	22.7	24.1	6,940		22.7	24.1	6,940
シーアールイー	6.1	8	11,104	パソナグループ	17	18.2	49,231	日本空調サービス	15.4	16.2	14,515		15.4	16.2	14,515
プロパティエージェン	1.5	—	—	C D S	3.2	1.7	2,908	オリエンタルランド	148.5	795.4	4,066,084		148.5	795.4	4,066,084
ゲイアリスト不動産	6.5	6.9	23,529	リンクドモチベーション	40.3	43.3	24,594	ダクシン	31.3	33.5	115,742		31.3	33.5	115,742
アグリ都市デザイン	2.2	1.1	1,782	エス・エム・エス	53.4	52.7	129,694	明光ネットワークジャパン	18.4	18.2	13,031		18.4	18.2	13,031
グッドコムアセット	12.5	13.4	10,559	サニーサイドアップグループ	3.8	2.3	1,368	ファルコホールディングス	6.1	6.8	13,980		6.1	6.8	13,980
ジェイ・エス・ビー	3.3	7.2	19,519	パソルホールディングス	157.1	1,530.1	363,857	秀英予備校	3.1	1.5	462		3.1	1.5	462
ロードスターキャピタル	5.8	9.4	18,273	リニカル	7.1	4.3	2,236	田谷	1.7	1.2	506		1.7	1.2	506
テンポインバージョン	3.7	1.9	1,778	クックパッド	38.4	41.1	4,932	ラウンドワン	117.3	141.4	97,000		117.3	141.4	97,000
グローバル・リンク・マネジメント	2.3	1.2	2,977	エスクリ	5.2	2.7	774	リゾートトラスト	55.4	65.3	167,102		55.4	65.3	167,102
フェイスネットワーク	1.7	1.7	2,687	アイ・ケイ・ケイホールディングス	6.2	3.3	2,399	ピー・エム・エル	17.4	18.5	52,836		17.4	18.5	52,836
霞ヶ関キャピタル	—	3.9	45,552	学情	6.4	7.7	13,898	りらひらひらコミュニケーションズ	23.2	—	—		23.2	—	—
パーク24	104.7	93.5	179,940	スタジオアリス	7	7.5	15,735	リソー教育	63.8	76.8	18,432		63.8	76.8	18,432
パラカ	4.7	5.1	10,225	シミックホールディングス	7.7	—	—	早稲田アカデミー	7.8	8.3	14,508		7.8	8.3	14,508
ミガロホールディングス	—	1	1,481	エプコ	2.7	1.8	1,699	ユー・エス・エス	144.3	168.6	453,196		144.3	168.6	453,196
宮越ホールディングス	6.2	6.6	7,134	N J S	2.6	3.3	9,025	東京個別指導学院	16.7	17.9	8,055		16.7	17.9	8,055
三井不動産	584.3	665.9	2,661,602	総合警備保障	52.1	251.1	200,553	サイバーエージェント	335.7	332.1	339,738		335.7	332.1	339,738
三菱地所	811.2	941.3	1,974,847	カカココム	104.7	99.3	177,796	楽天グループ	649.5	1,288.3	818,070		649.5	1,288.3	818,070
平和不動産	21.8	23.4	88,218	アイロムグループ	5.1	6.1	12,547	クリーク・アンド・リバー社	8.3	7.6	15,184		8.3	7.6	15,184
東京建物	128.1	125.8	279,590	セントケア・ホールディング	9.1	11	10,714	S B I グロ-バルアセットマネジメント	23	29.4	20,433		23	29.4	20,433
京阪神ビルディング	16.9	26.9	38,009	サイネックス	2.2	1.1	917	ター・オー・ダブリュー	27.2	29.4	10,084		27.2	29.4	10,084
住友不動産	243	208.2	993,322	ルネサンス	9.8	11.7	10,869	山田コサルティンググループ	7.1	6.5	11,381		7.1	6.5	11,381
テオーシー	24.5	25.7	17,193	ディップ	24.6	23	61,157	セントラルスポーツ	5.3	5.6	13,938		5.3	5.6	13,938
東京楽天地	2.4	—	—	デジタルホールディングス	10.9	7.8	9,742	フィルキャストホールディングス	13.4	14.4	25,776		13.4	14.4	25,776
レオパレス21	151.4	144.1	56,631	新日本科学	14.9	13.7	21,330	エン・ジャパン	25.4	24.5	67,154		25.4	24.5	67,154
スターツコーポレーション	19.3	20.7	62,307	キャリアデザインセンター	2.6	1.4	2,521	リソルホールディングス	1.1	0.6	3,666		1.1	0.6	3,666
フジ住宅	18.8	18.1	12,887	ペネフィット・ワン	65	52.2	109,463	テノワフ・ホールディングス	83.1	88	296,120		83.1	88	296,120
空港施設	16.2	20.3	12,525	エムスリー	277.3	297	587,317	アトラグループ	3	2	362		3	2	362
明和地所	6.1	8.2	10,791	フカダ・グローバルホールディング	7.8	4.3	1,840	インターワークス	3.2	—	—		3.2	—	—
ゴールドクレスト	12.8	11.7	26,933	プラス	1.7	0.7	503	アイ・アルジャパンホールディングス	7.3	7.8	10,303		7.3	7.8	10,303
エスリード	6.4	6.8	23,120	アウトソーシング	83.6	96.5	167,958	KeepE r 技研	8.7	9.3	60,636		8.7	9.3	60,636
日研グループホールディングス	21.7	23.1	11,619	ウエルネット	9.5	5.9	3,280	ファーストロジック	2	1.6	804		2	1.6	804
日本エスコン	30.3	26.9	26,577	ワールドホールディングス	6.3	6.8	20,672	三機サービス	2	1.2	1,615		2	1.2	1,615
M I R A R T Hホールディングス	67.7	66.1	33,182	ディー・エヌ・エー	59.9	53.4	81,621	Gunosy	11.1	11.9	8,687		11.1	11.9	8,687
A V A N T I A	5.9	3.5	3,164	情報堂D Yホールディングス	178.9	191.7	228,793	デザインワン・ジャパン	3.7	1.6	212		3.7	1.6	212
イオンモール	69.7	74.6	138,271	ぐるなび	25.8	28	7,392	イー・ガーディアン	5.3	5.7	8,031		5.3	5.7	8,031
毎日コムネット	4.5	2.4	1,783	タカミヤ	19.2	20.4	9,934	リアセンス	5.8	3.1	753		5.8	3.1	753
ファースト住建	5	2.5	2,770	シャッパバストレスキューシステム	8.7	—	—	ジャパマテリアル	42.9	46	118,450		42.9	46	118,450
ランド	810.9	798.5	5,589	ファンコミュニケーションズ	27.8	21	8,379	ベクトル	22	18.4	21,804		22	18.4	21,804
カチタス	36.1	38.7	69,040	ライク	5.3	5.6	8,540	ウチヤマホールディングス	5.6	2.8	1,072		5.6	2.8	1,072
トーセイ	22.3	24	48,840	A o b a - B B T	4.6	2.5	1,030	チャム・ケア・コーポレーション	11.7	12.5	17,162		11.7	12.5	17,162
穴吹興産	2.4	1.5	3,198	エズパール	40.3	43.2	13,262	キャリアアリンク	5.2	5.5	14,470		5.2	5.5	14,470
サンフロンティア不動産	22.4	21.3	36,593	WD Bホールディングス	7.1	7.7	17,594	I B J	8.6	11.5	7,820		8.6	11.5	7,820
FJネットホールディングス	14.1	15.2	19,547	ティア	7.4	3.9	1,887	アサンテ	7	7.4	12,321		7	7.4	12,321

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
バリューHR		千株	千円		千株	千円	日総工業		千株	千円		千株	千円	タナホコンサルティンググループ		千株	千株	千円		千株	千円
M&Aキャピタルパートナーズ	13	12.2	29,206	6	6,222	18,222	キュービネットホールディングス	10.5	—	—	5	5.2	5,610	ナガワ	3.7	4.7	33,793	5	4.7	33,793	
ライオンエクスプレスホールディングス	5.1	6	6,222	19	20.4	5,385	RPAホールディングス	19	20.4	5,385	東京都競馬	11.8	12.6	57,708	常磐興産	4.3	2.5	3,092	11.8	12.6	57,708
ERIホールディングス	3.2	1.9	3,562	4.3	1.9	1,508	スプリックス	4.3	1.9	1,508	カナモト	25.7	23.3	67,104	ニシオホールディングス	13	14	55,090	4.3	2.5	3,092
アビスト	2	1	3,115	7.7	6.4	18,022	マネジメントソリューションズ	7.7	6.4	18,022	アゴラ ホスピタリティグループ	70.2	43.4	998	トラランス・コスモス	17.4	18.7	55,165	7.7	6.4	18,022
シグマクシスホールディングス	21.3	20.3	34,185	3.3	3.5	1,242	プロレド・パートナーズ	3.3	3.5	1,242	乃村工藝社	61.2	65.6	56,940	藤田観光	6.2	6	40,200	21.3	20.3	34,185
ウィルグループ	11.7	12.5	14,900	3.6	2	622	and factory	3.6	2	622	KNT-CTホールディングス	8.4	9	11,763	日本管財	14.8	—	—	11.7	12.5	14,900
エスコロー・エージェンツ・ジャパン	13.5	7.9	1,106	1.5	0.8	414	テノホールディングス	1.5	0.8	414	トーカイ	12.5	13.3	28,209	白洋舎	1.1	1	2,736	13.5	7.9	1,106
メドピア	11	13.2	9,081	4.7	3.8	5,909	フロンティア・マネジメント	4.7	3.8	5,909	セコム	142.9	153.1	1,639,701	セントラル警備保障	7.5	8.1	20,841	11	13.2	9,081
レアジョブ	2.4	1.3	1,186	2	1.2	376	ピアラ	2	1.2	376	メイテックグループホールディングス	55.9	54.1	164,680	丹靑社	27	29.1	23,483	2.4	1.3	1,186
リクルートホールディングス	1,039	1,112.8	6,435,322	2.1	2.2	3,577	ゴロ・ホールディングス	2.1	2.2	3,577	応用地質	13.1	14	30,184	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	1,039	1,112.8	6,435,322
エラン	18.6	19.9	21,074	1.8	0.9	452	ギークス	1.8	0.9	452	進学会ホールディングス	4.2	1.7	433	オオバ	7.9	4.5	4,540	18.6	19.9	21,074
土木管理総合試験所	5.3	3.1	1,010	—	16.1	44,355	アンピスホールディングス	—	16.1	44,355	いであ	2.8	1.8	3,834	学究社	5.6	6	12,486	5.3	3.1	1,010
日本郵政	1,839.2	1,766.2	2,500,939	43.1	41.1	30,866	カープスホールディングス	43.1	41.1	30,866	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	ステップ	5.8	5.5	11,088	1,839.2	1,766.2	2,500,939
ベルシステム24ホールディングス	18.8	16.1	28,802	8.3	20.5	16,338	フォーラムエンジニアリング	8.3	20.5	16,338	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	18.8	16.1	28,802
鎌倉新書	15.9	12.8	7,936	4.7	5.1	5,630	FAST FITNESS JAPAN	4.7	5.1	5,630	ナック	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	15.9	12.8	7,936
SMM	3.2	1.3	421	16.8	15.5	6,851	ダイレクトマーケティングミックス	16.8	15.5	6,851	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	ステップ	5.8	5.5	11,088	3.2	1.3	421
一蔵	1.5	0.8	494	2.1	2.2	3,000	ロビンス	2.1	2.2	3,000	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	オオバ	7.9	4.5	4,540	1.5	0.8	494
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1.2	786	10.9	11.7	25,353	LITALICO	10.9	11.7	25,353	応用地質	13.1	14	30,184	船井総研ホールディングス	29.5	31.3	77,373	1.9	1.2	786
エアトリ	9.1	11	20,009	—	0.6	963	コンフィデンス・インターワークス	—	0.6	963	進学会ホールディングス	4.2	1.7	433	オオバ	7.9	4.5	4,540	9.1	11	20,009
アトラエ	11	8.9	5,918	5.7	3.4	1,547	アドバンテッジリスクマネジメント	5.7	3.4	1,547	いであ	2.8	1.8	3,834	学究社	5.6	6	12,486	11	8.9	5,918
ストライク	6.9	6.4	30,976	78.1	75.3	118,635	リロググループ	78.1	75.3	118,635	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	ステップ	5.8	5.5	11,088	6.9	6.4	30,976
ソラスト	38.7	41.4	23,598	9.8	10.5	8,158	東祥	9.8	10.5	8,158	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	38.7	41.4	23,598
セラク	5	4.6	5,147	—	9.1	33,488	ID&Eホールディングス	—	9.1	33,488	ナック	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	5	4.6	5,147
インソース	34.8	32.6	25,395	2.7	3.1	5,614	ビーウィズ	2.7	3.1	5,614	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	ステップ	5.8	5.5	11,088	34.8	32.6	25,395
ペイカレント・コンサルティング	111	110.5	345,754	29.5	28.8	36,316	TREホールディングス	29.5	28.8	36,316	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	111	110.5	345,754
Orchestra Holdings	3	3.2	3,168	6.3	5.7	10,807	人・夢・技術グループ	6.3	5.7	10,807	ナック	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	3	3.2	3,168
アイモパイル	7.3	20.1	9,105	—	13	10,647	NISSOホールディングス	—	13	10,647	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	ステップ	5.8	5.5	11,088	7.3	20.1	9,105
キャリアインデックス	4.2	2.3	457	26.7	27.3	68,058	大栄環境	26.7	27.3	68,058	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	4.2	2.3	457
MS-Japan	4.1	5.5	6,963	—	15.8	40,416	日本管財ホールディングス	—	15.8	40,416	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	4.1	5.5	6,963
船場	1.5	1.4	1,379	—	7.2	42,840	M&A総研ホールディングス	—	7.2	42,840	ナック	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	1.5	1.4	1,379
ジョビエレベーターサービスホールディングス	50	48.7	105,386	36.7	43.7	77,523	エイチ・アイ・エス	36.7	43.7	77,523	ダイセキ	28.7	30.7	123,874	ステップ	5.8	5.5	11,088	50	48.7	105,386
フルテック	1.7	1	1,128	4.4	6.8	17,761	ラックランド	4.4	6.8	17,761	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	1.7	1	1,128
グリーンズ	4.2	2.4	4,917	24	23.6	145,706	共立メンテナンス	24	23.6	145,706	ナック	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	4.2	2.4	4,917
ツナググループホールディングス	3.5	1.9	1,649	15	16	25,536	イチネンホールディングス	15	16	25,536	建設技術研究所	7.2	7.7	46,893	学究社	5.6	6	12,486	3.5	1.9	1,649
GAMEWITH	3.7	2.8	873	7.2	7.7	46,893	建設技術研究所	7.2	7.7	46,893	スペース	10	9.8	9,261	学究社	5.6	6	12,486	3.7	2.8	873
MS&Consulting	1.4	1	590	10	9.8	9,261	スペース	10	9.8	9,261	ベネッセホールディングス	52.3	50.5	131,249	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	1.4	1	590
ウェルビー	10.3	7.5	6,382	6	14.1	15,777	燎ホールディングス	6	14.1	15,777	ナック	6.5	12.8	6,937	ナック	6.5	12.8	6,937	10.3	7.5	6,382
エルク・ティール・エス	1.9	1.7	4,867	0.6	3	9,420	Sバル興業	0.6	3	9,420	ステップ	5.8	5.5	11,088	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	1.9	1.7	4,867
ミダグホールディングス	8.6	9.1	15,388	4.6	2.4	2,726	東京テアトル	4.6	2.4	2,726	ステップ	5.8	5.5	11,088	イオンディライト	15.5	16.1	60,455	8.6	9.1	15,388

(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		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 13,328		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 528,947,749		% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,775,214		2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	542,722,964		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	542,722,857,274円
一 株 式 等	12,373,197,806
株 式 (評 価 額)	528,947,749,730
未 収 入 金	569,015,410
未 収 入 委 託 証 拠 金	703,427,711
未 収 入 委 託 証 拠 金	129,466,617
(B) 負 債	592,021,000
未 払 解 約 金	592,021,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	542,130,836,274
元 本	121,842,817,407
次 期 繰 越 損 益	420,288,018,867
(D) 受 取 金 額 (C / D)	121,842,817,407円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	44,494円

(注1) 期首元本額 117,622,712,134円  
 追加設定元本額 59,907,077,380円  
 一部解約元本額 55,686,972,107円

(注2) 期末における元本の内訳

MHAMスリーウェイクオープン	234,935,632円
MHAM TOP I Xオープン	2,457,094,087円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,281,412,558円
One DC 国内株式インデックスファンド	30,809,632,061円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,610,201,313円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,608,149円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	17,989,649円
たわらノーロード TOP I X	2,226,070,109円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス (堅実型)	49,358,924円
たわらノーロード バランス (標準型)	360,326,830円
たわらノーロード バランス (積極型)	607,683,019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)	2,285,856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)	141,103,494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)	406,039,337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)	347,897,665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)	481,585,965円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	365,246円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,354,848円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	27,592,829円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,404,483円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,596,334円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,412,337,171円
Oneグローバルバランス	41,793,827円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	914,089,355円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,328,302,554円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,866,884,412円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	294,884,221円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	964,080,357円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,090,311,381円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	283,994,414円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	332,963,584円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	563,739,113円
投資のソムリエ	8,462,984,252円
フルズコントロール	331,322,523円
投資のソムリエ<DC年金>	830,639,366円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	315,192,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,094,963,321円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	940,176,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,070,818,810円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	79,256,153円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,224,319円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,888,540円
リスクコントロール世界分散投資	1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	230,928,569円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	80,685,240円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	43,107,354円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	26,468,340円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	499,441,883円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	6,256,314円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,630,575円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	32,054,533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)	1,852,453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)	1,973,535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)	1,168,057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)	1,140,141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)	21,514,902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)	4,850,093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	179,053,363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)	1,676,651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) 22-05	82,171,987円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産分配) 22-10	373,974,618円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	3,244,839円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	271,164,256円
AMIOネットアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定)	13,265,462円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	22,573,361円
日興資産戦略ファンド (インカム重視) 儲蓄ツケリ (適格機関投資家限定)	42,437,517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)	3,180,848円
リスクコントロール世界8資産バランス (FOF 5期) (適格機関投資家限定)	3,641,563円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	34,738,163円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	67,464,810円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,592,055円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	10,658,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	3,391,442円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	80,001円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,346,974円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	17,271,356円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	278,577,105円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	397,261,876円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,219,167,945円
DIAMグローバル・セット・バランスVA (適格機関投資家限定)	10,308,559円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	14,774,714円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	148,488,928円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家限定)	28,546,662円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	53,149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)	157,074,573円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	8,107,544円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	38,324,573円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	100,737,648円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	130,670,328円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	17,344,200円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	7,096,700円
動的パッケージファンド<DC年金>	26,832,017円
コア資産形成ファンド	13,890,277円
MHAMトピックスファンド	785,854,154円
MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	44,680,531円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,152,105,329円
MHAM日本株バッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,885,462,391円
期末元本合計	121,842,817,407円
担保資産	

(注3) 代用として担保を提供している資産はありません。

## ■損益の状況

当期 自2023年2月8日 至2024年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,425,561,919	円
	受取配当金	10,381,192,543	
	受取利息	112,936	
	その他の収益	47,949,906	
	支払利息	△3,693,466	
(B)	有価証券売買損益	111,503,767,553	
	売却益	123,369,784,497	
	売却損	△11,866,016,944	
(C)	先物取引等取引損益	3,953,117,580	
	取引益	4,399,997,660	
	取引損	△446,880,080	
(D)	その他費用	△2,081,296	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	125,880,365,756	
(F)	前期繰越損益金	279,360,210,690	
(G)	解約差損益金	△154,955,776,199	
(H)	追加信託差損益金	170,003,218,620	
(I)	合計(E+F+G+H)	420,288,018,867	
	次期繰越損益金(I)	420,288,018,867	

(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》

■当投資信託において保有していた株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2023年12月に当該和解金を計上いたしました。

(2023年12月20日)

# 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22期（決算日 2024年2月15日）

（計算期間 2023年2月16日～2024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22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 (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	純資産 総額
	期騰落率	騰落率	期騰落率	騰落率			
18期(2020年2月17日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
19期(2021年2月15日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
20期(2022年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565
21期(2023年2月15日)	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8	642,642
22期(2024年2月15日)	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4	856,221
22期(2024年2月15日)	83,633	34.0	2,736,922.65	34.4	96.4	1.8	1,360,958

(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

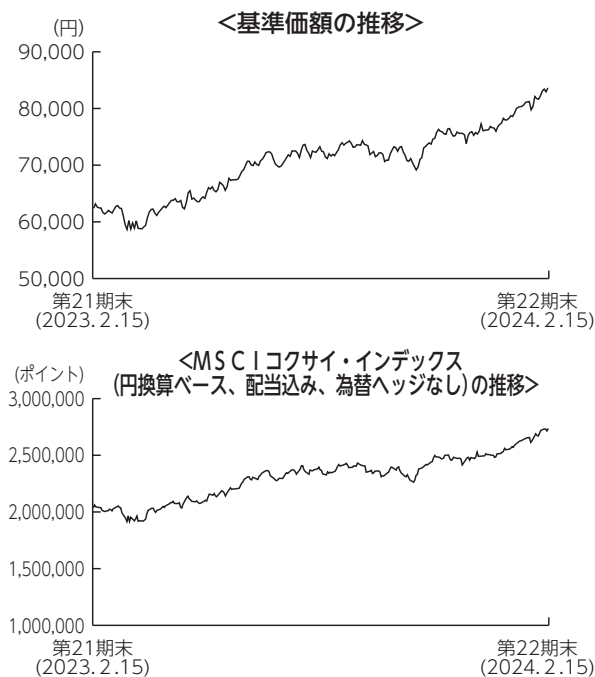
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 2 月 15 日	62,397	% -	2,036,206.59	% -	% 95.5	% 2.4
2 月 末	62,015	△0.6	2,024,295.30	△0.6	95.3	2.7
3 月 末	61,720	△1.1	2,015,006.82	△1.0	94.3	3.6
4 月 末	63,410	1.6	2,069,847.33	1.7	96.3	1.1
5 月 末	66,369	6.4	2,168,855.48	6.5	96.0	2.0
6 月 末	71,589	14.7	2,341,072.28	15.0	95.7	2.3
7 月 末	72,676	16.5	2,377,166.85	16.7	96.3	1.7
8 月 末	73,956	18.5	2,418,481.90	18.8	95.1	2.9
9 月 末	72,169	15.7	2,360,275.52	15.9	96.8	1.3
10 月 末	69,734	11.8	2,281,682.14	12.1	96.3	1.9
11 月 末	75,211	20.5	2,460,561.81	20.8	96.5	1.6
12 月 末	76,550	22.7	2,507,429.81	23.1	96.4	1.5
2024 年 1 月 末	81,230	30.2	2,657,966.51	30.5	95.7	2.7
(期 末) 2024 年 2 月 15 日	83,633	34.0	2,736,922.65	34.4	96.4	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（2023年2月16日から2024年2月15日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は83,633円となり、前期末比で34.0%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米欧中央銀行の利上げ長期化観測が懸念されていたところに、一転して早期利下げ観測が浮上したことから多くの株式市場が上昇しました。加えて、為替市場で各国中央銀行と日銀の金融政策の方向性の違いから全ての通貨に対し円安となったことも寄与し、当ファンドの基準価額は上昇しました。

### 投資環境

先進国株式市場は多くの市場が上昇しました。期前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となりました。2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や長期金利上昇への警戒感から下落しましたが、11月以降は米欧などで早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから米

国など多くの株式市場は上昇しました。その後は早期利下げ観測は後退したものの、大型ハイテク株などに牽引され上昇しました。

為替市場は全ての通貨に対し円安となりました。米ドルは期前半、F R Bの利上げ長期化観測や日銀の金融政策修正観測の後退などから日米の金融政策の方向性の違いが意識され円安米ドル高が進行しました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年に入ると米国の利下げ観測は後退し、改めて円安米ドル高となりました。ユーロなどに対しても各中央銀行の金融政策の方向性の違いなどから円安ユーロ高となりました。

### ポートフォリオについて

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



## 【運用状況】

### ○組入株式上位10業種

#### 期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.6%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.7
3	資本財	6.5
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.2
5	銀行	6.2
6	エネルギー	5.6
7	メディア・娯楽	5.0
8	各種金融	4.8
9	半導体・半導体製造装置	4.8
10	ヘルスケア機器・サービス	4.6

#### 期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.5%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.0
3	半導体・半導体製造装置	7.7
4	資本財	6.7
5	金融サービス	6.6
6	メディア・娯楽	6.4
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.3
8	銀行	5.1
9	一般消費財・サービス流通・小売り	4.8
10	エネルギー	4.4



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で34.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.4%下回りました。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) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	1円 (1) (0) (0) (0)	0.002% (0.001) (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 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	10 (10) (0) (0)	0.015 (0.015) (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)	17 (12) (5)	0.024 (0.016) (0.007)	(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	29	0.041	
期中の平均基準価額は70,616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 (2023年2月16日から2024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	201,199.39 百株 (8,428.59)	千アメリカ・ドル 2,176,298 (△375)	116,394.14 百株	千アメリカ・ドル 1,154,025
	カ ナ ダ	24,189.81 百株 (387.18)	千カナダ・ドル 139,511 (-)	13,131.73 百株	千カナダ・ドル 71,369
	オーストラリア	35,636.27 百株 (△668.68)	千オーストラリア・ドル 95,709 (-)	18,254.35 百株	千オーストラリア・ドル 51,278
	香 港	49,114 百株 (-)	千香港・ドル 154,405 (-)	29,493 百株	千香港・ドル 76,166
	シンガポール	60,335 百株 (35,288.22)	千シンガポール・ドル 15,583 (△49)	12,378 百株	千シンガポール・ドル 7,120
	ニュージーランド	2,918.52 百株 (-)	千ニュージーランド・ドル 2,741 (-)	- 百株	- 千ニュージーランド・ドル
	イ ギ リ ス	147,852.82 百株 (△1,691.59)	千イギリス・ポンド 111,828 (△638)	80,572.83 百株	千イギリス・ポンド 55,647
	イスラエル	1,810.83 百株 (-)	千イスラエル・シケル 9,910 (-)	3,689.04 百株	千イスラエル・シケル 7,214

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ス イ ス	百株 9,308.82 (796.67)	千スイス・フラン 79,635 (△383)	百株 9,910.6	千スイス・フラン 42,987	
	デ ン マ ー ク	百株 3,613.64 (2,397.1)	千デンマーク・クローネ 204,868 (-)	百株 2,066.9	千デンマーク・クローネ 114,086	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 3,294.23 (-)	千ノルウェー・クローネ 51,942 (△40)	百株 1,342.07	千ノルウェー・クローネ 21,391	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 16,692.57 (546.4)	千スウェーデン・クローナ 288,680 (-)	百株 15,731.31	千スウェーデン・クローナ 219,117	
	ユ ー ロ	ア イ ル ラ ン ド	百株 1,955.04 (-)	千ユーロ 5,255 (-)	百株 1,811.3	千ユーロ 10,624
		オ ラ ン ダ	百株 11,847.24 (2,024.76)	千ユーロ 49,648 (△57)	百株 9,609.12	千ユーロ 29,076
		ベ ル ギ ー	百株 880.49 (112.17)	千ユーロ 5,791 (-)	百株 490.21	千ユーロ 2,703
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 1,091.52 (-)	千ユーロ 2,425 (-)	百株 1,827.65	千ユーロ 1,572
		フ ラ ン ス	百株 12,278.26 (129.1)	千ユーロ 91,329 (△81)	百株 7,834.61	千ユーロ 52,133
		ド イ ツ	百株 15,631.14 (-)	千ユーロ 68,716 (△464)	百株 10,234.72	千ユーロ 35,105
		ス イ ス	百株 383.65 (-)	千ユーロ 4,036 (△39)	百株 95.19	千ユーロ 737
		ポ ル ト ガ ル	百株 2,186.26 (-)	千ユーロ 1,421 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	百株 23,314.77 (17,297.92)	千ユーロ 20,669 (△4)	百株 30,997.66	千ユーロ 11,683
		イ タ リ ア	百株 33,079.8 (-)	千ユーロ 14,241 (△1)	百株 12,925.86	千ユーロ 7,258
口	フ ィ ン ラ ン ド	百株 10,192.13 (640.8)	千ユーロ 11,591 (-)	百株 2,298.9	千ユーロ 2,543	
	オ ー ス ト リ ア	百株 277.66 (-)	千ユーロ 1,178 (-)	百株 -	千ユーロ -	

(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 額		売 付 額	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	カナダ	証券	千カナダ・ドル	証券	千カナダ・ドル
		(2,968)	(-)	(-)	(-)

(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 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8.981	1,023	3.582	338
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	11.195	620	5.253	283
	(-)	(-)	(-)	(-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	38.286	711	17.066	274
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	50.042	5,776	25.541	2,751
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11.994	2,086	7.408	1,265
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	11.902	1,192	8.322	781
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	5.046	3,731	2.146	1,501
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INC	29.18	3,127	18.278	1,754
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4.621	1,015	3.073	660
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	19.452	1,146	11.402	687
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41.098	781	19.936	328
	(-)	(-)	(-)	(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	7.459	1,648	4.504	874
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	30.066	2,390	11.303	881
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	33.13	608	17.597	289
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	9.102	513	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22.334	1,508	15.53	1,032
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	40.57	664	21.932	343
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	11.957	1,754	7.998	1,156
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	61.574	3,413	8.304	409
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	12.938	788	10.342	607
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
UDR INC	18.219	625	9.286	322
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.263	1,305	3.256	342
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	9.624	2,632	5.407	1,424
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	12.875	1,666	9.06	1,158
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	30.71	1,365	18.045	750
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	39.178	1,222	14.307	429
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	21.499	3,052	3.575	386
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	13.283	1,584	3.934	461
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	-	-	72.327	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	30.077	5,546	16.904	2,911
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	24.66	1,518	15.328	825
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	47.041	794	89.412	1,345
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	18.257	637	9.439	317
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	19.821	636	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	11.157	547	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	-	2.199	26
	(2.199)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	32.109	994	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	754.156	1,632	486.626	1,108
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	130.224	498	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	110.515	470	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	83.445	1,701	42.152	851
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	656.486	1,689	478.229	1,197
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>香港</b>	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT DUMMY	87	4,495	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LINK REIT	60.6	2,397	-	-
	(-)	(1)	(-)	(-)
LINK REIT-RTS	-	-	52.503	209
	(52.503)	(△1)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>シンガポール</b>	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	-	-	-	-
	(-)	(△3)	(-)	(-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	628.1	1,689	457.7	1,188
	(-)	(△13)	(-)	(-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	-	-	-
	(-)	(△17)	(-)	(-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	-	-	24.589	25
	(24.589)	(26)	(-)	(-)
KEPPEL REIT	-	-	36.98	29
	(36.98)	(22)	(-)	(-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	-	-	-	-
	(-)	(△3)	(-)	(-)
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	-	-	119.111	385
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	235.62	1,460	191.367	1,133
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW	29.844	808	26.007	723
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	12.488	1,202	8.836	823
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	11.128	266	-	-
	(-)	(△21)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.942	255	-	-
	(13.535)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	-	-	-	-
	(△13.535)	(-)	(-)	(-)

(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 255,616	百万円 257,547	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	655,018,143千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,026,729,929千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.63

(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 (2023年2月16日から2024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		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	11,415.95	14,153.69	241,999	36,418,548	大規模小売り
ABBOTT LABORATORIES	2,180.54	2,650.14	29,697	4,469,172	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	795.05	1,091.22	1,761	265,047	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,124.58	1,390.28	25,521	3,840,710	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	2,016.32	2,466.44	44,075	6,632,889	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	584.05	694.37	41,985	6,318,439	ソフトウェア
CHUBB LTD	521.17	628.23	15,587	2,345,784	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	277.73	342.61	7,434	1,118,890	化学
ALLSTATE CORP	329.39	396.52	6,399	963,051	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	837.7	1,013.35	19,747	2,971,748	コンゴロマリット
AMGEN INC	666.76	815.06	23,642	3,557,951	バイオテクノロジー
HESS CORP	352.71	414.96	5,922	891,310	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	795.36	954.49	20,130	3,029,392	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	626.53	773.42	6,094	917,168	電力
AFLAC INC	726.73	847.3	6,686	1,006,310	保険
AMERICAN INTL GROUP	938.43	1,081.5	7,480	1,125,775	保険
ANALOG DEVICES	633.36	762.33	14,203	2,137,519	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	864.52	1,024.32	5,845	879,733	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	484.9	540.42	7,622	1,147,047	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	108.31	132.52	4,373	658,116	ソフトウェア
APPLE INC	20,001.34	23,826.92	438,772	66,030,908	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	1,068.03	1,280.53	23,842	3,588,010	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	139.61	169.36	1,937	291,545	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	694.12	815.04	4,341	653,385	食品
AMEREN CORP	316.21	406.44	2,788	419,654	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	99.36	-	-	-	電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	269.07	320.74	8,408	1,265,446	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	518.47	629.63	15,797	2,377,353	専門サービス
AUTOZONE INC	24.51	27.16	7,406	1,114,555	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	95.14	115.42	2,382	358,490	容器・包装
BALL CORP	402.23	462.88	2,869	431,884	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,619.51	1,993.18	79,464	11,958,552	金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	969.68	1,163.87	6,340	954,221	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	631.74	802.19	3,179	478,540	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	350.61	439.38	10,484	1,577,744	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	289.58	344.76	5,978	899,701	電気設備
VERIZON COMM INC	5,240.12	6,415.22	25,757	3,876,187	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	291.91	316.07	2,589	389,655	保険
BEST BUY CO INC	254.05	305.68	2,280	343,173	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	30.21	30.21	990	149,077	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	353.37	420.53	5,635	848,089	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	672.13	836.97	3,090	465,154	電力
BOEING CO	702.82	866.01	17,612	2,650,567	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INC	144.56	144.56	1,165	175,343	専門サービス
BORGWARNER INC	278	370.1	1,152	173,438	自動車用部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,753.52	2,219.59	14,638	2,202,902	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	144.94	172.33	1,272	191,496	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	195.29	260.64	4,058	610,791	娯楽



銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	期末		
			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	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	27.31	34.11	4,029	606,324	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,659.49	3,197.71	15,633	2,352,701	医薬品
ONEOK INC	569.8	867.02	5,991	901,732	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	97.09	97.09	1,194	179,701	保険
UNITED RENTALS INC	88.83	107.88	7,055	1,061,824	商社・流通業
SEMPRA	385.67	983.72	6,832	1,028,285	総合公益事業
FEDEX CORP	309.91	367.46	8,702	1,309,647	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	118.5	133.02	2,598	391,015	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	743.44	915.2	9,528	1,433,890	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	384.05	483.08	2,770	416,927	飲料
QUANTA SERVICES INC	175.6	232.71	4,948	744,676	建設・土木
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,017.65	1,017.65	489	73,663	メディア
CSX CORP	2,635.36	3,042.11	11,255	1,693,886	陸上運輸
COTERRA ENERGY INC	999.16	1,147.11	2,742	412,754	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	269.78	269.78	1,103	166,131	食品
CONSTELLATION BRANDS INC	193.43	246.29	5,999	902,883	飲料
CARDINAL HEALTH INC	344.21	382.98	3,965	596,806	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARLISLE COS INC	61.19	75.2	2,612	393,169	建設関連製品
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	1,322.91	1,484.08	2,266	341,038	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	658.5	779.69	24,693	3,716,134	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	126.31	146.08	2,414	363,366	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	970.73	-	-	-	各種電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	3,650.43	4,423.91	77,874	11,719,271	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	302.36	389.11	3,774	568,004	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	198.78	228.76	2,537	381,923	保険
CINTAS CORP	111.73	141.69	8,680	1,306,391	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	5,161.36	6,184.56	31,095	4,679,632	通信機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	693.71	835.13	1,631	245,450	金属・鉱業
CLOROX COMPANY	157.94	183.05	2,786	419,295	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	5,108.54	6,273.48	37,195	5,597,545	飲料
COPART INC	540.11	1,283.73	6,318	950,873	商業サービス・用品
COGNEX CORP	204.32	-	-	-	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	988.65	1,213.09	10,154	1,528,192	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	345.46	383.76	9,033	1,359,425	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	74.34	89.28	3,570	537,376	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	283.64	348.74	1,815	273,220	電力
COMCAST CORP-CL A	5,492.1	6,281.71	26,395	3,972,295	メディア
CONAGRA BRANDS INC	619.81	736.39	1,968	296,220	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	438.55	517.36	4,492	676,114	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	366.03	441.28	2,489	374,675	総合公益事業
COOPER COS INC	63.42	79.71	2,969	446,822	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	252.81	304.36	1,869	281,414	飲料
CORNING INC	957.58	1,265.61	4,018	604,715	電子装置・機器・部品
WOLFSPEED INC	156.84	-	-	-	半導体・半導体製造装置
SEALED AIR CORP	176.1	-	-	-	容器・包装
HEICO CORP-CL A	94.63	116.14	1,798	270,662	航空宇宙・防衛
MANHATTAN ASSOCIATES INC	-	94.42	2,349	353,526	ソフトウェア
CUMMINS INC	178.03	212.5	5,534	832,960	機械
DARLING INTERNATIONAL INC	200.32	238.06	995	149,822	食品
DR HORTON INC	406.02	457.84	6,661	1,002,499	家庭用耐久財
DANAHER CORP	861.23	1,070.45	26,546	3,994,921	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
MOODY'S CORP	206.82	245.21	8,986	1,352,371	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	629.06	759.97	5,832	877,659	情報技術サービス
TARGET CORP	577.14	711.89	10,324	1,553,740	生活必需品流通・小売り
DEERE & CO	362.03	413.61	15,914	2,395,031	機械
MORGAN STANLEY	1,604.05	1,898.13	15,944	2,399,456	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	270.24	335.74	6,001	903,093	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	500.52	619.75	5,101	767,767	不動産管理・開発
DECKERS OUTDOOR CORP	-	41.74	3,539	532,729	繊維・アパレル・贅沢品
THE WALT DISNEY CO	2,274.04	2,794.06	31,170	4,690,853	娯楽
DOLLAR TREE INC	281.49	317.56	4,442	668,480	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	178.42	225.99	3,635	547,174	機械
OMNICOM GROUP	265.7	305.86	2,623	394,881	メディア
DTE ENERGY CO	237.92	337	3,549	534,182	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	964.73	1,181.23	10,789	1,623,690	電力
DARDEN RESTAURANTS INC	156.76	177.01	2,852	429,275	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	676.67	842.27	3,552	534,645	大規模小売り
BANK OF AMERICA CORP	9,008.68	10,908.1	36,138	5,438,488	銀行
CITIGROUP INC	2,418.65	2,941.7	15,879	2,389,675	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	167.9	167.9	1,378	207,494	化学
EATON CORP PLC	496.76	611.13	16,843	2,534,848	電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	343.37	417.15	12,545	1,887,952	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	244.16	-	-	-	メディア
ECOLAB INC	325.5	381.51	8,277	1,245,699	化学
REVVITY INC	156.49	179.72	1,861	280,089	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	348.38	388.01	5,551	835,467	娯楽
SALESFORCE INC	1,248.76	1,483.57	42,897	6,455,633	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	33.72	33.72	1,186	178,531	保険
EMERSON ELECTRIC CO	738.89	879.6	9,344	1,406,309	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	175.67	245.32	2,771	417,101	ガス
ENTERGY CORP	260.97	307.36	3,014	453,665	電力
EOG RESOURCES INC	734.98	903.94	10,034	1,510,112	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	151.56	187.3	4,688	705,627	専門サービス
EQT CORP	409.96	597.29	1,968	296,264	石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	289.95	358.46	5,113	769,520	パーソナルケア用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	199.74	224.15	2,818	424,150	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	5,193.82	6,116.07	61,674	9,281,387	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	155.34	177.11	905	136,278	化学
NEXTERA ENERGY INC	2,449.25	3,099.21	17,358	2,612,307	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	47.16	60.19	2,779	418,280	資本市場
FAIR ISAAC CORP	29.62	37.75	4,884	735,030	ソフトウェア
ASSURANT INC	58.23	87.66	1,505	226,611	保険
FASTENAL CO	729.41	856.03	6,003	903,442	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	843.62	1,054.1	3,532	531,574	銀行
M&T BANK CORP	207.66	249.58	3,398	511,407	銀行
FIRST HORIZON CORP	696.34	-	-	-	銀行
FISERV INC	760.76	917.18	13,297	2,001,107	金融サービス
FORD MOTOR CO	4,943.79	5,859.08	7,359	1,107,456	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	379.16	474.77	1,270	191,266	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,801.8	2,146.28	7,984	1,201,536	金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	15.87	15.84	2,364	355,881	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	262.69	333.44	7,958	1,197,681	保険

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		
DENTSPLY SIRONA INC	255.99	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	287.25	346.34	9,320	1,402,568		航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	749.19	885.17	5,520	830,825		食品
GENUINE PARTS CO	173.74	207.69	2,991	450,200		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,563.88	1,900.11	13,878	2,088,560		バイオテクノロジー
GARTNER INC	95.64	119.88	5,392	811,580		情報技術サービス
MCKESSON CORP	179.8	208.54	10,452	1,572,925		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	3,102.42	3,764.94	278,229	41,870,692		半導体・半導体製造装置
GRACO INC	—	239.85	2,118	318,863		機械
GENERAL ELECTRIC CO	1,369.1	1,646.58	24,122	3,630,179		コンプロマリット
WW GRAINGER INC	54.66	67.77	6,400	963,165		商社・流通業
HALLIBURTON CO	1,115.7	1,392.51	4,762	716,691		エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	497.39	1,176.37	6,572	989,077		飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	424.3	503	19,015	2,861,629		資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	243.2	287.28	6,038	908,666		航空宇宙・防衛
HASBRO INC	154.37	163.59	861	129,715		レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	174.31	174.31	1,284	193,276		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	51.85	68.78	1,329	200,151		航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	186.95	225	4,303	647,577		食品
HP INC	1,259.55	1,341.36	3,833	576,919		コンピュータ・周辺機器
F5 INC	69.24	89.81	1,654	249,036		通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	153.22	181.25	1,331	200,399		容器・包装
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	76.15	1,632	245,732		バイオテクノロジー
JUNIPER NETWORKS INC	437.15	578.81	2,143	322,550		通信機器
HOLOGIC INC	306.95	383.99	2,808	422,709		ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	1,275.83	1,527.31	54,712	8,233,733		専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	228.8	296.68	2,551	384,012		バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	388.51	490.54	1,412	212,605		食品
CENTERPOINT ENERGY INC	787.91	977.76	2,674	402,436		総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	36.02	49.17	2,197	330,717		建設関連製品
HUBBELL INC	69.03	78.2	2,812	423,294		電気設備
HUMANA INC	158.44	186.41	6,753	1,016,326		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	103.48	122.76	2,670	401,923		陸上運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,814.91	2,153.85	2,739	412,297		銀行
BIOGEN INC	176.03	219.1	4,836	727,831		バイオテクノロジー
IDEX CORP	90.65	110.45	2,507	377,344		機械
ILLINOIS TOOL WORKS	387.9	464.63	11,807	1,776,862		機械
INTUIT INC	335.01	427.34	28,081	4,226,029		ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	101.62	125	7,007	1,054,483		ヘルスケア機器・用品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	292.93	351.54	9,590	1,443,253		建設関連製品
INTEL CORP	5,124.32	6,392.05	28,246	4,250,811		半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	319.79	409.93	3,254	489,698		化学
INTERNATIONAL PAPER CO	441.53	534.19	1,844	277,587		容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	456.79	540.63	1,714	258,072		メディア
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	95.06	118.57	2,078	312,726		金融サービス
JABIL CIRCUIT INC	—	195.86	2,767	416,540		電子装置・機器・部品
INCYTE CORP	244.49	316.54	1,832	275,765		バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	3,270.95	3,669.56	57,149	8,600,462		医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	394.02	456.59	4,175	628,442		保険
KLA CORPORATION	177.34	204.32	13,359	2,010,434		半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	783.84	969.85	4,057	610,666		石油・ガス・消耗燃料

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	
			株数	株数			
(アメリカ)	百株	百株					
KELLANOVA	329.41	424.51		2,291		344,912	食品
KEYCORP	1,189.55	1,440.72		1,996		300,504	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	421.73	529.32		6,267		943,143	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	188.14	227.27		17,849		2,686,214	資本市場
KROGER CO	827.75	1,033.85		4,723		710,863	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	172.6	200.26		18,337		2,759,656	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	58.9	74.46		3,183		479,068	電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	110.29	134.51		2,224		334,809	容器・包装
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	-	202.6		1,545		232,511	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES	200.36	233.13		2,676		402,761	情報技術サービス
PLUG POWER INC	561.49	-		-		-	電気設備
LENNAR CORP	323.61	376.67		5,795		872,213	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	1,006.41	1,230.21		93,165		14,020,405	医薬品
BATH & BODY WORKS INC	281.56	346.38		1,519		228,732	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	179.37	-		-		-	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	911.89	1,108.84		15,991		2,406,589	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	371.89	448.25		5,927		892,053	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	296.95	338.42		14,152		2,129,792	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	235.3	302.89		2,226		335,118	保険
LOWE'S COS INC	774.78	884.86		20,080		3,021,858	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	1,018.28	1,265.01		5,674		854,005	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	404.01	404.01		1,729		260,221	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	320.31	402.79		2,617		393,942	食品
MCDONALD'S CORPORATION	914.13	1,110.35		31,996		4,815,221	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	425.05	495.71		20,879		3,142,201	資本市場
EVEREST GROUP LTD	53.53	66.7		2,474		372,438	保険
MARKEL GROUP INC	16.74	20.13		2,957		445,004	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	776.95	915.1		7,873		1,184,886	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	621.47	756.06		14,948		2,249,647	保険
MASCO CORP	289.37	345.61		2,539		382,123	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	77.36	93.65		5,052		760,281	建設資材
METLIFE INC	847.99	974.05		6,657		1,001,907	保険
MEDTRONIC PLC	1,660.79	2,021.17		16,913		2,545,260	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	974.96	-		-		-	娯楽
CVS HEALTH CORP	1,636.16	1,973.56		15,079		2,269,384	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	3,156.72	3,864.48		48,622		7,317,258	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	543.62	652.5		5,328		801,956	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	114.55	128.76		2,937		442,010	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	8,819.04	10,756.09		440,451		66,283,490	ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,356.54	1,680.37		13,750		2,069,307	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	695.97	816.68		6,580		990,345	半導体・半導体製造装置
3M CO	693.96	825.77		7,631		1,148,504	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	63.11	-		-		-	家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	177.09	236.75		3,105		467,339	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	64.45	76.74		1,881		283,079	ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	205.78	248.47		7,935		1,194,271	通信機器
ILLUMINA INC	198.33	243.79		3,431		516,346	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	693.25	827.77		4,857		730,983	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	117.16	146.13		1,925		289,776	バイオテクノロジー
NETAPP INC	282.65	327.85		2,877		432,991	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	419.84	-		-		-	家庭用耐久財

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
NEWMONT CORP	992.87	1,736.08	5,576	839,175	金属・鉱業
NVR INC	4.05	4.83	3,623	545,275	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,574.85	1,877.2	19,960	3,003,820	繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	64.47	75.48	1,990	299,559	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	289.97	341.4	8,612	1,296,043	陸上運輸
EVERSOURCE ENERGY	430.42	518.61	2,959	445,328	電力
NISOURCE INC	532.7	645.43	1,638	246,517	総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	248.36	328.68	2,597	390,955	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	183.61	220.98	9,863	1,484,415	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	4,724.91	5,582.86	27,093	4,077,318	銀行
NUCOR CORP	316.6	374.96	6,789	1,021,680	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	285.54	364.22	5,666	852,811	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	466.54	576.3	7,786	1,171,773	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,147.44	997.74	5,717	860,358	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	116.3	148.54	6,404	963,738	陸上運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	77.57	90.84	9,531	1,434,446	専門小売り
ORACLE CORP	1,992.12	2,507.07	28,645	4,310,903	ソフトウェア
PACCAR INC	648.01	777.44	8,292	1,248,006	機械
PTC INC	136.65	180.85	3,268	491,931	ソフトウェア
EXELON CORP	1,216.64	1,571.97	5,363	807,162	電力
PARKER HANNIFIN CORP	161.01	192.11	10,026	1,508,874	機械
PAYCHEX INC	405.19	491.52	6,007	904,047	専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	96.51	114.52	3,467	521,762	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	887.37	1,136.87	2,961	445,683	電力
PEPSICO INC	1,714.95	2,105.84	35,277	5,308,840	飲料
PENTAIR PLC	198.04	255.45	1,915	288,243	機械
PFIZER INC	6,989.45	8,623.81	23,379	3,518,328	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	327.96	403.19	1,428	214,975	水道
CONOCOPHILLIPS	1,591.69	1,839.94	20,261	3,049,140	石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,782.57	3,061.39	5,005	753,258	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	284.45	362.19	8,161	1,228,292	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	2,244.42	2,710.33	10,949	1,647,825	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	510.1	598.05	8,843	1,330,838	銀行
BROWN & BROWN INC	306.5	369.07	3,033	456,549	保険
GARMIN LTD	199.11	232.81	2,859	430,341	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	283.41	357.48	5,008	753,698	化学
COSTCO WHOLESALE CORP	551.82	676.03	48,821	7,347,152	生活必需品流通・小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	277.07	342.93	3,647	548,897	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	145.36	165.74	2,116	318,561	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,967.79	3,594.41	55,939	8,418,380	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	731.78	898.08	16,879	2,540,182	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	601	742.43	4,363	656,627	総合公益事業
PULTE GROUP INC	290.5	339.5	3,524	530,430	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	336.53	400.68	5,568	838,026	金融サービス
QUALCOMM INC	1,401.58	1,702.86	26,213	3,944,918	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	234.37	291.41	3,400	511,735	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	233.86	260.45	1,617	243,362	バイオテクノロジー
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	-	87.47	2,577	387,858	金属・鉱業
REGENERON PHARMACEUTICALS	133.97	160.52	15,214	2,289,616	バイオテクノロジー
REPLIGEN CORP	67.3	85.76	1,766	265,915	ライフサイエンス・ツール/サービス
RESMED INC	186.28	228.99	4,134	622,188	ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
US BANCORP	1,766	2,292.27	9,283	1,397,103	銀行
SEAGEN INC	168.6	—	—	—	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	458.51	563.09	4,778	719,183	保険
ROSS STORES INC	441.71	508.78	7,351	1,106,306	専門小売り
ROLLINS INC	259.2	457.08	2,022	304,377	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	131.2	163.44	8,853	1,332,394	ソフトウェア
ROCKWELL AUTOMATION INC	146.33	173.27	4,850	729,928	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	274.77	374.64	4,369	657,554	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	164.67	192.58	2,082	313,404	化学
ACCENTURE PLC-CL A	788.43	956.12	35,470	5,337,901	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,686.45	2,088.47	14,913	2,244,372	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	132.32	162.17	4,462	671,526	保険
AXON ENTERPRISE INC	—	110.39	2,989	449,935	航空宇宙・防衛
THE TRAVELERS COMPANIES INC	295.95	348.35	7,545	1,135,591	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	750.43	893.54	5,597	842,312	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	49.56	54.52	20,381	3,067,176	ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,774.1	2,179.9	10,409	1,566,453	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,813.79	2,301.45	14,506	2,183,013	資本市場
POOL CORP	46.6	63.05	2,413	363,196	販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	261.44	321.14	3,912	588,832	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	186.42	—	—	—	食品
SEI INVESTMENTS CO	144.77	144.77	953	143,485	資本市場
ELEVANCE HEALTH INC	299.28	361.39	18,290	2,752,508	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENCORA INC	191.04	257.01	5,951	895,692	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	319.21	355.91	2,800	421,470	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	304.76	375	11,663	1,755,258	化学
CENTENE CORP	700.8	824.87	6,391	961,919	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	73.3	—	—	—	銀行
SMITH (A.O.) CORP	148.56	195.63	1,587	238,967	建設関連製品
SNAP-ON INC	70.68	82.04	2,158	324,877	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	467.76	543.92	5,787	870,932	保険
ADVANCE AUTO PARTS	71.65	—	—	—	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	485.33	576.12	3,746	563,812	電力
SOUTHERN CO	1,360.27	1,667.22	11,305	1,701,352	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,653.26	1,987.29	7,036	1,058,997	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	197	197	664	100,057	旅客航空輸送
AT&T INC	8,882.01	10,942.28	18,503	2,784,575	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	2,316.39	2,770.81	41,842	6,296,802	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	192.7	225.92	2,002	301,398	機械
STATE STREET CORP	461.98	504.16	3,604	542,477	資本市場
STARBUCKS CORP	1,428.19	1,751.61	16,477	2,479,683	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	229.37	229.37	2,746	413,317	金属・鉱業
STRYKER CORP	426.35	518.49	18,117	2,726,439	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	554.71	676.48	39,190	5,897,780	娯楽
GEN DIGITAL INC	730.86	925.83	1,973	297,047	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	203.18	274	1,619	243,735	陸上運輸
SYNOPSIS INC	187.79	233.14	13,119	1,974,351	ソフトウェア
SYSCO CORP	625.21	764.19	6,037	908,523	生活必需品流通・小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	446.32	534.63	20,410	3,071,506	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	55.32	69.85	1,739	261,815	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,347.81	1,692.5	2,229	335,445	医薬品

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
TERADYNE INC	185.12	220.66	2,241	337,284	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,137.01	1,389.08	21,929	3,300,156	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	258.24	298.41	2,575	387,643	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	487.95	588.51	32,266	4,855,746	ライフサイエンス・ツール/サービス
GLOBE LIFE INC	121.53	149.73	1,876	282,449	保険
TORO CO	-	146.44	1,394	209,931	機械
DAVITA INC	68.13	68.13	840	126,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	136.9	168.08	3,958	595,656	専門小売り
BIO-TECHNE CORP	206.52	259.34	1,818	273,664	ライフサイエンス・ツール/サービス
TRIMBLE INC	286.76	375.04	2,183	328,535	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	53	61.75	2,717	409,002	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	356.84	413.16	2,147	323,193	食品
UGI CORP	241.6	-	-	-	ガス
MARATHON OIL CORP	840.59	929.52	2,081	313,199	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	777.69	931.33	23,293	3,505,438	陸上運輸
RTX CORP	1,830.61	2,234.86	20,424	3,073,665	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,165.09	1,413.9	73,090	10,999,336	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	80.96	99.03	1,601	240,996	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VF CORP	378.87	517.62	890	133,982	繊維・アパレル・贅沢品
PARAMOUNT GLOBAL	786.63	813.26	1,072	161,429	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	321.4	394.11	16,469	2,478,430	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	164.52	200.95	4,844	729,109	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	917.06	1,071.24	2,307	347,248	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	1,878.96	2,261.8	38,133	5,738,777	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	505.78	621.22	12,372	1,861,895	商業サービス・用品
WATERS CORP	75.11	87.86	2,789	419,826	ライフサイエンス・ツール/サービス
WATSCO INC	-	48.89	1,895	285,292	商社・流通業
WEBSTER FINANCIAL CORP	222.85	-	-	-	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	96.41	114.64	4,679	704,216	ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	126.79	156.04	1,954	294,117	食品
VAIL RESORTS INC	52.35	65.23	1,462	220,085	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	407.23	494.51	2,773	417,340	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	202.73	284	3,836	577,363	機械
WHIRLPOOL CORP	68.32	-	-	-	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	188.33	253.19	2,679	403,239	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	127.57	153.79	1,618	243,496	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	145.96	529.69	2,956	444,878	資本市場
CME GROUP INC	443.42	541.32	11,648	1,752,926	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,518.9	1,807.81	5,974	899,149	石油・ガス・消耗燃料
DICK'S SPORTING GOODS INC	-	85.51	1,427	214,812	専門小売り
LKQ CORP	315.04	438.82	2,143	322,595	販売
ALLIANT ENERGY CORP	339.66	405.24	1,930	290,469	電力
WEC ENERGY GROUP INC	383.18	478.82	3,670	552,321	総合公益事業
CARMAX INC	186.73	224.14	1,630	245,425	専門小売り
TJX COMPANIES INC	1,452.28	1,724.69	16,758	2,522,033	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	67.3	77.85	1,969	296,358	電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,560.49	1,560.49	497	74,913	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	173.28	235.28	989	148,852	コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	150.92	192.71	3,163	476,050	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	79.96	-	-	-	銀行
CBRE GROUP INC	410.89	485.77	4,220	635,196	不動産管理・開発

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
LIBERTY GLOBAL PLC	157.79	—	—	—	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	1,172.22	1,525.88	2,790	419,992	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	41.15	51.37	2,180	328,151	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	53.87	71.27	5,310	799,237	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	41.87	60.3	851	128,123	化学
T-MOBILE US INC	784.34	806.97	13,026	1,960,299	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	429.72	594.74	3,240	487,609	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	425.61	485.02	1,433	215,687	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	48.71	61.26	1,324	199,324	資本市場
CELANESE CORP	138.41	162.73	2,410	362,808	化学
DEXCOM INC	487.1	585.53	6,836	1,028,759	ヘルスケア機器・用品
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	195.54	3,651	549,486	建設関連製品
EXPEDIA GROUP INC	191.86	219.78	2,963	445,913	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	240.27	309.69	2,402	361,563	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	131.23	155.36	6,080	915,004	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	360.34	—	—	—	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	698.96	873.85	11,942	1,797,156	資本市場
LIVE NATION	204.44	235.97	2,109	317,469	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	34.74	42.26	11,072	1,666,364	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	61.48	84.96	9,746	1,466,678	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	1,074.66	1,282.61	59,665	8,979,096	金融サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	—	236.23	1,477	222,402	飲料
WESTERN UNION CO	467.12	—	—	—	金融サービス
OWENS CORNING	132.27	132.27	1,891	284,705	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	151.08	206.79	2,512	378,105	専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	178.61	300.64	2,316	348,644	商社・流通業
FIRST SOLAR INC	119.03	155.79	2,465	370,991	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	153	183.98	3,614	543,969	専門サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	72.63	6,395	962,448	コンピュータ・周辺機器
AECOM TECHNOLOGY CORP	—	210.94	1,895	285,191	建設・土木
DELTA AIR LINES INC	215.92	215.92	881	132,704	旅客航空輸送
INSULET CORP	88.34	101.58	1,917	288,599	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	332.36	391.88	4,275	643,465	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	387.62	470.54	6,719	1,011,189	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	56.88	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	145.47	172.55	7,949	1,196,327	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	266.9	—	—	—	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	57.15	69.13	12,072	1,816,813	大規模小売り
ULTA BEAUTY INC	60.73	72.63	3,824	575,567	専門小売り
INVESCO LTD	385.3	—	—	—	資本市場
MSCI INC	98.07	119.48	6,843	1,029,925	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,930.16	2,367.46	21,122	3,178,721	タバコ
VISA INC	2,035.26	2,448.21	67,952	10,226,174	金融サービス
KEURIG DR PEPPER INC	928.16	1,607.6	4,999	752,395	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	228.09	317.51	3,825	575,678	水道
MARATHON PETROLEUM CORP	631.37	615.28	10,452	1,572,978	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	161.82	214.3	1,704	256,516	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	2,578.77	2,983.12	4,943	743,876	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	228.48	368.91	4,580	689,302	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	333.42	404.21	3,825	575,690	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	47.13	64.81	1,816	273,393	航空宇宙・防衛



銘柄	期首(前期末)		当期		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	
SPLUNK INC	208.98	247.88	3,829	576,338	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	70.9	81.62	2,270	341,639	情報技術サービス
HCA HEALTHCARE INC	287.52	307.02	9,377	1,411,191	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	189.74	216.63	5,332	802,432	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	77.92	107.06	1,308	196,946	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88.44	102.95	2,804	421,996	金融サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	224.34	-	-	-	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	321.09	389.38	9,109	1,370,954	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	163.43	192.42	2,792	420,257	専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	258.3	332.63	2,938	442,207	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	69.11	93.98	1,267	190,775	自動車用部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	127.09	156.08	2,883	433,973	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	310.59	342.95	2,162	325,507	専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	278.99	334.44	4,414	664,354	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	811.66	1,005.99	7,130	1,073,062	ソフトウェア
HYATT HOTELS CORP	-	66.47	857	129,109	ホテル・レストラン・レジャー
HORIZON PHARMA PLC	276.13	-	-	-	バイオテクノロジー
TESLA INC	3,319.53	4,357.58	82,231	12,375,077	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	69.14	-	-	-	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	170.46	215.39	2,834	426,633	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,712.1	2,080.56	7,983	1,201,378	自動車
ALLY FINANCIAL INC	392.3	392.3	1,413	212,770	消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	96.61	118.95	3,033	456,470	資本市場
APTIV PLC	343.1	430.97	3,410	513,275	自動車用部品
PHILLIPS 66	594.04	683.58	9,926	1,493,803	石油・ガス・消耗燃料
META PLATFORMS INC	2,845.33	3,387.66	160,331	24,128,238	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	225.14	278.48	6,780	1,020,345	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	200.87	248.5	4,221	635,221	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	253.33	311.78	24,692	3,716,045	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	369.42	468.54	17,257	2,597,116	ソフトウェア
WORKDAY INC	255.47	310.6	9,387	1,412,736	ソフトウェア
ABBVIE INC	2,201.98	2,688.95	46,900	7,058,081	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	587.56	702.24	12,926	1,945,359	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	542.11	542.11	1,410	212,195	メディア
CDW CORP	164.65	202.62	4,852	730,229	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	475.9	631.1	3,999	601,946	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	210.9	257.1	1,858	279,619	情報技術サービス
SNAP INC	1,273.18	1,522.5	1,735	261,197	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	532.3	668.55	4,967	747,633	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	224.66	-	-	-	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	88.45	-	-	-	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	198.71	-	-	-	メディア
OKTA INC	178.28	218.31	1,912	287,796	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	176.53	-	-	-	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	1,262.92	1,521.6	4,389	660,623	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	181.67	217.85	2,240	337,185	食品
CNH INDUSTRIAL NV	-	1,619.62	2,032	305,889	機械
BROADCOM INC	502.59	676.79	85,425	12,855,726	半導体・半導体製造装置
ARES MANAGEMENT CORP	195.34	231.61	3,166	476,502	資本市場
MONGODB INC	90.21	109.06	5,305	798,481	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	84.53	105.65	2,062	310,369	専門小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	613.21	—	—	—	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	168.56	232.73	5,135	772,864	ヘルスケア・テクノロジー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	242.12	—	—	—	電気設備
EVERGY INC	282.26	331.92	1,632	245,707	電力
ALLEGION PLC	101.4	134.23	1,760	264,987	建設関連製品
DAYFORCE INC	183.14	220.02	1,590	239,391	専門サービス
STERIS PLC	125.24	155.4	3,537	532,292	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	263.62	319.74	1,633	245,833	ソフトウェア
WIX.COM LTD	58.55	89.97	1,166	175,473	情報技術サービス
DROPBOX INC	304.79	418.01	1,354	203,879	ソフトウェア
KKR & CO INC	674.3	903.73	8,671	1,304,942	資本市場
FUTU HOLDINGS LTD ADR	50.5	50.5	252	37,975	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	279.21	338.57	2,171	326,802	ソフトウェア
MODERNA INC	416.26	500.06	4,298	646,808	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	344.09	402.32	7,752	1,166,704	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	311.33	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA GROUP	382.14	451.63	15,292	2,301,389	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	327.7	386.69	3,327	500,692	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	876.67	1,060.37	5,681	855,003	化学
OVINTIV INC	316.03	391.6	1,660	249,871	石油・ガス・消耗燃料
AMCOR PLC	1,887.89	2,233.48	1,998	300,824	容器・包装
PINTEREST INC	697.46	909.36	3,257	490,195	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FOX CORP-A	365.01	365.01	1,104	166,164	メディア
FOX CORP-B	155.11	275.07	763	114,830	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	425.86	—	—	—	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	257.23	338.13	11,312	1,702,363	ソフトウェア
CHEWY INC	96.48	—	—	—	専門小売り
AVANTOR INC	782.14	971.57	2,370	356,756	ライフサイエンス・ツール/サービス
DYNATRACE INC	254.29	393.62	2,076	312,528	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	297.7	432.84	4,517	679,846	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	138	169.18	1,734	261,091	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	1,018.98	1,243.79	6,840	1,029,478	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	528.55	626	5,685	855,679	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	1,815.6	2,811.19	22,250	3,348,488	陸上運輸
CORTEVA INC	905.9	1,080.01	5,840	878,966	化学
MATCH GROUP INC	352.59	447.64	1,627	244,873	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FERGUSON PLC	257.02	308.68	5,974	899,102	商社・流通業
BILL HOLDINGS INC	119.88	162.43	1,051	158,299	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	880.26	1,085.46	13,888	2,090,074	資本市場
PAYLOCITY HOLDING CORP	53.22	58.09	999	150,361	専門サービス
CARLYLE GROUP INC	245.3	348.47	1,534	230,898	資本市場
DATADOG INC	291.79	386.35	5,260	791,600	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	256.89	308.9	2,681	403,548	コンピュータ・周辺機器
VERTIV HOLDINGS CO	—	532.34	3,458	520,486	電気設備
INGERSOLL RAND INC	514.79	619.76	5,360	806,672	機械
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	441.35	623.73	5,187	780,676	ヘルスケア機器・用品
PAYCOM SOFTWARE INC	63.41	89.41	1,692	254,641	専門サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	383.42	934.26	1,451	218,487	自動車
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	92.67	—	—	—	海上運輸
DRAFTKINGS INC	—	639	2,803	421,963	ホテル・レストラン・レジャー
UNITY SOFTWARE INC	308.39	409.67	1,430	215,224	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
AON PLC	263.41	313.09	9,657	1,453,415	保険
WARNER BROS DISCOVERY INC	2,917.78	3,514.21	3,419	514,574	娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	7.36	9.06	1,301	195,882	石油・ガス・消耗燃料
BENTLEY SYSTEMS INC	225.66	336.34	1,734	260,975	ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	130.94	263.05	4,218	634,886	資本市場
UIPATH INC	-	534.39	1,389	209,173	ソフトウェア
AFFIRM HOLDINGS INC	185.28	-	-	-	金融サービス
AIRBNB INC	471.77	644.56	9,552	1,437,537	ホテル・レストラン・レジャー
CONSTELLATION ENERGY CORP	412.24	482.14	6,203	933,594	電力
MONDAY.COM LTD	-	43.08	947	142,595	ソフトウェア
ROYALTY PHARMA PLC	417.75	621.73	1,821	274,142	医薬品
ROBLOX CORP	450.19	664.77	2,934	441,582	娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	296.56	-	-	-	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,508.26	1,841.48	2,222	334,489	医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	264.44	346.04	1,478	222,518	ホテル・レストラン・レジャー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	126.87	158.46	1,201	180,876	石油・ガス・消耗燃料
HF SINCLAIR CORP	202.99	255.6	1,521	228,945	石油・ガス・消耗燃料
SNOWFLAKE INC	285.82	426.08	10,055	1,513,250	情報技術サービス
DOORDASH INC	295.75	393.76	4,725	711,142	ホテル・レストラン・レジャー
ARISTA NETWORKS INC	293.67	392.38	10,424	1,568,761	通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	504.82	595.48	6,703	1,008,782	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	-	158.93	650	97,893	大規模小売り
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	2,028.24	2,731.08	6,879	1,035,309	ソフトウェア
FNF GROUP	310.04	389.07	2,023	304,524	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	166.15	187.23	2,701	406,555	専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,079.89	1,291.01	8,902	1,339,783	半導体・半導体製造装置
APA CORP	409.46	491.46	1,464	220,400	石油・ガス・消耗燃料
CONFLUENT INC	-	275.24	932	140,375	ソフトウェア
LINDE PLC	-	744.54	31,151	4,687,997	化学
ROBINHOOD MARKETS INC	-	735.66	984	148,129	資本市場
LUCID GROUP INC	449.1	1,439.27	496	74,725	自動車
U-HAUL HOLDING CO	119.81	119.81	762	114,816	陸上運輸
ASPEN TECHNOLOGY INC	37.21	37.21	671	101,002	ソフトウェア
TOAST INC	326.2	453.99	914	137,666	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD	1,683.28	2,795.15	953	143,438	陸上運輸
CATALENT INC	205.64	273.57	1,557	234,419	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	611.18	687.01	2,702	406,625	消費者金融
VERALTO CORP	-	370.86	3,123	470,037	商業サービス・用品
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	-	198.71	596	89,711	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE	-	281.91	1,882	283,354	娯楽
BUNGE GLOBAL SA	-	217.15	1,943	292,541	食品
KENVUE INC	-	2,640.38	5,040	758,542	パーソナルケア用品
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	633.78	730.13	2,286	344,025	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	52.37	67.99	1,792	269,823	ソフトウェア
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	222.09	277.13	4,292	645,973	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	58.02	73.6	4,634	697,393	ソフトウェア
QORVO INC	141.44	141.44	1,606	241,779	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	153.35	184.44	1,099	165,483	メディア
LIBERTY GLOBAL LTD	-	360.34	707	106,502	各種電気通信サービス
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	67.28	-	-	-	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	197.13	197.13	2,199	330,984	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(アメリカ)</b>	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ETSY INC	156.14	185.58	1,413	212,782	大規模小売り	
TRANSUNION	257.08	312.62	2,423	364,749	専門サービス	
ALCOA CORP	239.41	—	—	—	金属・鉱業	
ALBERTSONS COS INC	—	540.86	1,147	172,636	生活必需品流通・小売り	
BLOCK INC	669.1	843.06	5,683	855,244	金融サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	602.66	682.35	4,616	694,676	化学	
COCA-COLA EURO PACIFIC PARTNERS PLC	262.21	310.12	2,052	308,815	飲料	
WESTROCK CO	342.86	342.86	1,461	219,906	容器・包装	
KRAFT HEINZ CO	921.06	1,294.47	4,421	665,453	食品	
NOVOCURE LTD	123.17	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
FORTIVE CORP	426.08	553.7	4,627	696,441	機械	
WASTE CONNECTIONS INC	310.39	388.48	6,375	959,484	商業サービス・用品	
ALPHABET INC-CL A	7,443.29	9,072.3	132,401	19,925,048	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,563.84	1,867.11	2,843	427,934	コンピュータ・周辺機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,375.3	1,585.07	9,331	1,404,268	金融サービス	
SEA LTD ADR	439.08	580.7	2,479	373,065	娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	449.24	563.29	1,903	286,436	金融サービス	
ZILLOW GROUP INC-C	163.21	223.74	1,299	195,491	不動産管理・開発	
ALPHABET INC-CL C	6,916.6	7,929.18	116,669	17,557,661	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
ZSCALER INC	103.1	140.51	3,558	535,548	ソフトウェア	
ATLASSIAN CORP PLC	—	237.13	5,119	770,418	ソフトウェア	
LINDE PLC	620.82	—	—	—	化学	
ROKU INC	156.6	193.31	1,763	265,428	娯楽	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	140.85	150.49	4,323	650,609	メディア	
VISTRA CORP	496.33	496.33	2,197	330,664	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>	423,708.49 601銘柄	516,942.33 588銘柄	6,597,442 —	992,849,171 <73.0%>	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES LTD	570.3	752.91	4,618	513,283	金属・鉱業	
BARRICK GOLD CORP	2,148.35	2,674.95	5,093	566,047	金属・鉱業	
BANK OF MONTREAL	825.85	1,097.27	13,755	1,528,772	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	1,494.35	1,836.39	11,639	1,293,562	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	409.67	517.06	5,290	587,935	銀行	
BCE INC	76.97	141.97	711	79,113	各種電気通信サービス	
BROOKFIELD CORP	1,771.31	2,110.45	11,335	1,259,797	資本市場	
SAPUTO INC	345.82	345.82	961	106,886	食品	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	923.11	923.11	734	81,665	総合公益事業	
DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	115.08	115.08	1,367	151,983	ソフトウェア	
CGI INC	279.18	310.91	4,781	531,448	情報技術サービス	
CCL INDUSTRIES INC	210.58	210.58	1,212	134,712	容器・包装	
CAE INC	408.08	408.08	1,044	116,106	航空宇宙・防衛	
CAMECO CORP	542.64	660.84	3,782	420,403	石油・ガス・消耗燃料	
ROGERS COMM-CL B	456.07	533.75	3,255	361,857	無線通信サービス	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,145.14	1,430.11	8,699	966,846	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,407.03	1,643.44	13,377	1,486,786	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	61.24	89.11	1,255	139,523	大規模小売り	
CANADIAN UTILITIES LTD	163.3	163.3	488	54,247	総合公益事業	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	732.33	836.93	14,606	1,623,415	陸上運輸	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	217.13	301.42	1,402	155,841	繊維・アパレル・贅沢品	
OPEN TEXT CORP	332.17	404.59	2,207	245,335	ソフトウェア	
EMPIRE CO LTD	294.33	206.08	693	77,093	生活必需品流通・小売り	

