

運用報告書 (全体版)

第19期<決算日2023年1月11日>

投資のソムリエ<DC年金>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資 / 内外 / 資産割合
信託期間	2013年10月31日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。
主要投資対象	投資のソムリエ<DC年金>
	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。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、短期金融資産に投資する場合もあります。
	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。
	国内株式パッシブ・ファンド(個別化)・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。
	為替ヘッジ・海外債券パッシブ・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。
	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。
運用方法	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。
	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。
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
	※DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
組入制限	運用方針
	国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)に実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
	外貨連資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジを行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。
	基準価額の変動リスクを年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。
	※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。
	基本配分戦略(月次)では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。
	機動的配分戦略(日次)では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。
	各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には制限を設けません。
	外貨連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、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)、経費控除後の配当等収益および売却益(評価益を含みます。)等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

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、「投資のソムリエ<DC年金>」は、2023年1月11日に第19期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

投資のソムリエ<DC年金>

■最近 5 期の運用実績

決 算 期	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) 比 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分 配 落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率							
15期(2021年 1 月12日)	円 12,761	円 0	% 1.8	% 21.3	% 1.3	% 68.2	% －	% －	% 6.5	百万円 25,616
16期(2021年 7 月12日)	12,904	0	1.1	16.7	0.5	68.1	－	－	9.1	29,912
17期(2022年 1 月11日)	12,707	0	△1.5	18.7	0.9	54.6	－	－	6.8	38,723
18期(2022年 7 月11日)	11,608	0	△8.6	19.2	0.8	56.1	－	－	6.9	37,262
19期(2023年 1 月11日)	11,245	0	△3.1	15.1	0.9	47.3	－	－	8.0	37,919

- (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みます。
- (注 3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
- (注 4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
- (注 5) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指標を定めておりません。
- (注 6) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

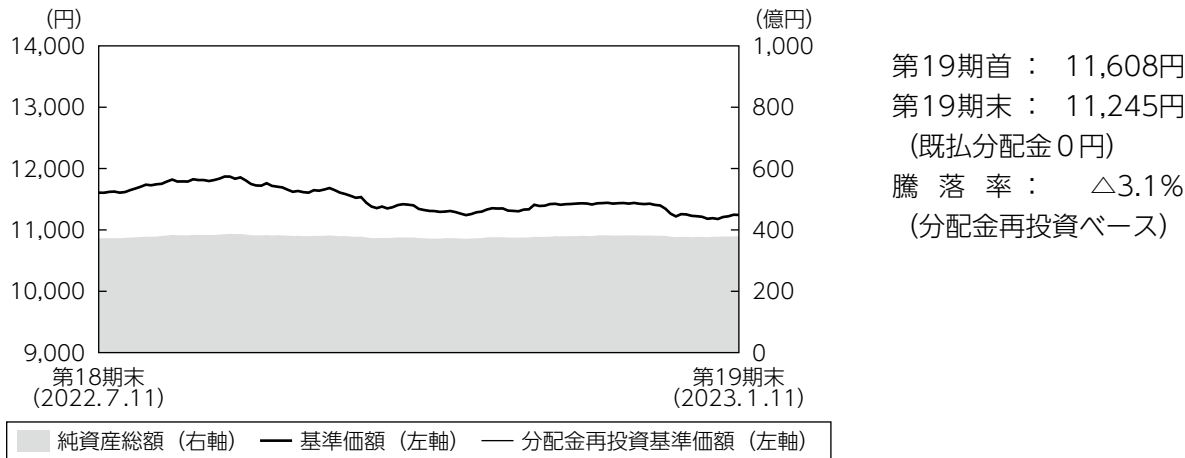
■当期中の基準価額の推移

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) 比 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率						
(期 首) 2022年 7 月11日	円 11,608	% －	% 19.2	% 0.8	% 56.1	% －	% －	% 6.9
7 月末	11,788	1.6	19.0	0.8	55.7	－	－	7.1
8 月末	11,693	0.7	20.9	0.9	60.7	－	－	7.0
9 月末	11,350	△2.2	10.7	△1.7	60.0	－	－	3.2
10月末	11,353	△2.2	12.3	0.7	59.7	－	－	6.2
11月末	11,433	△1.5	14.0	1.1	43.3	－	－	8.3
12月末	11,192	△3.6	14.0	0.8	68.0	－	－	6.0
(期 末) 2023年 1 月11日	11,245	△3.1	15.1	0.9	47.3	－	－	8.0

- (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) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含めて表示しています。
- (注 4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年7月12日から2023年1月11日まで）

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (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

今期の債券市場は、日銀の金融政策修正や欧米各国中央銀行の利上げ等を受けて、金利は上昇（価格は下落）しました。株式市場では、今後の景気見通しや金融政策への期待が変化する中で一進一退の展開となりました。当ファンドは、相対的にパフォーマンスのよかった新興国株式等がプラスに寄与した一方、金利上昇の影響で国内債券や為替ヘッジ先進国債券等がマイナスに寄与し、基準価額は下落しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.6%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	0.6%
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△4.9%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.5%
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	△3.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	△7.5%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	△2.4%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	△0.5%

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2022年12月中旬にかけては、欧米の主要中央銀行の金融引き締めに伴う世界景気の減速懸念や、米長期金利の上昇につれた動きなどが交錯し、国内債券市場の利回りは横ばいとなりました。12月下旬から期末にかけては、日銀が長期金利の変動幅を従来の±0.25%から±0.5%に拡大したことなどから利回りは上昇しました。

国内株式市場は、期初から2022年8月半ばまでは参議院選挙で自民党が圧勝したことや米国での利上げペースの鈍化などを受けて上昇しました。しかし、9月末にかけては世界景気の後退懸念などを要因として下落しました。その後、11月下旬にかけては、米国での長期金利の上昇の不服感などを要因として上昇しました。12月から期末にかけては、欧米の景気後退懸念の高まり、日銀による利上げ警戒感の高まりや円高進行などを要因として再び下落しました。

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、消費者物価指数が市場予想を上回ったことなどから、インフレ抑制のためにF R B（米連邦準備理事会）が積極的な利上げを継続したことを背景に利回りは上昇しました。ドイツ債についてもドイツの生産者物価指数の伸び加速や米国債の利回りの上昇、E C B（欧州中央銀行）の金融引き締め観測などを受けて利回りは上昇しました。

先進国株式市場は前期末比で上昇しました。期前半は中国の景気支援策や米ハイテク企業の好決算から上昇しましたが、その後F R Bの利上げ継続姿勢や天然ガス価格の高騰による欧州の景気後退が懸念され調整しました。その後2022年10月の米C P I（消費者物価指数）の伸びが鈍化したことから、米国の利上げペースの減速期待により底堅く推移して期末を迎えました。

国内リート市場は下落しました。期前半は米国の利上げペース鈍化観測などを背景に堅調な推移となりましたが、2022年9月にF R Bが3回連続となる0.75%の利上げを決定すると、米国の金融引き締めに対する警戒感が強まって下落しました。期後半は米国の金融引き締めペースを巡る思惑や相次ぐリーットの公募増資発表による需給悪化懸念、日銀の政策修正への警戒感などから不安定な相場展開となりました。

外国リート市場はまちまちの結果となりました。米国リート市場は期半ばにC P Iの伸び加速を受けてF R Bの利上げへの警戒感が強まり下落しました。欧州リート市場は英国の経済対策への懸念に伴う金利急騰などを背景にフランス、スペインを除く市場で下落しました。オーストラリアリート市場は期半ばに下落した後に値を戻し、前期末比ほぼ横ばいで期末を迎えました。

新興国債券市場は上昇しました。2022年8月半ばまで上昇した後、インフレ懸念による米長期金利の上昇や、米中央銀行による金融引き締めなどにより、10月にかけて反落しました。その後は、米国物価統計の落ち着いたにより米長期金利は低下し、スプレッドの縮小を伴いながら新興国債券も上昇に転じました。対米国債スプレッド（利回り格差）は、10月にかけて拡大したものの、期を通じては縮小しました。

新興国株式市場（円換算ベース）は前期末比でほぼ変わらずとなりました。期初、世界的に景気減速懸念がくすぶる中、中国の住宅ローン支払い拒否問題などもあって中国株が低調に推移する場面もありましたが、2022年8月に中国の予想外の利下げなどにより上昇しました。9月には米C P Iの伸び加速からF R Bの大幅利上げ継続による景気減速懸念が強まり下落しました。その後は中国によるゼロコロナ政策の緩和期待などから下げ幅を縮小して期末を迎えました。

為替市場では、ドル／円相場は、米国の金利が上昇し内外金利差が拡大したことや、日銀が金利上昇を抑制する姿勢を明確に示す中で2022年10月には1ドル＝150円を超える水準まで円安が進みましたが、その後は政府・日銀による為替介入や日銀の金融政策修正から円高が進み、前期末比では円高ドル安となりました。ユーロは米国で利上げペースが減速したこと等を受けて対ドルで上昇、また対円でも円安ユーロ高となり上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

【基本配分戦略（月次）】

8つのマザーファンドおよび為替ヘッジに関する基本配分比率を月次で決定し、リバランスを行いました。期を通じ、安定資産へ55～65％程度、リスク性資産へ25～35％程度配分しました。

【機動的配分戦略（日次）】

資産価格の下落するリスクが高まったと判断したことから、リスク性資産については2022年9月下旬から10月下旬、安定資産については当決算期の大半の期間において、各資産への配分を下げる運用を行いました。

●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NOMUR A-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。

●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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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、為替ヘッジあり）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。

●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。

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるS&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・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】

○資産配分

期首（前期末）

資 産		比 率	
安定資産	国内債券	16.7%	49.9%
	為替ヘッジ先進国債券	33.2%	
リスク性 資産	新興国債券	7.0%	34.0%
	国内株式	12.6%	
	先進国株式	5.0%	
	新興国株式	2.4%	
	国内リート	4.0%	
	先進国リート	2.9%	
現金等		16.1%	



期末

資 産		比 率	
安定資産	国内債券	18.8%	40.0%
	為替ヘッジ先進国債券	21.2%	
リスク性 資産	新興国債券	7.6%	31.5%
	国内株式	3.5%	
	先進国株式	6.2%	
	新興国株式	6.2%	
	国内リート	5.4%	
	先進国リート	2.5%	
現金等		28.4%	

※ 1 比率は純資産総額に対する割合です。

※ 2 国内債券：国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替ヘッジ先進国債券：為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国債券：エマージング債券パッシブ・マザーファンド、国内株式：国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、先進国株式：外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、新興国株式：エマージング株式パッシブ・マザーファンド、国内リート：J-REITインデックスファンド・マザーファンド、先進国リート：外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、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
	2022年7月12日 ～2023年1月11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	2,847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

基本戦略である基本配分戦略（月次）および機動的配分戦略（日次）に基づき、各マザーファンドの組入比率および為替ヘッジ比率を定め、安定した収益の獲得をめざします。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることで、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。

●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。

●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・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。

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を概ね一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

●J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

引き続き、リートの組入比率を高め、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。ベンチマークの構成銘柄の変更に応じたポートフォリオのリバランスを行い、資金の流入・流出に応じたきめ細かなポートフォリオ調整を実施し、ベンチマークと同等のリスク特性を維持するよう努めます。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第19期		項目の概要
	(2022年7月12日 ～2023年1月11日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	70円	0.610%	(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11,494円です。
(投信会社)	(33)	(0.291)	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)	(33)	(0.291)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(3)	(0.028)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	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)	(0.002)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.015	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.013)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	72	0.630	

(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。

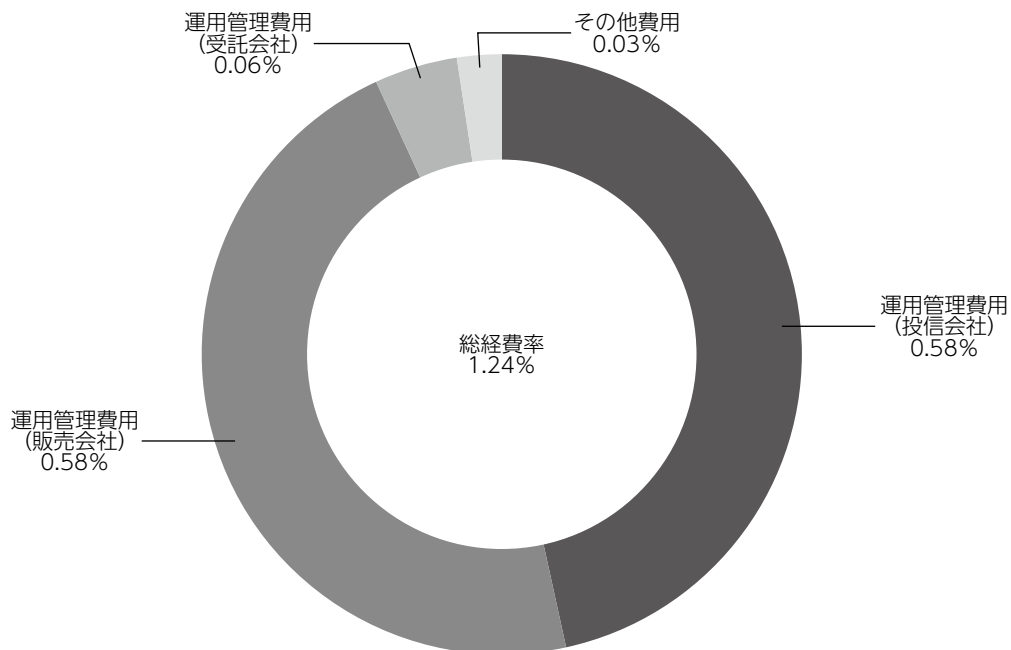
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.24%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。

■**売買及び取引の状況**（2022年7月12日から2023年1月11日まで）
先物取引の種類別取引状況

種 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 －	百万円 －	百万円 894	百万円 874

(注) 金額は受渡代金です。

■**親投資信託受益証券の設定、解約状況**（2022年7月12日から2023年1月11日まで）

	当 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	27,903,058	35,213,390	27,035,965	33,835,000
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	301,844	970,000	1,349,806	4,350,000
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,756,208	4,540,000	6,829,566	8,465,000
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	239,093	1,485,500	155,979	901,000
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	980,854	2,356,810	707,618	1,700,310
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	455,207	752,000	486,095	803,000
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	853,374	1,712,510	692,881	1,386,570
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,330,016	1,842,500	286,793	393,360

■**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	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	161,740,234千円	113,454,724千円	45,679,190千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	381,572,230千円	738,622,551千円	77,884,659千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.42	0.15	0.58

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年7月12日から2023年1月11日まで）
【投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞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	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D／C
金 銭 信 託	百万円 0.531	百万円 0.531	% 100.0	百万円 0.531	百万円 0.531	% 100.0

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	974千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2千円
(B)／(A)	0.2%

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

【国内債券パッシブ・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	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 868,226	百万円 40,368	% 4.6	百万円 845,571	百万円 46,571	% 5.5
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

平均保有割合 1.7%

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

【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	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D／C
株 式	百万円 41,009	百万円 11,501	% 28.0	百万円 120,730	百万円 84,947	% 70.4
金 銭 信 託	1	1	100.0	1	1	100.0

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) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 483	百万円 904	百万円 3,618

【為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】
期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	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
金 銭 信 託	百万円 0.216	百万円 0.216	% 100.0	百万円 0.216	百万円 0.216	% 100.0

平均保有割合 3.0%

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

【外国株式パッシブ・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
金 銭 信 託	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0	百万円 0.124	百万円 0.124	% 100.0

平均保有割合 0.2%

(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。

【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	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
株 式 先 物 取 引	百万円 9,176	百万円 4,474	% 48.8	百万円 9,263	百万円 －	% －
投 資 証 券	62,638	14,353	22.9	52,883	7,120	13.5
金 銭 信 託	0.406	0.406	100.0	0.406	0.406	100.0

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
	額
投 資 証 券	百万円 3,407

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

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D／C
金 銭 信 託	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0

平均保有割合 1.3%

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

【エマージング債券パッシブ・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		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D／C
金 銭 信 託	百万円 0.072	百万円 0.072	% 100.0	百万円 0.072	百万円 0.072	% 100.0

平均保有割合 2.0%

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

【エマージング株式パッシブ・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		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D／C
金 銭 信 託	百万円 0.022	百万円 0.022	% 100.0	百万円 0.022	百万円 0.022	% 100.0

平均保有割合 2.2%

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

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4,916,929	5,784,022	7,142,110
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,463,149	415,188	1,343,133
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,716,685	6,643,327	8,044,405
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	316,290	399,404	2,357,524
J－R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	617,721	890,956	2,058,198
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	640,725	609,837	966,410
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,310,869	1,471,362	2,866,949
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	637,923	1,681,147	2,369,240

■投資信託財産の構成

2023年1月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7,142,110	18.7
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,343,133	3.5
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,044,405	21.1
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,357,524	6.2
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	2,058,198	5.4
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	966,410	2.5
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,866,949	7.5
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,369,240	6.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,065,490	29.0
投 資 信 託 財 産 総 額	38,213,463	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2023年1月11日現在、562,687千円、1.5％、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは252,437,143千円、98.1％、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは802,795,507千円、99.9％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは65,447,819千円、98.7％、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは124,385,915千円、98.1％、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは98,281,118千円、95.6％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年1月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝132.40円、1カナダ・ドル＝98.59円、1オーストラリア・ドル＝91.33円、1香港・ドル＝16.95円、1シンガポール・ドル＝99.44円、1ニュージーランド・ドル＝84.37円、1台湾・ドル＝4.343円、1イギリス・ポンド＝160.99円、1イスラエル・シェケル＝38.217円、1スイス・フラン＝143.62円、1トルコ・リラ＝7.049円、1デンマーク・クローネ＝19.13円、1ノルウェー・クローネ＝13.28円、1スウェーデン・クローナ＝12.72円、1メキシコ・ペソ＝6.948円、1フィリピン・ペソ＝2.411円、100チリ・ペソ＝15.976円、100コロンビア・ペソ＝2.763円、1クウェート・ディナール＝433.67円、1カタール・リアル＝36.22円、1サウジアラビア・リアル＝35.34円、1インド・ルピー＝1.63円、100インドネシア・ルピア＝0.85円、1アラブ首長国連邦・ディルハム＝36.11円、1ブラジル・レアル＝25.428円、1チェコ・コルナ＝5.931円、100韓国・ウォン＝10.64円、1オフショア・人民元＝19.51円、1マレーシア・リンギット＝30.264円、1南アフリカ・ランド＝7.79円、1タイ・バーツ＝3.94円、1ポーランド・ズロチ＝30.312円、100ハンガリー・フォリント＝35.711円、1ユーロ＝142.25円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年1月11日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	45,819,872,982円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,077,363,495
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	7,142,110,391
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)	1,343,133,597
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	8,044,405,645
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,357,524,848
J-REITインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	2,058,198,975
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	966,410,064
エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)	2,866,949,106
エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)	2,369,240,515
未 収 入 金	8,031,849,076
差 入 委 託 証 拠 金	562,687,270
(B) 負 債	7,900,438,740
未 払 金	7,618,949,273
未 払 解 約 金	50,027,733
未 払 信 託 報 酬	230,890,798
そ の 他 未 払 費 用	570,936
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	37,919,434,242
元 本	33,720,845,622
次 期 繰 越 損 益 金	4,198,588,620
(D) 受 益 権 総 口 数	33,720,845,622口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	11,245円

■損益の状況

当期 自2022年7月12日 至2023年1月11日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,293,896円
受 取 利 息	16,643
そ の 他 収 益 金	4,946,985
支 払 利 息	△1,669,732
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△985,926,271
売 買 益	854,222,564
売 買 損	△1,840,148,835
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	37,540,029
取 引 益	37,540,334
取 引 損	△305
(D) 信 託 報 酬 等	△233,658,395
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△1,178,750,741
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	△2,070,578,353
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,447,917,714
(配 当 等 相 当 額)	(8,028,447,849)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△580,530,135)
(H) 合 計(E+F+G)	4,198,588,620
次 期 繰 越 損 益 金(H)	4,198,588,620
追 加 信 託 差 損 益 金	7,447,917,714
(配 当 等 相 当 額)	(8,031,151,747)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△583,234,033)
分 配 準 備 積 立 金	1,570,724,283
繰 越 損 益 金	△4,820,053,377

- (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) (D)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) (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。
- (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	41,052,326円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	8,031,151,747
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,529,671,957
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	9,601,876,030
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	2,847.46
(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基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。

《お知らせ》

■機動的配分戦略（日次戦略）における資産配分に関するルールを変更しました。

(2022年10月12日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日 2022年2月14日）

（計算期間 2021年2月16日～2022年2月14日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債券組入 比 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率	純 資 産 総 額
	円	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率				
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	ポイント 380.56	% 1.0	% 99.5	% —	% —	百万円 355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	—	553,303

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

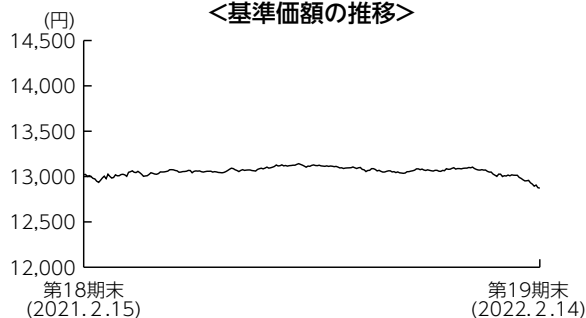
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2021 年 2 月 15 日	円 13,022	% —	ポイント 385.59	% —	% 99.2	% —	% —
2 月 末	12,936	△0.7	383.06	△0.7	99.5	—	—
3 月 末	13,025	0.0	385.72	0.0	99.7	—	—
4 月 末	13,049	0.2	386.44	0.2	99.8	—	—
5 月 末	13,054	0.2	386.62	0.3	99.9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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

＜基準価額の推移＞



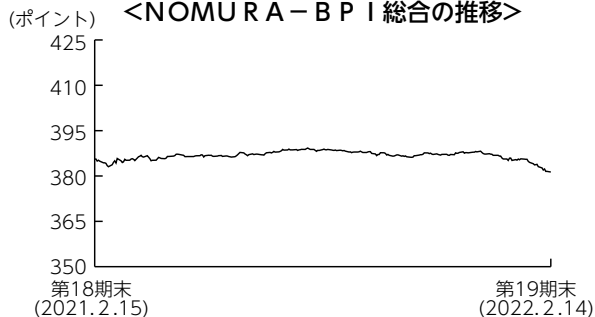
基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

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

＜NOMURA-BPI総合の推移＞



投資環境

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

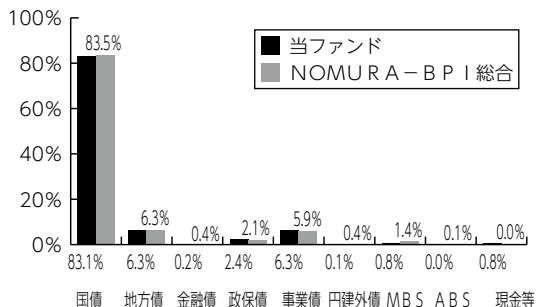
ポートフォリオについて

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

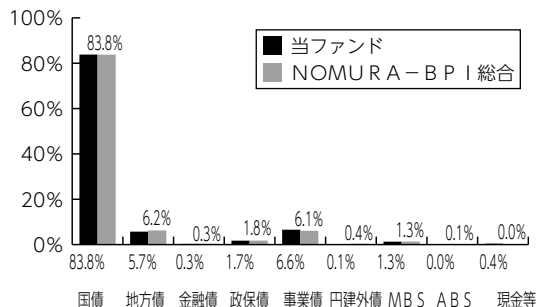
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

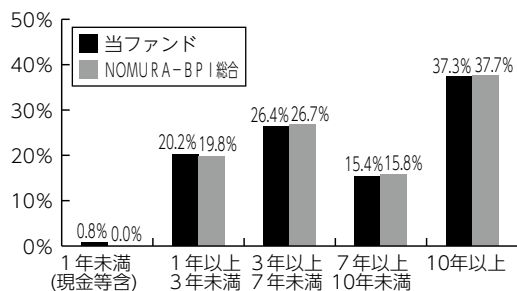


期末

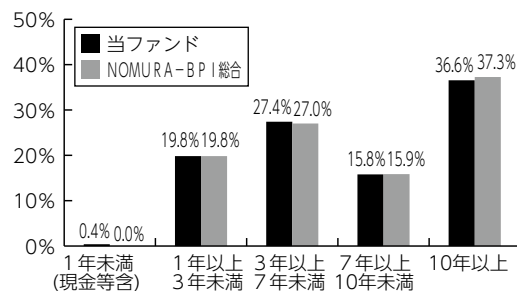


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.1%下落しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況（2021年 2 月16日から2022年 2 月14日まで）

公社債

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

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

■ 利害関係人との取引状況等（2021年 2 月16日から2022年 2 月14日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期	当			期		
区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
公社債	百万円 770,671	百万円 100,563	% 13.0	百万円 480,119	百万円 73,234	% 15.3

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	当期
	買付額
公社債	百万円 304

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	447,045,000	463,797,306	83.8	—	53.6	19.7	10.5
地 方 債 証 券	30,445,330	31,523,404	5.7	4.7	3.6	1.4	0.7
特 殊 債 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 券	27,481,000	27,644,946	5.0	0.1	2.4	1.9	0.7
合 計	531,923,315	551,087,616	99.6	4.8	63.0	24.2	12.5

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

(注 2) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 2 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
4 2 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
4 2 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
4 2 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
4 2 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
4 2 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
4 3 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
4 3 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	50,000	52,841	2024/06/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	3,820,000	3,863,280	2025/12/20

銘	柄	当期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額 償還年月日	
(国債証券)		%	千円	千円	
8 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	75,621	2025/12/20
8 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	182,998	2025/12/20
1 4 7 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,000,000	3,999,160	2026/03/20
3 4 2 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,980,000	3,994,606	2026/03/20
8 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	640,415	2026/03/20
8 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	131,235	2026/03/20
8 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	130,744	2026/03/20
1 4 8 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,900,000	3,898,284	2026/06/20
3 4 3 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,350,000	4,366,008	2026/06/20
8 8 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	648,504	2026/06/20
8 9 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,948	2026/06/20
1 4 9 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	4,200,000	4,196,136	2026/09/20
3 4 4 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,790,000	5,809,917	2026/09/20
9 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	516,910	2026/09/20
9 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	121,484	2026/09/20
1 5 0 回	利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,300,000	1,298,102	2026/12/20
3 4 5 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,190,000	5,206,296	2026/12/20
9 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,275,826	2026/12/20
3 4 6 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,740,000	4,754,409	2027/03/20
9 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	406,837	2027/03/20
9 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	740,108	2027/03/20
3 4 7 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,030,000	5,044,737	2027/06/20
9 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	550,000	616,099	2027/06/20
9 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	133,142	2027/06/20
3 4 8 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,990,000	5,003,872	2027/09/20
9 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	660,000	739,160	2027/09/20
9 8 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	178,297	2027/09/20
3 4 9 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,430,000	4,441,606	2027/12/20
9 9 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	750,000	839,340	2027/12/20
3 5 0 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	5,210,000	5,221,045	2028/03/20
1 0 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	830,000	937,783	2028/03/20
1 0 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.4000	230,000	262,657	2028/03/20
3 5 1 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,600,000	4,608,694	2028/06/20
1 0 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.4000	500,000	573,740	2028/06/20
1 0 3 回	利付国庫債券 (20年)	2.3000	160,000	182,587	2028/06/20
1 0 4 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	124,138	2028/06/20
3 5 2 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,440,000	4,447,281	2028/09/20
1 0 5 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	640,000	725,280	2028/09/20
1 0 6 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	569,905	2028/09/20
3 5 3 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,810,000	4,816,541	2028/12/20
1 0 7 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	600,000	682,722	2028/12/20
1 0 8 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	690,000	775,739	2028/12/20
3 5 4 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,060,000	4,064,263	2029/03/20
1 0 9 回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	350,000	394,908	2029/03/20
1 1 0 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	502,660	2029/03/20
3 5 5 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,310,000	4,311,551	2029/06/20
1 1 1 回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	460,000	530,794	2029/06/20
1 1 2 回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	740,000	848,491	2029/06/20
3 5 6 回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,640,000	3,637,233	2029/09/20
1 回	利付国庫債券 (30年)	2.8000	110,000	132,286	2029/09/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
113回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,170,000	1,345,862	2029/09/20
357回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,690,000	3,684,243	2029/12/20
114回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	820,000	946,895	2029/12/20
115回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	418,510	2029/12/20
2回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	118,144	2030/02/20
358回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,550,000	3,541,444	2030/03/20
116回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	530,000	618,329	2030/03/20
117回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,070,000	1,239,744	2030/03/20
359回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,260,000	4,245,942	2030/06/20
118回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	555,000	640,653	2030/06/20
119回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	470,000	534,775	2030/06/20
120回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	670,000	751,277	2030/06/20
360回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,040,000	4,022,830	2030/09/20
121回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	790,000	908,073	2030/09/20
122回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	650,352	2030/09/20
4回	利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	247,670	2030/11/20
361回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,000,000	3,977,320	2030/12/20
123回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,050,000	1,228,164	2030/12/20
124回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	600,000	696,576	2030/12/20
362回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,750,000	4,715,990	2031/03/20
125回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	709,350	2031/03/20
126回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	510,000	593,813	2031/03/20
127回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	623,905	2031/03/20
363回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,800,000	4,760,304	2031/06/20
128回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,370,000	1,587,227	2031/06/20
129回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	760,000	873,521	2031/06/20
364回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,400,000	4,356,528	2031/09/20
130回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	910,000	1,048,047	2031/09/20
131回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	790,000	902,401	2031/09/20
6回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	242,360	2031/11/20
365回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,300,000	1,285,583	2031/12/20
132回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	830,000	950,184	2031/12/20
133回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,030,000	1,189,093	2031/12/20
134回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	800,000	925,224	2032/03/20
135回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	640,000	733,862	2032/03/20
136回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	660,000	750,274	2032/03/20
137回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	800,000	918,800	2032/06/20
138回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,340,000	1,511,908	2032/06/20
139回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	920,000	1,047,318	2032/06/20
140回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,290,000	2,634,072	2032/09/20
8回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	232,380	2032/11/22
141回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	1,580,000	1,819,938	2032/12/20
142回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,500,000	1,743,615	2032/12/20
143回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,480,000	1,691,033	2033/03/20
144回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,310,000	1,482,697	2033/03/20
11回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	250,000	288,867	2033/06/20
145回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,350,000	2,715,354	2033/06/20
12回	利付国庫債券 (30年)	2.1000	230,000	276,696	2033/09/20
146回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	2,280,000	2,639,122	2033/09/20
13回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	150,000	179,062	2033/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	2,350,000	2,696,319	2033/12/20	
14回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	340,000	422,810	2034/03/20	
148回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	2,210,000	2,512,084	2034/03/20	
15回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	260,000	327,298	2034/06/20	
149回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	2,270,000	2,583,441	2034/06/20	
16回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	240,000	302,973	2034/09/20	
150回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	2,440,000	2,750,685	2034/09/20	
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	270,000	338,447	2034/12/20	
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,460,000	2,713,675	2034/12/20	
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	400,000	497,632	2035/03/20	
152回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,340,000	2,582,494	2035/03/20	
19回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	280,000	349,154	2035/06/20	
153回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	2,620,000	2,926,068	2035/06/20	
20回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	330,000	420,977	2035/09/20	
154回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,690,000	2,969,356	2035/09/20	
21回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	310,000	388,023	2035/12/20	
155回 利付国庫債券 (20年)	1.0000	2,460,000	2,650,133	2035/12/20	
22回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	290,000	371,727	2036/03/20	
156回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,550,000	2,538,142	2036/03/20	
23回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	350,000	449,694	2036/06/20	
157回 利付国庫債券 (20年)	0.2000	2,430,000	2,346,553	2036/06/20	
24回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	270,000	347,706	2036/09/20	
158回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,690,000	2,706,543	2036/09/20	
25回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	330,000	416,394	2036/12/20	
159回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	2,480,000	2,526,475	2036/12/20	
26回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	620,000	792,521	2037/03/20	
160回 利付国庫債券 (20年)	0.7000	2,010,000	2,073,676	2037/03/20	
27回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,890,000	1,919,654	2037/06/20	
161回 利付国庫債券 (20年)	2.5000	620,000	805,206	2037/09/20	
28回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,820,000	1,846,317	2037/09/20	
162回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	2,070,000	2,097,303	2037/12/20	
29回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	770,000	1,003,825	2038/03/20	
163回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,680,000	2,668,074	2038/03/20	
30回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	2,310,000	2,296,116	2038/06/20	
164回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	860,000	1,112,083	2038/09/20	
31回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,830,000	1,873,151	2038/09/20	
165回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,970,000	1,950,300	2038/12/20	
32回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	880,000	1,126,734	2039/03/20	
166回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,680,000	1,632,976	2039/03/20	
33回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,950,000	1,858,096	2039/06/20	
167回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	720,000	912,038	2039/09/20	
34回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,420,000	1,348,971	2039/09/20	
168回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,740,000	1,649,206	2039/12/20	
35回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	970,000	1,248,263	2040/03/20	
169回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,510,000	1,453,586	2040/03/20	
36回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	2,120,000	2,036,472	2040/06/20	
170回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	1,180,000	1,462,456	2040/09/20	
37回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,990,000	1,907,454	2040/09/20	
171回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,930,000	1,879,820	2040/12/20	
38回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,200,000	1,532,796	2041/03/20	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
176回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,080,000	2,021,843	2041/03/20	
177回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,300,000	2,191,785	2041/06/20	
35回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,460,000	1,818,371	2041/09/20	
178回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,100,000	2,036,391	2041/09/20	
179回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	800,000	776,176	2041/12/20	
36回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	2,170,000	2,712,239	2042/03/20	
37回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	2,260,000	2,788,297	2042/09/20	
38回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,550,000	1,885,854	2043/03/20	
39回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,220,000	1,510,055	2043/06/20	
40回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	940,000	1,145,784	2043/09/20	
41回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,080,000	1,295,665	2043/12/20	
42回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,120,000	1,344,560	2044/03/20	
43回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,120,000	1,345,489	2044/06/20	
44回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,130,000	1,358,395	2044/09/20	
45回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,270,000	1,474,444	2044/12/20	
46回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,670,000	1,939,404	2045/03/20	
47回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,310,000	1,549,651	2045/06/20	
48回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,640,000	1,870,567	2045/09/20	
49回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,460,000	1,665,422	2045/12/20	
50回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,660,000	1,675,222	2046/03/20	
51回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,350,000	1,211,233	2046/06/20	
52回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	1,510,000	1,418,358	2046/09/20	
53回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,200,000	1,151,448	2046/12/20	
54回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,450,000	1,454,553	2047/03/20	
55回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,520,000	1,523,207	2047/06/20	
56回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,230,000	1,231,303	2047/09/20	
57回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,300,000	1,300,000	2047/12/20	
1回 利付国庫債券 (40年)	2.4000	110,000	151,087	2048/03/20	
58回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,670,000	1,666,392	2048/03/20	
59回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,520,000	1,478,884	2048/06/20	
60回 利付国庫債券 (30年)	0.9000	1,130,000	1,149,729	2048/09/20	
61回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,140,000	1,102,619	2048/12/20	
2回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	630,000	836,621	2049/03/20	
62回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	1,070,000	981,050	2049/03/20	
63回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,160,000	1,032,724	2049/06/20	
64回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,180,000	1,048,418	2049/09/20	
65回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,010,000	895,567	2049/12/20	
3回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	540,000	720,835	2050/03/20	
66回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,090,000	965,631	2050/03/20	
67回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,550,000	1,446,615	2050/06/20	
68回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,340,000	1,249,992	2050/09/20	
69回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,450,000	1,388,360	2050/12/20	
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	966,996	2051/03/20	
70回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,420,000	1,359,224	2051/03/20	
71回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,600,000	1,531,040	2051/06/20	
72回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,500,000	1,434,915	2051/09/20	
73回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	600,000	573,792	2051/12/20	
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	1,010,000	1,311,889	2052/03/20	
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	1,030,000	1,317,009	2053/03/20	
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	1,190,000	1,463,473	2054/03/20	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
8回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	1,310,000	1,505,792	2055/03/20
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,950,000	1,675,966	2056/03/20
10回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,820,000	1,829,755	2057/03/20
11回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,480,000	1,441,638	2058/03/20
12回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,400,000	1,228,892	2059/03/20
13回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,730,000	1,512,244	2060/03/20
14回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	1,700,000	1,585,624	2061/03/20
小 計		—	447,045,000	463,797,306	—
(地方債証券)		%	千円	千円	
7 1 9回	東京都公募公債	0.8600	200,000	201,858	2023/03/20
1 2 1回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	503,335	2023/04/25
2 5 年度 4回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	303,270	2023/05/30
7 2 0回	東京都公募公債	0.8700	300,000	303,474	2023/06/20
1回	東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	102,059	2023/06/20
2 5 年度 4回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	202,128	2023/06/20
2 5 年度 2回	横浜市公募公債	0.8880	400,000	404,956	2023/07/14
3 7 4回	大阪府公募公債	0.9380	300,000	304,038	2023/07/28
2 5 年度 5回	千葉県公募公債	0.8400	200,000	202,532	2023/08/25
2 5 年度 6回	千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,271	2023/09/25
2 9 回 1号	宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,134	2023/10/25
1 2 7回	共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,134	2023/10/25
1 2 8回	共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	303,459	2023/11/24
2 5 年度 2回	島根県公募公債	0.6700	106,000	107,246	2023/11/27
7 2 6回	東京都公募公債	0.7300	400,000	405,316	2023/12/20
2 5 年度 8回	埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,289	2023/12/25
2 5 年度 11回	福岡県公募公債	0.6940	200,000	202,736	2024/02/26
2 5 年度 2回	新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,322	2024/02/28
1 3 2回	共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,345	2024/03/25
2 0 8回	神奈川県公募公債	0.5510	300,000	303,732	2024/06/20
2 6 年度 4回	札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,219	2024/06/20
1回	兵庫県公募公債 (12年)	1.1000	300,000	307,608	2024/06/26
2 6 年度 4回	神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,402	2024/07/18
2 6 年度 5回	埼玉県公募公債	0.6110	400,000	405,720	2024/07/29
4 8 8回	名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	456,633	2024/09/20
2 6 年度 1回	相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,295	2024/09/20
2 6 年度 1回	長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,361	2024/09/30
2 6 年度 1回	静岡県公募公債	0.5150	100,000	101,332	2024/11/25
2 6 年度 11回	京都府公募公債	0.4760	350,000	354,382	2024/12/19
2 6 年度 1回	三重県公募公債	0.4560	100,000	101,188	2024/12/25
2 6 年度 1回	浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,866	2025/01/23
1 4 2回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	504,480	2025/01/24
2 6 年度 3回	広島市公募公債	0.4290	100,000	101,177	2025/02/25
2 6 年度 17回	兵庫県公募公債	0.4600	200,000	202,544	2025/02/26
5回	東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	106,390	2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,524	2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	405,336	2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	610,044	2025/05/23
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	508,730	2025/07/25
7回	東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	107,575	2025/09/19
1回	静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	107,627	2025/09/19