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
KINROSS GOLD CORP	2,199.14	1,927.37	1,302	144,804	金属・鉱業
RB GLOBAL INC	132.86	266.41	2,478	275,509	商業サービス・用品
FORTIS INC	604.84	720.78	3,792	421,525	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	742.03	854.21	1,000	111,171	金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	746	82,935	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	342.08	435.51	1,809	201,112	保険
IMPERIAL OIL LTD	272.46	274.34	2,191	243,555	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	2,517.28	3,261.9	14,724	1,636,449	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	124.78	124.78	447	49,703	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,338.61	2,713.63	8,322	924,985	保険
LOBLAW CO LTD	216	248.03	3,371	374,732	生活必需品流通・小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,012.1	1,162.51	9,798	1,089,038	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	358.44	422.79	3,100	344,569	自動車用部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	758.84	903.24	6,433	715,050	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	27.99	31.33	4,242	471,565	保険
METRO INC	286.29	350.59	2,454	272,829	生活必需品流通・小売り
EMERA INC	369.98	446.43	2,090	232,303	電力
ONEX CORP	101.57	101.57	1,045	116,248	資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	193.23	553.73	929	103,266	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	655	898.64	3,413	379,324	保険
QUEBECOR INC-B	171.95	305.98	963	107,052	各種電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,719.47	2,135.23	27,982	3,109,940	銀行
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	1,163.63	1,440.17	16,527	1,836,854	陸上運輸
SHAW COMM INC-B	598.77	—	—	—	メディア
STANTEC INC	—	183.58	2,048	227,677	建設・土木
SUNCOR ENERGY INC	1,718.98	1,984.39	8,473	941,727	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	687.62	1,196.6	1,315	146,156	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	573.26	658.96	3,362	373,654	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	199.79	248.37	5,279	586,747	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	96.65	130.97	1,620	180,057	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) CS	2,251.61	2,795.45	22,215	2,469,024	銀行
TC ENERGY CORP	1,237.53	1,571.54	7,989	887,976	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	81.02	81.02	863	95,943	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	98.39	98.39	1,685	187,361	生活必需品流通・小売り
INTACT FINANCIAL CORP	215.66	267.58	5,979	664,544	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	585.39	738.65	4,324	480,657	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	25.3	30.41	11,310	1,257,070	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	231.63	294.2	4,236	470,842	金属・鉱業
TOURMALINE OIL CORP	392.98	490.85	2,650	294,532	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	245.71	399.97	1,275	141,759	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	156.65	241.29	1,094	121,668	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	338.33	472.49	1,289	143,306	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	681.79	821.64	3,725	414,031	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	362.04	415.08	4,268	474,375	大規模小売り
MEG ENERGY CORP	—	471.81	1,165	129,519	石油・ガス・消耗燃料
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,677.15	2,267.67	4,982	553,707	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	749.61	963.01	2,058	228,827	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	341.52	341.52	813	90,450	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	512.43	512.43	1,154	128,311	商業サービス・用品
TMX GROUP LTD	70.4	468.84	1,622	180,341	資本市場
BRP INC	43.07	43.07	382	42,516	レジャー用品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IVANHOE MINES LTD	640.27	988.2	1,401	155,736	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	661.77	773.39	5,116	568,675	化学
TFI INTERNATIONAL INC	93.99	115.91	2,275	252,942	陸上運輸
WSP GLOBAL INC	156.81	203.94	4,147	460,956	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	120.11	164.48	1,515	168,471	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	275.77	356.67	1,735	192,929	商業サービス・用品
NUVEI CORP	79.29	-	-	-	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	161.03	161.03	549	61,046	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	425.01	522.49	2,844	316,130	資本市場
AIR CANADA	188.14	418.58	794	88,296	旅客航空輸送
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	353.84	451.13	4,676	519,786	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	1,468.23	1,842.48	20,132	2,237,557	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	52.37	52.37	1,172	130,359	不動産管理・開発
HYDRO ONE LTD	462.25	462.25	1,856	206,319	電力
小計	株数 : 50,869.66 銘柄数 <比率> : 86	株数 : 62,314.92 銘柄数 : 86	386,892	42,999,195	<3.2%>
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	217.54	283.06	1,456	142,126	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPAC BANKING CORPORATION	4,377.12	5,201.9	12,546	1,224,710	銀行
FORTESCUE LTD	2,101.04	2,530.9	7,008	684,056	金属・鉱業
TELSTRA GROUP LTD	4,828.55	5,998.53	2,393	233,621	各種電気通信サービス
ASX LTD	236.64	312.15	2,084	203,471	資本市場
BHP GROUP LTD	6,313	7,757.07	35,643	3,479,185	金属・鉱業
AMPOL LTD	318.28	318.28	1,167	113,985	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	720.81	916.24	2,408	235,122	専門サービス
CSL LIMITED	601.03	736.93	20,648	2,015,455	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	61.34	93.17	1,693	165,334	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	3,796.33	4,762.58	6,077	593,181	運送インフラ
COCHLEAR LTD	78.36	104.46	3,437	335,530	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,132.29	2,576.92	2,208	215,563	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,112.29	2,556.04	29,156	2,845,990	銀行
RIO TINTO LIMITED	459.36	569.91	7,309	713,496	金属・鉱業
APA GROUP	1,643	2,228.29	1,793	175,090	ガス
ARISTOCRAT LEISU	766.75	868.29	3,794	370,374	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,816.64	3,600.82	2,279	222,484	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	607.67	693.36	3,842	375,076	建設資材
IGO LTD	919.47	919.47	639	62,375	金属・鉱業
ORICA LTD	638.62	638.62	1,037	101,233	化学
LEND LEASE CORP LTD	1,071.81	-	-	-	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	503.25	765.87	1,659	161,997	金属・鉱業
MACQUARIE GROUP LTD	466.42	567.01	10,541	1,028,989	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,541.62	1,996.28	2,882	281,373	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,928.66	4,650.95	15,120	1,475,886	銀行
NEWCREST MINING LTD	1,128.15	-	-	-	金属・鉱業
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,126.59	1,126.59	643	62,790	旅客航空輸送
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,724.87	2,198.07	3,618	353,155	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,355.78	1,626.29	2,093	204,301	金属・鉱業
REECE LTD	315.58	315.58	728	71,125	商社・流通業
SANTOS LTD	4,173.58	4,788.09	3,538	345,383	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	527.74	648.97	2,086	203,657	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	259.85	394.2	1,323	129,170	金融サービス

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	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
WESFARMERS LTD	1,397.2	1,728.24	10,186	994,279	大規模小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	2,354.31	2,821.53	8,797	858,726	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,543.2	1,838.4	6,522	636,675	生活必需品流通・小売り
SEEK LTD	384.05	585.13	1,420	138,674	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MINERAL RESOURCES LTD	211.79	288.65	1,640	160,147	金属・鉱業
BRAMBLES LTD	1,709.29	2,207.67	3,311	323,236	商業サービス・用品
PILBARA MINERALS LTD	3,279.47	4,044.96	1,415	138,189	金属・鉱業
CAR GROUP LTD	-	583.1	1,945	189,929	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AURIZON HOLDINGS LTD	2,228.49	2,228.49	878	85,704	陸上運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	792.33	1,349.1	1,493	145,776	飲料
XERO LTD	188.6	231.49	2,582	252,123	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD	237.81	449.23	984	96,117	各種消費者サービス
LOTTERY CORP LTD	2,912.7	2,912.7	1,433	139,879	ホテル・レストラン・レジャー
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,604.7	2,336.4	1,259	122,922	生活必需品流通・小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	3,743.53	4,434.5	12,332	1,203,760	銀行
MEDIBANK PVT LTD	2,985.76	4,127.51	1,560	152,291	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	5,966.94	6,827.38	2,102	205,257	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,716.84	1,975.89	3,161	308,586	生活必需品流通・小売り
WISETECH GLOBAL LTD	148.23	273.25	2,049	200,012	ソフトウェア
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	87,275.27 52銘柄	103,988.51 51銘柄	257,940 -	25,177,588 <1.8%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,570	2,570	2,109	40,616	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS LTD	1,972.96	2,417.96	15,583	299,987	電力
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	933.14	933.14	4,185	80,563	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,518.91	1,834.91	44,698	860,444	資本市場
MTR CORP	1,924.41	2,074.41	5,217	100,429	陸上運輸
HANG SENG BANK LTD	950.96	1,220.96	9,889	190,378	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,709.72	2,979.72	6,227	119,881	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,513.2	2,128.2	9,683	186,403	電力
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	-	2,020	5,181	99,740	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	15,364.06	15,364.06	8,742	168,286	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,609.04	3,369.04	14,941	287,627	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,199.95	6,804.95	12,997	250,200	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,730.66	1,730.66	1,623	31,249	不動産管理・開発
SINO LAND CO	4,112	6,592	5,247	101,009	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,805.65	2,045.65	14,605	281,164	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	530.2	530.2	3,234	62,258	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,801.56	2,151.56	18,202	350,392	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,780	1,780	1,178	22,683	建設関連製品
AIA GROUP LTD	14,933.16	17,785.16	111,512	2,146,624	保険
HKT TRUST / HKT LTD	4,631.36	7,971.36	7,413	142,707	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	3,358	3,358	7,790	149,968	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	1,400	1,400	1,867	35,951	海上運輸
SWIRE PROPERTIES LTD	2,016	2,016	3,003	57,823	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,961.35	2,561.35	6,262	120,553	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD	2,164	4,652	4,377	84,267	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,465	-	-	-	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	2,650	2,650	3,418	65,806	飲料
WH GROUP LTD	9,315	10,010	4,594	88,445	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,104.45	3,694.45	15,202	292,651	コンプロマリット

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		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,661.95	2,661.95	9,396	180,886	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	97,686.69	117,307.69	358,389	6,899,003	
		29銘柄	29銘柄	-	<0.5%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE TECH ENG	1,442	1,718	657	73,465	航空宇宙・防衛	
SEMBCORP INDUSTRIES	-	1,622	901	100,689	総合公益事業	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	2,248.1	2,687.1	8,751	977,147	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	394	1,010	594	66,419	不動産管理・開発	
SEATRIM LTD	-	72,352.22	622	69,471	機械	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	155	155	414	46,327	コングロマリット	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	998	1,399	1,280	142,921	資本市場	
GENTING SINGAPORE LTD	7,611.93	7,611.93	776	86,686	ホテル・レストラン・レジャー	
KEPPEL LTD	1,849	2,496	1,789	199,812	コングロマリット	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,981.98	5,020.98	6,502	725,967	銀行	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	9,433.3	13,408.3	3,150	351,803	各種電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,627	2,440	1,742	194,512	旅客航空輸送	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,399.66	1,915.66	5,425	605,717	銀行	
UOL GROUP LIMITED	436	436	257	28,720	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	438	-	-	-	電子装置・機器・部品	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,585	2,585	814	90,913	食品	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	3,065.9	4,052.9	1,146	128,059	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	37,664.87	120,910.09	34,828	3,888,636	
		15銘柄	16銘柄	-	<0.3%>	
(ニューージーランド)	百株	百株	千ニューージーランド・ドル	千円		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,643.41	2,297.26	1,872	171,593	運送インフラ	
EBOS GROUP LTD	-	256.31	946	86,704	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FISHER & PAYKEL	784.6	784.6	1,867	171,142	ヘルスケア機器・用品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,190.38	3,127.23	1,601	146,744	各種電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER LTD	628.34	628.34	425	38,986	電力	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,321.57	2,393.08	1,354	124,138	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 >	6,568.3	9,486.82	8,066	739,309	
		5銘柄	6銘柄	-	<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
ANTOFAGASTA PLC	459.63	612.95	1,027	194,393	金属・鉱業	
ASHTAD GROUP	543.04	668.51	3,456	653,808	商社・流通業	
SEVERN TRENT PLC	293.97	455.48	1,137	215,149	水道	
BARCLAYS PLC	20,224.17	22,290.23	3,165	598,763	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,241.96	1,241.96	588	111,268	家庭用耐久財	
BT GROUP PLC	9,041.98	9,041.98	947	179,257	各種電気通信サービス	
BUNZL PLC	385.93	539.79	1,720	325,533	商社・流通業	
CRH PLC	-	1,085.93	6,387	1,208,312	建設資材	
AVIVA PLC	3,486.83	4,292.05	1,826	345,474	保険	
CRODA INTERNATIONAL	167.82	205.73	1,000	189,335	化学	
DIAGEO PLC	2,829.74	3,468.58	9,949	1,882,169	飲料	
SCHRODERS PLC	1,103.66	1,103.66	439	83,198	資本市場	
DCC PLC	111.35	174.71	981	185,740	コングロマリット	
NATIONAL GRID PLC	4,605.69	5,474.62	5,485	1,037,705	総合公益事業	
KINGFISHER PLC	2,253.92	3,360.26	734	138,891	専門小売り	
BAE SYSTEMS PLC	3,796.23	4,573.88	5,625	1,064,246	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,628.77	3,256.71	7,812	1,477,956	タバコ	
HALMA PLC	510.66	622.08	1,362	257,716	電子装置・機器・部品	



銘柄	期首(前期末)		当期		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	
NEXT PLC	187.51	185.88	1,542	291,711	大規模小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	1,078.89	1,261.79	2,387	451,606	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	199.76	—	—	—	化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,574.26	1,931.17	3,374	638,286	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	2,209.35	2,590.74	5,663	1,071,337	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	24,887.38	29,731	18,454	3,490,949	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	7,381.79	8,563.99	2,014	381,035	保険
CENTRICA PLC	—	7,937.76	1,066	201,813	総合公益事業
UNILEVER PLC	3,166.86	3,824.37	15,243	2,883,695	パーソナルケア用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	905.69	1,151.34	1,177	222,808	水道
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	423.51	550.43	1,247	235,946	食品
PEARSON PLC	841.59	841.59	796	150,606	各種消費者サービス
PERSIMMON PLC	352.52	569.89	799	151,305	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	3,339.71	4,181.46	3,305	625,211	保険
RIO TINTO PLC	1,408.39	1,730.77	9,188	1,738,218	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	32,204.82	35,829.03	2,339	442,588	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	886.53	1,070.96	6,095	1,153,162	家庭用品
RELX PLC	2,404.03	2,891.43	9,645	1,824,697	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	3,121.14	3,748.45	1,527	288,955	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	11,219.24	13,032.32	4,068	769,674	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	6,704.64	8,963.55	1,873	354,387	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	674.48	890.82	554	104,850	資本市場
SSE PLC	1,315.74	1,689.22	2,652	501,693	電力
BP PLC	23,470.86	25,715.29	12,253	2,317,963	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	1,288.93	1,521.96	1,776	335,990	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	516.95	516.95	826	156,368	コングロメリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	89.36	107.51	1,092	206,630	機械
STANDARD CHARTERED PLC	3,198.02	3,625.28	2,088	395,017	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	84,778.63	98,680.76	4,085	772,831	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	5,698.63	5,698.63	819	155,017	家庭用耐久財
TESCO PLC	9,342.47	10,307.35	2,857	540,496	生活必需品流通・小売り
3I GROUP PLC	1,247.51	1,494.86	3,569	675,285	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	1,076.79	1,259.3	1,382	261,448	ヘルスケア機器・用品
GSK PLC	4,995.5	6,260.67	10,442	1,975,464	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	414.94	633.56	5,614	1,062,115	資本市場
WPP PLC	1,427.85	1,760.61	1,347	254,919	メディア
ASTRAZENECA PLC	1,930.29	2,365.72	23,004	4,351,716	医薬品
WHITBREAD PLC	254.7	314.75	1,084	205,119	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	233.09	233.09	1,020	193,086	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	522.29	522.29	677	128,096	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	217.52	268.74	2,053	388,398	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,920.97	2,658.07	666	126,109	生活必需品流通・小売り
ADMIRAL GROUP PLC	213.25	400.84	1,021	193,206	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	164.89	164.89	763	144,482	家庭用耐久財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	184.55	184.55	362	68,600	医薬品
ABRDN PLC	2,858.31	2,858.31	460	87,107	資本市場
EXPERIAN PLC	1,127.09	1,401.33	4,707	890,435	専門サービス
MONDI PLC	588.87	675.54	913	172,838	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	369.42	369.42	306	58,058	資本市場
OCADO GROUP PLC	697.66	697.66	371	70,316	生活必需品流通・小売り
INFORMA PLC	1,861.95	2,239.61	1,788	338,340	メディア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	末額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(イギリス)</b>	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
GLENORE PLC	12,257.76	15,701.88	6,145	1,162,585	金属・鉱業
ENTAIN PLC	744.51	969.24	904	171,139	ホテル・レストラン・レジャー
COCA-COLA HBC AG	213.38	310.35	739	139,844	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	862.23	1,358.28	672	127,290	保険
M&G PLC	2,704.01	2,704.01	594	112,380	金融サービス
ENDEAVOUR MINING PLC	-	280.75	356	67,395	金属・鉱業
WISE PLC	-	962.07	800	151,492	金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,521.8	3,820.71	413	78,203	専門小売り
HALEON PLC	6,227.66	8,367.29	2,645	500,494	パーソナルケア用品
SHELL PLC	9,059.72	10,110.99	25,252	4,776,958	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	1,108.33	1,431.88	1,020	193,075	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	-	271.04	4,500	851,382	ホテル・レストラン・レジャー
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,872.07	2,161.24	1,301	246,286	航空宇宙・防衛
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	281,373	53,227,458	
	77銘柄	81銘柄	-	<3.9%>	
<b>(イスラエル)</b>	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,467.03	1,874.04	5,942	245,076	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,803.43	2,390.83	6,574	271,149	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	2,877.73	-	-	-	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	36.62	33.3	2,519	103,891	航空宇宙・防衛
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	125.74	-	-	-	半導体・半導体製造装置
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,629.44	1,629.44	2,861	118,002	銀行
ICL GROUP LTD	1,030.67	1,030.67	1,769	72,982	化学
NICE LTD	76.4	90.53	7,264	299,578	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	174.4	294.44	3,954	163,079	銀行
AZRIELI GROUP	46.72	46.72	1,105	45,606	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	31,991	1,319,366	
	10銘柄	8銘柄	-	<0.1%>	
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	4,515.99	-	-	-	資本市場
LOGITECH INTL-REG	237.34	237.34	1,816	308,694	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	3,418.82	4,077.36	39,481	6,709,019	食品
CIE FINANC RICHEMONT	644.58	805.41	10,812	1,837,390	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	872.21	1,070.11	24,312	4,131,490	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	52.36	53.11	1,204	204,686	機械
SIKA INHABER	177.93	233.97	5,729	973,686	化学
SGS SA-REG	7.48	229.78	1,909	324,554	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS	2,693.94	3,120.75	27,400	4,656,113	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R	56.75	58.3	829	140,876	保険
BARRY CALLEBAUT AG	4.6	4.6	597	101,461	食品
CLARIANT AG-REG	210.72	229.09	250	42,627	化学
SWISSCOM AG-REG	34.31	44.57	2,242	381,112	各種電気通信サービス
ABB LTD	1,945.38	2,474.95	9,632	1,636,851	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG	198.42	264.54	965	163,989	専門サービス
GEBERIT AG	43.77	51.05	2,577	437,910	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG	90.27	115.36	5,336	906,840	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART	1.37	1.61	1,822	309,700	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.13	0.16	1,798	305,602	食品
GIVAUDAN-REG	11.73	13.92	5,115	869,293	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	187.71	221.6	9,692	1,647,094	保険
ROCHE HOLDING AG-BEARER	36.12	48.1	1,153	196,003	医薬品

銘柄	期首(前期末)		当期		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	
HOLCIM LTD	666.07	775.19	5,158	876,518	建設資材
TEMENOS GROUP	70.82	109.3	967	164,336	ソフトウェア
BACHEM HOLDING AG	46.73	46.73	295	50,146	ライフサイエンス・ツール/サービス
SONOVA HOLDING AG	69.84	81	2,307	392,145	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG	68.87	78.9	2,251	382,515	海上運輸
STRAUMANN HOLDING AG	145.31	164.75	2,293	389,703	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B	31.3	43	899	152,935	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	92.59	92.59	374	63,564	繊維・アパレル・贅沢品
HELVETIA HOLDING AG	-	49.06	599	101,875	保険
SCHINDLER NAMEN	27.2	42.09	914	155,349	機械
SWISS LIFE HOLDING AG	39.78	45.03	2,804	476,563	保険
BANQUE CANTONALE VAUD	49.03	49.03	518	88,065	銀行
EMS-CHEMIE HOLDING	8.1	12.45	779	132,438	化学
SWISS PRIME SITE AG	83.72	133.56	1,139	193,709	不動産管理・開発
AVOLTA AG	-	129.33	454	77,271	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	28.52	34.33	4,165	707,919	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD	260.31	321.14	1,520	258,395	資本市場
SWISS RE LTD	381.39	455.02	4,663	792,545	保険
BKW AG	31.94	31.94	420	71,535	電力
SIG GROUP AG	383.22	509.69	915	155,554	容器・包装
ALCON INC	612.85	749.22	5,091	865,232	ヘルスケア機器・用品
SANDOZ GROUP AG	-	573.47	1,631	277,244	医薬品
UBS GROUP AG	4,189.21	5,033.06	12,205	2,074,024	資本市場
VAT GROUP AG	33.25	41.31	1,752	297,850	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	208,806	35,482,442	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B	125.49	151.67	14,105	305,662	飲料
A P MOLLER A/S	6.63	6.63	7,170	155,381	海上運輸
AP MOLLER MAERSK A	3.59	5.43	5,766	124,963	海上運輸
DANSKE BANK A/S	853.71	1,023.03	19,882	430,855	銀行
GENMAB A/S	79.26	97.83	18,367	398,025	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS	238.59	547.95	20,060	434,709	化学
ROCKWOOL AS	8.73	8.73	1,889	40,938	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B	2,063.49	4,980.24	421,776	9,139,897	医薬品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,254.36	1,545.21	29,108	630,784	電気設備
COLOPLAST-B	153.43	212.91	18,706	405,364	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	238.42	281.9	32,052	694,567	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	113.67	177	6,331	137,199	ヘルスケア機器・用品
TRYG A/S	448.87	582.22	8,366	181,302	保険
PANDORA A/S	124.73	124.73	13,770	298,400	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	125.38	-	-	-	化学
ORSTED A/S	232.4	269.11	10,831	234,722	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	628,185	13,612,774	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
MOWI ASA	563.75	731.18	14,448	205,596	食品
NORSK HYDRO ASA	1,629.71	2,211.82	12,448	177,136	金属・鉱業
TELENOR ASA	859.54	1,195.76	13,727	195,339	各種電気通信サービス
KONGSBERG GRUPPEN ASA	111.85	111.85	7,275	103,535	航空宇宙・防衛
ORKLA ASA	1,160.68	1,160.68	8,802	125,260	食品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
EQUINOR ASA	1,156.17	1,298.95	34,292	487,979	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	198.34	294.14	10,597	150,807	化学
AKER BP ASA	387.23	409.33	10,708	152,375	石油・ガス・消耗燃料
SALMAR ASA	72.48	128.97	7,611	108,316	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	257.21	257.21	4,406	62,697	保険
ADEVINTA ASA	243.82	547.15	6,188	88,059	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	1,193.19	1,439.09	29,472	419,394	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,833.97 12銘柄	9,786.13 12銘柄	159,978 -	2,276,499 <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	3,341.22	3,960.72	66,757	955,973	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	1,942.04	2,418.69	35,409	507,065	機械
ERICSSON LM-B SHS	3,665.51	4,180	23,094	330,713	通信機器
GETINGE AB-B SHS	257.55	389.25	7,720	110,561	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	584.37	-	-	-	金融サービス
LUNDBERGS B	78.59	148.72	8,152	116,748	金融サービス
SKF AB-B SHS	465.94	465.94	9,905	141,852	機械
SANDVIK AB	1,333.5	1,692.18	36,720	525,834	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,958.37	2,502.03	37,230	533,136	銀行
SKANSKA AB-B SHS	439.37	439.37	8,207	117,530	建設・土木
SWEDBANK AB	1,122.96	1,325.81	28,359	406,101	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	702.11	927.95	12,652	181,185	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,844.99	2,188.46	26,611	381,079	銀行
VOLVO AB-A SHS	241.98	241.98	6,591	94,390	機械
VOLVO AB-B SHS	1,916.25	2,375.69	63,157	904,418	機械
HOLMEN AB-B SHS	101.42	173.2	6,872	98,415	紙製品・林産品
TELE2 AB-B SHS	644.16	676.54	5,639	80,759	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	152.92	152.92	5,096	72,986	金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	213.25	213.25	7,107	101,781	金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	269.07	-	-	-	家庭用耐久財
SAAB AB-B	-	117.89	9,145	130,969	航空宇宙・防衛
SECURITAS AB-B SHS	760.85	760.85	8,091	115,872	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	2,263.92	2,715.48	68,104	975,252	金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	822.87	1,046.69	14,768	211,489	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	1,246.12	1,533.68	43,525	623,290	建設関連製品
TELIA CO AB	3,448.1	3,448.1	8,406	120,380	各種電気通信サービス
BOLIDEN AB	362.6	362.6	9,694	138,819	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	353.13	444.07	16,879	241,708	機械
KINNEVIK AB-B	362.78	-	-	-	金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	729.42	729.42	4,655	66,661	不動産管理・開発
INDUTRADE AB	391.78	391.78	10,707	153,329	機械
HUSQVARNA AB-B SHS	477.69	477.69	3,664	52,480	機械
NIBE INDUSTRIER AB	1,858.45	2,128.32	13,978	200,176	建設関連製品
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	183.8	363.81	9,109	130,452	バイオテクノロジー
HEXAGON AB-B SHS	2,481.63	3,071.16	35,333	505,978	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	280.22	280.22	7,033	100,720	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	845.63	1,031.15	19,272	275,977	機械
EPIROC AB-B	412.05	614.87	10,108	144,753	機械
ESSITY AB-B	751.8	869	20,682	296,169	家庭用品
EQT AB	407.16	551.94	15,128	216,642	資本市場
EMBRACER GROUP AB	797.91	-	-	-	娯楽

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	末額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(スウェーデン)</b>	百株	百株	千スウェーデン・クローナ	千円	
VOLVO CAR AB	637.1	637.1	2,362	33,829	自動車
BEIJER REF AB	—	504.93	7,366	105,494	商社・流通業
LIFCO AB	268.35	396.31	10,625	152,151	コングロマリット
EVOLUTION AB	223.26	282.66	37,062	530,733	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	4,203.56	—	—	—	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	155.39	276.38	7,185	102,901	コングロマリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	46,001.14 45銘柄	47,508.8 42銘柄	788,182 —	11,286,768 <0.8%>
<b>(ユーロ圏・アイルランド)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	907.48	—	—	—	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	199.53	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	207.61	250.25	2,051	331,366	食品
KINGSPAN GROUP PLC	174.51	218.6	1,772	286,350	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	324.22	398.69	1,483	239,554	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,345.37	1,641.56	1,356	219,115	銀行
AIB GROUP PLC	1,475.78	2,269.14	921	148,876	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,634.5 7銘柄	4,778.24 5銘柄	7,585 —	1,225,263 <0.1%>
<b>(ユーロ圏・オランダ)</b>	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	733.77	907.75	13,639	2,203,108	航空宇宙・防衛
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	—	124.03	1,918	309,815	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE DSM NV	222.01	—	—	—	化学
ING GROEP NV-CVA	4,707.18	5,408.15	6,644	1,073,212	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	59.78	72.73	4,062	656,206	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	155.84	155.84	825	133,256	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,258.84	1,466.67	3,907	631,092	生活必需品流通・小売り
HEINEKEN NV	320.26	437.59	3,813	615,901	飲料
AKZO NOBEL	226.27	260.32	1,756	283,648	化学
ASML HOLDING NV	506.05	614.91	52,476	8,475,991	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,155.12	1,217.72	2,266	366,111	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	320.47	387.24	5,520	891,607	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	869.19	1,040.58	4,338	700,786	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	274.12	345.44	1,374	222,065	ライフサイエンス・ツール/サービス
KONINKLIJKE KPN NV	4,757.39	4,960.95	1,589	256,814	各種電気通信サービス
HEINEKEN HOLDING NV-A	108.53	176.9	1,275	206,010	飲料
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	577.75	839.4	817	132,109	飲料
OCI NV	123.29	123.29	334	54,105	化学
FERRARI NV	154.35	188.5	6,701	1,082,373	自動車
ASR NEDERLAND NV	—	273.65	1,176	190,015	保険
CNH INDUSTRIAL NV	1,246.04	—	—	—	機械
PROSUS NV	1,025.26	2,208.42	6,426	1,038,008	大規模小売り
JDE PEET'S BV	143.85	143.85	322	52,138	食品
EXOR NV	141.42	141.42	1,360	219,695	金融サービス
EURONEXT NV	100.81	140.77	1,115	180,192	資本市場
IMCD NV	68.23	93.32	1,300	210,042	商社・流通業
NN GROUP NV	362.89	434.78	1,628	263,065	保険
ARGENX SE	67.53	90.78	3,279	529,766	バイオテクノロジー
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	925.02	1,256.11	3,422	552,866	娯楽
STELLANTIS NV	2,806.95	3,419.19	7,718	1,246,744	自動車
FERROVIAL SE	—	738.17	2,610	421,594	建設・土木
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	226.7	—	—	—	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	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV	528.35	759.82	1,088	175,805	銀行
ADYEN NV	25.93	33.78	4,889	789,831	金融サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	24,199.19 31銘柄	28,462.07 31銘柄	149,603 -	24,163,985 <1.8%>
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE	242.9	335.45	693	111,939	化学
LOTUS BAKERIES NV	-	0.77	692	111,808	食品
D'IETEREN TRDG	27.36	27.36	479	77,512	販売
KBC GROUPE	322.13	359.62	2,269	366,521	銀行
SOFINA	22.81	22.81	501	80,980	金融サービス
SOLVAY SA	90.7	-	-	-	化学
AGEAS	181.36	240.86	926	149,623	保険
UCB SA	167.32	200.2	1,883	304,155	医薬品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	113.18	129.18	901	145,638	金融サービス
ELIA GROUP	40.78	40.78	428	69,161	電力
SYENSQO SA	-	112.17	926	149,670	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,053.27	1,295.06	7,500	1,211,559	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,261.81 10銘柄	2,764.26 11銘柄	17,202 -	2,778,571 <0.2%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	668.78	811.29	2,041	329,761	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	178.24	230.38	1,270	205,181	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	558.55	760.02	1,120	180,945	エネルギー設備・サービス
AROUNDTOWN SA	1,132.25	-	-	-	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,537.82 4銘柄	1,801.69 3銘柄	4,432 -	715,888 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	653.17	798.31	13,560	2,190,226	化学
AXA SA	2,280.92	2,717.13	8,323	1,344,480	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	837.2	981.92	2,894	467,551	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	31.2	31.2	552	89,197	航空宇宙・防衛
DANONE	791.5	965.32	5,861	946,737	食品
SAFRAN SA	425.57	510.62	8,982	1,450,906	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	183.05	314.27	1,170	189,033	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	291.23	291.23	972	157,111	建設・土木
BNP PARIBAS	1,390.23	1,608.93	8,675	1,401,242	銀行
THALES SA	128.86	150.23	2,070	334,495	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	198.39	250.63	5,513	890,598	情報技術サービス
EIFFAGE	117.84	127.06	1,220	197,141	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	294.05	334.67	3,248	524,666	メディア
L'OREAL	301.22	366.99	15,828	2,556,583	パーソナルケア用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	344.54	422.43	33,904	5,476,211	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	1,148.08	1,148.08	716	115,713	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	869.08	983.59	3,296	532,371	自動車用部品
PERNOD-RICARD	248.88	309.48	4,789	773,552	飲料
RENAULT SA	279.02	279.02	1,051	169,858	自動車
REMY COINTREAU	28.66	28.66	279	45,115	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	614.6	695.01	4,722	762,793	建設関連製品
SEB SA	25.96	25.96	287	46,501	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	1,004.09	1,166.35	2,522	407,485	銀行
VINCI S.A.	667.67	763.13	8,794	1,420,456	建設・土木

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SODEXO	98.22	129.1	1,002	161,855	ホテル・レストラン・レジャー	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	678.65	831.64	16,250	2,624,739	電気設備	
VIVENDI SE	989.44	989.44	1,024	165,487	メディア	
TOTALENERGIES SE	3,100.9	3,493.95	21,110	3,409,759	石油・ガス・消耗燃料	
VALEO	265.7	—	—	—	自動車用部品	
ORANGE	2,554.81	2,869.57	3,050	492,785	各種電気通信サービス	
HERMES INTL	39.16	48.8	10,465	1,690,332	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT SYSTEMES SA	819	1,015.97	4,353	703,248	ソフトウェア	
KERING	93.82	114.43	4,761	769,066	繊維・アパレル・贅沢品	
CARREFOUR SA	755.72	906.42	1,356	219,168	生活必需品流通・小売り	
SANOFI	1,424.61	1,744.57	14,956	2,415,725	医薬品	
UBISOFT ENTERTAINMENT	110.32	—	—	—	娯楽	
TELEPERFORMANCE	78.45	95.81	1,291	208,528	専門サービス	
EURAZEO	56.73	56.73	436	70,509	金融サービス	
ESSILORLUXOTTICA	356.82	452.65	8,632	1,394,392	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT AGRICOLE SA	1,437.2	1,669.21	2,036	328,979	銀行	
WENDEL	54.49	—	—	—	金融サービス	
BIOMERIEUX	48.7	48.7	493	79,722	ヘルスケア機器・用品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	31.09	38.55	928	149,998	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ENGIE	2,217.51	2,770.54	3,982	643,322	総合公益事業	
ALSTOM	370.07	474.94	540	87,298	機械	
IPSEN SA	38.73	59.64	616	99,509	医薬品	
ARKEMA SA	63.92	104.89	1,016	164,166	化学	
LEGRAND SA	327.83	411.05	3,739	604,041	電気設備	
ADP	39.75	61.04	725	117,225	運送インフラ	
BUREAU VERITAS SA	397.29	397.29	986	159,398	専門サービス	
GETLINK	635.09	639.68	978	158,081	運送インフラ	
EDENRED	310.91	356.18	1,972	318,602	金融サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	172.93	172.93	668	107,927	ホテル・レストラン・レジャー	
WORLDLINE SA	299.16	362.32	434	70,226	金融サービス	
AMUNDI SA	104.36	112.88	676	109,303	資本市場	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	31,126.39 55銘柄	35,699.14 52銘柄	247,730 —	40,013,435 <2.9%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADIDAS AG	219.74	245.5	4,292	693,375	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	415.77	497.83	5,036	813,422	自動車	
COMMERZBANK AG	1,410.36	1,587.92	1,664	268,791	銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	489.48	588.14	1,533	247,750	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNITED INTERNET	100.1	—	—	—	各種電気通信サービス	
HANNOVER RUECK SE	71.05	96.38	2,229	360,071	保険	
GEA GROUP AG	174.9	255.13	955	154,408	機械	
CONTINENTAL AG	129.21	176.35	1,342	216,877	自動車用部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	1,247.72	1,517.35	6,395	1,033,022	航空貨物・物流サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	168.54	233.11	1,071	173,123	自動車	
MERCK KGAA	162.3	202.16	3,113	502,854	医薬品	
RWE AG	778.53	987.51	3,144	507,856	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
SAP SE	1,300.68	1,594.38	26,288	4,246,059	ソフトウェア	
E.ON SE	2,802.87	3,393.66	3,994	645,165	総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	133.76	178.86	1,126	181,945	家庭用品	
SIEMENS AG-REG	953.29	1,161.5	19,169	3,096,240	コングロマリット	
PUMA AG	162.1	172.1	717	115,832	繊維・アパレル・贅沢品	