銘	柄	当期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)		%	千円	千円	
27年度15回	愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,571	2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,575	2025/12/25
2 7年度9回	千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,122	2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,074	2026/04/24
9回	東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	220,570	2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,998	2026/06/25
1回	兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	214,114	2026/07/29
2 8年度6回	北海道公募公債	0.0700	100,000	99,977	2026/08/31
7 6 0回	東京都公募公債	0.0450	100,000	99,862	2026/09/18
1 0回	東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	330,960	2026/09/18
4回	京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	111,143	2026/09/18
4 1 3回	大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,723	2026/10/28
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	502,335	2027/01/25
2 8年度8回	福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,725	2027/02/24
4 1 9回	大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,392	2027/04/27
2回	静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	106,848	2027/06/25
5回	兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,010	2027/07/07
2 9年度4回	大阪市公募公債	0.1500	200,000	199,998	2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,972	2027/09/24
2 4年度1回	福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	106,797	2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	100,471	2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	502,535	2028/02/25
2 9年度6回	広島市公募公債	0.2300	300,000	301,341	2028/02/25
2 9年度1 3回	京都府公募公債	0.2000	109,330	109,626	2028/03/16
5回	兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	321,342	2028/05/26
7 8 3回	東京都公募公債	0.2200	110,000	110,413	2028/06/20
4回	静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	107,343	2028/06/23
3 0年度7回	神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	301,740	2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募公債	0.1850	200,000	200,260	2028/09/20
7回	静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	342,096	2028/09/21
3 0年度3回	広島県公募公債	0.2540	100,000	100,581	2028/09/25
3 0年度3回	堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067	2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募公債	0.1350	200,000	199,458	2028/12/20
2 0回2号	福岡県公募公債	2.0500	100,000	112,685	2028/12/20
6回	大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612	2028/12/20
1 7回	横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	112,820	2028/12/20
6回	北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	112,474	2028/12/20
3 0年度6回	福岡県公募公債	0.2000	200,000	200,406	2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,237	2028/12/25
3 0年度1 4回	北海道公募公債	0.1950	400,000	400,132	2028/12/28
1 8回	東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	114,282	2029/03/19
3 0年度1 9回	愛知県公募公債	0.1150	200,000	199,016	2029/03/28
3 0年度3回	岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	199,508	2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	298,275	2029/05/25
6回	川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	228,986	2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募公債	0.0290	200,000	197,594	2029/06/21
9回	兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	105,986	2029/07/13
11回	神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	113,800	2029/07/20
7 9 6回	東京都公募公債	0.0400	200,000	197,530	2029/09/20
令和元年度 9回	静岡県公募公債	0.0500	200,000	197,680	2029/09/20

銘	柄	当		期		末
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
(地方債証券)		%	千円	千円		
令和元年度3回	横浜市公募債	0.0500	400,000	395,316	2029/10/16	
令和元年度16回	兵庫県公募債	0.0500	200,000	197,652	2029/10/23	
21回	東京都公募債 20年	2.1900	100,000	115,284	2029/12/20	
17回	さいたま市公募債	0.1100	200,000	198,376	2029/12/25	
令和元年度第8回	埼玉県公募債	0.1350	200,000	198,670	2030/01/30	
21年度2回	福岡県公募債 (20年)	2.2300	100,000	115,890	2030/02/22	
203回	共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,013	2030/02/25	
802回	東京都公募債	0.1300	400,000	396,980	2030/03/19	
511回	名古屋市公募債 10年	0.0750	200,000	197,608	2030/03/27	
令和2年度1回	京都府公募債	0.1350	400,000	397,116	2030/04/12	
令和2年 2回	大阪府公募債	0.1310	300,000	297,588	2030/05/22	
9回	埼玉県公募債 20年	2.1500	100,000	115,631	2030/05/24	
8回	静岡県公募債 15年	0.8280	200,000	209,836	2030/06/07	
令和2年度 10回	静岡県公募債	0.1350	100,000	99,073	2030/09/20	
令和2年5回	福岡県公募債	0.1350	100,000	99,022	2030/10/23	
36回2号	宮城県公募債 10年	0.1350	250,000	247,550	2030/10/28	
令和2年度1回	福島県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27	
令和2年度1回	高知県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27	
22年度14回	愛知県公募債	2.0870	300,000	347,595	2030/12/13	
9回	京都市公募債 20年	2.1430	200,000	232,738	2030/12/17	
813回	東京都公募債	0.1790	300,000	297,897	2030/12/20	
16回	神奈川県公募債 20年	2.0900	300,000	348,129	2031/01/24	
464回	大阪府公募債 10年	0.0720	200,000	196,622	2031/01/28	
令和2年度19回	北海道公募債	0.1450	100,000	98,897	2031/02/26	
令和2年度14回	京都府公募債	0.2140	200,000	199,184	2031/03/12	
令和2年 7回	広島県公募債	0.2140	200,000	199,182	2031/03/19	
251回	神奈川県公募債 10年	0.1990	200,000	198,826	2031/03/20	
令和2年度 14回	静岡県公募債	0.1400	200,000	197,780	2031/03/20	
令和3年度1回	長野県公募債 10年	0.1900	200,000	198,682	2031/04/16	
令和3年度2回	兵庫県公募債	0.1750	100,000	99,165	2031/04/25	
467回	大阪府公募債 10年	0.1640	200,000	197,956	2031/04/28	
469回	大阪府公募債 10年	0.1280	200,000	197,136	2031/06/27	
令和3年 5回	千葉県公募債	0.1050	200,000	196,712	2031/09/25	
472回	大阪府公募債 10年	0.1000	200,000	196,436	2031/09/29	
19回	神奈川県公募債 20年	1.8180	100,000	114,954	2032/01/30	
24年度2回	福岡県公募債 (20年)	1.6350	300,000	340,239	2032/08/16	
10回	大阪府公募債 20年	1.7200	200,000	228,482	2032/09/24	
24年度12回	神戸市公募債	1.7110	200,000	228,902	2032/12/17	
14回	千葉県公募債 20年	1.1370	100,000	108,398	2033/04/15	
13回	埼玉県公募債 20年	1.5990	100,000	113,533	2033/05/20	
1回	東京都公募債 30年	2.2100	200,000	240,730	2033/06/20	
14回	埼玉県公募債 20年	1.5460	300,000	340,266	2034/05/08	
29回	横浜市公募債 20年	1.5280	100,000	113,263	2034/05/26	
16回	名古屋市公募債 20年	1.5200	100,000	113,143	2034/06/09	
5回	群馬県公募債 20年	1.5290	100,000	113,268	2034/06/16	
17回	北九州市公募債 20年	1.5290	100,000	113,146	2034/06/20	
15回	埼玉県公募債 20年	1.1660	100,000	108,996	2035/02/16	
2回	横浜市公募債 30年	2.4900	100,000	125,684	2035/03/20	
18回	千葉県公募債 20年	1.1380	100,000	108,681	2035/04/13	
17回	名古屋市公募債 20年	1.2030	100,000	109,504	2035/05/28	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)		%	千円	千円	
13回	大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回	大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回	千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回	神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回	広島市公募公債	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回	札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回	仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回	福岡市公募公債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回	福岡市公募公債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回	兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回	福岡市公募公債	2.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年 2回	広島県公募公債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回	札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回	川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回	愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回	東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回	愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回	広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回	埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回	島根県公募公債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回	京都市公募公債 30年定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回	神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	189,564	2051/06/20
小	計	—	30,445,330	31,523,404	—
(特殊債券)		%	千円	千円	
19回	政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	100,742	2023/03/15
55回	鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	504,550	2023/03/20
189回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.5410	500,000	503,365	2023/04/28
18回	国際協力機構機構債券	0.8680	100,000	101,155	2023/06/20
193回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回	政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.9110	430,000	435,835	2023/07/31
116回	高速道路機構機構債	0.7220	100,000	101,136	2023/09/20
202回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回	政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	550,010	2024/01/19
7回	広島県・広島市折半保証広島高速道路債	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回	政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回	日本高速道路保有・債務返済機構債	0.5000	100,000	101,219	2024/09/20
71回	鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,362	2024/11/27
21回	政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,357	2025/03/17
241回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回	政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,199	2025/04/25
21回	沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,941	2025/06/20
254回	政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4400	100,000	101,487	2025/08/29
127回	日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,949	2025/09/19
85回	中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,841	2025/10/21
172回	住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,676	2025/11/20
23回	国際協力銀行債券	2.0900	100,000	107,806	2025/12/19

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	106,809	2025/12/19
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,957	2026/03/13
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	110,249	2026/03/20
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	100,104	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 1 0 年	0.0900	400,000	400,416	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	106,928	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	498,510	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	320,157	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,168	2026/12/14
3 0 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	100,296	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	211,904	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	301,767	2027/04/13
3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	801,656	2027/04/30
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,734	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,269	2027/07/16
2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,113	2027/11/19
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	100,231	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	107,376	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	299,130	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	301,425	2028/02/18
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	100,521	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	213,926	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.0700	200,000	225,488	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	106,336	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.2660	300,000	344,622	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.2660	300,000	345,489	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	212,340	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	228,672	2029/09/20
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	114,896	2029/12/28
7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	104,386	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	210,748	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	228,104	2030/10/29
1 2 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	567,995	2030/10/31
1 3 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.1320	100,000	116,328	2031/01/28
9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	198,172	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	406,605	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	115,414	2031/09/19
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	114,749	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	229,494	2031/12/26
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.6800	100,000	113,574	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	114,784	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債券	1.7240	100,000	113,908	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.7020	200,000	227,792	2032/09/28
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	111,437	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	637,360	2033/12/20
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	112,737	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.5660	100,000	113,297	2034/04/28
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	327,033	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	107,835	2035/05/18
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	110,076	2035/06/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.2980	200,000	220,534	2035/06/28
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	110,643	2035/06/29
1 7 1 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	192,904	2036/06/20
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	0.6690	100,000	101,313	2037/04/28
6 回 貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	29,689	2037/05/10
8 回 貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	20,925	2037/05/10
9 回 貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.1900	31,623	31,961	2037/05/10
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	202,422	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	261,262	2037/09/18
2 回 貸付債権担保 5 種住宅金融支援機構債券	2.2700	33,411	34,022	2037/11/10
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	100,279	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	99,389	2038/04/20
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	100,551	2038/09/17
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	336,891	2040/07/27
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	119,376	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	51,467	2041/03/10
4 3 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	11,425	2041/06/10
4 4 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	54,809	2041/07/10
5 1 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	32,671	2042/02/10
1 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	53,085	53,678	2042/05/10
4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	10,979	11,161	2042/08/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	306,622	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	18,671	19,689	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	112,585	119,648	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	173,976	183,008	2045/05/10
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	115,645	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	24,221	25,431	2045/07/10
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	224,626	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	106,929	2045/12/20
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	109,865	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	21,048	22,067	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	25,107	26,249	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	26,331	27,540	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	211,822	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	35,764	37,405	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	80,552	83,805	2047/09/10
7 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	34,953	36,402	2048/09/10
8 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,074	42,429	2049/03/10
8 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	41,755	43,162	2049/05/10
8 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	45,545	47,063	2049/07/10
9 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	47,705	48,980	2049/11/10
9 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	52,914	53,535	2050/02/10
9 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	59,393	60,561	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	93,581	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	187,562	2050/06/20
9 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	61,621	63,305	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	186,310	2051/08/31
4 2 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	189,248	2051/10/31
1 1 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	228,276	226,942	2051/11/10
1 1 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,473	77,568	2052/02/10

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

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
1 6 回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	202,226	2024/03/19
1 4 回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,259	2024/03/19
4 9 回 住友化学社債	0.9440	100,000	101,598	2024/04/25
2 回 B P C E S A 円債社債 (ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,964	2024/06/28
4 2 8 回 九州電力社債	0.9360	100,000	101,795	2024/07/25
2 9 回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,123	2024/09/03
2 5 回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,909	2024/09/20
7 2 回 三菱地所社債	2.2800	100,000	105,384	2024/09/20
1 6 回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,361	2024/10/28
1 0 回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	202,522	2024/10/28
4 回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,794	2024/10/31
6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	202,624	2024/11/28
2 5 回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	202,578	2024/12/20
1 1 回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	202,466	2024/12/20
3 2 1 回 北海道電力社債	0.8860	261,000	265,865	2024/12/25
1 0 回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,257	2025/02/28
2 6 回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,738	2025/05/21
2 9 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,822	2025/06/11
1 2 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,975	2025/06/20
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	318,549	2025/06/20
4 9 7 回 関西電力社債	1.0020	100,000	102,562	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	212,108	2025/06/20
1 2 回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
2 7 回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
1 4 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,792	2025/12/19
2 6 回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	199,146	2026/03/18
4 2 回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,840	2026/03/24
9 6 回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,565	2026/04/15
1 6 3 回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,954	2026/04/15
2 8 回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	298,170	2026/04/21
4 9 3 回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,520	2026/05/25
1 0 6 回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,410	2026/05/26
2 4 回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,954	2026/06/03
4 0 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,434	2026/06/03
3 5 回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,050	2026/06/05
11 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債 (2016)	0.4000	100,000	99,418	2026/06/10
5 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	100,064	2026/06/19
7 9 回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	299,349	2026/06/19
8 3 回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	199,566	2026/06/19
6 9 回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	298,221	2026/06/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	131,178	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	103,449	2026/06/25
9 0 回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	199,556	2026/07/27
2 0 回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	299,763	2026/07/27
9 1 回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
6 2 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/18
1 7 回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,801	2026/09/18
4 8 8 回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,999	2026/10/23
3 3 回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

銘柄	当 期 末	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円		
3 4 回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16	
1 2 回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15	
8 8 回 三菱東京ＵＦＪ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20	
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23	
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23	
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07	
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16	
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17	
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24	
25回 フランス相互信用組合銀行 (BFCM) 円債社債 (2017)	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12	
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22	
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25	
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	100,062	2027/11/19	
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	300,276	2027/12/20	
5 6 回 三菱ＵＦＪリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18	
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02	
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	200,934	2028/06/06	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	100,028	2028/10/25	
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	113,448	2029/03/21	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12	
1 4 回 プリDESTON社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19	
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27	
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20	
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11	
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25	
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19	
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21	
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31	
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05	
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22	
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21	
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24	
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	99,435	2030/06/25	
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	198,448	2030/08/09	
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20	
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27	
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	300,510	2030/12/13	

銘柄	当 期 末	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円		
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20	
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20	
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/24	
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31	
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22	
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25	
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19	
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14	
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20	
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	201,890	2032/01/23	
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	99,513	2036/06/02	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09	
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28	
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23	
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26	
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05	
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25	
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25	
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04	
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12	
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23	
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23	
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20	
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13	
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27	
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15	
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22	
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25	
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27	
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26	
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24	
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14	
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24	
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17	
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	93,516	2060/12/17	
小 計	—	27,481,000	27,644,946	—	
合 計	—	531,923,315	551,087,616	—	

■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月14日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	601,835,832,511円
コ	ン	49,696,366,967
公	債(評価額)	551,087,616,706
未	息	809,631,617
前	用	242,217,221
(B) 負	債	48,532,656,000
負	金	48,532,656,000
(C) 純	額(A-B)	553,303,176,511
元	本	429,840,166,151
次	金	123,463,010,360
(D) 受	益	429,840,166,151円
1	口	12,872円
万	口	
口	当	
当	た	
り	基	
基	準	
準	価	
価	額(C/D)	

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

投資のソムリエ(ターゲット・イヤヤー2040)	37,377,953円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤヤー2050)	15,418,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤヤー2060)	12,877,158円
4資産分散投資・ミドルクラス<D C年金>	327,852,051円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤヤー2065)	851,076円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,570,192,380円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,607,821,940円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,368,128,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	982,094,880円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,551,466,786円
インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04(適格機関投資家限定)	2,239,773,338円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型)21-06	1,216,964,056円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,398,783,514円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,901,727,961円
O n eコポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	463,351,202円
投資のソムリエ・私塾(適格機関投資家限定)	2,068,944,514円
O n eコポートフォリオ・プラス戦略(債券動向のアロケーション)	379,250,637円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	276,996,917円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I I(適格機関投資家限定)	3,244,504,751円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I I I(適格機関投資家限定)	3,251,938,545円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI V(適格機関投資家限定)	3,223,328,742円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	2,685,868,185円
リスクコントロール世界8資産(バランスファンド)(F O F 5用)(適格機関投資家専用)	51,300,165円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	165,802,939円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	98,585,137円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,788,034円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	97,096,530円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	34,365,367円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,318,042円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,972,068円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	126,573,725円
D I A M/バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,587,635,563円
D I A M/バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,301,884,615円
D I A M/バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,374,149,034円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2(適格機関投資家限定)	113,772,635円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2(適格機関投資家限定)	190,263,848円
D I A M アスク グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,187,734,764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)	180,904,488円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,231,460円
D I A M世界アセット(バランスファンド)2VA(適格機関投資家限定)	2,254,611,473円
D I A M世界アセット(バランスファンド)40VA(適格機関投資家限定)	49,059,889円
D I A M世界アセット(バランスファンド)25VA(適格機関投資家限定)	354,407,860円
D I A M世界アセット(バランスファンド)3VA(適格機関投資家限定)	558,346,963円
D I A M世界アセット(バランスファンド)4VA(適格機関投資家限定)	950,183,773円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	298,351,041円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	101,646,068円
O n eコポートフォリオ・プラス戦略ファンドI(適格機関投資家限定)	1,043,766,730円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	382,409,178円
動的パッケージファンド<D C年金>	333,573,020円
コア資産形成ファンド	227,460,602円
M H A M日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	42,573,117,520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)	46,106,741,798円
M H A M日本債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	14,232,766,343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)	1,641,455,600円
期末元本合計	429,840,166,151円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2022年2月7日）

（計算期間 2021年2月9日～2022年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額 総
	期 騰 落 率	中 率	(配当込み) ベンチマーク	期 騰 落 率			
16期（2018年2月7日）	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期（2019年2月7日）	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
18期（2020年2月7日）	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
19期（2021年2月8日）	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
20期（2022年2月7日）	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

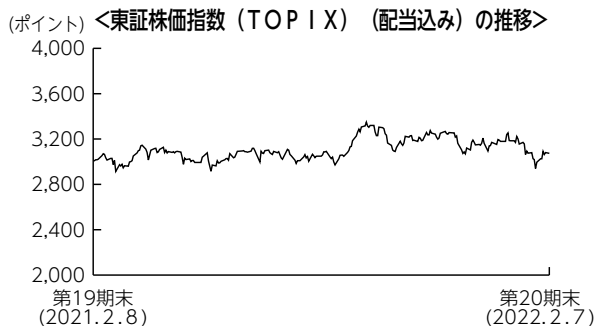
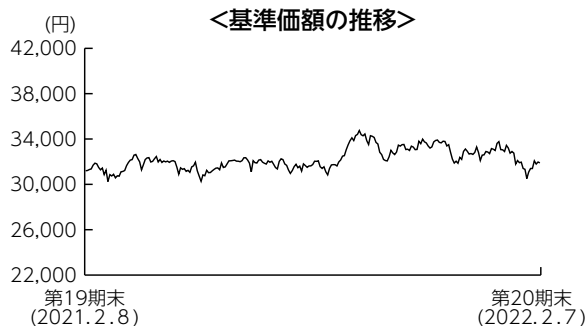
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月9日から2022年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は31,896円となり、前期末比で2.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

期初から2021年8月までは、国内の感染状況や米国長期金利の動向などを要因として、一進一退の相場展開となりました。9月には、菅前首相の退陣表明を受けて上昇しました。その後、中国恒大集団の信用リスク懸念や米国の金利上昇などを要因として反落しました。その後も、新型コロナウイルスの感染拡大懸念や金融引き締めへの警戒感の高まりなどを受けて下落する場面もありましたが、期末にかけては好決算銘柄を中心に反発しました。

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種

期首（前期末）

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



期末

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

○組入上位10銘柄

期首（前期末）

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



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	4.3%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.0
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.7
5	リクルートホールディングス	日本・円	1.5
6	東京エレクトロン	日本・円	1.3
7	日本電信電話	日本・円	1.3
8	任天堂	日本・円	1.2
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,174銘柄	

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は32,238円です。			

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

■売買及び取引の状況 (2021年2月9日から2022年2月7日まで)

(1) 株 式

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

(注1) 金額は受渡代金です。
(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 144,564	百万円 142,625	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	875,075,739千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	369,108,651千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	2.37

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月9日から2022年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	B / A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	D / C
株 式	百万円 479,219	百万円 130,245	% 27.2	百万円 395,856	百万円 59,442	% 15.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1,300

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	7,278千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	148千円
(B) / (A)	2.0%

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

■組入資産の明細

(1) 国内株式

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

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
日本たばこ産業	千株	千株	千円	共和レザー	千株	千株	千円	トリケミカル研究所	千株	千株	千円
ケンコーマヨネーズ	636.5	791.4	1,851,876	昭和電工	6.8	9.2	6,127	ADEK A	9.8	14.9	44,342
からべや日洋ホールディングス	7.3	8.5	11,517	住友化学	87.9	124.8	297,398	日油	53.3	66.3	167,473
なとり	7.8	9.6	18,240	住友精化	911.2	1,057.7	619,812	新日本理化	43.6	49.2	252,888
イフジ産業	6.9	8.1	16,200	日産化学	5.7	6.4	21,184	花王	19	23.6	5,923
ビッグルスコポーレーション	2.3	2.5	2,350	ラサ工業	63.9	78.4	516,656	第一工業製薬	8.7	11	8,987
ファーマーズ	2.8	7.2	11,419	クレハ	3.8	5	8,095	石原ケミカル	283.1	325.3	1,709,126
ユーグレナ	—	14	22,848	多木化学	9.9	11.5	103,960	日華化学	3.9	5.4	15,660
紀文食品	51.2	75	54,750	テイカ	4.5	5.6	29,400	ニイタカ	3	7.5	9,915
ミヨシ油脂	—	8.6	8,187	石原産業	8.4	10.8	14,850	三洋化成工業	4.3	5	4,015
理研ビタミン	4.4	6.2	6,869	片倉コープアグリ	20.6	23.8	27,631	有機合成薬品工業	2.4	3	6,849
繊維製品 (0.5%)	11.2	15.4	26,257	日本書達	2.4	2.5	2,875	大日本塗料	6.9	8.6	44,118
片倉工業	15.6	13.8	33,092	東ソー	16.2	18.4	63,204	日本ペイントホールディングス	9.2	10.3	2,811
グンゼ	8.5	9.6	37,008	トクヤマ	178.9	207.7	396,083	関西ペイント	13.2	17.8	14,453
東洋紡	45.8	56.9	74,254	セントラル硝子	34.3	46	90,666	神東塗料	95.5	541.2	459,478
ユニチカ	33.8	39.2	11,956	東亞合成	22	23.5	49,514	中国塗料	130.1	149.3	342,792
富士紡ホールディングス	5.6	6.4	24,288	大阪ソーダ	70.7	80.1	90,352	日本特殊塗料	9.3	10	1,540
倉敷紡績	10.7	12.3	23,579	関東電化工業	11.9	13.5	40,567	藤倉化成	27.9	34	30,668
シキボウ	6.6	7.9	7,244	デンカ	27.3	31.6	34,033	太陽ホールディングス	8.7	10.9	9,156
日本毛織	38.1	43.4	38,929	信越化学工業	42.2	52.4	190,474	D I C	16	18.3	8,820
ダイトウボウ	19.3	23.8	21,18	日本カーバイド工業	214.1	247.4	4,693,178	サカタインクス	8.5	21.2	68,158
トーア紡コーポレーション	4.1	4.3	1,754	堺化学工業	4.2	5.2	7,082	東チンキ&Cホールディングス	48.9	60.9	182,517
ダイドーリミテッド	16.6	20.5	2,870	第一稀元素化学工業	8.1	10	20,310	T & K T O K A	25.3	28.7	28,183
帝国繊維	13	16.3	32,811	エア・ウォーター	11.7	13.4	15,276	富士フイルムホールディングス	24.5	30.5	58,712
帝人	109	135.4	187,393	日本酸素ホールディングス	118.1	136.2	238,350	資生堂	9.4	11.7	10,120
東レ	838.4	1,042.5	699,309	東邦アセチレン	95.3	138.5	316,195	ライオン	207.8	258.5	1,967,702
サカイオーベックス	3.1	—	—	日本バークライジング	3.2	4.6	12,134	高砂香料工業	235	273.9	1,642,578
住江織物	2.1	3.4	6,504	高圧ガス工業	1.9	2.6	3,302	マンダム	153.7	177.6	268,708
日本フェルト	5.5	5.9	2,643	チタン工業	58.4	72.6	74,632	ミルボン	7.4	10.3	28,953
イチカワ	1.3	1.4	1,937	四国化成工業	18.5	23.1	17,278	ファンケル	24.7	30.9	39,644
日東製綱	1.3	1.7	2,459	戸田工業	1.5	1.7	2,774	コサセ	15.8	18.3	99,735
アツギ	9.3	11.5	6,704	ステラ ケミファ	15.5	19	26,600	コーセー	43	59.6	185,356
ダイニツク	3.6	3.8	2,728	保土谷化学工業	2.4	3.2	9,968	ジーボン	22.2	27.7	304,146
セーレン	28.5	29.6	61,952	日本触媒	6.3	7.2	17,978	ボーラ・オルビスホールディングス	7	9.4	14,720
ソート	4	6.2	5,139	大日本精化工業	3.4	4.6	24,012	ノエビアホールディングス	1.3	1.4	2,525
東海染工	1.3	1.4	1,605	カネカ	21	24.2	144,716	アジパルホールディングス	50.5	62.8	108,895
小松マテリアル	19.1	23.6	29,877	三菱瓦斯化学	9.6	12	27,108	新日本製薬	10	12.6	63,252
ワコールホールディングス	28.9	35.9	73,738	J S R	30	37.3	145,843	エステー	3	3.5	3,846
ホギメディカル	15.6	19.5	61,425	東京応化工業	116	133.8	285,529	アグロ カネショウ	2.4	4	5,300
クラフティアホールディングス	2.4	2.5	590	大阪有機化学工業	100	130.8	397,632	コニシ	7.7	9.5	14,601
T S Iホールディングス	34.7	47.9	15,807	三井化学	116.2	134.4	463,680	長谷川香料	4.5	5	6,515
マツカコーポレーション	3.7	4.6	5,409	K Hネオケム	19.9	23.3	147,955	星光PMC	19.5	24.1	38,222
ワールド	15.1	18.9	22,264	ダイセル	10.7	12.2	36,429	小林製薬	20.5	25.5	61,786
三陽商会	6	6.9	5,954	住友ベークライト	774.1	962.6	807,910	荒川化学工業	6.9	8.6	5,633
ナイガイ	3.8	4.1	1,160	積水化学工業	19.1	23.7	72,640	メック	33.1	41.3	391,111
オンワードホールディングス	69.3	86.3	25,631	日本ゼオン	155.5	207.2	181,507	タカラバイオ	9.9	12.3	13,849
ルックホールディングス	4	4.6	6,076	アイカ工業	18.2	22.8	121,752	J C U	8.1	11	33,880
キムラタン	68.3	79.9	1,518	宇部興産	244.9	301.3	583,618	新田セラチン	3.3	4.1	10,569
ゴールドウイン	19.1	26	158,340	積水樹脂	104.5	129.8	175,489	O A T アグリオ	31	38.5	88,280
デサント	19.8	28.1	97,085	タキロンシーアイ	32.2	40.1	127,317	デクセリアルズ	13.3	16.6	75,613
キング	4.6	6.7	3,463	旭有機材	58.4	67.8	147,058	アース製薬	7.7	9.3	6,045
ヤマトインターナショナル	10.6	13.3	3,790	ニチバン	19.1	21.9	43,843	北興化学工業	2.3	3.2	6,425
特種東海製紙	7.2	8.9	37,291	リケンテクノス	25.2	31.4	17,552	大成ラミック	33	38.2	118,420
王子ホールディングス	521.3	602.3	363,789	大倉工業	6.6	8.1	17,528	クミアイ化学工業	8.9	12.1	71,027
日本製紙	51.1	69	81,213	積水化成成品工業	6.2	8.6	14,852	日本農薬	10.9	13.8	10,874
三菱製紙	17.1	21.3	6,794	群衆化学工業	28.2	35.4	16,142	有沢製作所	3.7	4.6	12,962
北越コーポレーション	82.9	94.7	74,244	タイガースポリマー	5.5	7.5	15,037	日東電工	48.8	54.8	44,223
中越パルプ工業	4.7	5.6	5,538	ミライアル	15.6	19.6	8,800	レック	21.2	26.4	14,018
巴川製紙所	3.7	4.6	3,762	ダイキアクシス	2.2	3.5	12,075	三光合成	8.2	9.4	11,637
大王製紙	56	69.6	133,284	ダイキョーニシカワ	6.7	8.5	3,714	きもと	16.5	21.5	21,414
阿波製紙	3	4	1,324	竹本容器	3.7	4.7	6,974	前澤化成工業	75.7	89	775,190
レンゴー	119.4	136.3	117,763	森六ホールディングス	4.3	5.6	3,925	未来工業	14	19.1	18,106
トーモク	7.2	9	15,849	カーリットホールディングス	24.5	30.7	18,696	J S P	12.4	15.5	5,766
ザ・バック	8.7	11	29,931	日本精化	4.2	5.3	4,202	エフピコ	18.9	22.9	4,854
化学 (6.6%)				扶桑化学工業	6.3	7.9	15,634		10.6	13.2	54,978
北の達人コーポレーション	41.4	51.4	11,205		1.7	3.6	18,504		7.8	9.5	11,789
クラレ	182.3	210.4	217,764		71.6	113.4	132,224		4.3	5.5	8,475
旭化成	767.5	954.1	1,064,775		11.5	14.3	10,052		4	5.6	3,931

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末		銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額		株 数	株 数	評 価	額		株 数	株 数	評 価	額
三浦工業	千株	千株	千円	千円	帝国電機製作所	千株	千株	千円	千円	三菱重工業	千株	千株	千円	千円
タフミ	50.6	63	207,585	8.3	東京機械製作所	8.3	10.6	13,939	10.6	I H I	185.7	231	737,583	231
ツガミ	39.6	49.2	70,060	4.3	新東工業	4.3	—	—	—	サノヤホールディングス	79.5	91.8	214,353	91.8
オクワ	24.2	31.9	41,629	28.2	澁谷工業	28.2	32.6	22,689	32.6	スター精密	15.5	17	2,227	17
芝浦機械	13.6	16.9	81,458	10.4	アイチコーポレーション	10.4	12.8	32,256	12.8	電気機器 (18.0%)	18.2	22.8	33,288	22.8
アマダ	12.2	16.5	50,902	20.5	小森コーポレーション	20.5	21.7	17,967	21.7	日清紡ホールディングス	72	89.8	88,812	89.8
アイダエンジニアリング	171.2	229.4	251,651	30.1	鶴見製作所	30.1	37.5	26,100	37.5	イビデン	56.8	77.2	465,516	77.2
滝澤鉄工所	30.7	38.2	39,498	9.2	住友精密工業	9.2	11.5	19,630	11.5	ユニカミノルタ	239.4	320.9	159,808	320.9
F U J I	3.9	4.8	5,726	1.9	日本ギア工業	1.9	2.4	4,524	2.4	ブラザー工業	144.3	179.5	398,490	179.5
牧野フライズ製作所	46.6	67	168,103	6	石井鐵工所	6	6	1,578	6	ミネベアミツミ	203.7	253.4	676,831	253.4
オーエスジー	13.7	16	60,320	1.9	荏原製作所	1.9	2.7	7,641	2.7	日立製作所	568.4	707.2	4,163,993	707.2
ダイジェット工業	57.6	67.3	136,551	49	石井鐵工所	49	61.1	338,494	61.1	東芝	—	256.9	1,233,120	256.9
旭ダイヤモンド工業	1	1.1	1,083	1.2	西島製作所	1.2	1.2	3,584	1.2	三菱電機	1,182.4	1,470.1	2,072,841	1,470.1
DMG森精機	31	38.3	23,133	12.2	北越工業	12.2	13.5	12,433	13.5	富士電機	71.2	88.6	526,284	88.6
ソディック	73.9	86.3	149,557	12.4	ダイキン工業	12.4	14	12,600	14	東洋電機製造	4.7	5.9	5,658	5.9
ソディック	25.6	32.2	25,599	150.6	オルガノ	150.6	187.4	4,194,949	187.4	安川電機	127.3	158.4	760,320	158.4
ディスコ	15.9	21.5	693,375	3.8	トーヨーカネツ	3.8	4.2	32,550	4.2	シンフォニア テクノロジー	15.4	17.7	22,319	17.7
日東工器	5.7	8.1	13,024	4.4	栗田工業	4.4	5.5	14,069	5.5	明電舎	20	24.9	61,104	24.9
日進工具	4.6	11.6	16,576	64	橋本チエイン	64	79.7	379,770	79.7	オリジン	2.6	4	5,032	4
パンチ工業	9.9	12.2	5,990	16.9	大同工業	16.9	19.4	62,856	19.4	山洋電気	5.7	6.6	32,802	6.6
富士ダイス	6.4	6.8	4,182	4.6	木村化工機	4.6	6.7	6,231	6.7	デンヨー	10.1	12.6	21,092	12.6
豊和工業	6.5	7.9	6,557	9.8	アネスト岩田	9.8	12.2	9,064	12.2	P H Cホールディングス	—	16.9	27,124	16.9
OK K	4.8	5.6	4,244	20	ダイフク	20	23	18,653	23	東芝テック	12.7	16	79,120	16
石川製作所	3	3.9	5,752	65.1	サムコ	65.1	81	690,930	81	芝浦メカトロニクス	2.1	2.7	22,464	2.7
東洋機械金属	8.4	9.9	5,613	2.9	加藤製作所	2.9	3.6	8,067	3.6	マブチモーター	32.7	34.1	122,760	34.1
津田駒工業	2.4	3.4	1,975	6.4	油研工業	6.4	6.9	5,837	6.9	日本電産	284.6	381.1	3,803,759	381.1
エンシェウ	2.4	3.5	2,289	1.7	タダノ	1.7	1.8	3,117	1.8	ユ・エム・シー・エレクトロニクス	7	6.6	2,534	6.6
島精機製作所	17.1	21.2	37,078	57	フジテック	57	77	74,998	77	トレックス・セミコンダクター	6.4	7.5	19,740	7.5
オプトラン	14.6	18.3	42,016	40.8	C K D	40.8	54.6	147,420	54.6	東光高岳	6	8.2	11,783	8.2
N Cホールディングス	3.1	4.1	6,629	27.4	キート	27.4	43.4	89,317	43.4	ダブル・スコープ	23.2	42.3	33,163	42.3
イワキ	7.6	9.4	9,428	10	平和	10	12.6	21,256	12.6	ダイヘン	12.9	16.1	64,319	16.1
フリュー	11.5	12.8	16,473	32.9	理想科学工業	32.9	41.1	78,090	41.1	ヤーマン	19.3	24	21,456	24
ヤマシンフィルタ	23.5	29.3	11,221	9.2	S A N K Y O	9.2	12.3	27,416	12.3	J V Cケンウッド	101.9	119.5	22,346	119.5
日阪製作所	14.8	18.3	15,060	28	日本金銭機械	28	31.8	96,513	31.8	ミナキエンジニアリング	11	13.3	10,374	13.3
やまびこ	22.6	28.3	29,941	13.2	マースグループホールディングス	13.2	15	9,660	15	I P E X	5.5	6.9	11,854	6.9
野村マイクロ・サイエンス	—	3.9	16,282	7.6	フクシマガリレイ	7.6	9.4	15,199	9.4	日新電機	27.7	34.7	50,696	34.7
平田機工	5.5	6.9	39,054	8.1	オーイズミ	8.1	10.3	43,105	10.3	大崎電気工業	23.4	26.8	12,810	26.8
ベガスミシシ製造	12.2	15	8,565	5.1	ダイコク電機	5.1	5.4	2,133	5.4	オムロン	98.4	122.4	1,006,984	122.4
マルマエ	4.3	6	14,268	5.6	竹内製作所	5.6	6.9	8,583	6.9	日東工業	17.3	19.6	30,830	19.6
タツモ	4.9	6.9	9,694	19.7	アマノ	19.7	22.4	63,212	22.4	I D E C	15.9	18.3	42,639	18.3
ナプテスコ	68.9	82.9	290,564	31	J U K I	31	38.5	84,199	38.5	正興電機製作所	2.7	4.6	4,774	4.6
三井海洋開発	12.4	15.5	18,693	16.5	サンデン	16.5	20.5	15,723	20.5	不二電機工業	2.3	3.4	3,672	3.4
レオン自動機	11.4	15.6	16,270	10.6	ジャノメ	10.6	12.5	9,062	12.5	ジー・エス・コア コーポレーション	42.4	47.9	108,733	47.9
S M C	34.6	43.1	2,754,521	16.3	マックス	16.3	19.7	34,947	19.7	サクサホールディングス	2.8	2.9	3,822	2.9
ホソカワミクロン	4.1	10.3	29,530	30.4	グローリー	30.4	37.7	78,755	37.7	メルコホールディングス	4.1	3.3	12,490	3.3
ユニオンツール	4.4	5.5	20,405	11	新晃工業	11	13.8	25,267	13.8	テクノメディカ	2.8	3.5	5,533	3.5
オイレシ工業	16.5	20.5	33,066	19	大和冷機工業	19	21.2	23,977	21.2	ダイヤモンエレクトロニクスホールディングス	3.4	4.1	4,374	4.1
日精工・エス・ピー機械	3.4	4.9	14,327	107.5	セガサミーホールディングス	107.5	145.9	302,158	145.9	日本電気	150.2	186.9	949,452	186.9
サトーホールディングス	15.4	19.3	39,121	4.5	日本ビストンリング	4.5	5.4	7,225	5.4	富士通	106.4	132.4	2,133,626	132.4
技研製作所	10.3	12.8	49,792	5.5	リケン	5.5	6.4	17,299	6.4	沖電気工業	47.9	59.8	53,521	59.8
日本エアテック	3.8	6.8	7,459	16	T P R	16	19.9	29,631	19.9	岩崎通信機	4.4	6.3	5,134	6.3
カワタ	3.2	4.7	5,010	22.5	ツバキ・ナカシマ	22.5	32.2	46,657	32.2	電気興業	5.7	7.9	18,264	7.9
日精油脂工業	9.2	10.4	10,649	37.2	ホシザキ	37.2	43	373,240	43	サンケン電気	13.8	13.8	65,274	13.8
オカダアイオン	3.8	4.7	6,909	9.8	大豊工業	9.8	12	8,592	12	ナカヨ	1.9	2.2	2,494	2.2
ワイエイシイホールディングス	4.6	5.7	7,022	242.6	日本精工	242.6	276.6	206,620	276.6	アイホン	6.8	8.5	18,156	8.5
小松製作所	535.7	666.1	1,878,068	272.6	N T N	272.6	314.8	73,348	314.8	ルネサスエレクトロニクス	508.7	796.7	1,000,655	796.7
住友重機械工業	67.6	84.1	249,356	113.3	ジェイテクト	113.3	140.9	147,663	140.9	セイコーエプソン	146.6	182.4	335,980	182.4
日立建機	55.3	58.9	172,577	11	不二越	11	12.6	53,109	12.6	ワコム	85.5	114	101,688	114
日工	17.6	20.4	12,444	32.2	日本トムソン	32.2	40.2	24,964	40.2	アルバック	21.8	29.3	172,870	29.3
巴工業	4.8	5.9	13,044	73.7	T H K	73.7	83	233,977	83	アクセル	4.9	6.3	6,545	6.3
井関農機	11.8	13.7	18,303	7.9	ユーシン精機	7.9	11.7	8,154	11.7	E I Z O	10	11.5	42,435	11.5
T O W A	11	12.6	30,769	4.2	前澤給装工業	4.2	11.4	11,149	11.4	ジャパンディスプレイ	404	500	19,000	500
丸山製作所	2.4	3.2	4,793	14.7	イーグル工業	14.7	18.3	19,599	18.3	日本信号	27.6	37.5	33,975	37.5
北川鉄工所	5.5	6.8	9,526	7.3	前澤工業	7.3	8.9	5,936	8.9	京三製作所	25.4	31.6	13,272	31.6
ローツェ	5.2	7.4	75,924	12.1	日本ビラー工業	12.1	14.9	46,190	14.9	能美防災	15.7	19.5	40,540	19.5
タカキタ	4.3	5	3,050	36.6	キッツ	36.6	49.7	33,000	49.7	ホーチキ	8.6	10.9	13,178	10.9
クボタ	621.2	712.6	1,707,745	154.2	マキタ	154.2	179	711,883	179	星和電機	5.9	7.2	3,916	7.2
荏原実業	2.9	6.9	15,035	45.7	三井E&Sホールディングス	45.7	53	19,610	53	エレコム	13.5	33.7	46,000	33.7
三菱化工機	3.7	4.7	9,494	93.7	日立造船	93.7	124.3	92,354	124.3	パナソニック	1,260.9	1,568.1	1,884,072	1,568.1
月島機械	21.8	27.3	28,310											

銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末		銘柄	期首(前期末)		当期末	
	株数	株価	株数	評価額		株数	株価	株数	評価額		株数	株価	株数	評価額
シャープ	千株	千円	千株	千円	カシオ計算機	千株	千円	千株	千円	本田技研工業	千株	千円	千株	千円
アンリツ	136.8	167.6	208,997	148,780	ファナック	95.1	106.5	129.1	2,875,057	スズキ	930.9	1,157.5	3,938,972	1,614,768
富士通ゼネラル	71	94.6	149,562	2,875,057	日本シイエムケイ	103.8	25.5	28.9	16,241	S U B A R U	234.4	336.2	847,665	6,278
ソニーグループ	36.2	39.9	97,994	16,241	エンプラス	25.5	5.3	3.6	9,478	安永	338.8	421.2	532,906	191.9
T D K	740.6	921.1	11,661,126	24,297	ローム	5.3	4	19.9	604,044	ヤマハ発動機	5.7	7.2	6,929	11.8
帝国通信工業	57.1	213	970,215	612,955	浜松ホトニクス	49.2	65.8	105.5	124,100	T B K	167.1	191.9	37,664	38.2
タムラ製作所	5.6	6.7	9,112	124,100	三井ハイテック	84.8	11.6	14.6	214,920	エフセディ	11.8	16.9	106,507	18.5
アルプスアルパイン	42.3	56.8	36,749	214,920	新光電気工業	11.6	39.7	43.2	1,416,437	豊田合成	16	22.3	17,094	1.6
池上通信機	96.5	129.9	164,713	1,416,437	京セラ	11.6	180.2	206.9	377,177	菱三工業	38.2	47.4	6,428	10.2
日本電波工業	4	5	3,215	3,556,264	太陽誘電	13.3	52.5	71.3	16,892	ヨロズ	18.5	23.1	34,248	59.1
鈴木	11.5	13.3	16,651	5,567	村田製作所	4	347.3	431.9	6,897	エフ・シー・シー	1.6	1.7	1,533,054	62.1
メイコー	5.3	6.8	5,882	25.1	双葉電子工業	5.3	20.3	25.1	55,467	ティ・エス テック	10.3	11.5	97,000	7.6
日本トリム	—	12	44,700	5.5	ニチコン	2.5	4.6	5.5	26,082	ジャムコ	10.2	13.9	7,146	362.5
ローランド ディー・ジー	2.5	2.9	8,816	14	日本ケミコン	37.1	46.3	55,467	26,082	デルモ	4.2	4.3	1,724,320	416
フォスター電機	7	8.7	22,985	16.3	K O A	11.9	14	26,082	32,290	クリエートメディック	7	8.6	4,166	38.2
S M K	12.4	14.8	11,928	17.6	市光工業	11.9	14	26,082	32,290	日機装	38.2	44.1	37,529	6.8
ヨコオ	3.1	3.5	7,570	70.8	小糸製作所	11.9	14	26,082	32,290	日本エム・ディ・エム	6.8	8.6	13,837	152.2
ティアック	8.7	10.9	28,656	17.7	ミツバ	11.9	14	26,082	32,290	島津製作所	10	12.3	779,916	10
ホシデン	7.3	23.5	3,125	472,095	SCREENホールディングス	300.7	408.1	400,754	400,754	J M S	3.1	3.3	7,576	12.3
ヒロセ電機	32.2	35.4	42,480	58,625	キャノン電子	31.9	39.8	58,625	58,625	グボテック	8.5	10.8	14,450	5.5
日本航空電子工業	18.2	22.8	393,984	2,510	リコー	1.2	1.2	2,510	2,510	長野計器	5.5	6.4	21,760	7.5
T O A	27	33.7	61,738	5,156,691	象印マホービン	69.3	93.3	5,156,691	5,156,691	ブイ・テクノロジ	1.2	3.7	9,559	1.2
マクセル	14	16	12,432	130,800	MUTOHホールディングス	34.5	60	130,800	130,800	東京計器	5.9	7.5	14,685	5.9
古野電気	23.4	29.3	36,039	2,242	東電エレクトロニクス	2.4	2.5	2,242	2,242	愛知時計電機	10.7	13.3	3,564	19.9
ユニテック	15.1	17.4	18,339	17,936	トヨタ紡織	19.3	21.9	17,936	17,936	インターアクション	19.9	24.8	112,592	47
エニテック	3	3.3	11,913	1,060,880	ユニブラス	19	23.6	29,854	29,854	マニ	58.6	58.6	96,865	180.4
スミダコーポレーション	10	13.9	13,538	1,060,880	豊田自動織機	16.3	20.2	16,846	16,846	ニコン	59.5	69.1	102,682	59.5
アイコム	4.9	5.5	12,980	2,751,450	モリタホールディングス	260.4	323.7	2,751,450	2,751,450	トプコン	654.2	771.1	1,744,999	10.5
リオン	5	5.6	12,280	59,946	三機工業	31.2	38.8	59,946	59,946	オリンパス	10.5	12	63,000	9.5
本多通信工業	9.4	11.9	5,712	233,055	デンソー	91.9	107.3	233,055	233,055	理研計器	234.6	287	4,439,890	5.2
船井電機	13.4	—	—	11,000	東海理化電機製作所	35.7	43.7	8,827	8,827	タムロン	5.2	6.9	3,608	10.6
横河電機	118.3	147.2	274,969	19,929	川崎重工	4.3	5.5	11,000	11,000	H O Y A	10.6	13.2	27,508	9.9
新電元工業	4.5	5.6	18,900	1,847	名村造船所	1.6	1.7	1,847	1,847	シード	9.9	13.4	12,730	124.4
アズビル	80	86.2	359,023	16,954,067	日本車輛製造	1,394.4	1,733.9	1,038,432	1,038,432	ノーリツ鋼機	149.2	172.1	86,910	3.1
東亜ディーケーケー	6.1	7.6	6,878	194,616	日産自動車	342.6	461.4	687,947	687,947	イー・アンド・ディ	14.2	4.6	6,026	9.5
日本光電工業	48.9	60.9	188,790	171,935	いすゞ自動車	1,197.8	7,450.7	16,954,067	16,954,067	朝日インテック	18.1	48.8	132,540	1.2
チノール	3.8	4.8	7,862	5,662	トヨタ自動車	147.7	183.6	194,616	194,616	シチズン時計	1.2	1.8	957	5.5
共和電業	13	14.9	5,632	5,662	日野自動車	437.1	544.1	171,935	171,935	リズム	16.6	20.7	45,602	88.1
日本電子材料	4.3	7.2	16,516	5,662	三菱自動車工業	8.4	10.3	5,662	5,662	大研医器	88.1	109.6	117,052	3.1
堀場製作所	23.4	27.3	165,165	1,038,432	エフテック	2.6	5.7	3,192	3,192	メニコン	5.2	6.9	3,608	10.6
アドバンテスト	87.9	109.3	1,007,746	1,038,432	レシップホールディングス	4.2	2.8	2,282	2,282	シンシア	1.2	1.8	957	5.5
小野測器	4.3	6.9	3,312	1,038,432	G M B	2.3	2.9	2,105	2,105	松風	16.6	20.7	45,602	88.1
エスベック	10.5	12	24,168	57,421	ファルテック	26.4	32.7	57,421	57,421	セイコーホールディングス	5.5	6.4	12,268	16.6
キーエンス	116	133.2	7,826,832	15,428	武蔵精密工業	17.3	21.7	15,428	15,428	ニプロ	88.1	109.6	117,052	3.1
日置電機	5.7	7	44,240	15,428	日産車体	33.3	41.7	38,072	38,072	その他製品 (2.3%)	3.1	4.2	7,274	7
シスメックス	92.2	124.4	1,316,774	15,428	新明和工業	20.4	27.3	39,666	39,666	中本バックス	6.4	8.1	8,245	11.4
日本マイクロニクス	20.6	25.6	38,476	15,428	極東開発工業	9.8	12.1	13,467	13,467	スノーピーク	3	5	2,065	6.4
メガチップス	11.9	13.8	57,339	15,428	トビー工業	3.7	4.2	11,919	11,919	トラザクシオン	10.1	12.6	13,393	13
O B A R A GROUP	7	6.8	22,236	15,428	テラドラ	64.1	80.6	13,863	13,863	粒美堂	13	16.3	51,426	16.8
澤藤電機	1.3	1.8	2,649	15,428	曙ブレーキ工業	18.1	25.7	31,122	31,122	二ホンフラッシュ	16.8	20.5	6,293	11.6
原田工業	5	7.5	7,357	15,428	タチエス	57.2	71.2	91,207	91,207	前田工業	11.6	12.7	8,801	97.8
コーセル	14.4	16.3	13,219	15,428	N O K	29.6	36.8	15,124	15,124	永大産業	3.2	4.3	2,893	3.2
イリソ電子工業	9.9	12.3	52,152	15,428	フタバ産業	13.2	15.4	47,124	47,124	アートネイチャー	21.9	25.1	3,614	10.4
オプテックスグループ	19.4	24	35,256	15,428	K Y B	24.6	28.5	18,126	18,126	バウダイナムホールディングス	15.4	19.3	17,427	20.9
千代田インテグレイ	5.1	6.4	11,936	15,428	大同メタル工業	58.5	73	27,813	27,813	アイフィスジャパン	6.7	9.6	11,529	21.2
アイ・オー・データ機器	4.4	5.5	4,713	15,428	プレス工業	16.1	19.6	8,976	8,976	トッパン・フォームズ	21.2	—	—	24.3
レーザーテック	51.9	64.5	1,435,447	15,428	ミクニ	24.8	30.8	33,140	33,140	フジシールインターナショナル	24.3	35.7	76,540	24.3
スタンレー電気	82.9	102.8	274,064	15,428	河西工業	86.5	107.7	487,342	487,342					
岩崎電気	4.3	5.4	12,144	15,428	アイシン	370.8	461.4	406,954	406,954					
ウシオ電機	60.6	75.3	139,079	15,428	マツダ	10.4	9.6	5,712	5,712					
岡谷電機産業	8.9	9.3	2,929	15,428	今仙電機製作所									
ヘリオス テクノ ホールディング	11.2	12.9	3,715	15,428										
エノモト	3.3	4	6,408	15,428										
日本セラミック	12	13.8	34,610	15,428										
遠藤照明	6.7	6.9	6,817	15,428										
古河電池	8.4	10.7	13,171	15,428										
双信電機	5.8	6.4	3,718	15,428										
山一電機	7.6	10.8	23,630	15,428										
図研	7.7	9.5	28,376	15,428										
日本電子	21.6	30.8	192,500	15,428										

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
タカラトミー	52.9	61.5	71,586	東日本旅客鉄道	208.1	258.8	1,799,954	東海運	7.9	8.6	2,631
広済堂ホールディングス	8.1	9	6,993	西日本旅客鉄道	105.3	178.4	880,939	エーアイディー	7.2	8.8	12,786
エステールホールディングス	4	4	2,552	東海旅客鉄道	98.3	122.1	1,825,395	内外トランスライン	4.1	5.4	10,481
タカノ	4.5	5.4	3,758	西武ホールディングス	142.4	191.8	227,474	日本コンセプト	3.7	4.6	6,168
プロネクス	10.3	11.5	12,443	鴻池運輸	19	23.5	27,518	情報・通信業 (8.0%)			
ホクシン	8.5	11	1,705	西日本鉄道	32.8	40.7	103,296	NECネットエスアイ	38.3	47.8	82,789
ウッドワン	3.4	4.6	4,590	ハマキョウレックス	9.1	10.6	30,390	クロスキャット	3	3.9	6,438
大建工業	8	8.7	18,661	サカイ引越センター	5.5	6.9	30,291	システナ	41.4	205.8	74,088
凸版印刷	179.6	223.5	488,124	近鉄グループホールディングス	111.9	139.3	475,709	デジタルアーツ	6.8	7.9	51,508
大日本印刷	142.8	173.8	476,038	阪急阪神ホールディングス	149.3	174.1	600,645	日鉄ソリューションズ	17.3	20.9	75,344
共同印刷	3.7	4.6	12,479	南海電気鉄道	53.1	62.3	143,788	キューブシステム	6.2	7.5	6,982
N I S S H A	24.3	30.2	44,877	京阪ホールディングス	49.9	62.1	172,079	WOW WORLD	1.8	2.2	2,598
光村印刷	0.8	0.7	987	神戸電鉄	2.8	3.3	10,741	コア	4.9	6.4	9,888
TAKARA & COMPANY	5.8	7.4	13,912	名古屋鉄道	92.1	114.5	209,420	ラウーンホールディングス	8.2	10.3	12,318
アシックス	104.6	129.9	310,720	山陽電気鉄道	8.1	11	22,000	ソリトシステムズ	5.8	7.3	9,300
ツツミ	3	3.8	7,079	アルプス物流	—	9.9	10,038	ソフトクリエイティブホールディングス	4.5	6.4	24,128
ローランド	6.9	10.3	44,856	日本通運	38.8	—	—	T I S	116	137.6	379,638
小松ウオール工業	3.7	4.3	7,942	ヤマトホールディングス	15.7	195.2	484,681	JNSホールディングス	5.5	6.7	2,767
ヤマハ	70.3	85.5	459,135	山丸	28.7	36.6	149,145	電算システム	4.3	—	—
河合楽器製作所	3.3	4.1	12,209	丸連	7.6	8.3	2,008	グリー	71.1	65.7	55,647
クリナップ	11.4	14	7,462	丸全昭和運輸	9.1	11.5	36,627	GMOベババ	0.8	1.5	3,427
ビジョン	75.9	89	195,889	セコグループホールディングス	61.9	69.9	64,587	コエーテックホールディングス	23.7	46.1	190,623
オリバー	2.4	—	—	トナミホールディングス	2.3	3.4	12,546	三菱総合研究所	5	6.3	24,223
兼松サステック	0.6	0.6	990	ニッコンホールディングス	37.6	46.8	99,216	ボルテージ	2.8	4	1,312
キングダム	10.2	12.3	10,750	日本石油輸送	0.9	1.1	2,905	電算	1	1.1	2,476
リンテック	25.4	31.6	81,496	福山通運	14.4	23	83,950	AGS	6.1	7.2	5,803
イトーキ	23.3	26.8	9,326	セイノホールディングス	83.9	94.9	108,660	ファインデックス	9.7	12.1	11,240
任天堂	67.7	83	4,854,670	エスライン	3	3.2	2,870	ブレインパッド	2.9	11.3	12,836
三菱鉛筆	19.5	24.2	29,741	神奈川中央交通	2.5	3.4	11,424	K L a b	21.2	26.3	11,440
タカラスタンダード	24.5	30.5	41,541	日立物流	24.7	26.9	144,184	ホムトウイン・ビストロホールディングス	15.4	20.9	20,628
コクヨ	56.6	70.5	119,850	丸和運輸機関	23.6	29.5	34,220	イーブイクリエイティブジャパン	1.9	—	—
ナカバシ	12.1	14	7,224	C&Fロジホールディングス	11.4	14.3	19,347	ネクソン	293.1	325.4	761,110
グローブライド	5.7	13.2	35,970	九州旅客鉄道	86.4	107.8	262,277	アイスタイル	35.3	43.7	8,871
オカムラ	45.4	50.6	60,517	S Gホールディングス	211.7	263.3	622,441	エムアールホールディングス	3	16.4	12,956
美津濃	11.7	14.7	33,236	N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	—	48.2	325,350	エイチーム	8	9.9	7,365
電気・ガス業 (1.1%)				海運業 (0.6%)				エンゲモ			
東京電力ホールディングス	1,002.3	1,100.2	392,771	日本郵船	93.6	116.4	1,080,192	テクノスジャパン	10.9	15.5	9,935
中部電力	361.8	449.8	504,675	商船三井	66.4	77.1	669,999	e n i s h	8.9	11.2	5,084
関西電力	448	557	595,990	川崎汽船	34.5	42.9	288,717	コロプラ	5.9	8.8	3,176
中国電力	170.7	229.8	200,615	N Sユニテッド海運	5.4	7.7	27,373	オルトプラス	38	47.3	32,069
北陸電力	108.1	134.6	71,607	明治海運	12.3	16.5	13,447	ブロードリーフ	6.8	11.2	3,550
東北電力	276.8	343.8	249,255	飯野海運	52.4	64.5	35,668	ブロードリーフ	57.4	71.5	24,953
四国電力	98.2	132.5	103,880	共栄タンカー	2.2	2.5	2,310	クロス・マーケティンググループ	5.4	5.4	4,644
九州電力	261	303	249,369	乾汽船	5.9	9.4	22,080	デジタルハーツホールディングス	5.3	6.7	12,046
北海道電力	110.3	127.8	64,283	空運業 (0.4%)				システム情報	8.5	10.9	10,235
沖縄電力	23	31.4	44,117	日本航空	272.7	319.2	730,968	メディアドゥ	4.4	5.1	12,984
電源開発	94	125.2	246,644	ANAホールディングス	302.1	353.8	914,926	じげん	28.2	40.6	12,504
エフオン	7.2	8.9	4,823	パスコ	2.2	2.8	3,687	アイキューブ	6.3	14.7	11,848
イーレックス	17.3	21.7	31,877	食・酒・観光業 (0.2%)				エンクレージ・テクノロジ	2.2	3.4	1,846
レノバ	19.9	28.7	42,906	トランコム	3.4	4	29,680	サイバーリンクス	3.8	4.8	4,248
東京瓦斯	227.3	281.8	647,858	日新	9	11.3	18,825	ディー・エル・イー	9.2	9.6	2,140
大阪瓦斯	214.1	266.1	542,045	三菱倉庫	38.7	44.1	123,921	フィックスターズ	12.2	15.4	11,180
東邦瓦斯	58.1	67.5	212,625	三井倉庫ホールディングス	11.9	14.9	35,298	CARTA HOLDINGS	4.7	5.7	11,052
北海道瓦斯	6.6	7.6	11,384	住友倉庫	40.3	49.2	102,483	オブティム	8.1	10	10,030
広島ガス	25.4	29.1	10,417	滋澤倉庫	6.3	8.5	18,122	セレス	3.8	5.3	10,054
西部ガスホールディングス	13.3	16.6	36,188	東陽倉庫	16.8	22.8	7,204	S H I F T	5.2	7.3	149,650
静岡ガス	33.5	38.4	38,246	日本トランスシティ	25.1	30.8	19,681	ティーガイア	12.3	12.7	21,272
メタウォーター	13.4	15.3	30,890	ケイビシ	1.7	2.8	3,875	セック	1.7	2.3	5,101
陸運業 (3.0%)				中央倉庫	6.4	8.8	8,544	日本アジアグループ	11.2	—	—
S B Sホールディングス	8.7	11	35,970	川西倉庫	2.1	2.9	3,169	テクノトリックス	17.9	24.3	38,102
東武鉄道	123.2	143.6	407,680	安田倉庫	9.6	12	11,520	プロシッパ	3.4	4.9	6,615
相鉄ホールディングス	40.5	47	100,298	ファイズホールディングス	2	2.9	1,771	ガホー・オンライン・エンターテイメント	27.9	37.5	91,612
東急	298.1	370.8	579,931	東洋埠頭	3	3.2	4,678	GMOペイメントゲートウェイ	24.6	28	278,880
京浜急行電鉄	151.8	188.7	223,609	宇徳	8.5	—	—	ザッパラス	4.6	5.6	2,671
小田急電鉄	189.4	218.7	444,398	上組	62.4	76.7	171,961	システムリサーチ	3.4	4	7,040
京王電鉄	66	76.3	392,945	サンリツ	2.3	4	3,360	インタースタートネット	30.9	38.5	149,765
京成電鉄	88.6	102.5	328,000	キムラユニティー	3.5	4	5,436	ウィンクス	12.2	15.4	7,792
富士急行	16.1	17.6	68,552	キユーソー流通システム	2.9	7.3	6,570	ウィンクス	3.2	4.2	3,465
新京成電鉄	3	3.4	6,810	近鉄エクスプレス	21.2	26.3	78,374	GMOグローバルサイン・ホールディングス	2.5	3.3	11,715
								S R Aホールディングス	6.2	7.2	21,124