銘柄	期首(前期末)		当期		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		
BAYER AG	1,213.29	1,473.29	4,135	667,970	医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	196.44	241.91	1,698	274,294	家庭用品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	995.29	1,237.37	8,108	1,309,682	自動車	
BASF SE	1,164.08	1,354.42	6,172	996,916	化学	
BEIERSDORF AG	129.4	157.43	2,160	349,000	パーソナルケア用品	
HEIDELBERG MATERIALS AG	208.09	215.86	1,777	287,153	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	238.55	336.32	1,324	213,975	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	509.4	614.13	15,021	2,426,292	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	723.42	1,086.47	803	129,842	旅客航空輸送	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	176.12	209.96	8,606	1,390,083	保険	
RHEINMETALL STAMM	55.96	66.62	2,427	392,111	航空宇宙・防衛	
VOLKSWAGEN AG	33.15	54.6	726	117,292	自動車	
VOLKSWAGEN AG PFD	222.69	304.25	3,583	578,799	自動車	
NEMETSCHKE SE	98.78	102.22	889	143,641	ソフトウェア	
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,537.16	2,826.37	3,371	544,622	資本市場	
BMW VORZUG	78.21	78.21	746	120,577	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	4,033.92	4,822.93	10,658	1,721,589	各種電気通信サービス	
SARTORIUS AG	28.47	36.51	1,202	194,250	ライフサイエンス・ツール/サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,590.23	1,979.36	6,530	1,054,870	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	5.16	5.42	405	65,526	機械	
CARL ZEISS MEDITEC AG	48.66	48.66	538	87,044	ヘルスケア機器・用品	
BECHTLE AG	81.39	145.21	720	116,403	情報技術サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	238.84	287.51	5,377	868,634	資本市場	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	72.94	86.92	1,914	309,286	航空宇宙・防衛	
WACKER-CHEMIE GMBH	-	29.91	289	46,706	化学	
SYMRISE AG	172.65	195.47	1,902	307,324	化学	
BRENNTAG SE	179.34	215.59	1,709	276,139	商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	246.87	428.36	732	118,312	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,054.74	-	-	-	各種電気通信サービス	
TALANX AG	-	103.49	697	112,580	保険	
LEG IMMOBILIEN SE	82.09	119.15	827	133,715	不動産管理・開発	
VONOVIA SE	859.37	1,074.78	2,769	447,363	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	103.42	103.42	583	94,279	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	343.18	449.62	2,415	390,128	ヘルスケア機器・用品	
DR ING HC F PORSCHE AG	151.74	183.71	1,464	236,551	自動車	
SIEMENS ENERGY AG	590.14	748.92	1,054	170,319	電気設備	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	566.93	834.68	2,886	466,198	機械	
ZALANDO SE	313.21	313.21	612	98,928	専門小売り	
SCOUT24 SE	100.48	100.48	653	105,491	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	275.58	275.58	1,343	216,994	化学	
HELLOFRESH SE	178.56	178.56	220	35,690	生活必需品流通・小売り	
DELIVERY HERO SE	225.64	225.64	503	81,273	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,843.98 57銘柄	36,240.4 57銘柄	191,645 -	30,954,661 <2.3%>	
(ユーロ…スイス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DSM-FIRMENICH AG	-	288.46	2,685	433,772	化学	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	288.46 1銘柄	2,685 -	433,772 <0.0%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	346.44	456.06	982	158,669	生活必需品流通・小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3,179.56	5,054.41	1,897	306,553	電力	



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…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	594.06	795.85	1,124	181,635	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,120.06 3銘柄	6,306.32 3銘柄	4,004 -	646,858 <0.0%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	7,795.92	9,390.14	10,127	1,635,756	電力
REPSOL SA	1,787.13	1,950.49	2,707	437,279	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	6,649.75	7,557.2	2,701	436,378	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	377.01	509.46	861	139,107	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	235.71	348.36	1,271	205,431	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	7,351.18	9,146.52	8,401	1,357,089	銀行
ACCIONA S.A.	26.42	50.05	551	89,005	電力
NATURGY ENERGY GROUP SA	176.77	176.77	411	66,411	ガス
BANCO SANTANDER SA	20,668.57	24,843.77	9,115	1,472,283	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	490.11	655.89	949	153,294	電力
INDITEX	1,363.21	1,621.41	6,357	1,026,871	専門小売り
ENAGAS	382.7	382.7	548	88,609	ガス
GRIFOLS SA	319.82	319.82	339	54,834	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	635.13	-	-	-	建設・土木
CAIXABANK	5,660.59	6,300.95	2,514	406,175	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	396.88	396.88	553	89,393	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMADEUS IT GROUP SA	547.12	688.48	4,269	689,682	ホテル・レストラン・レジャー
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	98.22	98.22	207	33,505	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AENA SME SA	99.89	116.03	1,925	311,009	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	695.72	819.74	2,701	436,404	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,757.85 20銘柄	65,372.88 19銘柄	56,516 -	9,128,526 <0.7%>
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,446.13	1,446.13	2,970	479,771	保険
INTESA SANPAOLO	20,509.73	23,301.03	6,559	1,059,448	銀行
UNICREDIT SPA	2,411.49	2,446.66	7,282	1,176,266	銀行
ENI SPA	3,151.96	3,532.07	5,122	827,339	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	867.92	867.92	996	161,004	銀行
ENEL SPA	10,193.43	12,028.25	7,113	1,148,973	電力
LEONARDO SPA	-	649.15	1,187	191,771	航空宇宙・防衛
SNAM SPA	2,564.15	3,175.18	1,380	222,989	ガス
TELECOM ITALIA SPA	9,082.86	19,705.16	541	87,526	各種電気通信サービス
TERNA SPA	1,660.64	2,076.55	1,530	247,260	電力
RECORDATI SPA	109.08	181.97	918	148,369	医薬品
AMPLIFON SPA	123	202.49	630	101,847	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	307.28	383.43	1,572	253,919	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	24.29	24.29	210	34,046	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	250.14	297.63	1,776	286,996	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	835.76	835.76	614	99,327	金融サービス
FINECOBANK SPA	751.8	963.93	1,245	201,234	銀行
BANCO BPM SPA	-	2,027.27	1,035	167,193	銀行
POSTE ITALIANE SPA	588.89	887.62	883	142,651	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	418.79	418.79	448	72,513	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,297.34 18銘柄	75,451.28 20銘柄	44,022 -	7,110,450 <0.5%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	352.52	352.52	606	97,992	生活必需品流通・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	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	509.56	771.48	1,076	173,830	機械
UPM-KYMMENE OYJ	677.58	779.73	2,211	357,171	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	749.6	959.8	1,034	167,041	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	583.96	709.99	2,879	465,074	保険
FORTUM OYJ	541.94	736.99	803	129,752	電力
NOKIA OYJ	6,795.69	8,270.68	2,687	434,027	通信機器
ELISA OYJ	202.42	202.42	833	134,670	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	505.99	662.48	1,816	293,404	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	438.14	493	2,246	362,791	機械
ORION OYJ	135.59	135.59	537	86,769	医薬品
METSO CORPORATION	—	1,028.31	963	155,695	機械
NORDEA BANK ABP	—	4,924.03	5,288	854,183	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	11,492.99 11銘柄	20,027.02 13銘柄	22,984 —	3,712,404 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	172.58	233.54	935	151,074	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	73.2	106.63	667	107,815	電力
VOEST-ALPINE AG	105.93	180.32	454	73,337	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	456.86	565.74	2,231	360,396	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	808.57 4銘柄	1,086.23 4銘柄	4,288 —	692,622 <0.1%>
(ユーロ…バミューダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AEGON LTD	2,324.33	2,324.33	1,252	202,279	保険
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	2,324.33 1銘柄	2,324.33 1銘柄	1,252 —	202,279 <0.0%>
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	1,372,550.07 1,212銘柄	1,726,233.38 1,199銘柄	— —	1,311,536,937 <96.4%>

(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	
(カナダ)		証券	証券	千カナダ・ドル	千円
CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT	—	—	2,968	0	0
合 計	証 券 数 銘 柄 数<比 率>	— —銘柄	2,968 1銘柄	0 —	0 <0.0%>

(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) < >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			比率
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>不動産ファンド (アメリカ)</b>	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18.835	24.234	2,746	413,348		0.0
BOSTON PROPERTIES INC	18.531	24.473	1,547	232,835		0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58.993	80.213	1,472	221,628		0.0
PROLOGIS INC	115.173	139.674	18,227	2,743,050		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.932	21.518	3,727	560,896		0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	13.271	16.851	1,581	237,969		0.0
EQUINIX INC	11.399	14.299	11,908	1,792,087		0.1
CROWN CASTLE INC	54.164	65.066	6,883	1,035,970		0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.345	9.893	2,248	338,344		0.0
EQUITY RESIDENTIAL	46.054	54.104	3,173	477,534		0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	68.971	90.133	1,519	228,690		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	13.584	16.539	3,457	520,365		0.0
WELLTOWER INC	58.944	77.707	7,255	1,091,880		0.1
KIMCO REALTY	79.991	95.524	1,859	279,889		0.0
IRON MOUNTAIN INC	34.514	43.616	2,946	443,382		0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20.486	27.29	1,806	271,792		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	91.777	110.415	2,144	322,689		0.0
MID AMERICA	13.578	17.537	2,193	330,130		0.0
REALTY INCOME CORP	76.685	129.955	6,678	1,005,030		0.1
REGENCY CENTERS CORP	19.311	21.907	1,318	198,433		0.0
UDR INC	41.516	50.449	1,759	264,735		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	40.894	48.901	6,985	1,051,322		0.1
PUBLIC STORAGE	19.317	23.534	6,600	993,356		0.1
SUN COMMUNITIES INC	14.694	18.509	2,348	353,358		0.0
VENTAS INC	48.092	60.757	2,771	417,026		0.0
WEYERHAEUSER CO	89.893	114.764	3,790	570,455		0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.256	34.18	4,771	718,067		0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	36.258	45.607	6,486	976,181		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	72.327	-	-	-		-
AMERICAN TOWER CORP	58.087	71.26	13,431	2,021,351		0.1
WP CAREY INC	23.664	32.996	1,842	277,227		0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42.371	-	-	-		-
AMERICAN HOMES 4 RENT	42.177	50.995	1,735	261,154		0.0
INVITATION HOMES INC	76.646	96.467	3,118	469,344		0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	30.095	41.252	1,860	280,043		0.0
VICI PROPERTIES INC	120.602	152.711	4,459	671,059		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,612.427	1,923.33	146,658	22,070,635	-
		36銘柄<1.9%>	34銘柄<1.6%>	-	-	1.6
<b>(カナダ)</b>	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		%
CANADIAN APT PPTYS REIT	8.722	8.722	429	47,770		0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14.424	14.424	265	29,560		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	23.146	23.146	695	77,331	-
		2銘柄<0.0%>	2銘柄<0.0%>	-	-	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	比率	
<b>(オーストラリア)</b>	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%	
MIRVAC GROUP	432.802	700.332	1,568	153,125		0.0	
GPT GROUP	219.223	349.447	1,551	151,446		0.0	
STOCKLAND	259.328	369.843	1,667	162,812		0.0	
DEXUS	163.989	163.989	1,280	125,014		0.0	
GOODMAN GROUP	214.602	255.895	6,806	664,412		0.0	
VICINITY CENTRES	545.645	545.645	1,113	108,651		0.0	
SCENTRE GROUP	647.197	825.454	2,542	248,163		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,482.786 7銘柄<0.1%>	3,210.605 7銘柄<0.1%>	16,531	1,613,625	— 0.1	
<b>(香港)</b>	千□	千□	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	262.516	410.116	15,317	294,868		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	262.516 1銘柄<0.0%>	410.116 1銘柄<0.0%>	15,317	294,868	— 0.0	
<b>(シンガポール)</b>	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	787.231	787.231	1,503	167,878		0.0	
CAPLAND ASCENDAS REIT	440.678	611.078	1,662	185,577		0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474.1	474.1	715	79,929		0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405.5	405.5	551	61,572		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	2,107.509 4銘柄<0.0%>	2,277.909 4銘柄<0.0%>	4,433	494,957	— 0.0	
<b>(イギリス)</b>	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%	
BRITISH LAND CO PLC	119.111	—	—	—		—	
LAND SECURITIES GROUP PLC	77.092	121.345	770	145,763		0.0	
SEGRO PLC	165.081	165.081	1,345	254,448		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	361.284 3銘柄<0.0%>	286.426 2銘柄<0.0%>	2,115	400,211	— 0.0	
<b>(ベルギー)</b>	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
WAREHOUSES DE PAUW	27.206	31.043	786	127,056		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	27.206 1銘柄<0.0%>	31.043 1銘柄<0.0%>	786	127,056	— 0.0	
<b>(フランス)</b>	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
GECINA SA	5.045	8.697	832	134,433		0.0	
KLEPIERRE	25.279	36.407	826	133,427		0.0	
COVIVIO	5.066	5.066	209	33,777		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	18.477	1,275	205,983		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13.535	—	—	—		—	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	48.925 4銘柄<0.0%>	68.647 4銘柄<0.0%>	3,142	507,622	— 0.0	
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	6,925.799 58銘柄<2.2%>	8,231.222 55銘柄<1.9%>	—	25,586,308	— 1.9	

(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		末
			買 建 額	売 建 額	額
外 国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T		18,388		—
	S & P / T S E 6 0 I X F U T		785		—
	S P I 2 0 0 F U T U R E S		475		—
	FTSE 100 INDEX FUTURE		968		—
	D J E U R O S T O X X 5 0		3,381		—

(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

2024年2月15日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	率
株 式	1,311,536,937		96.3
投資信託受益証券、投資証券	25,586,308		1.9
コール・ローン等、その他	24,345,898		1.8
投資信託財産総額	1,361,469,144		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、1,360,702,498千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.49円、1カナダ・ドル=111.14円、1オーストラリア・ドル=97.61円、1香港・ドル=19.25円、1シンガポール・ドル=111.65円、1ニュージーランド・ドル=91.65円、1イギリス・ポンド=189.17円、1イスラエル・シケル=41.24円、1スイス・フラン=169.93円、1デンマーク・クローネ=21.67円、1ノルウェー・クローネ=14.23円、1スウェーデン・クローナ=14.32円、1ユーロ=161.52円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,361,991,056,310円
一 般 株 式 (評 価 額)	12,858,145,403
一 般 株 式 (評 価 額)	1,311,536,937,030
資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	2,108,582,829
資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	23,477,725,872
収 入 配 当 金	979,953,906
入 委 託 証 拠	1,045,069,259
	9,984,642,011
(B) 負 債	1,032,534,417
未 払 金	734,979,417
未 払 金	297,555,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,360,958,521,893
元 本	162,729,949,242
次 期 繰 越 損 益	1,198,228,572,651
(D) 受 取 益 権 総 額	162,729,949,242円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	83,633円

(注1) 期首元本額	137,221,085,885円	4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	138,504,634円
追加設定元本額	76,071,759,274円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	931,825,289円
一部解約元本額	50,562,895,917円	9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	126,111,412円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	62,279,509円
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,150,221,102円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	31,482,383円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	1,531,018円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	19,331,816円
MITO ラップ型ファンド (中立的)	6,233,160円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	137,756,308円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	15,643,534円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	4,571,353円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,027,667円	Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	26,922,113円
グローバル8資産ラップファンド (中立的)	19,283,292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)	14,029,309円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	13,461,739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)	14,048,261円
たわらノーロード 先進国株式	57,361,664,964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)	8,775,720円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	57,934,709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)	8,434,278円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,884,066,158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)	236,047円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	916,899,062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)	35,948,901円
たわらノーロード バランス (堅実型)	80,325,474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)	12,462,424円
たわらノーロード バランス (標準型)	756,198,335円	三菱UFJ活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	23,066,359円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,019,417,623円	MSCIコクア・イデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	340,464,020円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,335円	DIAM外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	34,977,326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)	33,236,783円	DIAM外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家専用)	1,003,831,300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)	203,020,399円	DIAM先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	197,607,732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)	238,815,086円	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,138,795,896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)	417,682,501円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	293,977,211円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円	AMOneマルチアセット・インカム戦略 (シグナルヘッジ付) (適格機関投資家限定)	897,249円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	123,405円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	5,291,360円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	13,286,479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)	23,104,484円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,251,865円	リスクコントロール世界8資産(5資産)ファンド (FOF 5用) (適格機関投資家専用)	4,021,219円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	10,682,039円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	19,013,111円
たわらノーロード 全世界株式	1,964,292,693円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	36,934,397円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	57,042,872,613円	DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,418,942円
One DC 先進国株式インデックスファンド	3,356,391,099円	DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	8,754,286円
Oneグローバルバランス	22,754,981円	DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	927,720円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >1安定型	135,514,309円	DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,206円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	746,042,424円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	284,746円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,008,349,921円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	14,185,996円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	81,254,701円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	101,538,091円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	228,321,872円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	190,422,402円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	237,223,346円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	668,030,631円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	17,324,819円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	28,599,230円
マネックス資産設計ファンド (積成型)	656,949,333円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	24,316,972円
マネックス資産設計ファンド エコリユーション	119,023,013円	DIAM アジア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	162,198,269円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	157,468,415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)	5,202,502円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	184,448,070円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	131,734円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	308,125,677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)	56,771,450円
投資のソムリエ	9,174,564,014円	DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	4,446,099円
フルスクンコントロール	104,334,373円	DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	21,030,916円
投資のソムリエ<DC年金>	900,536,286円	DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	36,765,356円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	173,236,376円	DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	71,611,164円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	285,154,879円	動的パッケージファンド<DC年金>	13,568,830円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,018,133,616円	コア資産形成ファンド	7,035,145円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,329,950,094円	たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	2,827,749,610円
ワールドアセットバランス (基本コース)	106,137,745円	MHAM外国株式インデックスファンド	131,843,275円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	234,745,869円	たわらノーロード 先進国株式 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	1,040,748,063円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	57,887,085円	MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	1,579,711,581円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	29,635,686円	MHAM外国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	1,932,759,205円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	8,910,823円	期末元本合計	162,729,949,242円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	191,573,092円		

## ■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

項	目	当 期
(A) 配	当 等 収 益	20,832,085,328円
受	取 配 当 金	20,332,078,276
受	取 利 息	132,172,297
そ	の 他 収 益	368,792,120
支	払 利 息	△957,365
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	301,808,509,319
売	買 益	366,644,884,225
売	買 損	△64,836,374,906
(C) 先	物 取 引 等 取 引 損 益	2,947,135,821
取	引 益	6,012,458,571
取	引 損	△3,065,322,750
(D) そ	の 他 費 用	△254,583,222
(E) 当	期 損 益 金(A + B + C + D)	325,333,147,246
(F) 前	期 繰 越 損 益 金	719,000,490,991
(G) 解	約 差 損 益 金	△300,527,369,812
(H) 追	加 信 託 差 損 益 金	454,422,304,226
(I) 合	計(E + F + G + H)	1,198,228,572,651
次	期 繰 越 損 益 金(I)	1,198,228,572,651

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

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

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

# 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第21期 (決算日 2024年2月14日)

(計算期間 2023年2月15日～2024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21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 (ベンチマーク)		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	%				
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	ポイント 390.72	% 1.2	% 99.4	% -	% -	百万円 222,859
18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
20期 (2023年2月14日)	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	-	-	554,514
21期 (2024年2月14日)	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	-	-	535,043

(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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。  
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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)。



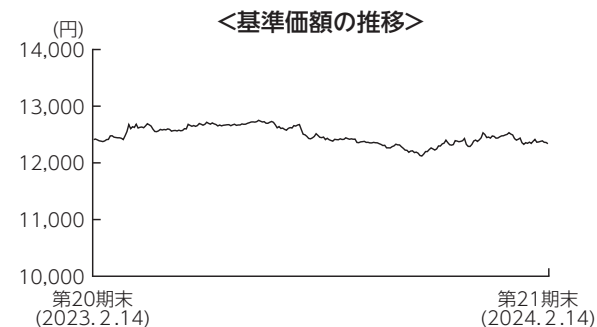
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2023年 2月14日	円 12,411	% -	ポイント 367.66	% -	% 99.7	% -	% -
2 月 末	12,476	0.5	369.57	0.5	99.6	-	-
3 月 末	12,649	1.9	374.74	1.9	99.8	-	-
4 月 末	12,680	2.2	375.61	2.2	100.1	-	-
5 月 末	12,668	2.1	375.27	2.1	99.7	-	-
6 月 末	12,700	2.3	376.29	2.3	99.5	-	-
7 月 末	12,505	0.8	370.43	0.8	99.1	-	-
8 月 末	12,415	0.0	367.76	0.0	96.7	-	-
9 月 末	12,326	△0.7	365.13	△0.7	99.5	-	-
10 月 末	12,130	△2.3	359.31	△2.3	99.8	-	-
11 月 末	12,385	△0.2	366.88	△0.2	99.4	-	-
12 月 末	12,436	0.2	368.38	0.2	99.7	-	-
2024年 1 月 末	12,344	△0.5	365.75	△0.5	99.6	-	-
(期 末) 2024年 2月14日	12,339	△0.6	365.56	△0.6	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（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

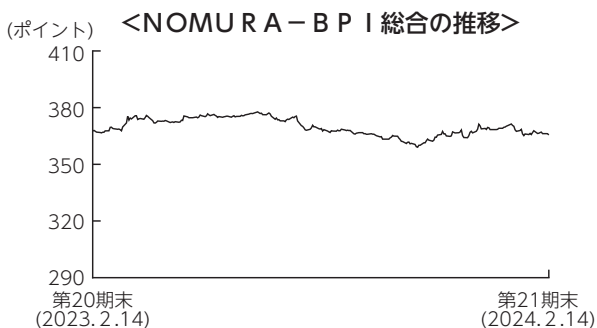


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は12,339円となり、前期末比で0.6%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。期初から2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、基準価額は上昇しました。7月以降は、日銀が金融政策を修正する中で、基準価額は下落基調となりました。11月以降は国内債券に対する堅調な需要を受けて基準価額の上昇が見られましたが、2024年1月から期末にかけては日銀が金融政策を追加修正する可能性が高まったことなどから基準価額は下落しました。



### 投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどをを受けて、利回りは上昇しま

した。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要を受けて利回りは低下しました。2024年1月から期末にかけては日銀のマイナス金利政策解除の観測が高まったことなどから利回りは上昇しました。

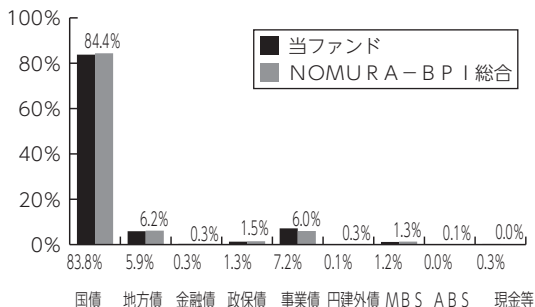
### ポートフォリオについて

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。

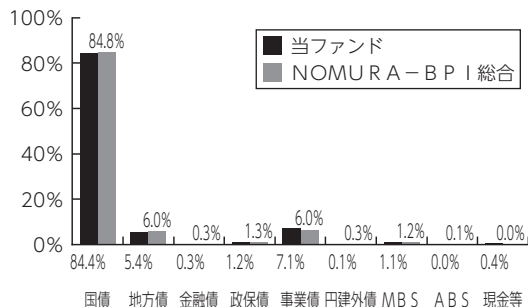
**【運用状況】** (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

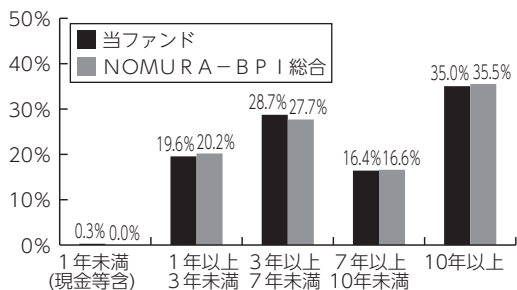


期末

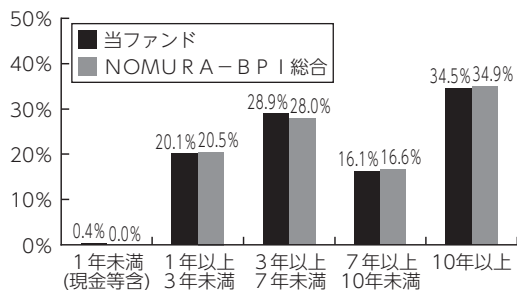


○残存年限別構成比

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0.6%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 (2023年2月15日から2024年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	716,806,028	720,895,402 (-)
	地方債証券	-	3,669,163 (-)
	特殊債証券	-	1,030,325 (316,495)
	社債証券	-	1,872,481 (-)

(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 (2023年2月15日から2024年2月14日まで)

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
公 社 債	百万円 716,806	百万円 57,522	% 8.0	百万円 727,467	百万円 67,522	% 9.3

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	464,585,000	451,739,708	84.4	—	52.8	21.6	10.1
地 方 債 証 券	29,139,330	29,000,791	5.4	4.5	3.2	1.7	0.5
特 殊 債 証 券	27,236,846	27,002,386	5.0	—	3.3	1.3	0.5
金 融 債 証 券	1,600,000	1,591,110	0.3	—	—	0.2	0.1
普 通 社 債 証 券	24,520,000	23,641,007	4.4	0.1	2.1	1.8	0.4
合 計	547,081,176	532,975,004	99.6	4.6	61.4	26.7	11.6

(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 4 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,500,000	1,500,075	2025/03/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,700,000	3,704,033	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,230,000	3,244,082	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	184,120	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	71,449	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	40,872	2025/03/20
4 4 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,000,000	999,940	2025/04/01
4 4 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	1,999,620	2025/05/01
4 4 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,800,000	1,799,406	2025/06/01
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,980,000	3,999,462	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	256,255	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	51,318	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	92,493	2025/06/20
4 5 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	12,500,000	12,489,875	2025/08/01
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	7,300,000	7,303,431	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,300,000	3,317,325	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	412,292	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	144,526	2025/09/20
4 5 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,900,000	2,894,548	2025/12/01
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,700,000	4,699,530	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,620,000	3,632,959	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	72,569	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	175,927	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	
4 5 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	900,000	899,658	2026/01/01
1 4 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,750,000	5,736,200	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,520,000	3,518,521	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	614,355	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	125,454	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	125,204	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,610,000	3,599,855	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,090,000	4,087,586	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	619,966	2026/06/20
8 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,484	2026/06/20
1 4 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,680,000	1,674,556	2026/09/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,570,000	3,567,215	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	495,154	2026/09/20
9 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	116,172	2026/09/20
1 5 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,470,000	1,464,575	2026/12/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,890,000	4,885,110	2026/12/20
9 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,224,565	2026/12/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,900,000	1,891,507	2027/03/20
1 5 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,890,000	1,887,089	2027/03/20
3 4 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,540,000	4,533,008	2027/03/20
9 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	391,115	2027/03/20
9 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	710,293	2027/03/20
1 5 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,210,000	5,179,677	2027/06/20

銘	柄	当 期 末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(国債証券)</b>					
347回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,500,000	4,488,030	2027/06/20
95回	利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	588,835	2027/06/20
96回	利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	127,675	2027/06/20
154回	利付国庫債券(5年)	0.1000	1,400,000	1,394,750	2027/09/20
348回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,070,000	4,054,737	2027/09/20
97回	利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	707,104	2027/09/20
98回	利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	170,848	2027/09/20
155回	利付国庫債券(5年)	0.3000	5,700,000	5,715,162	2027/12/20
156回	利付国庫債券(5年)	0.2000	4,300,000	4,295,055	2027/12/20
349回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,850,000	5,820,984	2027/12/20
99回	利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	803,587	2027/12/20
157回	利付国庫債券(5年)	0.2000	4,400,000	4,389,308	2028/03/20
158回	利付国庫債券(5年)	0.1000	3,600,000	3,576,672	2028/03/20
350回	利付国庫債券(10年)	0.1000	6,600,000	6,557,232	2028/03/20
100回	利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	895,528	2028/03/20
101回	利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	250,021	2028/03/20
159回	利付国庫債券(5年)	0.1000	2,100,000	2,083,326	2028/06/20
160回	利付国庫債券(5年)	0.2000	900,000	896,715	2028/06/20
161回	利付国庫債券(5年)	0.3000	1,700,000	1,700,714	2028/06/20
351回	利付国庫債券(10年)	0.1000	2,400,000	2,380,944	2028/06/20
102回	利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	545,590	2028/06/20
103回	利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	173,902	2028/06/20
104回	利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	118,614	2028/06/20
162回	利付国庫債券(5年)	0.3000	1,400,000	1,398,726	2028/09/20
163回	利付国庫債券(5年)	0.4000	3,000,000	3,010,860	2028/09/20
352回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,950,000	4,900,648	2028/09/20
105回	利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	691,891	2028/09/20
106回	利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	542,805	2028/09/20
164回	利付国庫債券(5年)	0.2000	1,700,000	1,687,437	2028/12/20
353回	利付国庫債券(10年)	0.1000	3,690,000	3,646,900	2028/12/20
107回	利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	650,166	2028/12/20
108回	利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	741,115	2028/12/20
354回	利付国庫債券(10年)	0.1000	2,460,000	2,428,020	2029/03/20
109回	利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	377,223	2029/03/20
110回	利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	478,627	2029/03/20
355回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,130,000	4,072,634	2029/06/20
111回	利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	504,629	2029/06/20
112回	利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	807,909	2029/06/20
356回	利付国庫債券(10年)	0.1000	2,700,000	2,660,040	2029/09/20
1回	利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	124,787	2029/09/20
113回	利付国庫債券(20年)	2.1000	1,370,000	1,501,136	2029/09/20
357回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,800,000	5,707,142	2029/12/20
114回	利付国庫債券(20年)	2.1000	410,000	450,827	2029/12/20
115回	利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	397,911	2029/12/20
2回	利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	111,942	2030/02/20
358回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,150,000	5,059,617	2030/03/20
116回	利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	587,589	2030/03/20

銘	柄	当 期 末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(国債証券)</b>					
117回	利付国庫債券(20年)	2.1000	470,000	518,273	2030/03/20
359回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,050,000	3,971,146	2030/06/20
118回	利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	610,111	2030/06/20
119回	利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	510,857	2030/06/20
360回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,100,000	4,010,661	2030/09/20
121回	利付国庫債券(20年)	1.9000	640,000	700,774	2030/09/20
122回	利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	620,473	2030/09/20
4回	利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	232,534	2030/11/20
361回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,500,000	5,366,845	2030/12/20
123回	利付国庫債券(20年)	2.1000	350,000	388,598	2030/12/20
362回	利付国庫債券(10年)	0.1000	4,210,000	4,097,466	2031/03/20
125回	利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	671,682	2031/03/20
126回	利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	563,733	2031/03/20
127回	利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	593,184	2031/03/20
363回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,919,370	2031/06/20
128回	利付国庫債券(20年)	1.9000	370,000	406,974	2031/06/20
364回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,950,000	5,754,780	2031/09/20
130回	利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	995,094	2031/09/20
6回	利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	227,966	2031/11/20
365回	利付国庫債券(10年)	0.1000	5,430,000	5,236,366	2031/12/20
132回	利付国庫債券(20年)	1.7000	30,000	32,606	2031/12/20
133回	利付国庫債券(20年)	1.8000	630,000	689,472	2031/12/20
366回	利付国庫債券(10年)	0.2000	4,880,000	4,731,208	2032/03/20
134回	利付国庫債券(20年)	1.8000	200,000	219,108	2032/03/20
135回	利付国庫債券(20年)	1.7000	130,000	141,415	2032/03/20
136回	利付国庫債券(20年)	1.6000	360,000	388,825	2032/03/20
367回	利付国庫債券(10年)	0.2000	5,700,000	5,510,076	2032/06/20
137回	利付国庫債券(20年)	1.7000	480,000	522,571	2032/06/20
138回	利付国庫債券(20年)	1.5000	1,060,000	1,136,691	2032/06/20
139回	利付国庫債券(20年)	1.6000	980,000	1,058,694	2032/06/20
368回	利付国庫債券(10年)	0.2000	4,750,000	4,577,860	2032/09/20
140回	利付国庫債券(20年)	1.7000	850,000	925,658	2032/09/20
369回	利付国庫債券(10年)	0.5000	5,220,000	5,150,208	2032/12/20
141回	利付国庫債券(20年)	1.7000	1,060,000	1,155,007	2032/12/20
142回	利付国庫債券(20年)	1.8000	430,000	472,342	2032/12/20
370回	利付国庫債券(10年)	0.5000	4,900,000	4,822,384	2033/03/20
143回	利付国庫債券(20年)	1.6000	1,230,000	1,329,716	2033/03/20
144回	利付国庫債券(20年)	1.5000	750,000	804,367	2033/03/20
371回	利付国庫債券(10年)	0.4000	5,200,000	5,058,716	2033/06/20
11回	利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	272,517	2033/06/20
145回	利付国庫債券(20年)	1.7000	2,250,000	2,452,657	2033/06/20
372回	利付国庫債券(10年)	0.8000	5,300,000	5,338,001	2033/09/20
12回	利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	259,299	2033/09/20
146回	利付国庫債券(20年)	1.7000	2,240,000	2,442,473	2033/09/20
373回	利付国庫債券(10年)	0.6000	1,200,000	1,182,948	2033/12/20
13回	利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	167,725	2033/12/20
147回	利付国庫債券(20年)	1.6000	1,290,000	1,393,703	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	
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	393,546	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,730,000	2,922,055	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	303,960	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,290,000	2,450,139	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	280,944	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,930,000	3,103,192	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	313,731	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,160,000	3,279,574	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	461,116	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,529,108	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	323,002	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,740,000	2,866,067	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	388,287	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,020,000	3,121,653	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	357,981	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,280,000	2,301,933	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	341,709	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,280,000	2,140,509	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	412,664	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,580,000	2,353,218	2036/06/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,140,000	2,018,041	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	381,212	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,840,000	1,750,244	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	724,240	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,820,000	1,747,691	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,760,000	1,662,443	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	732,170	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,930,000	1,816,940	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,430,000	2,278,538	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	909,832	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,750,000	2,533,245	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,250,000	2,063,587	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,003,749	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,540,000	1,447,061	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,350,000	2,136,009	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,014,041	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,590,000	1,416,610	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,520,000	1,326,412	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	818,337	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,900,000	1,649,352	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,502,507	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,114,646	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,380,000	1,205,098	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,360,000	2,050,202	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,299,840	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,400,000	2,074,008	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,020,000	1,767,378	2040/12/20

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	
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,355,760	2041/03/20
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,500,000	2,177,675	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,750,000	1,490,195	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,060,000	1,162,088	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,800,000	2,416,932	2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,200,000	1,890,306	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,499,465	2042/03/20
180回 利付国庫債券(20年)	0.8000	2,520,000	2,277,072	2042/03/20
181回 利付国庫債券(20年)	0.9000	1,900,000	1,742,262	2042/06/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,360,000	1,464,638	2042/09/20
182回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,150,000	2,035,319	2042/09/20
183回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,700,000	1,688,661	2042/12/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	850,000	898,509	2043/03/20
184回 利付国庫債券(20年)	1.1000	1,880,000	1,769,700	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,210,000	1,297,144	2043/06/20
185回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,100,000	1,969,632	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,030,000	1,085,002	2043/09/20
186回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,900,000	1,904,313	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,060,000	1,095,764	2043/12/20
187回 利付国庫債券(20年)	1.3000	500,000	482,860	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,000,000	1,032,470	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,410,000	1,453,949	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,163,719	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,150,000	1,141,835	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,870,000	1,853,656	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,340,000	1,349,661	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,720,000	1,667,454	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,300,000	1,257,906	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,150,000	982,985	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,520,000	1,153,011	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,500,000	1,188,690	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,220,000	986,199	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,790,000	1,510,348	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,080,000	908,452	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,040,000	872,092	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,730,000	1,446,193	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	126,511	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,383,377	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,120,000	907,625	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,330,000	1,126,895	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,060,000	852,515	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	330,000	365,445	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	720,000	547,336	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,100,000	810,128	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	952,718	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	948,844	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	596,343	2050/03/20