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
システムインテグレータ	千株	千株	千円	EDULAB	千株	千株	千円	日本電信電話	千株	千株	千円
朝日ネット	3.2	4.8	2,654	東海ソフト	1.1	—	—	KDDI	1,357.1	1,509.2	5,054,310
eBASE	9.4	13.3	8,246	ウイングアーク1st	1.4	2.4	2,198	ソフトバンク	930.4	1,051.8	3,938,991
アバント	13.8	17.2	9,718	ビット・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	8.2	11,422	エムティイーアイ	1,054.5	2,185.1	3,148,729
アドソル日進	12.4	15.5	17,654	サバーワークス	2	3.4	6,613	GMOインターネット	13.7	16.6	234,558
ODKソリューションズ	4.1	5.1	8,445	東名	—	2.6	6,125	ファイバーゲート	11.4	14.2	8,037
フリービット	2	3	1,911	ウィッツ	0.6	1.5	1,426	アイネット	41.5	51.1	127,443
コムチュア	6.9	8.6	7,808	トピラシステムズ	0.4	1.2	1,555	アイネット	3.7	4.7	5,649
サイバーコム	10.7	16.2	47,968	Sansan	1.1	2.9	2,375	アイネット	2.9	3.5	1,004
アステリア	2.1	2.4	2,613	Link-U	—	51.3	62,842	KADOKAWA	31.3	78.7	179,672
アイル	8.3	10.4	9,318	ギフティ	0.7	2.7	2,033	学研ホールディングス	15.6	20.2	21,593
マークラインズ	6.5	8	10,040	ベース	5.2	12.6	13,759	ゼンリン	21	23.4	24,242
メディカル・データ・ビジョン	4.8	7.4	17,915	JMDC	1	2.6	11,414	昭文社ホールディングス	4.4	4.6	2,014
gumi	13.2	18.3	18,702	フォーカスシステムズ	—	13.5	66,892	インプレスホールディングス	10	11.7	2,468
ショーケース	16	20	11,720	グレスコ	7.7	9.6	8,937	アイネット	6	7.6	9,750
モバイルファクトリー	2.4	3.4	1,557	ブジ・メディア・ホールディングス	7.9	10.7	18,136	松竹	7.6	9.5	114,570
テラスカイ	2.4	3.3	3,392	オービック	120.1	139	174,167	東宝	68.5	85.2	405,978
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3.7	5.2	7,638	ジャストシステム	36.6	45.6	859,104	東映	3.8	4.7	82,720
PCIホールディングス	5.1	6.4	7,756	TDCソフト	16.5	20.5	101,065	エヌ・ティ・ティ・データ	309	384.2	866,755
パイプHD	4.4	6.6	6,903	Zホールディングス	10.2	12.6	13,154	ビー・シー・エー	1.7	8.6	13,261
アイビシー	2.4	2.8	7,210	トレンドマイクロ	1,593.8	2,096.9	1,214,314	DTS	4	5.1	8,828
ネオジャパン	1.9	2.6	1,716	IDホールディングス	61.9	77.1	472,623	アイネット	24	27.7	71,743
PR TIMES	2.2	4	4,300	日本オラクル	4.5	9.4	7,980	アイネット	49.5	67.1	397,903
ラクス	2.4	3.2	8,995	アルファシステムズ	23.5	23.4	195,624	シーイーシー	12.2	15.4	16,755
ランドコンピュータ	—	49.6	108,723	フューチャー	3.1	3.3	12,292	カプコン	49.7	136.1	393,737
ダブルスタンダード	1.5	2.5	2,052	CAC Holdings	14	30.5	44,560	アイ・エス・ビー	5.3	6.8	6,283
オープンドア	1.5	4.5	11,101	SBCテクノロジーズ	7.5	8.6	11,567	ジャステック	7.3	8.6	8,969
マイネット	6.9	8.6	14,258	オービックビジネスコンサルティング	4.2	6.4	15,507	S C S K	26.8	100	195,600
アカツキ	3.8	5.1	2,565	伊藤テクノソリューションズ	3.3	4.5	3,253	日本システムウェア	3.8	5.4	11,496
ベネフィットジャパン	4.6	6.4	18,835	アイティフォー	11.9	13.9	60,395	アイネス	11.3	13.2	19,813
Ubicomホールディングス	0.9	1.1	2,327	東計電算	52.9	65.7	193,552	T K C	9.8	24.4	72,614
カナミックネットワーク	3	3.9	8,853	エックスネット	15.1	17.4	13,519	富士ソフト	12.3	15.4	77,000
ノムラシステムコーポレーション	10.6	15.4	6,976	大塚商会	1.8	1.7	8,117	N S D	37.3	46.5	96,487
チェンジ	5.1	7.6	1,938	サイボウズ	2.2	2.5	2,407	コナミホールディングス	42.1	52.4	366,800
シンクロ・フード	16.2	26.5	37,683	電通国際情報サービス	62.8	78	333,450	群中コンピュータホールディングス	5.3	6.7	19,999
オークネット	6.9	7.5	2,347	ACESS	13.5	19.4	27,819	J B C Cホールディングス	7.8	9.8	14,719
キャピタル・アセット・プランニング	6.1	7.7	11,711	デジタルガレージ	14.4	20.8	72,696	ミロク情報サービス	11.5	12.7	16,344
セグエグループ	1.5	2.9	2,293	エイムシステムズ	10.8	16.4	9,626	ソフトバンクグループ	920.5	865	4,627,750
エイトレード	2.9	3.8	2,200	ウェザーニューズ	19.1	23.8	88,774	卸売業 (5.6%)			
AOI TYO HOLDINGS	2.2	2.2	4,639	C I J	19.2	24	15,696	ボウスイ	0.6	0.6	501
マクロミル	12	—	—	ビジネスエンジニアリング	3.4	4.5	35,640	高千穂交易	4.7	5.9	9,410
ビーグロー	23.6	29.5	32,509	日本エンタープライズ	7.9	9.8	7,947	オルパルスクエアホールディングス	1.6	1.7	2,502
ユーザローカル	2.3	3.4	3,910	WOWOW	1.2	1.7	5,873	伊藤忠食品	2.4	3	14,835
オロ	3.6	4.6	10,718	スカラ	11.6	14.9	2,547	エレマテック	9.4	11.7	12,296
テクノウェル	1.8	4.5	6,570	インテリジェント ウェイブ	5.7	7	12,173	J A L U X	3.3	4.1	10,487
マネーフォワード	2.5	3.3	1,402	IMAGICA GROUP	10.3	12.7	8,509	あらた	9.3	11.6	44,660
サインボスト	2.2	3.4	2,077	ネットワンシステムズ	6.9	8.7	4,845	トーマンデバイス	1.6	2.4	15,408
電算システムホールディングス	—	22	109,340	システムソフト	10	12.2	7,112	東京エレクトロニクス	3.8	4.2	22,638
ソルグシーズ	2.6	4.6	4,135	アルゴグラフィックス	47.3	55	150,315	フィールズ	10.2	12.6	6,363
フェイス	—	6	15,768	マーベラス	25.5	30.8	3,172	双日	641.6	159.9	306,368
プロトコーポレーション	4.4	12.2	5,099	エイベックス	9	11.4	35,454	アルフレッサ ホールディングス	120.7	160.8	272,877
ハイマックス	3.6	4	2,664	日本ユニシス	18.2	22.8	16,507	横浜冷凍	30.8	41.4	35,728
野村総合研究所	10.4	15.4	19,404	兼松エレクトロニクス	19.9	24.9	33,316	神栄	1.6	2	1,794
サイバネットシステム	2.9	4	4,788	都築電気	40.3	45.1	141,388	ラサ商事	6.5	8.2	8,495
CEホールディングス	211.8	278.9	1,126,756	TBSホールディングス	6.4	8	30,800	アルコニック	12.3	15.4	20,851
日本システム技術	8.2	10.3	6,509	日本テレビホールディングス	4.3	7.5	10,515	神戸物産	80.4	112.5	396,562
インターホールディングス	6.2	7.6	3,655	朝日放送グループホールディングス	76.9	87.7	159,877	ハイパー	2	2.3	1,101
東邦システムサイエンス	2.1	2.9	6,342	テレビ朝日ホールディングス	96.6	120.4	159,891	あい ホールディングス	16.7	20.6	36,647
ソースネクスト	14.4	16.6	30,892	スカパーJ S A Tホールディングス	12.1	14.9	10,549	ディープイェックス	4	4.8	4,992
インフォコム	3	4.1	3,813	テレビ東京ホールディングス	35.8	34.7	55,832	ダイワホールディングス	10.6	70.4	115,596
シンプレックス・ホールディングス	54.7	61.7	9,810	日本 B S 放送	76.3	122	55,022	マクニコ・富士エーホールドディングス	27.7	34.5	93,046
HEROZ	10.6	15.9	30,925	ビジョン	8.5	10.6	21,571	ラクト・ジャパン	5.1	5	9,895
ラクス	—	16.8	34,809	ワイヤレスゲート	4.1	5.3	5,803	グリムス	2.5	6.6	14,031
I P S	3.2	4	3,708	コネクシオ	14.2	24.6	25,682	メディアスホールディングス	20.6	25.2	20,286
F I G	9.4	15.9	57,876	日本通信	3.1	3.6	1,702	八洲電機	9.2	11	10,527
システムサポート	2.1	4	7,356	クロップス	4.4	13.8	34,817	レスタールホールディングス	6.8	8.5	7,556
イーンソル	12.6	16	4,528		4.8	5.5	1,826	ジョーテックホールディングス	12.2	13.8	26,937
アルティア・ネットワークス	3.4	4.3	4,136		6.7	10.4	14,653	大光	2.3	3.6	4,186
	6.2	8.7	4,732		10.2	119.8	23,840	OCNホールディングス	4.9	6.8	4,583
	12.8	18.3	25,180		2.3	2.9	2,549		3.5	3.6	4,755

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
TOKAIホールディングス	56.6	70.4	63,219	OUGホールディングス	1.8	2.3	6,175	J Kホールディングス	10.7	11.7	11,629
黒谷	3.3	4	2,548	スターゼン	4.3	10.9	22,868	日伝	9.7	12.1	26,111
Cominix	1.7	1.8	1,317	山善	45.5	60.9	60,839	北沢産業	7.3	7.6	1,725
三洋貿易	11.6	14.7	15,199	椿本興業	1.7	2.3	9,487	杉本商事	5.9	6.6	14,242
ビュティガレージ	1.9	2.5	7,800	住友商事	734.9	913.9	1,678,377	因幡電機産業	31.1	38.7	99,962
ワイン・パートナーズ	8.5	10.9	10,823	内田洋行	4.6	6.3	28,948	東テック	3.9	4.6	11,145
ミタチ産業	3	4	3,604	三菱商事	709	1,085.1	4,289,400	ミスミグループ本社	146	181.7	630,499
シッパヘルスケアホールディングス	20.6	46.5	119,551	第一実業	5.3	6.7	28,542	アルテック	8.8	10.3	3,162
明治電機工業	3.1	4.7	5,757	キヤノンマーケティングジャパン	28.9	35.9	89,821	タキヒヨー	4	4.1	5,781
デリカフーズホールディングス	5.2	6	3,222	西華産業	6.2	7.9	12,687	蔵王産業	1.9	2.2	4,037
スターティアホールディングス	2.3	3.4	2,590	佐藤商事	10	12.1	14,023	スズケン	49.3	56.6	200,647
コメダホールディングス	25.4	31.6	67,782	菱洋エレクトロ	8.8	8.6	17,397	ジェコス	8.2	10.8	8,640
ピーバンドットコム	1.5	2.4	1,521	東京産業	11	13.2	9,438	グロセール	12.9	17.1	7,609
アセンテック	2.9	4.9	3,474	ユアサ商事	12	13.8	40,020	小売業(4.2%)			
富士興産	3.5	3.8	3,689	神鋼商事	2.7	3.4	12,750	ローソン	29.5	32.1	154,240
協栄産業	1.5	1.7	2,618	トルク	5.8	6	1,272	サンエー	8.8	11	44,935
フルサト・マルカホールディングス	—	14	30,716	阪和興業	23.2	28.9	95,370	カワチ薬品	8.1	11.3	26,577
ヤマエグループホールディングス	—	9.8	10,201	正栄食品工業	7.5	9.4	38,352	エービーシー・マート	18.1	22.7	118,040
小野建	10.7	14.3	24,238	カナデン	9.6	12	12,060	ハードオフコーポレーション	5.4	6.9	5,319
南陽	2.1	2.3	4,473	菱電商事	8.4	11.6	20,218	アスクル	10.1	32.7	54,249
佐島電機	7.4	9.1	8,399	フルサト工業	6.3	—	—	ゲオホールディングス	15.6	19.4	22,445
エコートレーディング	2.6	2.9	1,722	岩谷産業	27.9	34.8	183,744	アダストリア	16.1	15.5	27,125
伯東	7.1	8.7	19,783	ナイス	4.7	5.1	9,205	ジーフット	7.6	10	3,170
コンドーテック	9.2	11.6	11,982	昭光通商	3.4	—	—	シー・ヴィ・エス・バイエリア	2	2.3	869
中山福	7.1	7.6	3,108	ニチモウ	1.6	2.4	6,182	くら寿司	6.9	15.1	55,115
ナガイレーベン	15.5	19.3	40,916	極東貿易	3	4.1	10,893	キャンドウ	5.6	5.3	10,780
三菱食品	12.9	14.2	45,298	アステナホールディングス	15.2	20.3	8,363	アイケイ	2.5	4	1,544
松田産業	8.5	10.7	25,209	三菱石油	28.7	35.6	32,716	バルグループホールディングス	10.2	12.6	20,878
第一興商	17.3	27.5	91,850	稲畑産業	27.9	31.8	64,617	エディオン	49.3	66.3	73,924
メディアバルホールディングス	116.7	156.2	339,266	G S I クレオス	2.8	6.9	7,741	サウコーポレーション	23.9	29.6	18,766
S P K	5.2	6	7,668	明和産業	10.8	13.3	14,856	ワッツ	5.2	7.2	4,960
視原電気ホールディングス	4.4	5.4	10,675	クワザホールディングス	4.4	4.6	2,865	ハローズ	4.4	6.7	18,900
アズワン	8.3	21.1	129,132	ヤマエ田野	8.5	—	—	フジオードグループ本社	9.8	12.3	16,605
スズデン	3.5	5.3	10,732	ワキタ	22.9	31	31,434	あみやき亭	2.5	3.4	9,860
尾家産業	3	3.2	3,184	東邦ホールディングス	37.3	46.5	87,373	ひらまつ	21.9	30.8	5,821
シモジマ	6.5	9	9,117	サンゲツ	31.5	38.4	60,364	大黒天物産	2.7	4.7	22,419
ドウシシャ	11	13.8	20,920	ミツコログループホールディングス	17.1	21.3	21,917	ハニーズホールディングス	9.1	11.5	11,879
小津産業	2.3	2.5	4,920	シオネンホールディングス	4.3	5.4	17,685	フューライズホールディングス	3.3	4	2,860
高速	6.3	8.8	12,944	伊藤忠エネクス	26	32.1	33,448	アルペン	8.9	11.2	23,990
たけがし	3.5	5.6	8,092	サンリオ	32.6	44.9	105,290	ハバ	3.6	4.8	2,836
リックス	2.2	2.5	3,875	サンワ テクノス	7.6	8.8	11,915	Qホールディングス	15.7	17.8	23,745
丸文	10.6	12.7	9,258	リョーサン	12.8	16	36,576	ジンスホールディングス	6.2	9.9	66,528
ハピネット	9.7	12.1	18,452	新光商事	15.9	22	19,162	ビックカメラ	69	85.7	88,271
橋本総業ホールディングス	2	3	6,027	トナー	5.4	6.8	7,289	DCMホールディングス	71.9	89.3	98,587
日本ライフライン	37.6	42.9	42,942	三信電気	6.4	6.8	11,131	ベッパーフードサービス	13.2	19.7	6,934
タカショー	7.4	11	7,271	東陽テクニカ	12.2	14.3	15,015	Monotaro	82.8	183.1	337,087
マルカ	3.8	—	—	モスフードサービス	16.5	19.1	57,777	東京一番フーズ	2.6	4	2,372
I DOM	39.3	43.9	29,544	加賀電子	10.5	13.1	42,837	DDホールディングス	5.2	7.7	4,365
進和	7	8.7	17,748	ソーダニッカ	11.3	15.1	13,423	きりりホールディングス	3.4	4.1	1,455
エスケイジャパン	2.7	3.3	1,382	立花エレクトロ	8.7	11.7	18,532	アークランドサービスホールディングス	9.7	10.8	23,727
ダイエー	5	6.3	12,814	フォリアル	4.3	6.6	6,177	J. フロント リテイリング	139	172.8	185,932
シークス	14.8	20.6	27,047	P A L T A C	18.7	20.3	89,624	ドット・ビレスホールディングス	18.4	25	40,125
田中商事	3.1	3.3	2,128	三谷産業	15.6	17.1	5,232	マツキヨコカラ&カンパニー	48.1	89.1	363,528
オーハンテクニカ	6.2	8.2	11,693	太平洋興発	5.1	5.6	3,662	ブロンコビリー	6.1	8.3	18,467
白鋼	3.6	4.7	12,502	西Wismetacホールディングス	2.6	3.4	10,642	ZOZO	68.7	99.8	306,386
ダイコー通産	1.1	1.7	2,012	ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.1	1.2	2,354	トレジャー・ファクトリー	3.4	4.3	4,089
伊藤忠商事	814.6	1,012.8	3,766,603	コア商事ホールディングス	3.3	10.9	6,714	物語コーポレーション	3.1	7.2	45,216
丸紅	1,148.1	1,428.3	1,684,679	国際紙パルプ商事	25.5	30	9,450	ココカラファイン	10.4	—	—
高島	1.6	2.3	5,444	ヤマタネ	5.3	6.9	11,102	三好物産ホールディングス	203.4	253.3	236,582
長瀬産業	65.5	79.6	144,872	丸紅建材リース	0.9	1.1	1,967	Hamee	2.9	3.8	4,111
蝶理	7.5	8.2	14,678	日鉄物産	8.3	10.4	55,224	マーケットエンタープライズ	—	1.1	860
豊田通商	116.9	145.3	717,782	泉州電業	3.3	4.1	25,953	ウエルシアホールディングス	61.5	76.6	239,758
三共生興	18	19.6	11,074	トラスコ中山	26.7	30.2	75,349	クワイエツSDホールディングス	17.1	21.3	66,988
兼松	46.5	53.9	69,800	オートバックセブン	43.2	48.8	68,954	丸善CH1ホールディングス	15.4	18.9	6,898
ツカモトコーポレーション	1.7	1.8	2,354	モリト	9	10.9	7,957	ミサワ	2.4	3	1,965
三井物産	945.5	1,124.4	3,333,846	加藤産業	16.9	21	69,090	ティーライフ	1.7	2	2,630
日本紙パルプ商事	6.1	7.7	30,684	北恵	3.2	4	3,472	イー・ピーホールディングス	1.9	2.2	965
カメイ	15.2	17.1	17,698	イノテック	6.6	8.7	12,815	チムニー	3.5	4.6	5,349
東都水産	1.4	0.6	2,361	イエローハット	21.9	25.1	42,017	シュッピン	7.9	12	12,948

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額		株	数	価 額	株	数	価 額
オイシックス・ラ・大地	11.5	20.8	53,185	千株	千円		ピーシーデポコーポレーション	13.6	16.9	4,867	千株	千円		パローホールディングス	23.8	32.1	72,225	千株	千円	
ネクスステージ	19.9	29.3	85,907				壹番屋	8.2	10.3	48,049				藤久	2.7	—	—			
ジョイフル本田	34.2	42.4	64,660				トップカルチャー	4.8	5.5	1,545				ベルク	5.8	6.4	34,496			
鳥貴族ホールディングス	3.3	5.3	9,714				P L A N T	3.1	3.6	2,390				大 庄	6.3	8	8,256			
ホットランド	8.6	11	14,069				スギホールディングス	23.2	28.9	194,786				ファーストリテイリング	15.6	19.4	1,242,570			
すかいらーくホールディングス	130.4	186.9	280,536				葉王堂ホールディングス	5.1	7.3	17,571				サンドラッグ	43.8	54.5	162,628			
SFPホールディングス	5.7	7.2	10,188				ウィア・ホールディングス	14.2	19.3	2,952				サックパル ホールディングス	10	13.8	7,120			
綿半ホールディングス	8.8	11	14,289				スクロール	16.6	22.3	20,159				ヤマザワ	2.6	2.9	4,738			
ヨシダホールディングス	2.3	2.9	6,252				ヨンドーホールディングス	10.8	13.3	23,368				やまや	2.5	3	7,482			
コナミデジタルエンタテインメント・ホールディングス	33.9	42.3	45,684				木曽路	15.3	19.3	42,884				ペルーナ	25	31.1	23,418			
ゴルフダイジェスト・オンライン	6	7.6	8,109				SRSホールディングス	14.6	20	16,260				銀行業 (5.6%)						
B E E N O S	5.4	7.5	13,702				千趣会	20.9	26.4	9,794				島根銀行	4.3	4.5	2,533			
あさひ	8.6	12	17,112				タカキュー	9.9	12.9	1,380				じもとホールディングス	8	10.8	7,430			
日本調剤	7.1	8.8	12,883				リテールパートナーズ	14.1	17.6	22,792				めぐみフィナンシャルグループ	604.6	751.7	208,220			
コスモス薬品	11.8	14.7	207,270				ケーヨー	21.6	26.9	22,918				東京きらびフィナンシャルグループ	14.6	18.3	30,707			
トーエール	5.7	6.8	5,861				上新電機	13.7	16.6	35,275				九州フィナンシャルグループ	238	296.3	135,705			
オンリー	2.6	—	—				日本瓦斯	19.2	70.4	117,004				ゆうちょ銀行	330.8	342.8	402,447			
セブン&アイ・ホールディングス	455.6	566.6	3,282,880				ロイヤルホールディングス	20.3	24.9	46,961				富士第一銀行	28.6	35.7	11,424			
クニエイト・レストランツ・ホールディングス	62.5	77.1	58,596				東天虹	0.6	0.6	562				コンソリア・フィナンシャルグループ	709.7	828	416,484			
ツルハホールディングス	25.4	31.6	288,192				いのげや	13	18	25,416				西武フィナンシャルホールディングス	77.6	94.6	80,788			
サマルホールディングス	9.1	11.5	18,285				チヨダ	12.2	14	10,668				関西みらいフィナンシャルグループ	54.8	—	—			
フェリシモ	2.6	3.4	4,372				ライフコーポレーション	8.8	13.5	41,242				三十三フィナンシャルグループ	10.2	13.7	21,344			
トリドールホールディングス	28.8	35.9	83,682				リンガーハット	14.4	17.9	40,650				美野北フィナンシャルグループ	19	23.6	65,584			
TOKYO BASE	10.4	13.2	5,913				Mr Ma x HD	15.9	18.2	11,156				ひろぎんホールディングス	172.2	214.3	150,652			
ウィルバスホールディングス	1.9	2.5	2,425				テンアライド	11.7	15.3	4,758				おきなわフィナンシャルグループ	—	13.1	30,418			
JMホールディングス	8.8	9.8	16,787				AOKIホールディングス	23.1	28	16,856				十六フィナンシャルグループ	—	19.5	47,541			
サツドラホールディングス	1.5	7.4	4,684				オークワ	18.2	22.8	21,500				北都フィナンシャルホールディングス	—	13.4	42,880			
アレナホールディングス	6.7	11.2	12,208				コメリ	18	22.4	61,219				新生銀行	95.1	94.6	221,458			
株式会社中ホールディングス	3	3.9	8,037				青山商事	25.7	29.7	20,582				あおぞら銀行	69.4	81	222,912			
パルコジャパンリミテッド	8.1	10.6	9,508				しまむら	13.5	16.8	176,904				三井住友フィナンシャルグループ	7,977.2	9,093.4	6,731,844			
クスリのアオキホールディングス	11.6	14.4	98,928				はせがわ	5.2	8	2,408				りそなホールディングス	1,267.6	1,659.4	901,386			
力の源ホールディングス	5.4	7.7	4,319				高島屋	84.7	105.3	117,725				三井住友トラスト・ホールディングス	220.5	274.1	1,162,184			
FOOD & LIFE COMPANIES	63.9	84.7	300,685				松屋	25.4	29.1	21,155				三井住友フィナンシャルグループ	807.1	1,003.6	4,351,609			
メディカルシステムネットワーク	10.2	14.2	7,668				エイ・ツー・オー リテイリング	55	68.5	56,992				千葉銀行	388.8	483.8	381,718			
一家ホールディングス	—	2.7	1,422				近鉄百貨店	4.5	5.5	14,756				群馬銀行	239.8	277.9	112,271			
藤久ホールディングス	—	3.5	2,688				丸井グループ	98.5	114.3	259,918				武蔵野銀行	17.3	21.6	41,752			
はるやまホールディングス	6.1	6.9	3,519				アグリアル リテイリング	9.7	11.4	37,848				千葉興業銀行	29.8	34.5	10,005			
ノジマ	20.7	23.4	58,125				井筒屋	6.3	6.9	2,732				筑波銀行	48.4	56.9	11,778			
カッパ・クリエイト	16.4	20.4	27,478				イオン	448.1	557.2	1,481,594				七十七銀行	36.6	45.5	73,164			
ライトオン	8.8	11.2	8,064				イズミ	23.6	26.3	86,395				青森銀行	9	11.3	22,249			
ジーンズメイト	3.6	—	—				平和堂	21.5	26.8	52,474				秋田銀行	7.1	9.4	17,343			
良品計画	154.5	166.7	293,892				フジ	14.1	17.6	32,929				山形銀行	13	16.3	16,348			
三城ホールディングス	14.9	15.7	3,940				ヤオコー	13.2	16.5	109,560				岩手銀行	7.6	9.4	18,593			
アドヴァングループ	12	14.9	14,125				ゼビオホールディングス	14	19.7	18,064				東邦銀行	104.1	121.4	26,950			
アルビス	3.7	4.8	10,502				ケーズホールディングス	103.7	133.4	165,282				東北銀行	5.9	7.5	8,047			
コナカ	14.1	16.9	5,965				Olympicグループ	6	7.9	5,609				みちのく銀行	7.5	9.5	8,540			
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.2	2,026				日産東京販売ホールディングス	14.3	22.8	5,198				ふくおかフィナンシャルグループ	105.1	122	289,018			
G-7ホールディングス	6.9	16.2	24,526				シルバライフ	1.6	3	3,264				静岡銀行	283.9	353.2	323,531			
イオン北海道	15.6	25.7	29,400				一家ダイニングプロジェクト	1.1	—	—				十六銀行	14.6	—	—			
コジマ	19.9	24.8	13,392				Genky DrugStores	5.1	6.4	22,848				スルガ銀行	101.6	127	63,627			
ヒマラヤ	4.3	5.1	5,232				ナリス・インターナショナル	2.3	3.4	3,910				八十二銀行	262.3	326	144,418			
コーナン商事	16.6	20.6	72,821				フクオクグループホールディングス	6.8	8.8	9,160				山梨中央銀行	13.6	16	15,472			
エコス	4.3	5.4	11,334				ギフト	1.1	2.4	5,904				大垣共立銀行	23	28.8	60,307			
ワタミ	15.3	17.6	16,227				アインホールディングス	16.9	19.4	115,818				福井銀行	10	12.5	18,587			
マルシェ	3	4	1,760				元気寿司	3.2	4.1	10,455				北國銀行	10.9	—	—			
パルパティフィ・インターナショナルホールディングス	232.8	289.5	480,859				ヤマダホールディングス	390.2	528.8	210,462				清水銀行	4.9	6.3	10,508			
西松屋チェーン	25.5	31.7	47,264				アークランドサカモト	18.2	22.8	34,884				富山銀行	1.9	2.2	4,818			
ゼンショーホールディングス	62.5	70.8	195,903				ニトリホールディングス	46.3	57.6	936,000				滋賀銀行	23.3	27.3	62,844			
幸楽苑ホールディングス	7.3	9.2	12,493				グルメ軒屋	8.4	12	12,144				南都銀行	17	22.8	46,603			
ハークスレイ	2	6.3	3,024				愛眼	7.6	8.1	1,417				百五銀行	105.2	140	51,380			
サイゼリヤ	17.2	21.5	59,340				ケーユーホールディングス	6	7.9	8,121				京都銀行	41.7	51.9	295,311			
VTホールディングス	43.9	54.6	24,897				吉野家ホールディングス	38.2	50.6	121,035				紀陽銀行	41.3	49.2	77,390			
魚力	3.5	3.9	7,979				松屋フーズホールディングス	5.6	7	25,375				ほくほくフィナンシャルグループ	77.5	90.5	87,061			
ポプラ	3.3	4.6	648				サガミホールディングス	15.7	22.3	24,061				山陰合同銀行	73.6	86.3	58,597			
フジ・コーポレーション	3.1	7.9	9,345				関西フードマーケット	8.8	11	11,506				中国銀行	100.4	116	110,316			
ユナイテッドアローズ	13.2	15.1	27,240				王将フードサービス	7.7	9.5	56,525				鳥取銀行	4	4.2	5,191			
ハイドイ日高	16.8	20.9	35,927				プレナス	13.2	16.4	33,029				伊予銀行	154.6	192.3	120,956			
YU-WA CREATION HOLDINGS	6.4	8.6	1,720				ミニストップ	8.7	11.2	16,497				百十四銀行	12.2	15.4	27,273			
コロワイド	38.6	59.5	100,436				アークス	22.1	27.7	60,940				四国銀行	16.7	22.3	18,419			

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

銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)			銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
キャリアデザインセンター	千株	千株	千円	リソルホールディングス	千株	千株	千円	プロレド・パートナーズ	千株	千株	千円
ベネフィット・ワン	2.5	3.6	4,194	テクノプロ・ホールディングス	0.9	1.6	7,000	and factory	1.6	3	2,436
エムスリー	41.2	51.2	153,548	アトラグループ	22.5	84.1	295,191	テノ・ホールディングス	1	3.3	1,214
ツカギ・グローバルホールディング	199.3	247.9	1,042,667	インターワークス	2.5	2.6	676	フロンティア・マネジメント	0.9	2	1,206
プラス	9.5	8.5	2,380	アイ・アールジャパンホールディングス	3.5	4.5	1,687	コプロ・ホールディングス	2	3.6	2,350
アウトソーシング	1.5	2.2	1,392	Keep Per 技研	4.6	6.6	32,505	ビアラ	0.6	2.3	1,258
ウェルネット	64.7	80.5	108,514	ファーストロジック	7.3	9	16,929	ギークス	0.6	2.9	3,204
ワールドホールディングス	11.5	14.3	6,263	三機サービス	2.2	2.9	2,166	カープスホールディングス	1.5	2.6	3,803
ティーン・エヌ・エー	3.9	5.6	13,484	Gunosy	2.3	3	2,907	フォーラムエンジニアリング	31	38.7	27,244
情報屋DYYホールディングス	47.8	53.6	95,783	デザインワン・ジャパン	6.8	8.8	6,274	FAST FITNESS JAPAN	5.8	9.9	8,613
ぐるなび	157.2	195.6	350,124	イー・ガーディアン	3.5	3.6	673	ダイレクトマーケティングミックス	—	2	4,224
タカミヤ	19.6	22.9	8,724	リブセンス	4.9	5.6	14,795	ポピンズホールディングス	4.4	15.2	21,964
ジャパネットホスピタリティシステム	14.1	17.6	7,128	ジャパネットマテリアル	6.2	8.7	1,400	LITALICO	2.3	3.4	8,493
ファンコミュニケーションズ	8.9	9.4	8,610	ベクトル	34.8	43.2	71,625	アドバテッジシステムマネジメント	—	11.5	35,190
ライク	31.3	35.1	13,267	ウチヤマホールディングス	14	19.7	20,448	リログループ	5.7	7.2	5,184
ビジネス・ブレイクスルー	3	3.8	6,805	チャーム・ケア・コーポレーション	5.8	7.4	2,412	東祥	61.7	76.9	158,337
エス・グループ	5.1	5.5	2,304	キャリアリンク	8.4	10.6	12,084	TREホールディングス	7.1	10.6	16,472
WDBホールディングス	28.9	39.7	39,342	IBJ	3.6	5.1	8,573	エイチ・夢・技術グループ	—	19.4	28,731
手間いらず	5.2	6.6	18,513	アサンテ	9.1	11.5	8,728	ラククランド	—	5.6	10,102
ティア	1.1	1.8	8,496	N・フィールド	4.1	6.4	10,419	共立メンテナンス	16.4	31.3	64,165
CDG	7.2	8.7	3,801	M&Aキャピタルパートナーズ	7.6	—	—	イチネホールディングス	3.2	4.1	11,836
アドウェイズ	1.3	1.4	1,912	ライオンシステムホールディングス	4.5	5.6	13,904	建設技術研究所	18.7	25	103,875
パリュウ・コマース	13.7	20.9	15,863	ER1ホールディングス	9.3	11.6	55,042	スバース	11.8	14.6	18,804
インフォマート	7.5	11.2	39,032	アビスト	4.3	5.4	8,262	長 大	7.3	8.5	20,102
J.P.ホールディングス	114.3	153.9	97,880	シグマシステムホールディングス	2.8	4	4,660	燃ホホールディングス	7.7	10.4	9,505
エコナックホールディングス	32.6	35.7	8,246	ウィルグループ	1.8	2.2	6,435	スバル興業	4.5	—	—
E.P.S.ホールディングス	20.7	26	2,288	エスコロー・エージェンツ・ジャパン	6.2	8.6	19,049	東京テアトル	4.7	6.3	9,714
CLホールディングス	15.3	—	—	メドピア	8.2	10.4	13,176	タナベ経営	0.7	0.7	5,537
プラステック・インターナショナル	2.7	3	3,594	レアジョブ	16.6	18.9	3,553	ナガワ	4.6	5.4	6,615
アミューズ	42.2	52.4	37,832	リクルートホールディングス	5.3	10.9	30,498	よみうりランド	2.2	4.8	3,028
ドリームインキュベータ	6.2	7.7	16,216	エラン	1.6	2.8	2,282	東京競馬場	3.6	4.6	43,608
クワイック	3.5	3.9	8,088	土本管理総合試験所	809.3	1,083.7	6,140,244	常盤興産	0.6	—	—
TAC	7	9.6	15,801	ネットマーケティング	15.6	19.4	19,826	カナモト	7.3	10.7	46,224
ケネディクス	6.3	8.6	1,952	日本郵政	5.7	6.9	2,187	東京ドーム	4.7	5.4	7,317
電通グループ	32.3	—	—	ベルシテム24ホールディングス	5.4	6.9	3,029	西尾レントオール	19.9	24.8	57,015
ティクアンドザ・ニーズ	127	144.8	605,988	鎌倉新書	855.3	1,834.3	1,880,157	アゴラ ホスピタリティ・グループ	44.5	—	—
ぴあ	5.2	6.7	6,880	SMN	18.9	20.1	28,642	トランス・コスモス	10.4	12.9	36,894
イオンファンタジー	3.2	4.9	16,415	一蔵	11.4	16	8,400	ナ村工務社	71.2	75.2	1,654
シーティーエス	4.3	5.4	11,718	LITALICO	2.4	3.4	2,046	日本管財	10.8	17.9	57,101
ネクシースグループ	12.6	16	12,976	グローバルキッズCOMPANY	1.7	2.3	899	トーカイ	48.3	60.2	57,671
H.U. グループホールディングス	3.5	5	3,445	エアトリ	4.6	—	—	白洋舎	4.4	6.2	15,196
アルプス技研	31.7	36.7	108,411	アトラエ	2.1	2.7	2,130	セコム	6	8.7	12,754
サニックス	10	12.6	23,347	ストライク	6.1	9	27,270	セントラル警備保障	12.2	15.1	42,083
ダイオーズ	17.7	24.4	4,733	ソラスト	3.4	9.8	20,482	丹青社	11	12.5	22,887
日本空調サービス	2.2	3.5	3,475	セラク	4.2	5.3	21,995	メイテック	1	1.7	2,050
オリエンタルランド	12.2	15	11,730	インソーズ	27.7	34.5	36,570	応用地質	111.3	138.5	1,147,749
ダスキン	120.1	166.1	3,474,812	ベイカレント・コンサルティング	3.5	4.6	5,602	船井総研ホールディングス	5.4	6.8	16,109
明光ネットワークジャパン	26.2	32.6	89,650	Orchestra Holdings	13.7	26.112	26,112	進学会ホールディングス	21.1	28.7	20,635
ファルコホールディングス	14.2	16.5	9,322	アイモバイル	9.9	9.9	402,435	オオバ	13.8	17	113,900
秀英予備校	5.4	6.8	14,048	キャリアインデックス	2.5	2.8	7,834	いであ	13.2	16	34,160
田谷	2.8	3.6	1,519	MS-Japan	4	4	4,660	学究社	23.1	28.8	66,643
ラウンドワン	1.7	1.8	991	船場	4.6	4.8	3,609	パネッセルホールディングス	4.9	5.1	1,672
ワタベウェディング	38.5	39.2	57,310	グレイステクノロジー	4.5	5.7	5,061	イオンディライト	7.9	10.2	7,405
りらあコミュニケーションズ	51.7	64.4	123,390	フルテック	1.6	1.7	1,269	ナック	2.7	3.9	6,953
リソー教育	14.6	18.2	66,339	グリーンズ	5.7	—	—	ダイセキ	3.4	4.7	7,219
早稲田アカデミー	1.7	21.3	21,917	ツナググループホールディングス	44.5	71,422	71,422	ステップ	41.4	46.8	106,516
ユー・エス・エス	57.3	64.3	26,105	GAMEWITH	2.2	2,893	2,893	合計	13.9	17.3	52,332
東京個別指導学院	4.4	8	8,104	ソウルドアウト	4.2	5.3	2,501	銘柄数<比率>	5.6	7.4	7,266
サイバーエージェント	126.4	157.3	299,656	MS&Consulting	1.7	3.4	1,030	株数・金額	18.9	26	127,270
楽天グループ	9.9	12.3	7,699	ウェルビー	3.5	4.3	1,917	銘柄数<比率>	4.3	5.3	9,481
クリーク・アンド・リバーサ	69.6	346.2	508,221	エル・ディー・エス	2.4	2.4	1,576	(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。	124,117.8	161,644	387,140,847
モーニングスター	526.6	721.4	705,529	ミダックホールディングス	9.1	11.129	11,129	(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。	2,183銘柄	2,174銘柄	1<97.4%>
デー・オー・ダブリュ	5.8	7.5	13,087	日経工業	0.8	1.1	4,152	(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。	15,710	8,558	11,180
山田コンサルティンググループ	12.4	24.7	14,424	キュービーネットホールディングス	8.7	11	7,052		5,788	22,770	
セントラルスポーツ	19.8	24.8	7,489	RPAホールディングス	5.2	6.6	11,180				
フルキャストホールディングス	6.6	7.5	8,565	スプリックス	12.8	19.7	7,052				
エン・ジャパン	4.2	5.2	12,844	マネジメントソリューションズ	3.2	4	5,788				
	20.1	22.9	66,341		5.5	6.9	22,770				