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
<b>(国債証券)</b>				
6 6回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,090,000	791,677 2050/03/20
6 7回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,270,000	971,626 2050/06/20
6 8回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,340,000	1,021,401 2050/09/20
6 9回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,360,000	1,062,323 2050/12/20
4回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	793,389 2051/03/20
7 0回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,400,000	1,089,788 2051/03/20
7 1回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,480,000	1,148,021 2051/06/20
7 2回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,290,000	997,118 2051/09/20
7 3回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,390,000	1,071,606 2051/12/20
5回	利付国庫債券 (40年)	2.0000	710,000	749,781 2052/03/20
7 4回	利付国庫債券 (30年)	1.0000	1,390,000	1,160,872 2052/03/20
7 5回	利付国庫債券 (30年)	1.3000	1,320,000	1,188,316 2052/06/20
7 6回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,320,000	1,215,733 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,600,000	1,543,632 2052/12/20
6回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	940,000	969,976 2053/03/20
7 8回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,800,000	1,653,048 2053/03/20
7 9回	利付国庫債券 (30年)	1.2000	1,600,000	1,396,880 2053/06/20
8 0回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,700,000	1,713,226 2053/09/20
8 1回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	200,000	192,046 2053/12/20
7回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	880,000	864,503 2054/03/20
8回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	990,000	900,286 2055/03/20
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,890,000	1,252,408 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,930,000	1,499,783 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,040,000	775,236 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,420,000	938,236 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	2,090,000	1,362,889 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	2,100,000	1,461,096 2061/03/20
1 5回	利付国庫債券 (40年)	1.0000	2,340,000	1,795,271 2062/03/20
1 6回	利付国庫債券 (40年)	1.3000	1,700,000	1,429,513 2063/03/20
小	計	-	464,585,000	451,739,708 -
<b>(地方債証券)</b>				
5回	東京都公募債 20年	2.1100	100,000	102,178 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募債	0.5340	100,000	100,461 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	401,568 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	603,186 2025/05/23
2 7年度 4回	千葉県公募債	0.6020	200,000	201,294 2025/07/25
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	502,880 2025/07/25
7回	東京都公募債 20年	2.1600	100,000	103,173 2025/09/19
1回	静岡県公募債 20年	2.1800	100,000	103,196 2025/09/19
1 5 0回	共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	301,635 2025/09/25
2 7年度 1 5回	愛知県公募債 10年	0.4710	100,000	100,483 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	100,479 2025/12/25
2 7年度 9回	千葉県公募債	0.0950	100,000	99,716 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,607 2026/04/24
9回	東京都公募債 20年	2.4400	200,000	210,298 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,224 2026/06/25
1 6 0回	共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	497,755 2026/07/24

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
<b>(地方債証券)</b>				
1回	兵庫県公募債 15年	1.6600	200,000	206,898 2026/07/29
2 8年度 6回	北海道公募債	0.0700	100,000	99,557 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募債	0.0450	100,000	99,497 2026/09/18
1 0回	東京都公募債 20年	2.3300	300,000	316,152 2026/09/18
4回	京都市公募債 20年	2.5100	100,000	105,820 2026/09/18
4 1 3回	大阪府公募債 10年	0.0210	100,000	99,385 2026/10/28
1 9 0回	大阪府公募債 5年	0.0010	300,000	297,792 2026/12/25
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	498,905 2027/01/25
令和3年度 3回	仙台市公募債 5年	0.0010	300,000	297,768 2027/01/28
2 8年度 8回	福岡県公募債	0.2400	100,000	99,941 2027/02/24
1 6 9回	共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	498,950 2027/04/23
4 1 9回	大阪府公募債 10年	0.1960	100,000	99,713 2027/04/27
2回	静岡県公募債 15年	1.4060	100,000	103,695 2027/06/25
5回	兵庫県公募債 12年	0.6870	100,000	101,282 2027/07/07
1 7 3回	共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,672 2027/08/25
2 9年度 4回	大阪市公募債	0.1500	200,000	198,716 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,375 2027/09/24
2 4年度 1回	福岡県公募債 15年	1.3290	100,000	103,700 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,513 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,510 2028/02/25
2 9年度 6回	広島市公募債	0.2300	300,000	298,389 2028/02/25
2 9年度 1 3回	京都府公募債	0.2000	109,330	108,537 2028/03/16
5回	兵庫県公募債 15年	1.3100	300,000	311,415 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募債	0.2200	110,000	109,153 2028/06/20
4回	静岡県公募債 15年	1.3380	100,000	104,014 2028/06/23
3 0年度 8回	北海道公募債	0.2490	400,000	396,768 2028/08/31
3 0年度 7回	神戸市公募債 30年	0.2540	300,000	297,681 2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募債	0.1850	200,000	197,832 2028/09/20
7回	静岡県公募債 20年	2.3200	300,000	325,803 2028/09/21
3 0年度 3回	広島県公募債	0.2540	100,000	99,224 2028/09/25
3 0年度 3回	堺市公募債	0.1950	100,000	98,742 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募債	0.1350	200,000	197,008 2028/12/20
2 0回 2号	福岡県公募債	2.0500	100,000	107,617 2028/12/20
6回	大阪市公募債 20年	2.2100	200,000	216,702 2028/12/20
1 7回	横浜市公募債 20年	2.0700	100,000	107,737 2028/12/20
6回	北九州市公募債 20年	2.0300	100,000	107,471 2028/12/20
3 0年度 6回	福岡県公募債	0.2000	200,000	197,622 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,855 2028/12/25
3 0年度 1 4回	北海道公募債	0.1950	400,000	394,936 2028/12/28
1 8回	東京都公募債 20年	2.2200	100,000	108,736 2029/03/19
3 0年度 1 9回	愛知県公募債	0.1150	200,000	196,408 2029/03/28
3 0年度 3回	岡山県公募債 10年	0.1500	200,000	196,756 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	294,294 2029/05/25
6回	川崎市公募債 20年	2.2100	200,000	217,928 2029/05/25
令和元年度 1回	福岡県公募債	0.0290	200,000	195,300 2029/06/21
9回	兵庫県公募債 15年	1.0200	100,000	102,798 2029/07/13
1 1回	神奈川県公募債 20年	2.0800	100,000	108,530 2029/07/20



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	
196回 共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	488,870	2029/07/25
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	195,152	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	195,262	2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	390,400	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	195,074	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	109,761	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	195,662	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	195,830	2030/01/30
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	110,220	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	97,629	2030/02/25
802回 東京都公募公債	0.1300	400,000	391,140	2030/03/19
511回 名古屋市長公募公債 10年	0.0750	200,000	194,898	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募公債	0.1350	400,000	390,784	2030/04/12
令和2年 2回 大阪府公募公債	0.1310	300,000	292,668	2030/05/22
9回 埼玉県公募公債 20年	2.1500	100,000	110,017	2030/05/24
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	203,708	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	97,296	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募公債	0.1350	100,000	97,228	2030/10/23
36回2年 宮城県公募公債 10年	0.1350	250,000	242,980	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
22年度14回 愛知県公募公債	2.0870	300,000	330,165	2030/12/13
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	220,734	2030/12/17
813回 東京都公募公債	0.1790	300,000	292,077	2030/12/20
16回 神奈川県公募公債 20年	2.0900	300,000	330,453	2031/01/24
464回 大阪府公募公債 10年	0.0720	200,000	192,918	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募公債	0.1450	100,000	96,870	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募公債	0.2140	200,000	194,634	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募公債	0.2140	200,000	194,680	2031/03/19
251回 神奈川県公募公債 10年	0.1990	200,000	194,474	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募公債	0.1400	200,000	193,670	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	0.1900	200,000	194,180	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募公債	0.1750	100,000	96,880	2031/04/25
467回 大阪府公募公債 10年	0.1640	200,000	193,604	2031/04/28
469回 大阪府公募公債 10年	0.1280	200,000	192,658	2031/06/27
11回 北九州市公募公債 20年	2.0190	300,000	329,586	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公募公債	0.1050	200,000	191,810	2031/09/25
472回 大阪府公募公債 10年	0.1000	200,000	191,586	2031/09/29
474回 大阪府公募公債 10年	0.1190	300,000	287,223	2031/11/28
19回 神奈川県公募公債 20年	1.8180	100,000	108,645	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	482,465	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	480,210	2032/03/25
258回 神奈川県公募公債 10年	0.2900	300,000	289,497	2032/06/18
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	1.6350	300,000	321,906	2032/08/16
10回 大阪府公募公債 20年	1.7200	200,000	215,816	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募公債	1.7110	200,000	215,950	2032/12/17
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	102,889	2033/04/15

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 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	106,953	2033/05/20
1回 東京都公募公債 30年	2.2100	200,000	224,866	2033/06/20
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	318,219	2034/05/08
26年度4回 愛知県公募公債 20年	1.5420	200,000	212,100	2034/05/15
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	105,940	2034/05/26
16回 名古屋市長公募公債 20年	1.5200	100,000	105,842	2034/06/09
5回 群馬県公募公債 20年	1.5290	100,000	105,941	2034/06/16
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	105,799	2034/06/20
31回 東京都公募公債 20年	1.2380	200,000	205,728	2034/09/20
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	101,888	2035/02/16
2回 横浜市公募公債 30年	2.4900	100,000	115,694	2035/03/20
18回 千葉県公募公債 20年	1.1380	100,000	101,490	2035/04/13
17回 名古屋市長公募公債 20年	1.2030	100,000	102,088	2035/05/28
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	101,743	2035/09/28
14回 大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	93,216	2036/09/29
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	91,915	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	117,612	2037/03/19
29年度2回 広島市公募公債	0.6160	200,000	185,874	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	277,719	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	92,618	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募公債	0.7010	200,000	184,544	2038/10/19
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	0.2860	100,000	85,242	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	113,464	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募公債	2.2800	100,000	112,418	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募公債	0.4640	100,000	85,941	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	109,178	2041/09/20
5回 川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	108,991	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	109,203	2042/09/19
14回 東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	107,627	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	147,594	2045/06/20
27年度2回 広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	81,807	2046/03/22
6回 埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	171,040	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公募公債	0.3690	300,000	212,850	2049/06/18
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	0.4320	200,000	144,450	2049/06/18
12回 埼玉県公募公債 30年	0.4740	300,000	217,158	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	151,146	2051/06/20
小 計	-	29,139,330	29,000,791	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
21回 政保中部国際空港債	0.4500	100,000	100,401	2025/03/17
24回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4500	500,000	502,040	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,349	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	409,928	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	100,571	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4400	100,000	100,469	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,706	2025/09/19
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	298,986	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	100,443	2025/11/20

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	
2 3 回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	103,358	2025/12/19
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	102,881	2025/12/19
F 5 3 8 回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	497,820	2025/12/25
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,648	2026/03/13
3 3 回 政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	298,941	2026/03/16
8 7 回 中日本高速道路債券	0.0600	400,000	397,924	2026/03/18
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	104,754	2026/03/20
2 7 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	298,920	2026/03/31
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,599	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	398,380	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	103,368	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
3 2 5 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	309,873	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,662	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	99,707	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	206,076	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	299,007	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	797,536	2027/04/30
9 6 回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,990	2027/05/28
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	198,316	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,661	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,939	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	99,449	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	103,914	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	296,307	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	298,044	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	99,208	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	206,138	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	214,862	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	102,925	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	327,294	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	328,032	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,900	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	217,514	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	109,439	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	101,254	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,884	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	216,362	2030/10/29
1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	541,375	2030/10/31
1 2 1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	109,893	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	192,776	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	383,484	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	108,901	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	108,696	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	216,450	2031/12/26
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	384,036	2032/04/14

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	
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	107,062	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	107,963	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	107,271	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	214,502	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	105,383	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	586,595	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	105,372	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	105,597	2034/04/28
3 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	520,115	2034/09/28
4 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	298,458	2035/01/26
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	306,267	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	100,422	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	102,214	2035/06/20
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	204,606	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	103,148	2035/06/29
第 2 6 2 回 政保道路債	1.1090	500,000	504,910	2035/11/30
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,802	2036/06/20
2 8 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,272	2036/08/29
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,194	2037/04/28
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	187,104	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	233,730	2037/09/18
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,332	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	90,651	2038/04/20
F 1 7 4 回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	323,085	2038/05/28
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,457	2038/09/17
5 0 回 高速道路機構債	0.5000	300,000	261,801	2039/03/18
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	249,837	2039/09/28
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	423,105	2040/04/24
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	299,532	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	105,683	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	39,840	39,922	2041/03/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	262,347	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	14,543	15,049	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	91,485	95,618	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	137,552	142,813	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	97,988	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	19,385	20,065	2045/07/10
1 回 高速道路機構債	2.9900	300,000	365,850	2045/09/20
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	190,616	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	90,510	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	93,062	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	16,717	17,291	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	19,533	20,123	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	20,588	21,207	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	176,331	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	25,093	25,777	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	61,990	63,137	2047/09/10

銘 柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
3 6 回 高速道路機構債	2.8400	300,000	357,984	2048/03/20
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	27,869	28,479	2048/09/10
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	34,215	34,555	2049/03/10
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	34,841	35,184	2049/05/10
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	38,462	38,743	2049/07/10
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	39,819	39,807	2049/11/10
3 9 8 回 政保道路債	0.4220	300,000	215,955	2049/12/28
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	45,186	44,313	2050/02/10
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 3 0 年	0.5170	300,000	218,448	2050/04/28
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	50,831	50,142	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	76,186	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	152,808	2050/06/20
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	52,733	52,311	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	148,552	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	150,504	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	199,941	190,849	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	67,846	65,087	2052/02/10
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	67,335	64,691	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	67,696	64,966	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	211,506	201,639	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	211,575	201,595	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	144,312	137,350	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	215,997	205,032	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	214,077	203,291	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	373,440	355,589	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	74,406	70,786	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	76,806	72,208	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	248,163	231,548	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	97,883	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	330,528	309,275	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	254,616	238,524	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	260,364	243,979	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	794,556	742,520	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	135,102	2061/02/28
小 計	-	27,236,846	27,002,386	-
<b>(金融債券)</b>	%	千円	千円	
い第 8 4 3 号 利付商工債	0.1200	100,000	99,735	2025/08/27
3 6 9 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0600	400,000	398,876	2025/08/27
い第 8 5 1 号 利付商工債	0.0900	300,000	298,101	2026/04/27
3 7 7 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0400	300,000	298,296	2026/04/27
い第 8 5 4 号 利付商工債	0.0800	300,000	297,708	2026/07/27
い第 8 5 5 号 利付商工債	0.0800	200,000	198,394	2026/08/27
小 計	-	1,600,000	1,591,110	-
<b>(普通社債券)</b>	%	千円	千円	
1 0 回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,381	2025/02/28
2 6 回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	100,504	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	199,544	2025/06/11

銘 柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(普通社債券)</b>	%	千円	千円	
1 2 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	100,653	2025/06/20
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	307,218	2025/06/20
4 9 7 回 関西電力社債	1.0020	100,000	100,872	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	204,598	2025/06/20
1 2 回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,596	2025/07/09
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	205,810	2025/09/19
2 7 回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,236	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	199,314	2025/12/19
2 6 回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,672	2026/03/18
4 2 回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,504	2026/03/24
9 6 回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,312	2026/04/15
1 6 3 回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	298,002	2026/04/15
2 8 回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	297,675	2026/04/21
4 9 3 回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,446	2026/05/25
1 0 6 回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,866	2026/05/26
2 4 回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,476	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	99,148	2026/06/03
3 5 回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	297,507	2026/06/05
1 1 回 グレディ・アグリコル・エス・エー・限社債 (2016)	0.4000	100,000	99,016	2026/06/10
5 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,523	2026/06/19
7 9 回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	298,149	2026/06/19
8 3 回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,766	2026/06/19
6 1 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,800	2026/06/19
6 9 回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,672	2026/06/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	125,644	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	101,459	2026/06/25
9 0 回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	198,712	2026/07/27
2 0 回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	297,354	2026/07/27
3 回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	296,466	2026/09/04
9 1 回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	496,400	2026/09/17
6 2 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,395	2026/09/18
1 7 回 パナソニック社債	0.4700	100,000	99,897	2026/09/18
2 7 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,732	2026/10/16
4 8 8 回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,574	2026/10/23
3 3 回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	299,535	2026/12/14
3 4 回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	199,972	2027/02/16
1 2 回 リソナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	104,231	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	105,786	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	299,376	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	299,703	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,262	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	298,335	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	106,514	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,996	2027/09/24
2 5 回 フランス相互証券銀行 (BFMC) 円債債 (2017)	0.5100	300,000	295,200	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,148	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	197,394	2027/10/25

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	99,222	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	296,820	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,744	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,284	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,098	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	98,784	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	107,938	2029/03/21
2 3 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	98,027	2029/04/12
1 4 回 プリザーストン社債	0.3750	300,000	294,570	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,704	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	392,104	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	390,344	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	194,654	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	290,241	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	193,470	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	108,359	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	195,508	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	97,017	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	97,265	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	194,260	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	390,836	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	97,185	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	292,026	2030/07/16
3 1 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	193,402	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	193,926	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	388,756	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,357	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	290,607	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	288,195	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	217,508	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	192,236	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	187,466	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	95,906	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	287,508	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	284,229	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	286,134	2031/09/19

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 3 6 回 東北電力社債	0.2900	300,000	284,712	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	473,415	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	190,592	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	193,142	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	288,636	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	193,290	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	291,132	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	93,318	2036/06/02
2 3 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	181,972	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	181,886	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	91,027	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,425	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	90,459	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	177,542	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	89,098	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	181,828	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	88,282	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,864	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,896	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	170,884	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	82,501	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	84,566	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,514	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,008	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	82,981	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	91,760	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	84,283	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	74,850	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	146,124	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	191,754	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	68,471	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	66,718	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	68,042	2060/12/17
小 計	-	24,520,000	23,641,007	-
合 計	-	547,081,176	532,975,004	-

## ■投資信託財産の構成

2024年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	532,975,004	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,195,447	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	535,170,451	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

(2024年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	535,170,451,990円		
コ ー ー ン 等	1,146,537,036		
公 社 債(評価額)	532,975,004,601		
未 収 利 息	851,415,151		
前 払 金	197,495,202		
(B) 負 債	127,352,000		
未 払 金	127,352,000		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	535,043,099,990		
元 本	433,635,920,893		
次 期 繰 越 損 益	101,407,179,097		
(D) 受 取 権 益 総 額	433,635,920,893円		
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,393円		
(注1) 期首元本額	446,785,885,792円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,203,233,548円
追加設定元本額	581,209,223,036円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	40,681,178円
一部解約元本額	594,359,187,935円	Oneグローバル最適化バラン (安定型) <ラップ向け>	165,621,139円
(注2) 期末における元本の内訳		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)	1,183,200,695円
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	26,445,559,786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)	1,182,101,124円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	56,606,049円	マルチアセット・インカム戦略ファンド2020-08 (適格機関投資家限定)	1,143,992,121円
M I T O ラップ型ファンド (中立的型)	87,780,257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)	711,889,754円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	46,315,205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)	1,156,117,973円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	777,318,271円	インカム重視マルチアセット運用ファンド1   2021-04 (適格機関投資家限定)	3,005,245,833円
グローバル8資産ラップファンド (中立的型)	271,566,704円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式・債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	1,992,568,129円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	40,009,486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)	1,048,536,393円
たわらノーロード 国内債券	19,198,371,011円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式・債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	2,040,423,193円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	5,643,042,131円	予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	1,944,132,777円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,562,213,631円	D I A M国内債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	10,164,316,653円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,036,245,918円	Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,179,872,920円
たわらノーロード バランス (積極型)	418,452,135円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	2,899,325,828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)	192,215,501円	A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	597,580,172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)	2,441,981,254円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	267,019,349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)	2,731,291,553円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI   I (適格機関投資家限定)	2,397,299,626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)	824,901,392円	One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)	2,408,636,925円
たわらノーロード 最適化バラン (保守型)	243,747円	One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)	2,381,224,582円
たわらノーロード 最適化バラン (安定型)	37,274,547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)	1,953,854,751円
たわらノーロード 最適化バラン (成長型)	20,761,641円	リスコントロール世界8資産バラン (F O F s 用) (適格機関投資家専用)	38,996,223円
たわらノーロード 最適化バラン (安定成長型)	193,622,319円	A M O n e コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	465,443,530円
たわらノーロード 最適化バラン (成長型)	6,019,391円	D I A Mグローバル・バランファンド25VA (適格機関投資家限定)	149,736,384円
たわらノーロード 最適化バラン (積極型)	62,284円	D I A Mグローバル・バランファンド50VA (適格機関投資家限定)	96,780,040円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,288,509,146円	D I A M国際分散バランファンド30VA (適格機関投資家限定)	21,757,666円
Oneグローバルバラン	99,032,940円	D I A M国際分散バランファンド50VA (適格機関投資家限定)	57,519,512円
D I A Mバラン・ファンド<DC年金>1 安定型	10,956,808,045円	D I A M国内重視バランファンド30VA (適格機関投資家限定)	30,515,732円
D I A Mバラン・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	16,342,447,363円	D I A M国内重視バランファンド50VA (適格機関投資家限定)	383,617円
D I A Mバラン・ファンド<DC年金>3 成長型	7,495,480,579円	D I A M世界バランファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,811,312円
D I A M DCバラン30インデックスファンド	2,655,296,811円	D I A M世界バランファンド50VA (適格機関投資家限定)	93,208,060円
D I A M DCバラン50インデックスファンド	2,757,571,061円	D I A Mバランファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,672,002,806円
D I A M DCバラン70インデックスファンド	520,501,398円	D I A Mバランファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,146,463,178円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	74,055,112円	D I A Mバランファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,390,842,814円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,816,801,094円	D I A Mグローバル・アセット・バラン (適格機関投資家限定)	56,186,546円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,416,875円	D I A Mグローバル・アセット・バランVA2 (適格機関投資家限定)	133,021,861円
D I A M DC 8資産バランファンド (新興国10)	5,297,839,731円	D I A M アクサ グローバル バランファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,599,270,535円
D I A M DC 8資産バランファンド (新興国20)	2,349,035,825円	D I A M世界アセットバランファンドVA (適格機関投資家向け)	102,733,521円
D I A M DC 8資産バランファンド (新興国30)	482,650,017円	D I A M世界バランファンド55VA (適格機関投資家限定)	576,326円
投資のソムリエ	90,500,056,135円	D I A M世界アセットバランファンド 2VA (適格機関投資家限定)	1,492,236,253円
グループコントロール	1,148,797,889円	D I A M世界アセットバランファンド40VA (適格機関投資家限定)	29,216,169円
投資のソムリエ<DC年金>	8,880,659,007円	D I A M世界アセットバランファンド25VA (適格機関投資家限定)	276,501,966円
D I A M 8資産バランファンドN<DC年金>	6,325,921,180円	D I A M世界アセットバランファンド 3VA (適格機関投資家限定)	483,425,446円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,157,585,678円	D I A M世界アセットバランファンド 4VA (適格機関投資家限定)	784,416,491円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,420,751,107円	D I A M世界バラン25VA (適格機関投資家限定)	205,921,080円
リスク抑制世界8資産バランファンド	34,063,239,343円	D I A M国内バラン30VA (適格機関投資家限定)	58,717,183円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	514,904,079円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	387,569,601円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	264,258,876円	動的パッケージファンド<DC年金>	213,242,040円
リスク抑制世界8資産バランファンド (DC)	91,237,587円	コア資産形成ファンド	109,306,062円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,029,090,803円	たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	21,839,360,333円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,536,190,751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]	24,944,266,426円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,558,314,912円	M H A M日本債券バッシブファンド [適格機関投資家限定]	18,573,817,425円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,200,480,373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]	117,422,889円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	679,094,815円	期末元本合計	433,635,920,893円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	280,353,329円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	172,141,111円		

## ■損益の状況

当期 自2023年2月15日 至2024年2月14日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益	3,407,110,674	円
受	取 利 息	3,409,137,096	
支	払 利 息	△2,026,422	
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△9,054,042,305	
売	買 益	4,732,773,783	
売	買 損	△13,786,816,088	
(C) 当	期 損 益 金(A+B)	△5,646,931,631	
(D) 前	期 繰 越 損 益 金	107,728,829,513	
(E) 解	約 差 損 益 金	△145,497,077,749	
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金	144,822,358,964	
(G) 合	計(C+D+E+F)	101,407,179,097	
次	期 繰 越 損 益 金(G)	101,407,179,097	

(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21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024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21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (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
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
17期 (2020年2月21日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	—	百万円 130,803
18期 (2021年2月22日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—	137,037
19期 (2022年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—	141,964
20期 (2023年2月21日)	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	—	186,822
21期 (2024年2月21日)	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	—	260,393

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

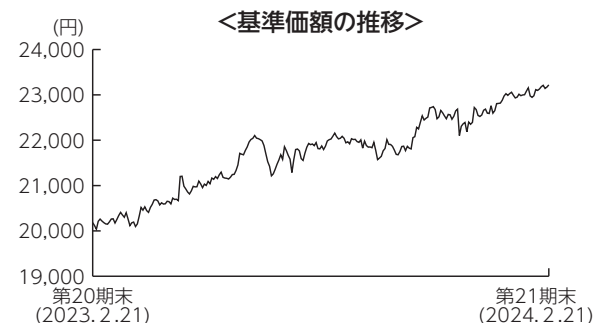
年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス ( 除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023 年 2 月 21 日	円 20,182	% -	ポイント 126,494.96	% -	% 99.0	% -
2 月 末	20,261	0.4	126,903.56	0.3	98.9	-
3 月 末	20,517	1.7	128,532.24	1.6	98.7	-
4 月 末	20,668	2.4	129,370.99	2.3	98.6	-
5 月 末	21,198	5.0	132,828.99	5.0	98.8	-
6 月 末	22,045	9.2	138,284.08	9.3	98.7	-
7 月 末	21,569	6.9	135,227.94	6.9	98.7	-
8 月 末	22,157	9.8	138,880.03	9.8	98.9	-
9 月 末	21,834	8.2	136,810.50	8.2	98.6	-
10 月 末	21,807	8.1	136,724.14	8.1	98.7	-
11 月 末	22,569	11.8	141,488.31	11.9	98.5	-
12 月 末	22,596	12.0	141,801.08	12.1	98.5	-
2024 年 1 月 末	22,998	14.0	144,118.59	13.9	99.4	-
(期 末) 2024 年 2 月 21 日	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-

(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（2023年2月22日から2024年2月21日まで）

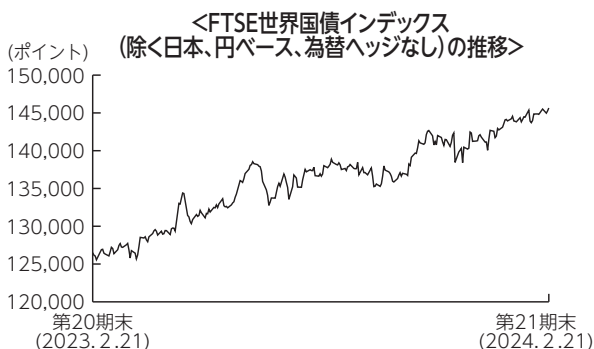


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下（価格は上昇）したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドル／円については日銀が金融緩和を継続する中、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを継続したことを受け、日米金利差が意識され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、米国債利回りは上昇、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドイツ債については、金融引き締め長期化観測が高まり上昇したのちに、ユーロ圏の景気懸念やインフレの鈍化などから利回りは低下しました。

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 R Bが金融引き締めを継続する中、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

## ポートフォリオについて

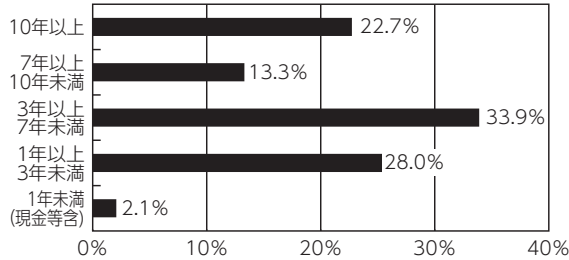
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

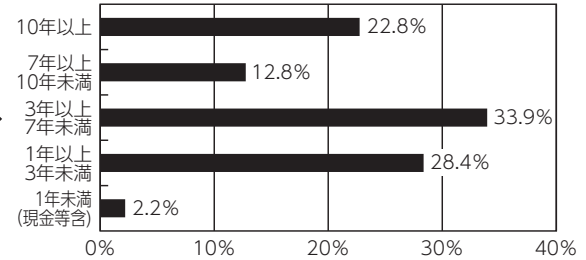
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○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	49.5%	50.0%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
計	51.6%	52.0%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.9%	1.9%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.4%	8.4%	0.0%
ドイツ	6.5%	6.4%	0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.5%	7.6%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	5.0%	5.0%	△0.0%
ユーロ計	33.1%	33.2%	△0.1%
デンマーク	0.3%	0.3%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	4.8%	4.7%	0.1%
ポーランド	0.4%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	39.0%	39.1%	△0.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.6%	1.6%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	4.4%	4.8%	△0.4%
シンガポール	0.5%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.6%	△0.0%
計	7.2%	7.6%	△0.4%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.0%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

#### 期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	46.7%	47.2%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	48.7%	49.2%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.0%
計	0.8%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.7%	1.8%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.0%	8.1%	△0.1%
ドイツ	6.3%	6.3%	△0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.3%	7.3%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
ユーロ計	31.8%	32.1%	△0.3%
デンマーク	0.3%	0.3%	△0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	5.2%	5.2%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	38.1%	38.5%	△0.4%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.3%	1.4%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	8.3%	8.5%	△0.2%
シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	10.7%	11.0%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.3%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

(注) 世界国債インデックスとはFTSE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15.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークと同程度となり、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

## 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 (保 管 費 用)	3円	0.015%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(そ の 他)	(3)	(0.014)	
合 計	(0)	(0.001)	
	3	0.015	
期中の平均基準価額は21,728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 (2023年2月22日から2024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 459,048	千アメリカ・ドル 331,987				
	カ	ナ	ダ		国 債 証 券	千カナダ・ドル 25,463	千カナダ・ドル 17,904				
	オ	ス	ト	ラ	リ	ア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 16,897	千オーストラリア・ドル 13,157		
	シ	ン	ガ	ポ	ー	ル	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 3,224	千シンガポール・ドル 2,464		
	ニ	ュ	ー	ジ	ー	ラ	ン	ド	国 債 証 券	千ニュージーランド・ドル 2,597	千ニュージーランド・ドル 989
	イ	ギ	リ	ス		国 債 証 券	千イギリス・ポンド 40,138	千イギリス・ポンド 22,621			
	イ	ス	ラ	エ	ル	国 債 証 券	千イスラエル・シュケル 7,410	千イスラエル・シュケル 3,549			
	デ	ン	マ	ー	ク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 11,286	千デンマーク・クローネ 12,347			
	ノ	ル	ウ	ェ	ー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 13,227	千ノルウェー・クローネ 10,083			
	ス	ウ	ェ	ー	デ	ン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 9,524	千スウェーデン・クローナ 2,541		
	メ	キ	シ	コ		国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 113,030	千メキシコ・ペソ 81,670			
	中				国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 730,187	千オフショア・人民元 137,577			
	マ	レ	ー	シ	ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 11,910	千マレーシア・リンギット 7,301			
	ポ	ー	ラ	ン	ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 16,614	千ポーランド・ズロチ 10,609			
国	ユ ー ロ	ア	イ	ル	ラ	ン	ド	国 債 証 券	千ユーロ 3,525	千ユーロ 2,887	
		オ	ラ	ン	ダ		国 債 証 券	11,284	8,015		
		ベ	ル	ギ	ー		国 債 証 券	12,412	9,503		
		フ	ラ	ン	ス		国 債 証 券	70,879	54,149		
		ド	イ	ツ			国 債 証 券	54,900	40,085		
		ス	ペ	イ	ン		国 債 証 券	40,842	30,090		
		イ	タ	リ	ア		国 債 証 券	62,054	47,199		
		フ	ィ	ン	ラ	ン	ド	国 債 証 券	3,929	2,451	
オ	ー	ス	ト	リ	ア	国 債 証 券	10,493	7,197			

(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 (2023年2月22日から2024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 916,450	千アメリカ・ドル 810,479	千円 121,701,636	% 46.7	% -	% 19.6	% 19.4	% 7.8	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 50,260	千カナダ・ドル 46,076	千円 5,115,401	2.0	-	1.1	0.5	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,065	千オーストラリア・ドル 35,489	千円 3,492,489	1.3	-	0.9	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,855	千シンガポール・ドル 9,323	千円 1,041,728	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,570	千ニュージーランド・ドル 6,419	千円 594,617	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 86,324	千イギリス・ポンド 70,878	千円 13,437,202	5.2	-	3.5	1.1	0.6	
イスラエル	千イスラエル・シケル 22,320	千イスラエル・シケル 19,889	千円 810,730	0.3	-	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 32,720	千デンマーク・クローネ 30,676	千円 668,129	0.3	-	0.2	0.0	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,620	千ノルウェー・クローネ 29,940	千円 429,040	0.2	-	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 37,140	千スウェーデン・クローナ 35,693	千円 517,914	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 273,005	千メキシコ・ペソ 250,053	千円 2,201,447	0.8	-	0.5	0.3	0.0	
中 国	千オフショア・人民元 1,000,520	千オフショア・人民元 1,032,940	千円 21,528,239	8.3	-	3.7	3.7	0.8	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,060	千マレーシア・リンギット 38,987	千円 1,219,734	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,150	千ポーランド・ズロチ 35,744	千円 1,344,336	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	10,200	9,105	1,478,204	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
オランダ	25,700	23,264	3,776,775	1.5	-	0.8	0.5	0.1	
ベルギー	30,390	27,580	4,477,411	1.7	-	1.2	0.5	0.1	
フランス	141,120	128,977	20,938,250	8.0	-	4.8	2.6	0.6	
ドイツ	108,580	100,614	16,333,748	6.3	-	3.3	2.1	0.8	
スペイン	82,390	77,154	12,525,285	4.8	-	2.7	1.6	0.6	
イタリア	122,640	116,425	18,900,577	7.3	-	4.1	2.5	0.7	
フィンランド	9,630	8,170	1,326,408	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
オーストリア	21,230	18,965	3,078,798	1.2	-	0.6	0.5	0.1	
合 計	-	-	千円 256,938,107	98.7	-	48.9	36.6	13.1	

(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) 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	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 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,460	2,371	356,089	2026/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	5,740	5,288	794,126	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	4,000	600,691	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	725	108,912	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,819	573,587	2028/01/31
US T N/B 4.125 01/31/25	国債証券	4.1250	1,800	1,785	268,146	2025/01/31
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	3,400	3,261	489,813	2030/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	5,700	5,256	789,361	2026/01/31
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,380	2,310	346,875	2028/01/31
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	3,000	2,968	445,728	2027/01/15
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	4,300	4,243	637,175	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,400	2,464	370,083	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,360	1,120	168,216	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,540	1,255	188,501	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,370	973	146,217	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,000	903	135,633	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,860	1,992	299,197	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	500	515	77,347	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,230	1,267	190,255	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,424	213,888	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	4,610	3,530	530,129	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	5,000	3,219	483,415	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	603	90,611	2038/02/15
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	3,800	3,277	492,149	2053/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,690	1,723	258,845	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,636	395,854	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,780	3,405	511,431	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	6,090	5,751	863,678	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,810	2,020	303,350	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,360	1,825	274,185	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,037	306,020	2048/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,981	297,545	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,830	4,477	672,407	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,540	4,283	643,206	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,556	534,113	2027/02/15
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,189	328,837	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,917	287,912	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	9,690	7,896	1,185,695	2031/02/15
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	3,500	3,186	478,547	2043/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	5,100	3,485	523,327	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	4,420	2,712	407,376	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	8,280	6,939	1,041,964	2032/02/15
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	7,900	7,436	1,116,617	2033/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,000	150,171	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,830	4,128	619,966	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	5,210	4,844	727,417	2027/02/28
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,867	430,577	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	4,690	4,143	622,257	2028/02/29

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,700	4,196	630,186	2029/02/28	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,766	715,767	2026/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,397	660,307	2025/02/15	
US T N/B 4.0 02/28/30	国債証券	4.0000	3,000	2,955	443,775	2030/02/28	
US T N/B 4.0 02/29/28	国債証券	4.0000	3,200	3,163	474,993	2028/02/29	
US T N/B 4.0 02/15/26	国債証券	4.0000	4,000	3,956	594,070	2026/02/15	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,746	262,297	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,300	3,150	473,093	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	3,200	2,856	428,894	2027/03/31	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,726	409,343	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	4,610	4,084	613,360	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	5,720	5,290	794,463	2026/03/31	
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	4,000	3,655	548,928	2029/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	4,000	3,786	568,508	2027/03/31	
US T N/B 3.625 03/31/30	国債証券	3.6250	3,300	3,183	478,087	2030/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,868	580,908	2025/03/15	
US T N/B 3.625 03/31/28	国債証券	3.6250	3,800	3,703	556,131	2028/03/31	
US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	4.6250	3,630	3,634	545,751	2026/03/15	
US T N/B 3.875 03/31/25	国債証券	3.8750	1,050	1,038	155,949	2025/03/31	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,954	293,521	2025/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	2,060	1,968	295,603	2026/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	5,100	4,508	677,014	2028/04/30	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,100	315,397	2027/04/30	
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,800	3,555	533,875	2029/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	6,000	5,533	830,889	2026/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/28	国債証券	3.5000	3,100	3,005	451,331	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,428	364,723	2025/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	6,000	5,713	857,953	2027/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	3,000	2,873	431,413	2030/04/30	
US T N/B 3.75 04/15/26	国債証券	3.7500	6,000	5,904	886,600	2026/04/15	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,925	439,288	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	839	126,116	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,210	1,197	179,777	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,630	1,601	240,549	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	869	130,615	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	933	140,155	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,790	268,860	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	3,696	555,136	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,201	180,401	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,290	1,011	151,893	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,251	187,879	2047/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,346	502,453	2052/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,730	1,226	184,132	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,224	334,027	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,015	302,659	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,600	3,435	515,839	2049/05/15	
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	3,510	3,029	454,981	2053/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	609	91,556	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	4,420	3,201	480,734	2041/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,823	574,086	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,594	689,924	2028/05/15	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,770	3,439	516,436	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,166	625,673	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	755	810	121,723	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	5,170	4,856	729,232	2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	8,380	4,185	628,531	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,250	2,135	320,676	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	8,740	7,316	1,098,697	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,532	230,147	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,143	472,092	2042/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	800	728	109,316	2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	8,050	7,264	1,090,860	2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	7,500	6,979	1,048,025	2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	2,980	2,632	395,230	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,140	3,652	548,447	2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	7,050	5,653	848,990	2030/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	4,910	4,651	698,405	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,065	460,240	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	5,630	5,177	777,521	2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	2,500	2,435	365,721	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	1,690	1,595	239,555	2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	3,500	3,397	510,121	2030/05/31
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	3,500	3,434	515,746	2026/05/15
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	2,200	2,145	322,144	2025/05/15
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	1,012	152,073	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	2,880	2,715	407,729	2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,448	367,718	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,265	490,340	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,293	494,529	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	4,200	4,057	609,214	2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	4,510	4,152	623,586	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,500	3,329	500,000	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	2,420	2,361	354,536	2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国債証券	4.0000	2,000	1,977	296,906	2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国債証券	4.1250	4,700	4,661	700,031	2026/06/15
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	5,700	5,531	830,535	2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,143	321,828	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,500	2,352	353,183	2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	9,270	8,049	1,208,687	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,304	496,221	2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	2,500	2,459	369,343	2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,563	535,067	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	3,070	2,827	424,508	2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国債証券	4.1250	2,500	2,484	373,061	2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	5,100	4,651	698,507	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,625	544,426	2027/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,124	469,137	2025/07/15
US T N/B 4.5 07/15/26	国債証券	4.5000	4,100	4,102	615,956	2026/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,220	1,105	165,966	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,198	179,897	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,240	957	143,852	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,684	252,930	2044/08/15



銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,480	1,492	224,181	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,287	193,397	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,810	3,522	528,927	2051/08/15
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	1,600	1,512	227,173	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,355	203,495	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	3,550	3,411	512,338	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,640	246,263	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	4,140	2,705	406,314	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	5,540	4,220	633,695	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	2,000	1,948	292,647	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,270	1,526	229,150	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,810	2,922	438,881	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,955	593,938	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,030	6,545	982,844	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	5,030	4,742	712,199	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,777	266,844	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,360	2,938	441,214	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,482	372,739	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	5,310	3,510	527,153	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,060	2,456	368,814	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	6,870	3,546	532,522	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	7,840	6,984	1,048,768	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	8,000	7,742	1,162,613	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,960	7,241	1,087,383	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	7,740	6,153	923,979	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	2,800	2,596	389,899	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,354	503,781	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,249	488,017	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,680	402,439	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,950	4,517	678,384	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,960	444,578	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,935	440,838	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,783	568,138	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国債証券	4.3750	4,000	3,991	599,431	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,703	255,861	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,810	3,312	497,388	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国債証券	4.6250	3,000	3,057	459,067	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,444	216,919	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	4,980	4,354	653,898	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,465	520,399	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	3,220	3,197	480,106	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	5,510	5,036	756,246	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,944	442,183	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	4,550	4,459	669,563	2029/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国債証券	4.6250	3,500	3,514	527,756	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	2,270	2,208	331,602	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,410	2,240	336,454	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,134	620,794	2028/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,187	478,590	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	4,490	4,118	618,411	2026/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,700	2,662	399,730	2029/10/31

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,340	3,315	497,919	2027/10/31	
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,714	557,809	2025/10/31	
US T N/B 4.625 10/15/26	国債証券	4.6250	3,400	3,415	512,877	2026/10/15	
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	4,000	3,972	596,451	2025/10/15	
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,350	1,406	211,165	2028/11/15	
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,200	2,334	350,598	2027/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,960	1,543	231,777	2044/11/15	
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,300	1,261	189,496	2040/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,197	179,882	2042/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	843	126,592	2041/11/15	
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,300	195,336	2043/11/15	
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,652	248,089	2047/11/15	
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	5,280	2,917	438,077	2050/11/15	
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	5,370	3,146	472,444	2051/11/15	
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	4,860	4,492	674,588	2052/11/15	
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	460	359	53,947	2045/11/15	
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	818	122,902	2046/11/15	
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	992	149,086	2039/11/15	
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,450	2,834	425,581	2048/11/15	
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,690	2,478	372,127	2049/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,120	4,916	738,276	2025/11/15	
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	5,480	5,213	782,857	2028/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,830	7,347	1,103,278	2026/11/15	
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,038	456,239	2027/11/15	
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,360	3,259	489,371	2025/11/30	
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	3,120	2,895	434,789	2042/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	4,320	2,717	408,105	2040/11/15	
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	500	512	76,927	2043/11/15	
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	2,923	438,985	2041/11/15	
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,680	252,318	2026/11/30	
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	7,600	7,507	1,127,285	2032/11/15	
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,850	2,497	375,063	2029/11/15	
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	2,000	2,033	305,294	2033/11/15	
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	8,590	6,959	1,044,999	2031/11/15	
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	9,480	7,624	1,144,902	2030/11/15	
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,403	511,082	2027/11/30	
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	4,700	4,317	648,244	2026/11/30	
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	5,000	4,406	661,701	2028/11/30	
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	5,190	4,815	723,118	2025/11/30	
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,800	2,742	411,825	2029/11/30	
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,300	3,248	487,727	2027/11/30	
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,559	534,542	2025/11/15	
US T N/B 4.625 11/15/26	国債証券	4.6250	3,900	3,919	588,620	2026/11/15	
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	3,000	2,894	434,704	2025/12/31	
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,962	294,640	2026/12/31	
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,566	535,578	2026/12/31	
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,600	4,022	603,948	2028/12/31	
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	4,000	3,701	555,861	2025/12/31	
US T N/B 3.875 12/31/29	国債証券	3.8750	2,800	2,741	411,628	2029/12/31	
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	4,020	3,497	525,216	2027/12/31	
US T N/B 4.375 12/15/26	国債証券	4.3750	4,800	4,796	720,289	2026/12/15	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,093	614,692	2025/12/15
US T N/B 3.875 12/31/27	国債証券	3.8750	4,600	4,527	679,794	2027/12/31
小 計	—	—	916,450	810,479	121,701,636	—
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,150	127,675	2025/02/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	676	75,148	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,306	145,062	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	910	844	93,769	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	1,630	1,619	179,792	2028/03/01
CANADA 3.0 04/01/26	国債証券	3.0000	1,400	1,370	152,122	2026/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,063	118,083	2025/04/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	1,700	1,608	178,594	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	818	90,862	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	716	79,595	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	630	728	80,894	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	740	790	87,730	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	930	871	96,783	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,283	142,538	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	504	56,015	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	530	498	55,311	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	2,350	2,051	227,786	2030/06/01
CANADA 2.75 06/01/33	国債証券	2.7500	1,180	1,109	123,221	2033/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	238,845	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,590	1,417	157,375	2032/06/01
CANADA 3.5 08/01/25	国債証券	3.5000	400	394	43,835	2025/08/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	2,310	2,180	242,092	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	1,050	1,015	112,775	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	2,670	2,484	275,819	2026/09/01
CANADA 3.25 09/01/28	国債証券	3.2500	1,200	1,181	131,149	2028/09/01
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	1,660	1,625	180,456	2025/10/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	800	806	89,588	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	850	756	83,977	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	3,460	2,590	287,617	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,180	1,515	168,246	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	339	37,706	2064/12/01
CANADA 2.75 12/01/55	国債証券	2.7500	300	263	29,268	2055/12/01
CANADA 3.25 12/01/33	国債証券	3.2500	2,100	2,056	228,316	2033/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	2,600	2,132	236,789	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,420	2,089	231,956	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,520	1,403	155,853	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	700	655	72,741	2029/12/01
小 計	—	—	50,260	46,076	5,115,401	—
<b>(オーストラリア)</b>		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	1,090	849	83,589	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	1,100	1,090	107,360	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,540	1,585	156,040	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	1,600	1,615	158,958	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	1,400	1,362	134,035	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	1,660	1,702	167,580	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	830	783	77,150	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,780	1,674	164,777	2028/05/21

銘柄	当	期				末		
		種	利	額	評		償	
					面			価
類	率	金額	外貨建金額	邦貨換算金額				
<b>(オーストラリア)</b>								
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,660	1,529	150,519	2030/05/21		
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	960	762	75,080	2041/05/21		
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	2,130	1,706	167,951	2032/05/21		
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,800	1,734	170,694	2034/05/21		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	820	716	70,462	2039/06/21		
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,010	1,689	166,222	2031/06/21		
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	650	563	55,483	2035/06/21		
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	2,520	1,420	139,792	2051/06/21		
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	2,615	2,408	237,000	2026/09/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	450	429	42,287	2028/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,430	1,380	135,820	2027/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,400	1,319	129,819	2029/11/21		
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,670	1,513	148,951	2033/11/21		
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,850	1,527	150,297	2032/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	2,470	1,969	193,799	2031/11/21		
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,460	1,372	135,065	2025/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,670	1,374	135,234	2030/12/21		
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	1,500	1,407	138,513	2034/12/21		
小計	—	—	40,065	35,489	3,492,489	—		
<b>(シンガポール)</b>								
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	810	90,501	2027/03/01		
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	460	441	49,339	2046/03/01		
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	840	672	75,082	2050/03/01		
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	660	636	71,104	2042/04/01		
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	340	334	37,399	2028/05/01		
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	780	769	85,999	2025/06/01		
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	590	576	64,404	2026/06/01		
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	640	635	70,970	2029/07/01		
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	190	174	19,487	2039/07/01		
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	840	760	84,946	2031/07/01		
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	125	127	14,224	2072/08/01		
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	890	816	91,260	2036/08/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	620	613	68,510	2030/09/01		
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	580	594	66,424	2033/09/01		
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	198	22,223	2027/09/01		
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	510	409	45,725	2051/10/01		
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	510	485	54,281	2026/11/01		
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	280	267	29,842	2025/11/01		
小計	—	—	9,855	9,323	1,041,728	—		
<b>(ニュージーランド)</b>								
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	800	793	73,529	2027/04/15		
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	450	406	37,662	2033/04/14		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	810	635	58,902	2037/04/15		
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	670	650	60,235	2025/04/15		
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	750	693	64,206	2029/04/20		
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	540	355	32,892	2051/05/15		
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	247	22,932	2041/05/15		
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	880	706	65,439	2031/05/15		
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	123	11,456	2034/05/15		
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	910	739	68,519	2032/05/15		
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	650	540	50,074	2028/05/15		

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ニュージーランド)</b>			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26		国債証券	0.5000	580	526	48,766	2026/05/15
小計		-	-	7,570	6,419	594,617	-
<b>(イギリス)</b>			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44		国債証券	3.2500	1,640	1,356	257,233	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国債証券	3.5000	1,550	1,324	251,087	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国債証券	4.0000	900	816	154,822	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国債証券	1.7500	1,130	658	124,799	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国債証券	3.7500	1,650	1,543	292,668	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国債証券	0.8750	1,350	664	125,901	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国債証券	1.1250	2,110	1,354	256,764	2039/01/31
UK TREASURY 4.625 01/31/34		国債証券	4.6250	400	416	78,930	2034/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国債証券	1.0000	2,470	1,970	373,512	2032/01/31
UK TREASURY 3.25 01/31/33		国債証券	3.2500	2,500	2,351	445,707	2033/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国債証券	0.5000	1,880	1,590	301,513	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国債証券	0.1250	1,340	1,152	218,484	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国債証券	0.2500	1,700	1,630	309,123	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国債証券	0.1250	1,750	1,617	306,579	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国債証券	4.1250	2,340	2,334	442,643	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国債証券	5.0000	1,485	1,488	282,244	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国債証券	4.2500	1,300	1,302	246,995	2036/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国債証券	4.2500	1,770	1,804	342,006	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国債証券	0.6250	1,060	1,008	191,181	2025/06/07
UK TREASURY 4.5 06/07/28		国債証券	4.5000	1,750	1,779	337,300	2028/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国債証券	1.5000	1,200	671	127,395	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国債証券	1.2500	1,730	839	159,095	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国債証券	3.7500	970	841	159,613	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国債証券	1.5000	1,210	612	116,163	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国債証券	1.7500	1,260	664	125,977	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国債証券	2.5000	1,250	790	149,810	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国債証券	3.5000	1,480	1,209	229,224	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国債証券	1.5000	1,900	1,785	338,431	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国債証券	1.2500	1,100	1,002	190,046	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国債証券	0.8750	2,100	1,577	299,050	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国債証券	0.2500	2,240	1,707	323,797	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国債証券	0.6250	1,650	1,119	212,208	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国債証券	4.2500	1,060	1,037	196,777	2039/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国債証券	2.0000	1,110	1,069	202,679	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国債証券	4.5000	1,200	1,235	234,298	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国債証券	1.7500	1,890	1,394	264,361	2037/09/07
UK TREASURY 3.75 10/22/53		国債証券	3.7500	1,800	1,553	294,531	2053/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国債証券	1.6250	1,270	659	124,953	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61		国債証券	0.5000	1,880	553	105,010	2061/10/22
UK TREASURY 4.0 10/22/63		国債証券	4.0000	820	741	140,616	2063/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国債証券	1.6250	830	380	72,117	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73		国債証券	1.1250	740	267	50,729	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国債証券	1.2500	1,750	1,062	201,452	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国債証券	0.6250	1,640	653	123,948	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国債証券	1.6250	1,030	929	176,235	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国債証券	0.8750	1,430	1,211	229,594	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国債証券	0.3750	1,390	1,103	209,195	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国債証券	0.3750	2,430	2,199	417,048	2026/10/22

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				期		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(イギリス)</b>		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	国債証券	3.5000	1,500	1,475	279,692	2025/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	980	1,066	202,208	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,380	1,433	271,745	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,745	1,738	329,574	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,280	1,217	230,757	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,112	1,051	199,340	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,310	1,318	249,993	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,770	1,722	326,463	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,495	1,566	297,060	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,317	1,247	236,498	2049/12/07
小計	—	—	86,324	70,878	13,437,202	—
<b>(イスラエル)</b>		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,410	1,557	63,474	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	1,430	1,340	54,621	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,810	1,561	63,652	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	1,660	1,573	64,133	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,401	97,869	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	2,300	1,845	75,210	2032/04/30
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,819	74,162	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	2,420	1,697	69,175	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,000	1,941	79,122	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	2,360	2,199	89,634	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	1,220	1,294	52,768	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	国債証券	2.8000	960	660	26,904	2052/11/29
小計	—	—	22,320	19,889	810,730	—
<b>(デンマーク)</b>		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	4,560	2,443	53,218	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,650	9,509	207,116	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	3,740	3,675	80,049	2025/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	4,850	4,516	98,367	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	5,140	4,627	100,786	2029/11/15
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	5,080	4,236	92,261	2031/11/15
DENMARK 2.25 11/15/33	国債証券	2.2500	1,700	1,667	36,328	2033/11/15
小計	—	—	32,720	30,676	668,129	—
<b>(ノルウェー)</b>		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	6,710	6,386	91,511	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	5,100	4,792	68,683	2027/02/17
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	1,130	1,099	15,759	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,924	27,576	2028/04/26
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	2,030	1,788	25,630	2032/05/18
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	4,610	3,978	57,006	2030/08/19
NORWAY 3.0 08/15/33	国債証券	3.0000	2,900	2,715	38,916	2033/08/15
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,920	2,627	37,652	2029/09/06
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,950	2,460	35,254	2031/09/17
NORWAY 3.5 10/06/42	国債証券	3.5000	2,200	2,166	31,049	2042/10/06
小計	—	—	32,620	29,940	429,040	—
<b>(スウェーデン)</b>		%	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	3,990	4,443	64,482	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	3,390	3,159	45,848	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	5,920	5,870	85,174	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	4,920	4,191	60,812	2031/05/12

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(スウェーデン)</b>			%	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 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	4,050	4,004	58,106	2032/06/01	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	8,210	7,852	113,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,960	3,622	52,565	2029/11/12	
SWEDEN 1.75 11/11/33	国債証券	1.7500	2,700	2,548	36,979	2033/11/11	
小計	—	—	37,140	35,693	517,914	—	
<b>(メキシコ)</b>			%	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	36,282	33,436	294,374	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	25,080	22,431	197,487	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	3,680	3,495	30,777	2025/03/06	
MEXICAN BONDS 03/01/29	国債証券	8.5000	9,500	9,173	80,763	2029/03/01	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	24,159	23,435	206,327	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,148	27,780	244,579	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	19,290	17,202	151,446	2033/05/26	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	28,146	26,588	234,081	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	13,290	11,397	100,340	2053/07/31	
MEXICAN BONDS 09/03/26	国債証券	7.0000	8,000	7,502	66,049	2026/09/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,707	21,151	186,219	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	19,561	17,001	149,680	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,631	128,813	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,803	51,092	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	10,035	9,020	79,413	2034/11/23	
小計	—	—	273,005	250,053	2,201,447	—	
<b>(中国)</b>			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	15,500	15,832	329,979	2032/02/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	国債証券	2.8800	11,200	11,589	241,546	2033/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	40,500	40,634	846,893	2025/02/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	19,100	21,625	450,709	2050/03/16	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	11,253	234,531	2029/03/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	3.0300	54,000	55,050	1,147,353	2026/03/11	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	2.8000	10,000	10,231	213,231	2030/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	15,820	17,880	372,661	2052/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	7,600	9,140	190,494	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	国債証券	3.1900	8,500	9,524	198,515	2053/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	25,100	25,320	527,716	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	18,500	19,263	401,475	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	9,000	9,195	191,659	2032/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	国債証券	2.6700	14,500	14,741	307,229	2033/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	54,000	55,641	1,159,653	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	国債証券	3.2900	4,000	4,205	87,647	2029/05/23	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	64,600	65,640	1,368,063	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	国債証券	2.3000	39,500	39,609	825,527	2026/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,500	177,163	2025/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	23,500	23,977	499,730	2027/06/04	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	22,000	22,447	467,837	2029/06/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	18,450	18,952	395,004	2026/06/06	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	国債証券	2.6200	10,000	10,119	210,916	2030/06/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	国債証券	3.8600	5,800	7,059	147,125	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	国債証券	2.4000	25,000	25,102	523,181	2028/07/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,567	428,669	2027/07/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	21,000	21,379	445,593	2032/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	20,000	20,016	417,187	2025/08/25	

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(中国)</b>			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26		国債証券	2.6900	60,600	61,382	1,279,310	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27		国債証券	3.5900	5,000	5,262	109,681	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26		国債証券	2.1800	42,000	41,999	875,345	2026/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50		国債証券	3.8100	17,500	21,268	443,269	2050/09/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32		国債証券	2.6000	18,300	18,441	384,348	2032/09/01
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30		国債証券	2.6000	3,000	3,034	63,243	2030/09/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29		国債証券	2.6200	18,000	18,257	380,521	2029/09/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52		国債証券	3.1200	9,500	10,348	215,677	2052/10/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51		国債証券	3.5300	12,450	14,536	302,960	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48		国債証券	4.0800	10,300	12,842	267,651	2048/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28		国債証券	2.9100	29,100	29,934	623,887	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27		国債証券	2.4400	21,000	21,134	440,477	2027/10/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32		国債証券	2.8000	31,300	32,050	667,976	2032/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31		国債証券	2.8900	15,100	15,568	324,466	2031/11/18
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30		国債証券	3.2700	3,000	3,166	65,990	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29		国債証券	3.1300	8,000	8,341	173,843	2029/11/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25		国債証券	2.2800	31,800	31,878	664,392	2025/11/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26		国債証券	2.3900	22,000	22,131	461,263	2026/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30		国債証券	2.5400	3,000	3,021	62,981	2030/12/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29		国債証券	2.7900	24,000	24,550	511,670	2029/12/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27		国債証券	3.2800	18,500	19,287	401,976	2027/12/03
小計		—	—	1,000,520	1,032,940	21,528,239	—
<b>(マレーシア)</b>			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27		国債証券	3.8920	1,000	1,011	31,652	2027/03/15
MALAYSIA 4.457 03/31/53		国債証券	4.4570	2,000	2,077	64,985	2053/03/31
MALAYSIA 4.736 03/15/46		国債証券	4.7360	300	324	10,155	2046/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国債証券	4.3920	1,050	1,070	33,485	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国債証券	4.4980	1,200	1,250	39,132	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国債証券	3.8440	1,660	1,655	51,799	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国債証券	4.7620	1,700	1,835	57,423	2037/04/07
MALAYSIA 2.632 04/15/31		国債証券	2.6320	1,100	1,020	31,914	2031/04/15
MALAYSIA 4.504 04/30/29		国債証券	4.5040	2,950	3,068	96,012	2029/04/30
MALAYSIA 3.502 05/31/27		国債証券	3.5020	650	650	20,346	2027/05/31
MALAYSIA 3.757 05/22/40		国債証券	3.7570	1,500	1,447	45,274	2040/05/22
MALAYSIA 4.254 05/31/35		国債証券	4.2540	1,400	1,437	44,977	2035/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28		国債証券	3.7330	2,000	2,008	62,822	2028/06/15
MALAYSIA 4.232 06/30/31		国債証券	4.2320	670	687	21,501	2031/06/30
MALAYSIA 4.065 06/15/50		国債証券	4.0650	1,700	1,664	52,076	2050/06/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48		国債証券	4.9210	1,990	2,203	68,947	2048/07/06
MALAYSIA 3.906 07/15/26		国債証券	3.9060	1,920	1,942	60,766	2026/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34		国債証券	3.8280	1,820	1,811	56,668	2034/07/05
MALAYSIA 3.582 07/15/32		国債証券	3.5820	1,400	1,372	42,924	2032/07/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29		国債証券	3.8850	700	707	22,148	2029/08/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25		国債証券	3.9550	1,950	1,964	61,467	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43		国債証券	4.9350	1,600	1,767	55,286	2043/09/30
MALAYSIA 4.696 10/15/42		国債証券	4.6960	960	1,035	32,410	2042/10/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26		国債証券	3.9000	1,660	1,679	52,550	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27		国債証券	3.8990	1,730	1,752	54,811	2027/11/16
MALAYSIA 4.642 11/07/33		国債証券	4.6420	1,450	1,540	48,191	2033/11/07
小計		—	—	38,060	38,987	1,219,734	—



銘柄	当期				期末	
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ポーランド)</b>		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	3,190	3,265	122,805	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,460	3,162	118,954	2028/04/25
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	5,440	4,178	157,143	2032/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	4,170	3,973	149,430	2025/04/25
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	3,650	3,511	132,070	2027/05/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	3,290	3,104	116,759	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	1,590	1,551	58,339	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,175	81,802	2027/07/25
POLAND 7.5 07/25/28	国債証券	7.5000	3,400	3,709	139,526	2028/07/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	2,000	1,767	66,476	2029/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	4,720	3,684	138,558	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,661	62,470	2026/10/25
小計	—	—	39,150	35,744	1,344,336	—
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	840	708	115,032	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	660	608	98,854	2031/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	590	602	97,848	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	169	27,533	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	650	472	76,713	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	290	257	41,861	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	960	951	154,412	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	710	664	107,847	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	678	110,182	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,120	1,079	175,166	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	780	678	110,181	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	286	46,572	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	420	389	63,203	2027/05/15
IRISH 3.0 10/18/43	国債証券	3.0000	210	211	34,264	2043/10/18
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	670	550	89,393	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	600	495	80,386	2032/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	350	300	48,749	2030/10/18
小計	—	—	10,200	9,105	1,478,204	—
<b>(ユーロ…オランダ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,320	1,495	242,756	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,710	1,708	277,407	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,430	688	111,827	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	1,090	1,202	195,264	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,320	1,489	241,846	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,310	1,301	211,215	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	990	675	109,626	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,310	929	150,963	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	660	563	91,466	2054/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,030	911	147,947	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,280	1,187	192,795	2027/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	2,180	2,065	335,374	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,820	1,727	280,449	2026/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,480	1,371	222,591	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,460	1,374	223,123	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,360	1,206	195,842	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	596	96,847	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,900	1,577	256,126	2031/07/15

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	国債証券	2.5000	350	346	56,179	2033/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	1,000	844	137,122	2032/07/15
小計	—	—	25,700	23,264	3,776,775	—
(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	1,600	1,776	288,389	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,450	235,491	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,105	179,418	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	930	1,013	164,453	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,570	1,867	303,248	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	1,110	973	158,033	2033/04/22
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	320	304	49,401	2039/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	640	683	110,954	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	920	664	107,920	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	960	686	111,405	2050/06/22
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	1,390	889	144,352	2053/06/22
BELGIUM 3.3 06/22/54	国債証券	3.3000	270	264	43,005	2054/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	304	49,363	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	336	54,614	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	870	366	59,536	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,460	1,401	227,450	2026/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,393	226,228	2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	940	867	140,834	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	930	600	97,519	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,350	1,235	200,622	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	580	584	94,898	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	523	84,915	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,380	1,337	217,178	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,210	1,138	184,787	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	780	641	104,095	2037/06/22
BELGIUM 3.45 06/22/43	国債証券	3.4500	240	245	39,829	2043/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,200	1,022	166,015	2030/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/33	国債証券	3.0000	1,200	1,213	197,039	2033/06/22
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	1,050	861	139,842	2032/06/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	1,040	845	137,314	2031/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	1,080	980	159,248	2027/10/22
小計	—	—	30,390	27,580	4,477,411	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	3,700	3,413	554,081	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	3,530	3,335	541,536	2026/02/25
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	3,780	3,509	569,691	2028/02/25
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	国債証券	2.7500	3,100	3,112	505,345	2029/02/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	1,570	1,515	245,982	2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,850	3,903	633,708	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,690	3,164	513,653	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,728	280,656	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,460	1,673	271,725	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,100	3,518	571,247	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	2,330	2,729	443,077	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,540	2,541	412,649	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,539	249,906	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	3,720	2,568	416,982	2050/05/25

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(ユーロ…フランス)</b>						
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	千ユーロ 3,470	千ユーロ 1,878	千円 305,020	2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	3,660	1,938	314,732	2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	940	636	103,318	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	306	49,798	2072/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,650	4,611	748,628	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,090	4,707	764,175	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	5,780	5,338	866,601	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	3,430	3,317	538,591	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,218	522,455	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	3,560	3,051	495,395	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	4,960	4,712	765,097	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	3,560	3,374	547,800	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,950	1,298	210,748	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	4,080	3,353	544,449	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	900	708	115,058	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	1,200	1,073	174,267	2043/05/25
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	国債証券	3.0000	3,000	3,046	494,567	2033/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,790	2,232	362,342	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,450	2,055	333,667	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,490	893	145,019	2044/06/25
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	国債証券	2.5000	4,120	4,090	664,120	2026/09/24
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,274	369,268	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,240	3,247	527,129	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	2,040	2,258	366,661	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,610	3,196	518,890	2032/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,649	430,136	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	4,020	3,757	609,921	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	4,600	4,216	684,425	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,670	2,983	484,326	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	4,280	3,582	581,580	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	3,850	3,622	588,020	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	3,590	3,090	501,787	2029/11/25
小 計	-	-	141,120	128,977	20,938,250	-
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>						
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	千ユーロ 1,310	千ユーロ 1,460	千円 237,126	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	840	1,017	165,110	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	2,620	3,139	509,635	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	2,030	2,365	383,970	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,650	1,606	260,751	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	3,860	3,693	599,524	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,430	1,292	209,847	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	2,120	1,970	319,897	2028/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,420	2,264	367,601	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	2,340	1,999	324,656	2031/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	3,050	3,045	494,359	2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,500	2,086	338,727	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,720	1,502	243,849	2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国債証券	2.3000	700	698	113,433	2033/02/15
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,534	249,117	2025/04/11
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	国債証券	2.2000	2,100	2,083	338,203	2028/04/13
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	3,510	3,315	538,291	2026/04/10

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	2,060	1,906	309,455	2027/04/16	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,760	1,344	218,291	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	1,660	1,358	220,475	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,880	1,394	226,448	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	650	731	118,831	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,180	1,292	209,857	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,730	2,097	340,472	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,456	236,518	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,320	2,289	371,653	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,610	2,075	336,902	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,020	2,450	397,834	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,240	2,215	359,662	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	2,540	1,258	204,270	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	1,850	1,571	255,105	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,820	2,164	351,439	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,350	381,540	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,610	2,443	396,671	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	3,590	3,367	546,672	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	2,570	2,344	380,561	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	2,290	2,021	328,216	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	3,140	1,632	264,969	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	2,330	2,222	360,879	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,890	2,443	396,601	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,010	527	85,639	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	3,730	3,223	523,261	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	890	768	124,796	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,100	929	150,960	2031/08/15	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	2,760	2,580	418,939	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	2,650	2,529	410,601	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	2,280	2,191	355,829	2027/10/15	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,050	1,009	163,950	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,350	1,290	209,524	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,481	240,547	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,560	2,295	372,664	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	国債証券	2.4000	300	301	48,942	2030/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	2,000	1,975	320,653	2029/11/15	
小計	-	-	108,580	100,614	16,333,748	-	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,960	2,238	363,423	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,660	1,792	290,935	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,330	1,288	209,149	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,910	1,755	284,907	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,880	1,678	272,436	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,640	1,548	251,458	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,598	259,500	2025/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,510	1,446	234,837	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,730	1,693	274,938	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,044	331,931	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,500	1,396	226,756	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,850	1,533	248,942	2032/04/30	
SPAIN 3.15 04/30/33	国債証券	3.1500	1,570	1,565	254,101	2033/04/30	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,800	1,553	252,120	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,880	1,527	247,974	2031/04/30
SPAIN 3.5 05/31/29	国債証券	3.5000	500	513	83,408	2029/05/31
SPAIN 2.8 05/31/26	国債証券	2.8000	1,800	1,792	290,984	2026/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	870	835	135,584	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,330	2,488	403,962	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,910	2,202	357,479	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,880	2,135	346,662	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,012	164,419	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,895	1,933	313,918	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,665	270,353	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,965	2,350	381,630	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,870	1,740	282,629	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	740	710	115,353	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,038	330,964	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,940	1,667	270,762	2035/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,600	1,149	186,678	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	348	56,648	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,550	1,443	234,289	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	1,700	1,513	245,744	2029/07/30
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	2,060	2,256	366,374	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,457	236,662	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,300	1,134	184,116	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,560	1,292	209,805	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	1,270	846	137,401	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	660	321	52,136	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,790	963	156,389	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,810	1,784	289,724	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,860	1,768	287,018	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,630	2,521	409,413	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	2,130	1,872	303,968	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	2,140	1,769	287,305	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,644	266,943	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,810	1,261	204,801	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	2,450	2,187	355,135	2030/10/31
SPAIN 3.55 10/31/33	国債証券	3.5500	1,820	1,867	303,199	2033/10/31
小計	-	-	82,390	77,154	12,525,285	-
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,710	1,603	260,306	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	1,310	1,316	213,707	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,660	3,071	498,627	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,470	1,472	239,117	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	2,540	2,430	394,583	2028/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,528	248,192	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,800	1,566	254,297	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,270	989	160,649	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,690	1,491	242,136	2048/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	400	289	47,000	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	216	35,094	2072/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,110	2,163	351,237	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,290	1,983	322,022	2032/03/01

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	1,060	927	150,556	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	2,120	2,014	327,063	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	2,170	2,183	354,505	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,320	1,005	163,245	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	818	132,867	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,480	1,026	166,718	2037/03/01
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	545	88,579	2038/03/01
ITALY BTPS 4.2 03/01/34	国債証券	4.2000	400	412	66,994	2034/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,299	210,944	2028/03/15
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	1,160	1,171	190,235	2035/04/30
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	1,110	694	112,713	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,375	223,276	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	2,110	1,766	286,838	2031/04/01
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	1,150	1,158	188,072	2028/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	2,020	1,890	306,906	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,300	1,221	198,368	2027/04/01
ITALY BTPS 3.8 04/15/26	国債証券	3.8000	1,500	1,519	246,661	2026/04/15
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,260	2,621	425,553	2031/05/01
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,430	1,397	226,943	2025/05/15
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	1,600	1,685	273,614	2033/05/01
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	2,850	2,753	447,077	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,560	1,524	247,437	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,590	1,544	250,738	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,580	1,282	208,224	2032/06/01
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,169	189,781	2029/06/15
ITALY BTPS 3.7 06/15/30	国債証券	3.7000	1,400	1,418	230,276	2030/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,790	1,747	283,749	2026/07/15
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	979	159,002	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,215	197,396	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	2,360	2,591	420,706	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,890	2,063	335,050	2039/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,700	1,639	266,236	2027/08/01
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	2,210	2,173	352,882	2029/08/01
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,920	1,554	252,364	2031/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,156	187,819	2030/08/01
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,318	214,039	2025/08/15
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,850	1,714	278,404	2026/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,520	1,321	214,555	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,560	1,658	269,197	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,380	1,185	192,407	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	2,180	2,316	376,027	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,650	1,802	292,638	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,200	863	140,183	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,120	677	110,034	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,195	194,047	2033/09/01
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券	2.1500	960	632	102,624	2052/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	1,380	1,290	209,522	2049/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,360	1,128	183,161	2036/09/01
ITALY BTPS 4.45 09/01/43	国債証券	4.4500	800	816	132,586	2043/09/01
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	1,680	1,556	252,712	2027/09/15
ITALY BTPS 3.85 09/15/26	国債証券	3.8500	1,500	1,524	247,503	2026/09/15

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>(ユーロ…イタリア)</b>								
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	国債証券		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2053/10/01	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	国債証券		4.5000	670	684	111,073		
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券		4.0000	1,400	1,441	234,048	2031/10/30	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券		7.2500	1,250	1,381	224,293	2026/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券		6.5000	2,010	2,242	363,991	2027/11/01	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券		5.2500	2,640	2,902	471,221	2029/11/01	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券		2.5000	1,550	1,531	248,654	2025/11/15	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券		2.0000	1,660	1,625	263,935	2025/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券		1.2500	2,180	2,072	336,527	2026/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券		2.8000	1,940	1,902	308,884	2028/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券		0.9500	1,700	1,400	227,412	2031/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券		1.6500	2,140	1,904	309,105	2030/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券		2.5000	1,340	1,224	198,827	2032/12/01	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券		3.8500	1,700	1,740	282,518	2029/12/15	
	国債証券		2.6500	1,720	1,688	274,059	2027/12/01	
小計	-	-	-	122,640	116,425	18,900,577	-	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>								
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2052/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券		0.1250	640	298	48,521		
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券		0.7500	600	524	85,162	2031/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券		1.3750	380	276	44,937	2047/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券		0.5000	460	438	71,143	2026/04/15	
FINLAND 2.75 04/15/38	国債証券		1.1250	480	407	66,172	2034/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券		2.7500	370	356	57,931	2038/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券		0.5000	380	239	38,880	2043/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券		0.1250	280	199	32,347	2036/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券		1.3750	210	201	32,734	2027/04/15	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券		4.0000	220	222	36,135	2025/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券		2.7500	320	321	52,181	2028/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券		2.6250	330	309	50,246	2042/07/04	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券		0.5000	800	711	115,483	2029/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券		0.8750	810	784	127,336	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券		0.5000	650	590	95,917	2028/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券		0.5000	400	370	60,186	2027/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券		0.2500	290	185	30,036	2040/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券		1.5000	700	632	102,699	2032/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券		0.1250	700	576	93,646	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券		0.0000	510	428	69,583	2030/09/15	
	国債証券		0.0000	100	93	15,124	2026/09/15	
小計	-	-	-	9,630	8,170	1,326,408	-	
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>								
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券		3.8000	310	357	58,062		
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券		1.5000	740	549	89,179	2047/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券		0.5000	1,520	1,366	221,903	2029/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	国債証券		0.7500	935	867	140,901	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券		2.9000	150	150	24,387	2034/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	国債証券		0.0000	1,410	1,165	189,278	2031/02/20	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券		2.9000	1,300	1,306	212,033	2033/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券		0.9000	600	519	84,364	2032/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券		0.0000	1,180	1,006	163,383	2030/02/20	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券		4.8500	1,210	1,257	204,062	2026/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券		4.1500	1,010	1,131	183,652	2037/03/15	
	国債証券		0.7500	590	344	55,892	2051/03/20	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	410	185	30,075	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,340	1,251	203,166	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	870	832	135,183	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	590	464	75,354	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	140	22,859	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	550	552	89,772	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	615	684	111,049	2027/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	460	451	73,309	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	295	47,998	2117/09/20
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,330	1,263	205,073	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	890	864	140,395	2025/10/20
AUSTRIA 3.15 10/20/53	国債証券	3.1500	420	423	68,799	2053/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	840	598	97,092	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	271	44,131	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	620	547	88,955	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	18,478	2086/11/02
小計	—	—	21,230	18,965	3,078,798	—
合計	—	—	—	—	256,938,107	—

## ■投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

項目	当	期	末
	評価額	比	率
公社債	千円		%
コーポレートローン等、その他	256,938,107		98.3
投資信託財産総額	4,534,468		1.7
	261,472,575		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、259,685,707千円、99.3%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、2024年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.16円、1カナダ・ドル=111.02円、1オーストラリア・ドル=98.41円、1シンガポール・ドル=111.73円、1ニュージーランド・ドル=92.63円、1イギリス・ポンド=189.58円、1イスラエル・シケル=40.76円、1デンマーク・クローネ=21.78円、1ノルウェー・クローネ=14.33円、1スウェーデン・クローナ=14.51円、1メキシコ・ペソ=8.803円、1オフショア・人民元=20.841円、1マレーシア・リンギット=31.284円、1ポーランド・ズロチ=37.609円、1ユーロ=162.34円です。



# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	262,047,572,911円
コ ー ル ・ 公 司 債 等	2,571,862,881
社 債 (評価額)	256,938,107,694
未 収 入 金 息	575,027,153
前 払 収 入 利 費	1,747,978,124
	214,597,059
(B) 負 債	1,654,049,105
未 払 収 入 金	1,628,558,105
未 払 解 約 金	25,491,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	260,393,523,806
元 次 本 金	112,140,675,109
受 益 繰 越 損 益	148,252,848,697
(D) 受 益 権 総 額	112,140,675,109円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	23,220円

(注1) 期首元本額	92,568,430,085円
追加設定元本額	57,122,203,229円
一部解約元本額	37,549,958,225円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	6,936,625,396円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,145,444円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,898,297円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	33,055,375円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,463,237円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,934,640円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,209,559円
たわらノーロード 先進国債券	20,317,116,345円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,175,860,175円
たわらノーロード バランス (堅実型)	70,372,889円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,159,511円
たわらノーロード バランス (積極型)	90,074,981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)	17,547,319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)	1,061,778,662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)	1,874,531,468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)	939,477,666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)	721,685,160円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,181,174円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	12,367,147円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	192,544,517円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	20,620,422円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	38,634,144円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,881,458,772円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,443,766,551円
Oneグローバルバランス	60,758,637円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	415,782,480円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	854,188,656円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	822,838,550円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	23,358,394円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	887,363,869円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	15,215,627円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159,329,380円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	160,868,965円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	260,318,009円
クルーズコントロール	1,073,014,665円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	854,009,676円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	488,705,414円
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,190,355円

Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,009,306円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513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)	237,386,300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)	238,317,641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)	95,585,889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)	143,381,639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)	544,565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)	621,159,184円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	543,853,224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)	211,165,647円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	866,888,247円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	634,044,700円
D I AM海外ヘルパシブ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	4,747,484,094円
D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,512,206,226円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	222,937,463円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	43,680,338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)	393,718,174円
D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	322,665,524円
D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	208,816,275円
D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,704,671円
D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	20,619,600円
D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,524,169円
D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,265円
D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,512,264円
D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	33,413,721円
D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,252,683,690円
D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,244,567,605円
D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,359,122,210円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	50,385,127円
D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	100,205,864円
D I AMアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,142,198,851円
D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	202,876,714円
D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	155,039円
D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	199,846,920円
D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	259,826,276円
D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	336,700,092円
D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,520,161円
動的パッケージファンド<DC年金>	48,713,270円
コア資産形成ファンド	24,325,247円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,593,798,610円
たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	12,277,305,584円
MH AM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,666,776,191円
MH AM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,479,083円
期末元本合計	112,140,675,109円

## ■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,766,181,304	円
	受取利息	5,766,646,977	
	その他の収益	5,079	
	支払利息	△470,752	
(B)	有価証券売買損益	26,829,583,002	
	売却益	30,605,561,933	
	売却損	△3,775,978,931	
(C)	その他の費用	△34,657,163	
(D)	当期損益金(A+B+C)	32,561,107,143	
(E)	前期繰越損益金	94,253,940,578	
(F)	解約差損益金	△43,521,353,795	
(G)	追加信託差損益金	64,959,154,771	
(H)	計(D+E+F+G)	148,252,848,697	
	次期繰越損益金(H)	148,252,848,697	

(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18期（決算日 2024年6月6日）

（計算期間 2023年6月7日～2024年6月6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18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年8月4日から無期限です。
運用方針	東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所に上場し、東証R E I T指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 外貨建資産への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証R E I T指数		投資証券 組入比率	不動産 投信先 物比率	純資産 総額
	期中 騰落率	騰落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 騰落率			
14期（2020年6月8日）	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期（2020年6月8日）	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
15期（2021年6月7日）	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531
16期（2022年6月6日）	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3	199,921
17期（2023年6月6日）	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2	200,500
18期（2024年6月6日）	23,008	△2.9	4,307.31	△2.9	97.1	2.8	176,077

（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）の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません（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）。

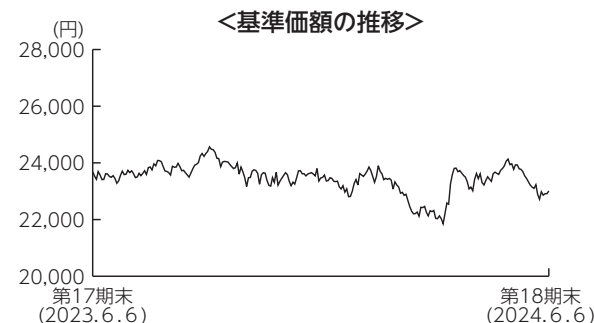
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	( 配 当 込 み ) ( ベ ン チ マ ー ク )	騰 落 率		
( 期 首 ) 2023 年 6 月 6 日	円 23,686	% -	ポ イ ン ト 4,437.30	% -	% 97.8	% 2.2
6 月 末	23,600	△0.4	4,421.28	△0.4	97.8	2.1
7 月 末	23,876	0.8	4,472.88	0.8	97.7	2.2
8 月 末	24,229	2.3	4,539.20	2.3	97.2	2.7
9 月 末	23,852	0.7	4,468.30	0.7	97.0	2.9
10 月 末	23,355	△1.4	4,372.14	△1.5	97.1	2.9
11 月 末	23,801	0.5	4,455.46	0.4	97.2	2.7
12 月 末	23,412	△1.2	4,382.85	△1.2	97.1	2.8
2024 年 1 月 末	23,392	△1.2	4,378.56	△1.3	97.1	2.7
2 月 末	22,258	△6.0	4,166.74	△6.1	97.3	2.7
3 月 末	23,557	△0.5	4,410.17	△0.6	97.2	2.7
4 月 末	23,800	0.5	4,455.74	0.4	97.2	2.7
5 月 末	22,980	△3.0	4,302.09	△3.0	97.2	2.7
( 期 末 ) 2024 年 6 月 6 日	23,008	△2.9	4,307.31	△2.9	97.1	2.8

(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（2023年6月7日から2024年6月6日まで）

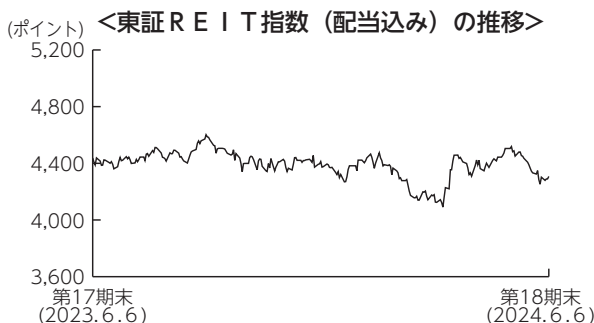


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,008円となり、前期末比で2.9%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

日銀による金融政策の早期正常化観測などを背景に東証REIT指数（配当込み）が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。



### 投資環境

リート市場は下落しました。2024年1月半ばまでは日米の金融政策の先行き不透明感から方向感に欠ける展開が続きました。その後、日銀の金融政策正常化への警戒感から下落しましたが、3月の金融政策決定会合においてマイナス金利解除が決まると先行き不透明感が払拭され、加えて金融緩和的な環境が当面続くとの観測から反発しました。期末にかけては、日銀が金融政策の正常化を早めるとの観測が強まり、軟調に推移しました。

### 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2.9%下落しました。

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)	0円	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
(投資証券)	(0)	(0.001)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は23,451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 (2023年6月7日から2024年6月6日まで)

### (1) 投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
<b>国内</b>	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	1.82	215,974	2.101	248,909
	(-)	(-)	(-)	(-)
サンケイリアルエステート投資法人	2.866	261,292	3.31	299,730
	(-)	(-)	(-)	(-)
S O S I L A物流リート投資法人	4.492	549,146	5.155	627,392
	(-)	(-)	(-)	(-)
東海道リート投資法人	1.678	210,433	1.831	227,205
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本アコモデーションファンド投資法人	3.081	1,929,478	3.559	2,215,658
	(-)	(-)	(-)	(-)
森ヒルズリート投資法人	10.515	1,480,261	12.142	1,693,861
	(-)	(-)	(-)	(-)
産業ファンド投資法人	19.279	2,617,554	16.329	2,225,882
	(-)	(-)	(-)	(-)
アドバンス・レジデンス投資法人	9.196	3,051,767	10.901	3,601,098
	(-)	(-)	(-)	(-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2.89	657,189	16.463	3,519,258
	(-)	(-)	(-)	(-)
アクティブピア・プロパティーズ投資法人	4.631	1,862,059	5.419	2,171,683
	(-)	(-)	(-)	(-)
G L P投資法人	30.123	4,081,394	35.003	4,676,432
	(-)	(-)	(-)	(-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4.602	1,491,072	5.032	1,613,794
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本プロロジスリート投資法人	15.626	4,310,532	17.979	4,878,631
	(-)	(-)	(-)	(-)
星野リゾート・リート投資法人	2.245	1,315,222	1.883	1,119,686
	(-)	(-)	(-)	(-)
Oneリート投資法人	1.557	405,199	1.798	465,279
	(-)	(-)	(-)	(-)
イオンリート投資法人	12.369	1,780,060	12.612	1,799,162
	(-)	(-)	(-)	(-)
ヒューリックリート投資法人	8.359	1,291,991	9.654	1,491,758
	(-)	(-)	(-)	(-)
日本リート投資法人	2.905	1,005,465	3.355	1,160,649
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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		26.852		2,158,993		31.012		2,508,612
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		1.871		259,702		2.371		327,950
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		1.704		491,759		9.75		2,652,150
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		2.207		313,314		2.548		358,481
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		2.657		298,187		2.802		311,461
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		28.903		4,727,220		33.38		5,404,280
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		1.478		162,524		1.707		187,696
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		12.375		1,860,122		13.144		1,950,287
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		18.561		1,062,613		15.279		887,851
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		1.406		177,552		1.594		201,606
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4.074		1,914,082		4.263		1,968,867
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ホテル&レジデンシャル投資法人		1.359		93,573		1.728		116,580
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		14.575		663,663		13.561		620,717
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		3.116		1,189,632		3.561		1,357,297
		(-)		(-)		(-)		(-)
CREロジスティクスファンド投資法人		3.886		622,019		4.445		708,229
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.453		170,595		1.678		195,775
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		5.304		520,584		4.907		485,949
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人		3.959		499,714		4.523		568,458
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		10.424		6,292,531		12.039		7,189,709
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		9.209		5,236,328		10.599		5,957,540
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		42.515		4,137,198		53.819		5,196,002
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		17.806		3,070,729		20.564		3,548,381
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		6.113		2,156,108		7.06		2,474,634
		(-)		(-)		(-)		(-)
NTT都市開発リート投資法人		9.364		1,214,627		9.795		1,268,538
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		5.992		1,054,823		6.921		1,213,089
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		6.638		744,935		7.614		851,266
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	19.993 (-)	3,005,653 (-)	23.089 (-)	3,443,613 (-)
森トラストリート投資法人	18.408 (-)	1,344,609 (-)	19.85 (-)	1,440,247 (-)
インヴィンシブル投資法人	50.923 (-)	3,073,858 (-)	49.476 (-)	3,003,666 (-)
フロンティア不動産投資法人	3.315 (-)	1,492,992 (-)	3.829 (-)	1,722,127 (-)
平和不動産リート投資法人	7.538 (-)	1,063,901 (-)	7.308 (-)	1,026,115 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	5.64 (-)	1,617,816 (-)	7.189 (-)	2,054,307 (-)
福岡リート投資法人	4.616 (-)	762,262 (-)	5.332 (-)	873,951 (-)
KDX不動産投資法人	31.031 (24.335)	7,788,795 (-)	17.614 (-)	3,381,983 (-)
いちごオフィスリート投資法人	7.328 (-)	623,720 (-)	8.462 (-)	720,480 (-)
大和証券オフィス投資法人	1.867 (3.676)	1,200,170 (-)	2.283 (-)	1,361,843 (-)
阪急阪神リート投資法人	4.709 (-)	665,980 (-)	4.905 (-)	686,661 (-)
スターツプロシード投資法人	1.551 (-)	325,486 (-)	1.791 (-)	375,512 (-)
大和ハウスリート投資法人	13.465 (-)	3,557,715 (-)	15.552 (-)	4,085,667 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	31.902 (-)	2,301,345 (-)	34.265 (-)	2,511,266 (-)
大和証券リビング投資法人	14.334 (-)	1,555,762 (-)	14.764 (-)	1,598,601 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	7.704 (-)	989,812 (-)	9.801 (-)	1,265,802 (-)

(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 20,724	百万円 19,938	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（2023年6月7日から2024年6月6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 100,979	百万円 13,310	% 13.2	百万円 112,099	百万円 13,897	% 12.4
不動産投信指数先物取引	20,724	5,118	24.7	19,938	9,265	46.5

### (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 4,180

### (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)	2,468千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	885千円
(B) / (A)	35.9%

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
<b>不動産ファンド</b>			千□		千□	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人			3.762		3.481	418,068	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			5.929		5.485	467,322	0.3
S O S I L A物流リート投資法人			9.206		8.543	1,002,948	0.6
東海道リート投資法人			3.078		2.925	359,190	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			6.391		5.913	3,843,450	2.2
森ヒルズリート投資法人			21.763		20.136	2,625,734	1.5
産業ファンド投資法人			28.239		31.189	3,907,981	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人			18.505		16.8	5,510,400	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			13.573		—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人			9.771		8.983	3,373,116	1.9
G L P 投資法人			62.397		57.517	7,644,009	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			8.85		8.42	2,723,870	1.5
日本プロロジスリート投資法人			32.182		29.829	7,433,386	4.2
星野リゾート・リート投資法人			3.237		3.599	1,885,876	1.1
One リート投資法人			3.228		2.987	761,386	0.4
イオンリート投資法人			21.247		21.004	2,810,335	1.6
ヒューリックリート投資法人			17.316		16.021	2,351,882	1.3
日本リート投資法人			6.012		5.562	1,888,299	1.1
積水ハウス・リート投資法人			55.614		51.454	4,121,465	2.3
トーセイ・リート投資法人			4.106		3.606	498,349	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			8.046		—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人			4.563		4.222	545,904	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人			4.811		4.666	492,263	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人			59.85		55.373	7,818,667	4.4
いちごホテルリート投資法人			3.066		2.837	313,488	0.2
ラサールロジポート投資法人			22.657		21.888	3,307,276	1.9
スターアジア不動産投資法人			23.108		26.39	1,593,956	0.9
マリモ地方創生リート投資法人			2.827		2.639	342,278	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			7.311		7.122	3,155,046	1.8
日本ホテル&レジデンシャル投資法人			2.987		2.618	195,041	0.1
投資法人みらい			22.485		23.499	1,058,629	0.6
三菱地所物流リート投資法人			6.358		5.913	2,288,331	1.3
C R E ロジスティクスファンド投資法人			7.93		7.371	1,068,795	0.6
ザイマックス・リート投資法人			3.002		2.777	331,851	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			8.724		9.121	902,066	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人			8.067		7.503	907,863	0.5
日本ビルファンド投資法人			21.591		19.976	11,725,912	6.7

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	%	
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,979	17,589	9,163,869	5.2	
日本都市ファンド投資法人	93,381	82,077	7,444,383	4.2	
オリックス不動産投資法人	36,876	34,118	5,455,468	3.1	
日本プライムリアルティ投資法人	12,657	11,71	3,881,865	2.2	
NTT都市開発リート投資法人	17,791	17.36	2,046,744	1.2	
東急リアル・エステート投資法人	12,409	11.48	1,796,620	1.0	
グローバル・ワン不動産投資法人	13.62	12,644	1,284,630	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人	41.4	38,304	5,431,507	3.1	
森トラストリート投資法人	34,447	33,005	2,323,552	1.3	
インヴィンシブル投資法人	81.46	82,907	5,662,548	3.2	
フロンティア不動産投資法人	6,867	6,353	2,877,909	1.6	
平和不動産リート投資法人	13.04	13.27	1,762,256	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,479	10.93	2,992,634	1.7	
福岡リート投資法人	9,572	8,856	1,416,074	0.8	
KDX不動産投資法人	10,769	48,521	7,399,452	4.2	
いちごオフィスリート投資法人	15,165	14,031	1,149,138	0.7	
大和証券オフィス投資法人	3,834	7,094	1,992,704	1.1	
阪急阪神リート投資法人	8.36	8,164	1,091,526	0.6	
スターツプロシード投資法人	3,208	2,968	606,065	0.3	
大和ハウスリート投資法人	27,898	25,811	6,540,507	3.7	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	59,684	57,321	4,522,626	2.6	
大和証券リビング投資法人	25,646	25,216	2,624,985	1.5	
ジャパンエクセレント投資法人	16,978	14,881	1,827,386	1.0	
合 計	□ 数 ・ 金 額	1,128,309	1,091,979	170,968,898	-
	銘 柄 数 < 比 率 >	60銘柄 < 97.8% >	58銘柄 < 97.1% >	-	97.1

(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) いちごホテルリート投資法人、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、ザイマックス・リート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、KDX不動産投資法人、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、スターツプロシード投資法人、トーセイ・リート投資法人、福岡リート投資法人、S O S I L A 物流リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、森トラストリート投資法人、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、投資法人みらい、CREロジスティクスファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、Oneリート投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、東海道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		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	東 証 R E I T	百万円 4,979		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2024年6月6日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 170,968,898		% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,029,246		3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	177,998,145		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

(2024年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	177,998,145,093円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	4,452,172,984
投 資 証 券(評価額)	170,968,898,350
未 収 入 金	1,077,568,704
未 収 配 当 金	1,319,496,712
差 入 委 託 証 拠 金	180,008,343
(B) 負 債	1,920,896,895
未 払 払 金	226,286,895
未 払 払 解 約 金	1,694,610,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	176,077,248,198
元 本	76,529,156,421
次 期 繰 越 損 益 金	99,548,091,777
(D) 受 益 権 総 口 数	76,529,156,421口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	23,008円

(注1) 期首元本額	84,649,761,469円
追加設定元本額	43,457,370,268円
一部解約元本額	51,577,975,316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)	274,804円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,143,704円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	2,907,813円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	3,263,162円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	3,763,743円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	2,003,505円
たわらノーロード 国内リート	5,959,788,163円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,691,467,158円
たわらノーロード バランス (堅実型)	47,220,839円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,082,290,459円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,367,082,467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)	363,532,982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)	1,004,444,746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)	714,849,012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)	854,144,072円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	4,118,390円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	82,954,597円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	14,531,791円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	26,594,772円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,646,122円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	473,314,451円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,539,059円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	152,407,293円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	236,914,240円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	528,218,240円
投資のソムリエ	3,343,920,338円
投資のソムリエ<DC年金>	354,825,931円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	225,908,401円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	714,661,133円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,188,732,008円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	60,679,736円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	31,642,088円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	6,628,675円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	74,459,869円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	110,119,108円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	134,261,239円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	27,251,818円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	33,832,205円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	20,798,045円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	5,257,990円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	55,791,387円
Jリートインデックスファンド (DC)	80,982,635円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド (隔月決算型)	14,068,198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)	67,677,043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) 20-04 (適格機関投資家限定)	213,663,893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)	67,645,374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)	89,471,283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)	40,737,084円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル連日本政府保証償活型) (適格機関投資家限定)	187,394,813円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	81,150,070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・シグナルヘッジ付き) 21-03 (適格機関投資家限定)	213,274,938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)	104,578,140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)	172,266,444円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-05 (適格機関投資家限定)	26,270,997円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-07 (適格機関投資家限定)	43,694,307円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-08 (適格機関投資家限定)	30,480,697円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	81,099,581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)	46,826,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-09 (適格機関投資家限定)	30,344,037円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-12 (適格機関投資家限定)	43,911,261円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家限定)	174,653,236円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	124,680,497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・シグナルヘッジ付き) 24-04 (適格機関投資家限定)	111,255,376円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2024-05 (適格機関投資家限定)	175,975,490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)	3,087,015,147円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	53,275,042円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	24,607,627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)	319,808,903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)	111,939,256円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家限定)	1,961,878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)	112,498,130円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド<DC年金>	7,051,073,596円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド (毎月決算型)	31,672,270,859円
MHAM J-R E I Tインデックスファンド (年1回決算型)	2,630,987,832円
たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>	5,218,394,727円
期末元本合計	76,529,156,421円

## ■損益の状況

当期 自2023年6月7日 至2024年6月6日

項	目	当	期
(A)	配当等収当益	8,115,346,474	円
	受取配当金	8,115,874,480	
	受取利息	576,101	
	その他の収益	6	
	支払利息	△1,104,113	
(B)	有価証券売買損益	△13,925,966,692	
	売却益	2,997,248,845	
	売却損	△16,923,215,537	
(C)	先物取引等取引損益	△188,895,920	
	取引益	297,573,890	
	取引損	△486,469,810	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△5,999,516,138	
(E)	前期繰越損益金	115,851,031,341	
(F)	解約差損益金	△69,011,497,158	
(G)	追加信託差損益金	58,708,073,732	
(H)	計(D+E+F+G)	99,548,091,777	
	次期繰越損益金(H)	99,548,091,777	

(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。

# 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2024年6月24日）

（対象期間 2023年6月23日～2024年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2007年4月11日から無期限です。
運用方針	S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率	純資産額
	円	期中騰落率	ポイント	期中騰落率			
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	—	百万円 34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	—	78,959
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3	—	56,003
16期(2023年6月22日)	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4	—	81,199
17期(2024年6月24日)	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0	87,881

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

(注3) S & P 先進国 REIT インデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが委託会社に付与されています。S & P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、委託会社により一定の目的でサブライセンスされています。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

(注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

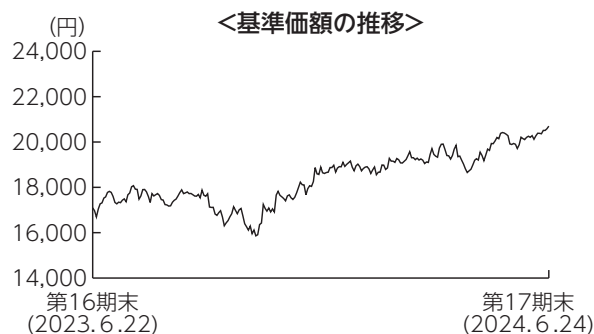
年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率		
(期 首) 2023年 6 月22日	円 17,096	% -	ポイント 177,832.19	% -	% 99.4	% -
6 月 末	17,529	2.5	182,685.34	2.7	99.1	-
7 月 末	17,623	3.1	183,725.47	3.3	99.7	-
8 月 末	17,891	4.7	186,587.56	4.9	99.6	-
9 月 末	16,888	△1.2	176,100.67	△1.0	99.1	-
10 月 末	15,911	△6.9	165,961.31	△6.7	99.7	-
11 月 末	17,563	2.7	183,266.40	3.1	99.6	-
12 月 末	18,976	11.0	198,444.21	11.6	99.1	-
2024年 1 月 末	18,816	10.1	196,616.69	10.6	99.6	-
2 月 末	19,149	12.0	200,192.11	12.6	99.5	-
3 月 末	19,901	16.4	208,220.30	17.1	99.2	-
4 月 末	19,554	14.4	204,506.61	15.0	99.4	-
5 月 末	19,877	16.3	207,988.97	17.0	99.3	-
(期 末) 2024年 6 月24日	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0

(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（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は20,700円となり、前期末比で21.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

カナダやシンガポール、香港などのリート市場は下落しマイナスの影響となりました。一方、米国や豪州で浮上した早期利下げ観測や、株高に伴うリスク選好の改善などから、両国のリート市場が上昇したことや、為替市場で全ての指数構成通貨に対し円安となったことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

外国リート市場はまちまちの結果となりました。前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となり、2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や米欧長期金利上昇への警戒感から下落しました。その後は米国や豪州で早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから両国のリート市場は上昇しましたが、カナダやシンガポール、香港などのリート市場は下落しました。

為替市場では、米ドルは期前半、F R Bの利上げ長期化観測や日銀の金融政策修正観測の後退などから円安米ドル高となりました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年以降は米国の利下げ観測は後退したほか、3月の日銀のマイナス金利解除決定後も日米金利差は残るとの見方などから改めて円安米ドル高が進行しました。ユーロなど他の指数構成通貨に対しても円安となりました。

### ポートフォリオについて

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

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%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 (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	2円 (0) (0) (2)	0.013% (0.000) (0.002) (0.011)	(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)	4 (0) (4)	0.024 (0.002) (0.022)	(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)	8 (7) (1)	0.046 (0.038) (0.008)	(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	15	0.083	
期中の平均基準価額は18,397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 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

### (1) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44.521	4,791	51.491	5,440
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	0.7	130	0.861	161
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	42.103	2,474	47.241	2,780
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	73.871	2,399	78.516	2,541
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	28.657	200	41.562	287
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	29.363	1,710	30.57	1,712
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	3.203	59	3.719	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	17.22	655	19.099	746
	(-)	(-)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	20.917	908	24.191	1,014
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	262.201	29,328	303.138	34,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	40.914	7,276	47.416	8,292
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXP INDUSTRIAL TRUST	60.11	529	72.905	634
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
CAMDEN PROPERTY TRUST	30.337	2,942	35.142	3,339
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	25.854	413	27.396	438
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	26.952	20,491	30.643	22,767
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	49.099	1,892	57.324	2,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	-	-	1.936	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	35.373	732	42.016	852
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	-	-	-	-
	(△14.046)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	37.223	464	46.279	564
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	12.207	221	12.873	215
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18.669	4,210	21.491	4,749
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	101.285	6,084	114.785	6,785
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19.889	1,875	23.003	2,129
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	36.575	1,700	42.101	1,970
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	163.634	2,990	192.551	3,410
	(68.793)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	30.158	571	35.968	667
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.711	485	29.203	582
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	34.114	248	41.344	307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	191.286	16,821	173.196	14,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	13.221	2,224	13.918	2,300
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	181.693	3,331	211.022	3,816
	(22.741)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	33.041	1,051	37.091	1,184
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	12.892	419	14.463	456
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	42.905	89	54.866	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	29.058	114	45.368	192
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
IRON MOUNTAIN INC	84.737	5,378	97.576	6,262
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	52.643	613	61.448	740
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	58.647	3,863	61.535	4,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	32.368	491	34.118	511
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	205.808	3,509	239.71	4,083
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	34.115	4,503	39.173	5,045
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.369	92	22.894	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	8.55	440	10.426	532
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	3.326	192	3.69	213
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.963	39	4.265	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	14.309	406	14.653	402
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	12.409	131	15.407	158
	(△37.596)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	241.687	12,818	238.92	12,253
	(46.343)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	45.789	2,777	52.728	3,167
	(4.873)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	88.351	3,213	104.621	3,730
	(-)	(-)	(-)	(-)
COPT DEFENCE PROPERTIES	25.01	611	29.107	693
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	5.322	193	5.894	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	93.859	11,200	109.206	13,072
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	0.859	113	-	-
	(△38.877)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	45.539	12,126	52.779	13,992
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	36.367	4,250	42.011	4,935
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER INC	30.312	736	32.271	791
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	15.546	224	14.922	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	7.301	93	8.897	108
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.496	58	2.833	107
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	119.656	5,316	135.393	5,812
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	46.64	1,053	53.971	1,220
	(-)	(-)	(-)	(-)
ELME COMMUNITIES	23.129	334	27.066	381
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	56.332	1,197	67.413	1,415
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	59.182	7,298	69.034	8,586
	(34.794)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15.813	38	22.988	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	43.304	416	54.462	522
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	64.136	2,501	73.264	2,856
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	99.952	12,895	99.877	12,501
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	55.669	460	61.361	506
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	120.97	728	144.998	696
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	49.277	627	57.755	720
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	34.935	436	37.953	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	27.099	152	33.126	187
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	-	-	9.459	56
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	30.512	1,761	24.342	1,362
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12.003	240	15.468	306
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	31.451	312	39.557	398
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	75.049	2,057	88.383	2,457
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23.04	311	29.698	397
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	5.225	51	8.382	82
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	55.891	782	65.968	921
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	4.626	47	5.285	58
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	19.816	105	28.132	158
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	49.348	1,722	55.784	1,926
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	63.87	3,683	71.761	4,009
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	19.265	320	22.63	374
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	3.576	51	5.844	79
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	101.71	1,585	118.698	1,748
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18.44	1,707	19.352	1,793
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	16.204	175	20.226	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	29.193	1,053	31.906	1,094
	(△60.818)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	43.806	532	48.563	566
	(△102.067)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	66.598	3,215	68.832	3,276
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	92.827	3,264	103.625	3,574
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	53.26	789	63.653	913
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	5.684	452	6.967	560
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	19.549	284	28.115	407
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	-	-	-	-
	(△63.796)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	163.111	5,371	191.011	6,172
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	-	-	100.1	33
	(-)	(△3)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	23.574	194	34.234	284
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8.418	177	10.3	210
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	51.48	1,217	47.358	1,062
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	77.068	3,550	85.668	3,876
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82.72	1,759	97.129	2,051
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	-	-	-	-
	(31.76)	(△1)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
POSTAL REALTY TRUST INC	5.632	80	5.703	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	-	-	2.368	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21.094	522	22.303	544
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	15.013	165	22.077	237
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	7.744	37
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	17.614	278	17.012	268
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	44.817	1,016	31.887	698
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEAKSTONE REALTY TRUST	25.787	461	12.15	175
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	-	-	2.103	140
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	30.863	1,050	34.113	1,157
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK HOMES TRUST INC	-	-	1.188	15
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	38.971	1,266	48.023	1,509
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	34.595	514	42.683	618
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAR HOLDINGS	-	-	5.322	75
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	5.848	121	6.978	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	394.3	218	239.1	125
	(-)	(△6)	(-)	(-)
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	26.412	394	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	-	-	-
	(5.763)	(1)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	28.405	128	43.11	192
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17.038	154	16.798	146
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	28.38	451	33.49	522
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20.737	249	23.172	269
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19.339	230	27.887	345
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	163.733	829	64.263	312
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3.317	122	3.621	118
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	15.828	492	24.069	822
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.372	186	6.899	194
	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	61.027	955	65.631	1,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	28.67	240	42.191	355
	(42.743)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	-	-	-	-
	(0.629)	(4)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	49.336	652	60.888	808
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	301.198	8,852	331.053	9,514
	(-)	(-)	(-)	(-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	28.644	652	30.699	687
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>カナダ</b>	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	20.529	484	23.651	547
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	25.791	1,179	29.746	1,323
	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	49.618	460	54.877	496
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.659	404	34.075	475
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	40.883	738	47.516	833
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALLIED PROPERTIES REIT	15.152	269	17.905	303
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	-	-	3.363	36
	(△2.585)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.644	663	9.605	658
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4.232	26	6.905	41
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	16.028	209	18.95	242
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19.459	245	24.11	299
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31.25	138	35.58	159
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	-	-	2.22	34
	(-)	(-)	(-)	(-)
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	-	-	4.643	14
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	23.695	304	27.414	342
	(-)	(-)	(-)	(-)



	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>カナダ</b>	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.558 (-)	602 (-)	10.2 (-)	703 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	- (△17.707)	- (-)	- (-)	- (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	35.392 (-)	462 (-)	42.996 (-)	544 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	1.955 (-)	33 (-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.913 (-)	165 (-)	14.896 (-)	203 (-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	17.876 (-)	43 (-)
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	5.878 (-)	31 (-)
SLATE GROCERY REIT	10.756 (-)	124 (-)	10.653 (-)	115 (-)
PRIMARIS REIT	13.25 (-)	178 (-)	14.806 (-)	198 (-)
SLATE OFFICE REIT	- (-)	- (-)	17.818 (-)	27 (-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	8.337 (-)	85 (-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.472 (-)	297 (-)	18.761 (-)	315 (-)
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	171.757 (-)	609 (-)	158.601 (-)	548 (-)
MIRVAC GROUP	1,167.272 (-)	2,476 (-)	1,323.343 (-)	2,806 (-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	206.513 (-)	84 (-)	318.514 (-)	125 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	158.557 (-)	534 (-)	184.015 (-)	606 (-)
GPT GROUP	569.358 (-)	2,289 (-)	647.888 (-)	2,601 (-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	308.93 (-)	449 (-)	270.119 (-)	395 (-)
ABACUS GROUP	174.871 (-)	184 (-)	201.768 (-)	218 (-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	71.254 (-)	188 (-)	94.114 (-)	245 (-)
STOCKLAND	722.285 (-)	2,908 (-)	829.224 (-)	3,360 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	114.527 (-)	494 (-)	119.742 (-)	515 (-)
DEXUS	314.91 (-)	2,289 (-)	352.435 (-)	2,546 (-)
GOODMAN GROUP	502.781 (-)	11,860 (-)	567.649 (-)	13,506 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
VICINITY CENTRES	1,003.623	1,841	1,173.558	2,109
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	136.538	1,411	154.812	1,569
	(-)	(-)	(-)	(-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	84.538	196	108.784	242
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGION RE LTD	238.016	520	286.625	605
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	122.699	370	149.701	458
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	67.105	228	85.07	285
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	151.636	516	185.161	626
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	19.686	54	17.711	48
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	296.673	659	326.065	709
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	94.174	184	119.787	225
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	1,544.091	4,175	1,777.304	4,775
	(-)	(-)	(-)	(-)
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	-	-	140.343	97
	(-)	(-)	(-)	(-)
HMC CAPITAL LTD	64.179	330	76.071	404
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	538.614	643	503.146	594
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCO REIT	75.434	104	56.03	81
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS STORAGE KING	72.902	78	44.226	44
	(195.539)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA OFFICE REIT	44.311	48	69.257	80
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAYPOINT REIT LTD	116.495	277	150.326	350
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>香港</b>	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	630.5	24,255	728.7	26,800
	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	419	578	496	612
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	366	965	527	1,230
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71	127	77	146
	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	277	1,382	364	1,680
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,515.1 (-)	2,845 (△10)	1,699.9 (-)	3,109 (-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,078.6 (-)	2,935 (△21)	1,142.7 (-)	3,029 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	490.3 (-)	578 (△5)	597.5 (-)	686 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,060.7 (-)	1,656 (△46)	1,154.3 (-)	1,782 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	330.7 (-)	164 (-)	415.3 (-)	195 (-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	640.9 (-)	609 (△17)	639.4 (-)	582 (-)
KEPPEL REIT	713.6 (-)	599 (-)	694.3 (-)	592 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	379.1 (-)	818 (-)	387.4 (-)	828 (-)
ESR LOGOS REIT	1,470.2 (-)	427 (△9)	1,976.2 (-)	561 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	158 (-)	155 (△3)	275.3 (-)	274 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	179.7 (-)	148 (△23)	278.4 (-)	225 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (△1)	538.1 (-)	115 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	267.8 (-)	340 (△5)	223.3 (-)	283 (-)
PARKWAY LIFE REIT	121.8 (-)	440 (△5)	131.9 (-)	465 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	563.2 (-)	1,259 (△1)	623.2 (-)	1,379 (-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	592.1 (-)	833 (△11)	673.9 (-)	907 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	184.8 (-)	115 (-)	201.7 (-)	121 (-)
PARAGON REIT	361.8 (-)	313 (-)	368.5 (-)	309 (-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	53.6 (-)	37 (△0.47114)	71.2 (-)	43 (-)
QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	135.2 (-)	44 (△0.70461)	1,174.355 (-)	240 (-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	448.9 (-)	257 (-)	579.5 (-)	312 (-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	80.3 (-)	47 (△5)	307 (-)	164 (-)
KEPPEL DC REIT	319.8 (-)	618 (△10)	376.9 (-)	696 (-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	657.9 (-)	736 (△15)	783.9 (-)	827 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>ニュージーランド</b>	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	348.222	420	328.964	382
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	13.547	32	223.11	450
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	202.439	431	246.973	520
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	315.744	267	384.422	321
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	189.174	211	200.554	220
	(-)	(-)	(-)	(-)
STRIDE STAPLED GROUP	30.039	41	263.389	331
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	270.474	895	307.817	1,018
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	35.117	700	39.543	764
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	56.282	598	55.829	551
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	1,244.694	312	1,539.073	383
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	220.397	1,342	255.575	1,536
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	31.106	155	35.891	177
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	144.545	1,345	162.453	1,483
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	233.58	215	298.954	274
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	421.322	3,294	431.267	3,288
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	135.122	556	85.135	334
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	691.22	294	800.762	337
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	-	-	50.234	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	-	-	52.789	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
HELICAL PLC	-	-	5.963	13
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	170.84	113	185.846	120
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	160.763	88	201.78	109
	(△354.973)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	43.415	325	51.935	373
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	376.435	696	396.622	709
	(401.903)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	182.131 (-)	122 (-)	243.237 (-)	165 (-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	549.049 (-)	655 (-)	635.277 (-)	748 (-)
WAREHOUSE REIT PLC	58.167 (-)	48 (-)	60.241 (-)	48 (-)
NEWRIVER REIT PLC	30.491 (-)	26 (-)	64.763 (-)	49 (-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	- (-)	- (-)	293.773 (-)	233 (-)
PRS REIT PLC/THE	141.145 (-)	109 (-)	180.137 (-)	135 (-)
CLS HOLDINGS PLC	- (-)	- (-)	38.026 (-)	45 (-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	178.71 (-)	107 (-)	214.964 (-)	121 (-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	325.039 (-)	246 (-)	381.621 (-)	291 (-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	582.838 (157.608)	831 (-)	662.654 (-)	941 (-)
CUSTODIAN REIT PLC	101.126 (-)	83 (-)	104.931 (-)	86 (-)
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	436.589 (-)	342 (-)	183.813 (-)	141 (-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	131.486 (-)	114 (-)	175.194 (-)	155 (-)
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	- (-)	- (-)	103.977 (-)	71 (-)
LIFE SCIENCE REIT PLC	201.363 (-)	143 (-)	53.766 (-)	34 (-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC-RTS	- (96.861)	- (-)	96.861 (-)	102 (-)
AEW UK REIT PLC	33.925 (-)	29 (-)	62.221 (-)	52 (-)
LXI REIT PLC	366.301 (△730.734)	331 (-)	403.027 (-)	356 (-)
REGIONAL REIT LTD	56.067 (-)	24 (-)	- (-)	- (-)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	98.957 (-)	111 (-)	130.393 (-)	141 (-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	100.219 (-)	84 (-)	115.933 (-)	93 (-)
<b>イスラエル</b>	千□	千イスラエル・シュケル	千□	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	37.888 (-)	555 (-)	44.537 (-)	652 (-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	57.219 (-)	422 (-)	65.119 (-)	479 (-)
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	39.089 (-)	68 (-)	59.731 (-)	103 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>韓国</b>	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	10.475 (-)	42,625 (-)	49.828 (-)	194,286 (-)
E KOCREF CR-REIT CO LTD	- (-)	- (-)	11.135 (-)	54,863 (-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21.366 (-)	131,851 (-)	24 (-)	151,899 (-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.697 (-)	26,264 (55)	24.051 (-)	100,182 (-)
LOTTE REIT CO LTD	43.393 (-)	133,723 (-)	51.072 (-)	159,436 (-)
KORAMCO LIFE INFRA REIT	10.885 (-)	58,631 (-)	8.873 (-)	45,653 (-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	- (-)	- (-)	9.851 (-)	31,664 (-)
JR REIT XXVII	44.308 (-)	179,948 (-)	45.023 (-)	182,075 (-)
SK REITS CO LTD	16.994 (-)	74,021 (△3,172)	- (-)	- (-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	29.522 (-)	109,361 (△159)	39.496 (-)	147,731 (-)
D&D PLATFORM REIT CO LTD	17.128 (-)	55,171 (△24)	19.888 (-)	64,614 (-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	9.562 (-)	34,844 (△544)	8.876 (-)	30,237 (-)
SK REITS CO LTD-RTS	- (11.9)	- (△16)	11.9 (-)	77 (-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD-RTS	- (7.341)	- (△55)	7.341 (-)	796 (-)
<b>ユーロ (ガーンジー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
SHURGARD SELF STORAGE LTD	14.26 (-)	568 (-)	1.676 (-)	71 (-)
<b>ユーロ (シンガポール)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	95.4 (-)	127 (△16)	128.2 (-)	163 (-)
<b>ユーロ (アイルランド)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	60.918 (-)	58 (-)	83.346 (-)	78 (-)
<b>ユーロ (オランダ)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
VASTNED RETAIL	3.282 (-)	65 (-)	3.903 (-)	75 (-)
WERELDHAVE NV	8.41 (-)	124 (-)	12.56 (-)	175 (-)
NSI NV	2.777 (-)	48 (-)	3.792 (-)	65 (-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10.687 (-)	225 (-)	12.016 (-)	244 (-)
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COFINIMMO SA	10.952 (-)	703 (-)	9.881 (-)	603 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
RETAIL ESTATES	4.347	252	4.62	266
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3.366	60	15.979	330
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	54.907	1,367	53.483	1,278
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	5.641	396	4.493	312
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	17.307	963	15.759	838
	(-)	(7)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	4.423	53	5.343	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA SA-RTS	-	-	17.659	7
	(17.659)	(△7)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	13.195	360	9.442	256
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	16.193	1,555	19.88	1,884
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	5.38	172	7.293	220
	(-)	(△24)	(-)	(-)
ALTAREA	1.572	123	1.761	137
	(-)	(△0.33328)	(-)	(-)
KLEPIERRE	54.725	1,290	62.745	1,440
	(-)	(△74)	(-)	(-)
COVIVIO	13.935	594	14.422	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	27.097	222	25.38	209
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	11.681	165	15.53	218
	(-)	(△20)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	27.41	1,428	34.451	1,773
	(-)	(△100)	(-)	(-)
<b>ユーロ (ドイツ)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	11.372	72	15.044	94
	(-)	(△12)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	-	-	3.939	15
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (スペイン)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	66.154	362	84.623	456
	(-)	(△7)	(-)	(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	11.497	66	18.351	104
	(-)	(△1)	(-)	(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	81.925	694	96.047	794
	(-)	(△30)	(-)	(-)

(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	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 1,922	百万円 1,032	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	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 (2023年6月23日から2024年6月24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) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		末
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	比率
<b>不動産ファンド</b>						
<b>(アメリカ)</b>						
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		391.9	291.8	39	6,344	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0	0.0
PRIME US REIT		317.6	349.36	40	6,423	0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		144.6	299.8	178	28,519	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		839	839	55	8,853	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		70.549	63.579	7,410	1,184,833	1.3
ALEXANDER'S INC.		1.021	0.86	188	30,159	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		63.691	58.553	3,601	575,729	0.7
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		104.551	99.906	3,298	527,427	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		65.982	53.077	423	67,633	0.1
AGREE REALTY CORP		41.761	40.554	2,494	398,752	0.5
BRT APARTMENTS CORP		6.159	5.643	101	16,158	0.0
SL GREEN		28.057	26.178	1,444	230,988	0.3
EPR PROPERTIES		33.842	30.568	1,247	199,447	0.2
PROLOGIS INC		414.926	373.989	40,914	6,541,393	7.4
AVALONBAY COMMUNITIES INC		63.859	57.357	11,694	1,869,719	2.1
LXP INDUSTRIAL TRUST		131.103	118.308	1,050	167,965	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		47.839	43.034	4,720	754,766	0.9
VERIS RESIDENTIAL INC		35.212	33.67	487	77,948	0.1
EQUINIX INC		42.028	38.337	29,327	4,688,929	5.3
NNN REIT INC		82.288	74.063	3,126	499,935	0.6
CTO REALTY GROUTH INC		9.356	7.42	126	20,285	0.0
COUSINS PROPERTIES INC		68.071	61.428	1,420	227,162	0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		14.046	-	-	-	-
SITE CENTERS CORP		81.813	72.757	1,043	166,808	0.2
SAFEHOLD INC		17.782	17.116	324	51,856	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		11.922	11.922	9	1,562	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		28.759	25.937	7,216	1,153,724	1.3
EQUITY RESIDENTIAL		152.806	139.306	9,515	1,521,416	1.7
FEDERAL REALTY INVS TRUST		33.218	30.104	3,017	482,506	0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		58.984	53.458	2,526	404,010	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		244.412	284.288	5,469	874,495	1.0
EQUITY COMMONWEALTH		49.039	43.229	837	133,943	0.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC		48.223	42.731	1,109	177,354	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST		76.925	69.695	353	56,494	0.1
WELLTOWER INC		223.439	241.529	24,713	3,951,153	4.5
EAST GROUP		20.032	19.335	3,231	516,614	0.6
KIMCO REALTY		277.027	270.439	5,132	820,653	0.9
KILROY REALTY CORP		47.193	43.143	1,362	217,829	0.2
LTC PROPERTIES INC		18.9	17.329	587	93,922	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		101.192	89.231	233	37,377	0.0

銘 柄	期 首(前期末)	当 期			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
BRANDYWINE REALTY TRUST	81.948	65.638	297	47,643	0.1
IRON MOUNTAIN INC	131.248	118.409	10,521	1,682,229	1.9
THE MACERICH COMPANY	95.956	87.151	1,278	204,407	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	78.222	75.334	4,846	774,936	0.9
ACADIA REALTY TRUST	44.351	42.601	739	118,171	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	318.701	284.799	5,220	834,632	0.9
MID AMERICA	52.249	47.191	6,652	1,063,528	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13.525	—	—	—	—
NATIONAL HEALTH INVS INC	19.429	17.553	1,171	187,325	0.2
CENTERSPACE	6.622	6.258	419	67,125	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8.132	5.83	138	22,183	0.0
GETTY REALTY CORP	20.182	19.838	524	83,796	0.1
RPT REALTY	40.594	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	302.637	351.747	18,695	2,989,013	3.4
REGENCY CENTERS CORP	68.717	66.651	4,141	662,173	0.8
UDR INC	138.65	122.38	4,983	796,732	0.9
COPT DEFENCE PROPERTIES	50.428	46.331	1,141	182,444	0.2
SAUL CENTERS INC	5.447	4.875	176	28,261	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	147.007	131.66	19,243	3,076,638	3.5
LIFE STORAGE INC	38.018	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	71.125	63.885	18,593	2,972,765	3.4
SUN COMMUNITIES INC	55.989	50.345	5,916	945,937	1.1
TANGER INC	46.487	44.528	1,182	189,013	0.2
UMH PROPERTIES INC	26.109	26.733	414	66,290	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16.72	15.124	209	33,562	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6.151	4.814	185	29,678	0.0
VENTAS INC	179.26	163.523	8,244	1,318,183	1.5
VORNADO REALTY TRUST	71.874	64.543	1,665	266,336	0.3
ELME COMMUNITIES	40.732	36.795	555	88,771	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	99.789	88.708	1,944	310,883	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	60.583	85.525	13,592	2,173,167	2.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53.55	46.375	74	11,863	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	94.114	82.956	840	134,354	0.2
CUBESMART	100.353	91.225	4,130	660,411	0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	131.006	131.081	19,445	3,109,005	3.5
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	91.448	85.756	715	114,346	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	266.517	242.489	1,163	186,091	0.2
DOUGLAS EMMETT INC	76.09	67.612	905	144,743	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	55.617	52.599	643	102,932	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	58.595	52.568	378	60,512	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	50.883	41.424	241	38,677	0.0
TERRENO REALTY CORP	32.893	39.063	2,264	361,982	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	23.022	19.557	421	67,319	0.1
RLJ LODGING TRUST	70.804	62.698	601	96,231	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	121.186	107.852	2,734	437,119	0.5

銘 柄	期 首(前期末)	当 期			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	55.166	48.508	672	107,568	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	23.664	23.664	53	8,550	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	22.868	19.711	162	26,030	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	103.588	93.511	1,369	218,875	0.2
WHITESTONE REIT	19.598	18.939	251	40,150	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61.059	52.743	257	41,235	0.0
STAG INDUSTRIAL INC	79.986	73.55	2,608	416,980	0.5
WP CAREY INC	96.284	88.393	4,872	778,970	0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC	33.832	30.467	499	79,788	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15.596	13.328	175	28,085	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	169.898	152.91	2,454	392,378	0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	25.104	24.192	2,410	385,311	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	29.672	25.65	281	45,028	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63.531	—	—	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	106.824	—	—	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	90.045	87.811	3,909	625,026	0.7
AMERICAN HOMES 4 RENT	140.789	129.991	4,725	755,460	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	101.147	90.754	1,642	262,626	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	12.848	11.565	1,245	199,194	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	43.096	34.53	506	80,988	0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	63.796	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	260.485	232.585	8,238	1,317,117	1.5
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	62.501	51.841	471	75,341	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17.079	15.197	320	51,315	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	66.693	70.815	1,901	303,993	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	26.881	26.881	92	14,741	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	118.272	109.672	4,866	777,999	0.9
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	136.117	121.708	2,744	438,793	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	22.683	22.683	62	9,936	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC	7.309	7.238	95	15,228	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6.752	4.384	67	10,759	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	29.365	28.156	690	110,468	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	23.717	16.653	192	30,831	0.0
CITY OFFICE REIT INC	17.231	17.231	86	13,774	0.0
ORION OFFICE REIT INC	28.112	20.368	69	11,104	0.0
NETSTREIT CORP	28.118	28.72	485	77,600	0.1
CARETRUST REIT INC	44.457	57.387	1,428	228,458	0.3
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	13.637	148	23,699	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	2.103	—	—	—	—
PHILLIPS EDISON & CO INC	52.693	49.443	1,603	256,436	0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1.188	—	—	—	—
APARTMENT INCOME REIT CORP	67.666	58.614	2,285	365,383	0.4
BROADSTONE NET LEASE INC	83.884	75.796	1,192	190,620	0.2
STAR HOLDINGS	5.322	—	—	—	—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	11.835	10.705	239	38,269	0.0

銘 柄	期 首(前期末)		当 期		末	
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	率
<b>(アメリカ)</b>	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	-	26.412	394	63,045		0.1
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	5.763	138	22,177		0.0
PARAMOUNT GROUP INC	78.702	63.997	287	45,940		0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26.422	26.662	234	37,554		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	52.509	47.399	856	136,937		0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	42.482	40.047	487	77,921		0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	49.736	41.188	586	93,838		0.1
COMMUNICATIONS SALES & LEASING I	-	99.47	284	45,483		0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10.016	9.712	361	57,840		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	36.394	28.153	1,189	190,171		0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10.321	9.794	226	36,249		0.0
APPLE HOSPITALITY REIT INC	95.647	91.043	1,328	212,371		0.2
GLOBAL NET LEASE INC	48.468	77.69	553	88,438		0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE	14.638	15.267	74	11,862		0.0
CLIPPER REALTY INC	5.086	5.086	18	2,894		0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	96.622	85.07	1,260	201,566		0.2
VICI PROPERTIES INC	451.537	421.682	11,849	1,894,460		2.2
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	39.634	37.579	921	147,379		0.2
小 計	□ 数 ・ 金 額	11,681.835	10,964.702	423,772	67,752,784	-
	銘 柄 数<比 率>	145銘柄<77.0%>	139銘柄<77.1%>	-	-	77.1
<b>(カナダ)</b>	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	31.367	28.245	608	71,084		0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT	37.034	33.079	1,424	166,306		0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58.204	52.945	457	53,459		0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	46.831	41.415	599	69,953		0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66.005	59.372	972	113,521		0.1
ALLIED PROPERTIES REIT	28.626	25.873	396	46,329		0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	8.533	2.585	47	5,552		0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.738	9.777	670	78,211		0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	24.568	21.895	140	16,382		0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV	24.648	21.726	267	31,193		0.0
INTERENT REAL ESTATE INVEST	32.303	27.652	326	38,088		0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	55.673	51.343	238	27,868		0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	8.705	6.485	95	11,203		0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT	4.643	-	-	-		-
DREAM INDUSTRIAL REIT	56.937	53.218	654	76,409		0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.423	15.423	48	5,635		0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	13.984	12.342	816	95,272		0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21.434	3.727	30	3,606		0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	72.055	64.451	804	93,891		0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	9.341	7.386	107	12,553		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25.088	22.105	284	33,234		0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	17.876	-	-	-		-
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.769	9.891	45	5,345		0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.104	8.104	125	14,624		0.0

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
<b>(カナダ)</b>	千□	千円	千□	千カナダ・ドル	千円	%
SLATE GROCERY REIT	12.066		12.169	133	15,540	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	14.455		14.455	95	11,136	0.0
PRIMARIS REIT	21.998		20.442	268	31,306	0.0
SLATE OFFICE REIT	17.818		—	—	—	—
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	8.337		—	—	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	24.983		23.694	396	46,271	0.1
小計	□数・金額	792,546	649,799	10,057	1,173,982	—
	銘柄数<比率>	30銘柄<1.7%>	26銘柄<1.3%>	—	—	1.3
<b>(オーストラリア)</b>	千□	千円	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%
BWP TRUST	209.056		222.212	806	85,631	0.1
MIRVAC GROUP	1,776.143		1,620.072	3,175	337,094	0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP	632.521		520.52	216	22,932	0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT	230.204		204.746	685	72,815	0.1
GPT GROUP	853.243		774.713	3,191	338,843	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	302.227		341.038	601	63,901	0.1
ABACUS GROUP	195.539		168.642	198	21,125	0.0
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	160.446		137.586	335	35,638	0.0
STOCKLAND	1,071.893		964.954	4,284	454,831	0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	162.299		157.084	761	80,878	0.1
DEXUS	479.312		441.787	2,893	307,195	0.3
GOODMAN GROUP	769.687		704.819	25,288	2,684,670	3.1
VICINITY CENTRES	1,758.932		1,588.997	2,995	317,976	0.4
CHARTER HALL GROUP	212.89		194.616	2,382	252,883	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	126.146		101.9	241	25,637	0.0
REGION RE LTD	515.147		466.538	1,045	110,941	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	240.142		213.14	667	70,822	0.1
ARENA REIT	165.205		147.24	584	62,055	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	299.469		265.944	922	97,967	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	91.184		93.159	281	29,867	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	538.807		509.415	1,186	126,005	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85.857		85.857	297	31,627	0.0
GDI PROPERTY GROUP	222.442		222.442	133	14,168	0.0
RURAL FUNDS GROUP	173.97		148.357	307	32,601	0.0
SCENTRE GROUP	2,339.436		2,106.223	6,718	713,273	0.8
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	140.343		—	—	—	—
HMC CAPITAL LTD	109.034		97.142	720	76,519	0.1
HOMECO DAILY NEEDS REIT	709.912		745.38	913	96,933	0.1
HEALTHCO REIT	182.619		202.023	232	24,663	0.0
ABACUS STORAGE KING	—		224.215	266	28,325	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	210.931		185.985	223	23,693	0.0
WAYPOINT REIT LTD	300.308		266.477	620	65,913	0.1
小計	□数・金額	15,265,344	14,123,223	63,182	6,707,435	—
	銘柄数<比率>	31銘柄<6.8%>	31銘柄<7.6%>	—	—	7.6
<b>(香港)</b>	千□	千円	千□	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	1,145.32		1,047.12	33,350	683,357	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
<b>(香港)</b>	千□	千□	千香港・ドル	千円	%	
PROSPERITY REIT	538	538	747	15,322	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	985	908	889	18,232	0.0	
CHAMPION REIT	896.07	735.07	1,117	22,893	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	445	439	768	15,741	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	678	591	2,316	47,469	0.1	
小 計	□ 数 ・ 金 額	4,687.39	4,258.19	39,190	803,017	-
	銘柄 数<比 率>	6銘柄<1.4%>	6銘柄<0.9%>	-	-	0.9
<b>(シンガポール)</b>	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,246.609	2,061.809	3,999	471,869	0.5	
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,505.56	1,441.46	3,646	430,224	0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,005.29	898.09	951	112,304	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,469.02	1,375.42	1,788	210,935	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	614.9	530.3	254	30,028	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	995.816	997.316	882	104,123	0.1	
KEPPEL REIT	890.7	910	755	89,102	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	480.7	472.4	1,006	118,702	0.1	
ESR LOGOS REIT	2,901.84	2,395.84	658	77,725	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	394.5	277.2	266	31,393	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	548.48	449.78	301	35,550	0.0	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	538.1	-	-	-	-	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	228.595	273.095	344	40,593	0.0	
PARKWAY LIFE REIT	173.2	163.1	570	67,343	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	912.62	852.62	1,824	215,248	0.2	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,038.8	957	1,167	137,734	0.2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	481.4	464.5	285	33,700	0.0	
PARAGON REIT	493.8	487.1	421	49,705	0.1	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	112.4	112.4	15	1,856	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	259.9	242.3	159	18,865	0.0	
OUÉ REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,039.155	-	-	-	-	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	847.2	716.6	408	48,186	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	226.7	-	-	-	-	
KEPPEL DC REIT	594.4	537.3	951	112,191	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	1,304.864	1,178.864	1,131	133,507	0.2	
小 計	□ 数 ・ 金 額	21,304.549	17,794.494	21,792	2,570,894	-
	銘柄 数<比 率>	25銘柄<3.6%>	22銘柄<2.9%>	-	-	2.9
<b>(ニュージーランド)</b>	千□	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%	
PRECINCT PROPERTIES	610.508	629.766	714	69,905	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209.563	-	-	-	-	
GOODMAN PROPERTY TRUST	476.422	431.888	898	87,856	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	710.515	641.837	532	52,100	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	376.442	365.062	376	36,774	0.0	
STRIDE STAPLED GROUP	233.35	-	-	-	-	
小 計	□ 数 ・ 金 額	2,616.8	2,068.553	2,521	246,636	-
	銘柄 数<比 率>	6銘柄<0.4%>	4銘柄<0.3%>	-	-	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	率
<b>(イギリス)</b>	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%
BRITISH LAND CO PLC	416.926	379.583	1,567	316,937		0.4
DERWENT LONDON PLC	49.785	45.359	1,031	208,531		0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	78.821	79.274	930	188,154		0.2
HAMMERSON PLC	1,850.26	1,555.881	440	89,018		0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	339.433	304.255	1,903	384,752		0.4
WORKSPACE GROUP PLC	60.495	55.71	328	66,338		0.1
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	0	0		0.0
UNITE GROUP PLC	178.13	160.222	1,438	290,880		0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	600.827	535.453	488	98,726		0.1
SEGRO PLC	550.499	540.554	4,827	975,904		1.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	114.09	164.077	554	112,119		0.1
ASSURA PLC	1,318.883	1,209.341	472	95,596		0.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	184.841	134.607	68	13,797		0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT	256.281	203.492	91	18,595		0.0
HELICAL PLC	48.089	42.126	100	20,269		0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	248.473	233.467	158	31,954		0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	395.99	—	—	—		—
SAFESTORE HOLDINGS LTD	96.433	87.913	701	141,831		0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	441.765	823.481	1,604	324,475		0.4
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU	351.056	289.95	223	45,136		0.1
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	875.198	788.97	1,090	220,437		0.3
WAREHOUSE REIT PLC	184.359	182.285	143	29,039		0.0
NEWRIVER REIT PLC	148.157	113.885	84	17,060		0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	293.773	—	—	—		—
PRS REIT PLC/THE	249.964	210.972	162	32,842		0.0
CLS HOLDINGS PLC	83.611	45.585	42	8,607		0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	153.569	117.315	66	13,519		0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	552.98	496.398	358	72,557		0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	844.097	921.889	1,415	286,090		0.3
CUSTODIAN REIT PLC	190.248	186.443	136	27,591		0.0
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	—	252.776	203	41,087		0.0
HOME REIT PLC	286.621	286.621	0	0		0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	288.036	244.328	229	46,481		0.1
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO P	103.977	—	—	—		—
LIFE SCIENCE REIT PLC	—	147.597	49	9,936		0.0
AEW UK REIT PLC	78.98	50.684	45	9,160		0.0
LXI REIT PLC	767.46	—	—	—		—
REGIONAL REIT LTD	180.491	236.558	49	9,995		0.0
URBAN LOGISTICS REIT PLC	221.68	190.244	235	47,692		0.1
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	185.316	169.602	145	29,453		0.0
小計	□数・金額	13,500.634	11,717.937	21,390	4,324,575	—
	銘柄数<比率>	38銘柄<4.7%>	36銘柄<4.9%>	—	—	4.9
<b>(イスラエル)</b>	千□	千□	千イスラエル・シユケル	千円		%
REIT 1 LTD	87.414	80.765	1,102	46,935		0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	92.361	84.461	554	23,588		0.0

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
<b>(イスラエル)</b>	千□		千□	千イスラエル・シケル	千円	%
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314.331		293.689	441	18,780	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	494.106 3銘柄<0.1%>	458.915 3銘柄<0.1%>	2,097 -	89,303 -	- 0.1
<b>(韓国)</b>	千□		千□	千韓国・ウォン	千円	%
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	39.353		-	-	-	-
E KOCREF CR-REIT CO LTD	11.135		-	-	-	-
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	29.807		27.173	168,200	19,359	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18.354		-	-	-	-
LOTTE REIT CO LTD	55.954		48.275	162,686	18,725	0.0
KORAMCO LIFE INFRA REIT	20.53		22.542	104,031	11,974	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9.851		-	-	-	-
JR REIT XXVII	66.386		65.671	273,191	31,444	0.0
SK REITS CO LTD	31.791		48.785	231,728	26,671	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	73.968		63.994	292,132	33,624	0.0
D&D PLATFORM REIT CO LTD	26.101		23.341	78,659	9,053	0.0
NH ALL-ONE REIT CO LTD	20.887		21.573	78,849	9,075	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	404.117 12銘柄<0.2%>	321.354 8銘柄<0.2%>	1,389,480 -	159,929 -	- 0.2
<b>(ユーロ…ガーデンジ)</b>	千□		千□	千ユーロ	千円	%
SHURGARD SELF STORAGE LTD	-		12.584	482	82,504	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄<-%>	12.584 1銘柄<0.1%>	482 -	82,504 -	- 0.1
<b>(ユーロ…シンガポール)</b>	千□		千□	千ユーロ	千円	%
CROMWELL REIT EUR	162.64		129.84	184	31,520	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	162.64 1銘柄<0.0%>	129.84 1銘柄<0.0%>	184 -	31,520 -	- 0.0
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>	千□		千□	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	198.163		175.735	159	27,309	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	198.163 1銘柄<0.0%>	175.735 1銘柄<0.0%>	159 -	27,309 -	- 0.0
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	千□		千□	千ユーロ	千円	%
VASTNED RETAIL	7.975		7.354	173	29,670	0.0
WERELDHAVE NV	18.149		13.999	187	32,021	0.0
NSI NV	8.534		7.519	145	24,834	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19.196		17.867	393	67,199	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	53.854 4銘柄<0.2%>	46.739 4銘柄<0.2%>	899 -	153,727 -	- 0.2
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>	千□		千□	千ユーロ	千円	%
COFINIMMO SA	13.78		14.851	849	145,226	0.2
RETAIL ESTATES	5.13		4.857	307	52,561	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12.613		-	-	-	-
WAREHOUSES DE PAUW	69.994		71.418	1,804	308,415	0.4
MONTEA SCA	6.01		7.158	563	96,307	0.1
AEDIFICA	17.659		19.207	1,098	187,823	0.2
CARE PROPERTY INVEST NV	16.012		15.092	197	33,748	0.0



銘柄	期首(前期末)	当期			期末
		□数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー) XIOR STUDENT HOUSING NV	千□ 10.247	千□ 14	千ユーロ 403	千円 68,931	% 0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	151.445 8銘柄<1.0%>	146.583 7銘柄<1.0%>	5,223 —	893,013 — 1.0
(ユーロ…フランス) GECINA SA ICADE ALTAREA KLEPIERRE COVIVIO MERCIALYS CARMILA SA UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	千□ 24.437 14.462 2.083 86.815 20.812 35.663 26.256 48.183	千□ 20.75 12,549 1,894 78,795 20,325 37.38 22,407 41,142	千ユーロ 1,886 305 168 2,029 929 397 364 3,023	千円 322,460 52,304 28,818 347,007 158,935 67,930 62,363 516,831	% 0.4 0.1 0.0 0.4 0.2 0.1 0.1 0.6
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	258.711 8銘柄<1.7%>	235.242 8銘柄<1.8%>	9,105 —	1,556,652 — 1.8
(ユーロ…ドイツ) HAMBORNER REIT AG ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千□ 32.393 3.939	千□ 28.721 —	千ユーロ 188 —	千円 32,161 —	% 0.0 —
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	36.332 2銘柄<0.0%>	28.721 1銘柄<0.0%>	188 —	32,161 — 0.0
(ユーロ…スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千□ 133.768 26.318 148.852	千□ 115.299 19,464 134.73	千ユーロ 637 134 1,420	千円 109,004 22,960 242,772	% 0.1 0.0 0.3
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	308.938 3銘柄<0.4%>	269.493 3銘柄<0.4%>	2,191 —	374,737 — 0.4
(ユーロ…イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	千□ 20.555	千□ 20.555	千ユーロ 35	千円 6,149	% 0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	20.555 1銘柄<0.0%>	20.555 1銘柄<0.0%>	35 —	6,149 — 0.0
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	71,937.959 324銘柄<99.4%>	63,422.659 302銘柄<99.0%>	— —	86,986,336 — 99.0

(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) < >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。

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期		期末
		買	建 額	
外国	D J U S R E A L E S T A T E		百万円 895	百万円 —

(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

2024年6月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券、投資証券	86,986,336 千円	98.4 %
コール・ローン等、その他	1,451,023	1.6
投資信託財産総額	88,437,359	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、87,853,241千円、99.3%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、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1香港・ドル=20.49円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シケル=42.573円、100韓国・ウォン=11.51円、1ユーロ=170.96円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	88,649,701,899円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	300,886,231
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	9,407,460,726
投 資 証 券(評価額)	77,578,875,696
未 収 入 金	636,567,111
未 収 配 当 金	289,741,082
差 入 委 託 証 拠	436,171,053
(B) 負 債	767,857,343
未 払 金	754,822,343
未 払 解 約 金	13,035,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	87,881,844,556
元 本	42,455,688,196
次 期 繰 越 損 益 金	45,426,156,360
(D) 受 益 権 総 口 数	42,455,688,196口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,700円

(注1) 期首元本額 47,496,039,171円  
追加設定元本額 32,421,167,258円  
一部解約元本額 37,461,518,233円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国リート (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	3,553,671,263円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,401,394円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,121,852円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	39,716,333円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	45,898,769円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,586,104円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	27,197,441円
たわらノーロード 先進国リート	15,330,920,587円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	128,586,248円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	250,596,932円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	4,258,594,024円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,106,523円
たわらノーロード バランス (標準型)	618,010,808円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,446,430,148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)	1,255,966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)	633,358,212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)	672,887,840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)	1,200,068,581円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	536,766円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	40,159,308円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	13,385,607円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	33,328,539円
One DC先進国リートインデックスファンド	2,255,560,675円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	15,876,493円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	596,420,560円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	79,425,412円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	189,471,408円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	313,572,673円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	612,101,769円
投資のソムリエ	3,856,050,647円
投資のソムリエ<DC年金>	413,259,951円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	270,614,486円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,013,891円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,452,619,453円
ワールドアセットバランス (基本コース)	246,980,107円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	680,485,328円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	63,029,259円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	32,850,694円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,386,291円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	86,191,058円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,215,386,591円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,783,516円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	38,983,095円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	35,002,071円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	22,084,482円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	5,403,231円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	68,809,621円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	270,424,593円
D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金>	383,275,072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)	217,802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)	647,540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)	125,270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)	867,926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)	711,941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)	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	5,202円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	62,054,960円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	895,492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)	572,716円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用)	2,122,603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)	40,047,574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)	101,133,689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)	16,902,701円
期末元本合計	42,455,688,196円

## ■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,544,474,640円	
	受取配当金	3,509,420,266	
	受取利息	22,157,843	
	その他の収益	12,979,415	
	支払利息	△82,884	
(B)	有価証券売買損益	11,467,586,659	
	売買益	18,334,949,393	
	売買損	△6,867,362,734	
(C)	先物取引等取引損益	4,548,586	
	取引益	5,384,758	
	取引損	△836,172	
(D)	その他費用	△38,379,043	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	14,978,230,842	
(F)	前期繰越損益金	33,703,055,639	
(G)	解約差損益金	△27,955,379,863	
(H)	追加信託差損益金	24,700,249,742	
(I)	計(E+F+G+H)	45,426,156,360	
	次期繰越損益金(I)	45,426,156,360	

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

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

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

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■先物取引等の指図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12日)