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		期末
		買建額	売建額	額
国内	T O P I X	百万円 10,035		百万円 －

■投資信託財産の構成

2022年2月7日現在

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月7日)現在

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

(注1)	期首元本額	102,105,610,506円
	追加設定元本額	163,179,331,486円
	一部解約元本額	140,714,316,471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	561,857,238円
	MHAM TOP I Xオープン	2,725,686,605円
	MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	7,087,968,915円
	One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253円
	D I AM国内株式バッシブ・ファンド	4,704,569,337円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,424,028円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	23,972,661円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	78,308,323円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	28,249,023円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,103,225円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	15,896,115円
	たわらノーロード TOP I X	1,306,069,812円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,033,861,326円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	40,906,841円
	たわらノーロード バランス (標準型)	262,619,504円
	たわらノーロード バランス (積極型)	394,664,404円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	3,669,806円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	174,139,046円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	434,342,242円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	283,511,087円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	405,598,982円
	たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	705,164円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,916,286円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	36,588,931円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,020,593円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	19,092,798円
	D I AM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円
	Oneグローバルバランス	5,199,858円
	D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,065,319,872円
	D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,512,005,009円
	D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,794,173,475円
	D I AM DC バランス30インデックスファンド	343,318,358円
	D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円
	D I AM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187円
	マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	30,317,366円
	マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,055,563,450円
	マネックス資産設計ファンド エポリューション	18,529,124円
	D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	304,544,955円
	D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	306,459,778円
	D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	545,764,310円
	投資のソムリエ	13,743,021,171円
	クルーズコントロール	128,837,057円
	投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円
	D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円
	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円
	D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,701,235円
	D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	5,513,567円
	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	41,503,360円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,618,660円
	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円
	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円
	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	15,092,602円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	105,875,155円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	985,477円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	22,944,960円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	23,431,080円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	21,508,092円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	14,273,870円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	22,637,856円
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)	193,585,816円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05	41,677,610円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	84,110,969円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07	68,984,011円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08	47,924,787円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	22,733,018円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09	49,987,822円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12	70,694,127円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	329,597,803円
D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	34,825,039円
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	116,640,502円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (FOF S用) (適格機関投資家限定)	39,121,859円
リスクコントロール世界8資産/バランスファンド (FOF S用) (適格機関投資家専用)	7,907,522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)	57,045,218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)	101,888,672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)	4,956,036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)	26,722,842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)	5,712,676円
D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,338,373円
D I AM世界/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	7,152,634円
D I AM世界/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,835,196円
D I AM/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	557,427,217円
D I AM/バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	634,827,723円
D I AM/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,809,585,772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)	31,302,882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)	31,388,733円
D I AM アップ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	301,727,428円
D I AM世界アセット/バランスファンドVA (適格機関投資家限定)	74,733,048円
D I AM世界/バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,406,645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)	349,638,985円
D I AM世界アセット/バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	20,826,049円
D I AM世界アセット/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	73,311,471円
D 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)	173,199,524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)	237,769,545円
D I AM世界/バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	38,321,734円
D I AM国内/バランス30VA (適格機関投資家限定)	18,177,991円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(121) (適格機関投資家限定)	291,737,796円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	936,557,239円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
D I AM世界アセット/バランスファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージ・ジファンド<DC年金>	19,960,341円
コア資産形成ファンド	13,478,680円
MHAM TOP I XファンドVA (適格機関投資家専用)	692,612,483円
MHAM動的パッケージファンド (適格機関投資家限定)	65,067,969円
MHAM日本株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,686,127,829円
期末元本合計	2,050,559,819円
担保資産	124,570,625,521円

(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2021年2月9日 至2022年2月7日

項 目					当 期
(A)	配 当 受 取 金	等 配 取 利 金	収 当 損 益		7,296,744,510円
					7,292,821,896
					44,549
	の 他 収 益				6,677,036
	支 払 利 息				△2,798,971
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益				△7,496,155,473
		買 買 損 益			39,449,298,775
					△46,945,454,248
(C)	先 物 取 引 等 取 引 損 益				654,522,360
		引 引 損 益			1,686,367,190
					△1,031,844,830
(D)	当 期 損 益		金(A + B + C)		455,111,397
(E)	前 期 繰 越 損 益		金		216,481,029,551
(F)	解 約 差 損 益		金		△309,165,756,529
(G)	追 加 信 託 差 損 益		金		364,995,605,514
(H)	合 計(D + E + F + G)				272,765,989,933
	次 期 繰 越 損 益		金(H)		272,765,989,933

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2022年6月22日）

（計算期間 2021年6月23日～2022年6月22日）

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2008年1月16日から無期限です。
運 用 方 針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」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		F T S E 世 界 国 債 インデックス		債券組入 比	債券先物 比	純 資 産 総 額
	円	%	(除く日本、 円ベース、 為替ヘッジあり) (ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
11期 (2018年6月22日)	13,246	△1.7	ポイント 381.67	% △1.6	% 98.0	% －	百万円 290,732
12期 (2019年6月24日)	13,888	4.8	400.89	5.0	96.9	－	454,858
13期 (2020年6月22日)	14,658	5.5	424.77	6.0	100.6	－	337,333
14期 (2021年6月22日)	14,333	△2.2	415.85	△2.1	97.9	－	573,974
15期 (2022年6月22日)	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	－	375,850

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークはF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

(注3) F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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おりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、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

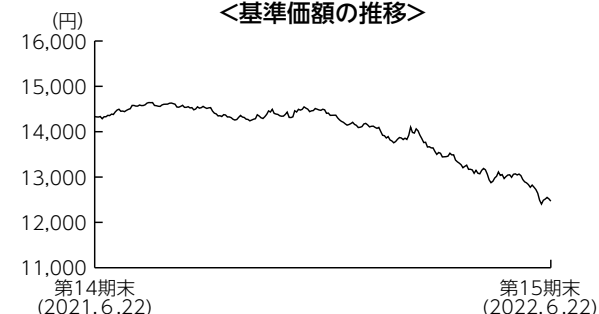
年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世 界 国 債 イ ン デ ッ ク ス		債券組入 比	債券先物 率
		騰 落 率	(除 く 日 本 、 円 ベ ー ス 、 為 替 ヘ ッ ジ あ り) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2021 年 6 月 22 日	円 14,333	% －	ポイント 415.85	% －	% 97.9	% －
6 月 末	14,329	△0.0	415.77	△0.0	97.6	－
7 月 末	14,578	1.7	423.02	1.7	97.4	－
8 月 末	14,582	1.7	423.13	1.8	98.5	－
9 月 末	14,352	0.1	416.47	0.2	90.9	－
10 月 末	14,346	0.1	416.21	0.1	100.5	－
11 月 末	14,435	0.7	418.85	0.7	96.7	－
12 月 末	14,304	△0.2	415.09	△0.2	100.4	－
2022 年 1 月 末	14,123	△1.5	409.98	△1.4	97.7	－
2 月 末	13,830	△3.5	401.33	△3.5	98.1	－
3 月 末	13,459	△6.1	390.67	△6.1	102.4	－
4 月 末	13,160	△8.2	382.14	△8.1	134.0	－
5 月 末	13,032	△9.1	378.13	△9.1	98.7	－
(期 末) 2022 年 6 月 22 日	12,469	△13.0	361.76	△13.0	104.3	－

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年6月23日から2022年6月22日まで）

＜基準価額の推移＞



基準価額の推移

当期末の基準価額は12,469円となり、前期末比で13.0%下落しました。

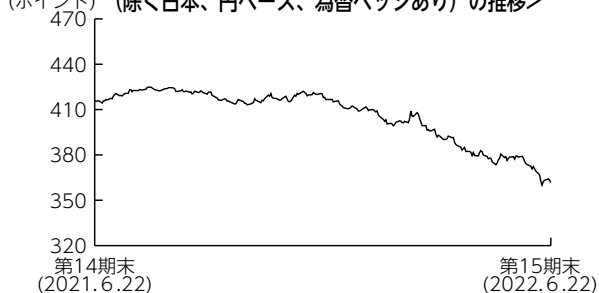
基準価額の主な変動要因

記録的なインフレに収束の兆しが見えない中、F R B（米連邦準備理事会）が2022年6月に通常の3倍となる0.75%の利上げを実施したことなどを背景に米国債やドイツ国債の利回りが上昇（価格は下落）したことが基準価額の下落要因となりました。

投資環境

外国債券市場では、米国債やドイツ国債の利回りは上昇する展開となりました。米国債は、F R B高官からインフレを抑制するため利上げペースを早める旨の発言が相次いだこと、ロシアによるウクライナへの侵攻を受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についてもE C B（欧州中央銀行）の利上げ観測や、ユーロ圏インフレ率の加速などを受けて利回りは上昇しました。

＜F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）の推移＞



ポートフォリオについて

ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.0%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、ほぼ同程度の運用成果となりました。

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) (そ の 他)	2円 (2) (0)	0.016% (0.014) (0.002)	(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
合 計	2	0.016	
期中の平均基準価額は13,992円です。			

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月23日から2022年6月22日まで)
公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 4,914,654	千アメリカ・ドル 5,494,081 (-)
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダ・ドル 251,989	千カナダ・ドル 291,768 (-)
	オーストラリア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 229,921	千オーストラリア・ドル 296,314 (-)
	シンガポール	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 57,753	千シンガポール・ドル 65,595 (-)
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリス・ポンド 441,626	千イギリス・ポンド 526,508 (-)
	イスラエル	国 債 証 券	千イスラエル・シェケル 128,140	千イスラエル・シェケル 156,134 (-)
	デンマーク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 292,058	千デンマーク・クローネ 343,759 (-)
	ノルウェー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 224,531	千ノルウェー・クローネ 263,883 (-)
	スウェーデン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 254,669	千スウェーデン・クローナ 311,356 (-)
	メキシコ	国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 1,475,444	千メキシコ・ペソ 1,754,228 (-)

			買 付 額	売 付 額
外 国	中 国	国 債 証 券	千オフショア・人民元 812,249	千オフショア・人民元 410,496 (-)
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 193,451	千マレーシア・リンギット 224,237 (-)
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 196,938	千ポーランド・ズロチ 242,904 (-)
	ユ ー ロ	ア イ ル ラ ン ド	千ユーロ 64,945	千ユーロ 77,716 (-)
		オ ラ ン ダ	166,662	191,731 (-)
		ベ ル ギ ー	195,612	227,273 (-)
		フ ラ ン ス	899,229	1,038,475 (-)
		ド イ ツ	675,576	785,447 (-)
		ス ペ イ ン	535,122	613,902 (-)
		イ タ リ ア	803,076	935,537 (-)
		フ ィ ン ラ ン ド	51,778	60,641 (-)
		オ ー ス ト リ ア	125,003	143,931 (-)

(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。

■利害関係人との取引状況等 (2021年6月23日から2022年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

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 1,610,280	千アメリカ・ドル 1,464,100	千円 199,835,047	% 53.2	% —	% 23.2	% 19.5	% 10.4
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 84,590	千カナダ・ドル 75,656	千円 7,974,905	2.1	—	1.0	0.6	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 69,660	千オーストラリア・ドル 62,081	千円 5,879,760	1.6	—	1.1	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 18,370	千シンガポール・ドル 17,637	千円 1,735,324	0.5	—	0.3	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 120,060	千イギリス・ポンド 116,205	千円 19,420,263	5.2	—	3.9	0.7	0.6
イスラエル	千イスラエル・シェケル 40,350	千イスラエル・シェケル 39,620	千円 1,565,167	0.4	—	0.2	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 78,970	千デンマーク・クローネ 77,252	千円 1,490,202	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 63,300	千ノルウェー・クローネ 58,971	千円 814,395	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 81,210	千スウェーデン・クローナ 79,682	千円 1,070,927	0.3	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 481,838	千メキシコ・ペソ 445,355	千円 3,012,696	0.8	—	0.4	0.4	—
中 国	千オフショア・人民元 399,450	千オフショア・人民元 402,732	千円 8,203,301	2.2	—	1.0	1.0	0.2
マレーシア	千マレーシア・リングギット 66,970	千マレーシア・リングギット 65,034	千円 2,017,579	0.5	—	0.4	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 67,350	千ポーランド・ズロチ 53,359	千円 1,651,407	0.4	—	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	19,810	18,137	2,602,024	0.7	—	0.5	0.2	0.0
オランダ	48,210	46,466	6,666,083	1.8	—	1.1	0.5	0.2
ベルギー	56,600	54,720	7,850,197	2.1	—	1.6	0.5	0.0
フランス	246,200	238,979	34,284,051	9.1	—	5.6	2.7	0.9
ドイツ	183,330	179,638	25,770,977	6.9	—	4.1	1.8	1.0
スペイン	149,420	143,687	20,613,341	5.5	—	3.4	1.5	0.5
イタリア	235,800	225,079	32,289,916	8.6	—	4.9	2.5	1.2
フィンランド	15,780	14,438	2,071,402	0.6	—	0.3	0.1	0.1
オーストリア	37,160	35,232	5,054,427	1.3	—	0.8	0.5	0.1
合 計	—	—	千円 391,873,402	104.3	—	54.2	33.9	16.1

(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 評 価 額		末 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 2.625 01/31/26	国 債 証 券	2.6250	1,280	1,246	170,141	2026/01/31
US T N/B 2.5 01/31/25	国 債 証 券	2.5000	6,000	5,879	802,433	2025/01/31
US T N/B 2.25 01/31/24	国 債 証 券	2.2500	6,160	6,073	829,020	2024/01/31
US T N/B 2.5 01/31/24	国 債 証 券	2.5000	10,000	9,900	1,351,357	2024/01/31
US T N/B 0.125 01/15/24	国 債 証 券	0.1250	10,000	9,542	1,302,519	2024/01/15
US T N/B 0.875 01/31/24	国 債 証 券	0.8750	6,000	5,785	789,701	2024/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国 債 証 券	1.5000	13,290	12,216	1,667,418	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国 債 証 券	1.7500	10,000	9,035	1,233,208	2029/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国 債 証 券	0.7500	10,270	8,875	1,211,420	2028/01/31
US T N/B 1.125 01/15/25	国 債 証 券	1.1250	2,940	2,782	379,774	2025/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国 債 証 券	6.0000	1,810	1,970	268,953	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国 債 証 券	3.1250	1,310	1,214	165,713	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国 債 証 券	3.1250	2,760	2,538	346,428	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国 債 証 券	2.5000	5,270	4,300	587,018	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国 債 証 券	3.5000	890	898	122,652	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国 債 証 券	5.3750	2,290	2,639	360,325	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国 債 証 券	4.5000	1,410	1,610	219,799	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国 債 証 券	4.7500	2,470	2,878	392,941	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国 債 証 券	3.6250	5,660	5,620	767,161	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国 債 証 券	3.0000	5,450	4,986	680,583	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国 債 証 券	2.2500	11,790	9,265	1,264,681	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国 債 証 券	4.3750	1,890	2,128	290,564	2038/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国 債 証 券	4.6250	2,790	3,215	438,850	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国 債 証 券	2.3750	9,980	8,179	1,116,447	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国 債 証 券	1.8750	13,740	9,818	1,340,158	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国 債 証 券	1.6250	7,900	7,416	1,012,269	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国 債 証 券	2.5000	4,440	3,630	495,512	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国 債 証 券	3.0000	6,430	5,783	789,456	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国 債 証 券	3.0000	5,830	5,280	720,701	2048/02/15
US T N/B 2.75 02/15/24	国 債 証 券	2.7500	3,470	3,447	470,493	2024/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国 債 証 券	2.0000	9,000	8,695	1,186,855	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国 債 証 券	2.6250	7,530	7,184	980,636	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国 債 証 券	2.7500	9,000	8,693	1,186,567	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国 債 証 券	2.2500	8,770	8,329	1,136,932	2027/02/15
US T N/B 2.125 02/29/24	国 債 証 券	2.1250	5,000	4,915	670,906	2024/02/29
US T N/B 2.5 02/28/26	国 債 証 券	2.5000	5,520	5,346	729,762	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国 債 証 券	2.7500	6,290	6,199	846,180	2025/02/28
US T N/B 2.375 02/29/24	国 債 証 券	2.3750	5,800	5,725	781,530	2024/02/29
US T N/B 1.125 02/15/31	国 債 証 券	1.1250	14,250	11,932	1,628,618	2031/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国 債 証 券	1.8750	6,540	4,958	676,805	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国 債 証 券	2.0000	8,510	6,290	858,624	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国 債 証 券	1.8750	13,520	11,926	1,627,868	2032/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国 債 証 券	1.1250	3,840	3,463	472,671	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国 債 証 券	1.5000	8,730	7,658	1,045,312	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国 債 証 券	1.8750	6,690	6,251	853,301	2027/02/28
US T N/B 0.125 02/15/24	国 債 証 券	0.1250	4,870	4,634	632,587	2024/02/15
US T N/B 1.125 02/28/25	国 債 証 券	1.1250	4,820	4,547	620,721	2025/02/28
US T N/B 1.5 02/29/24	国 債 証 券	1.5000	8,520	8,287	1,131,142	2024/02/29
US T N/B 1.125 02/29/28	国 債 証 券	1.1250	12,380	10,931	1,491,993	2028/02/29
US T N/B 1.875 02/28/29	国 債 証 券	1.8750	10,000	9,105	1,242,805	2029/02/28
US T N/B 0.5 02/28/26	国 債 証 券	0.5000	10,350	9,307	1,270,411	2026/02/28
US T N/B 1.5 02/15/25	国 債 証 券	1.5000	9,580	9,130	1,246,281	2025/02/15

銘柄	柄	当		期			未										
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
(アメリカ)					%	千	アメリカ・ドル		千	アメリカ・ドル		千円					
US T N/B 2.125 03/31/24		国	債	証	券	2.1250	10,900		10,702		1,460,775		2024/03/31				
US T N/B 2.625 03/31/25		国	債	証	券	2.6250	4,430		4,349		593,644		2025/03/31				
US T N/B 2.25 03/31/26		国	債	証	券	2.2500	7,000		6,715		916,541		2026/03/31				
US T N/B 0.625 03/31/27		国	債	証	券	0.6250	2,630		2,309		315,289		2027/03/31				
US T N/B 0.25 03/15/24		国	債	証	券	0.2500	10,000		9,508		1,297,774		2024/03/15				
US T N/B 0.5 03/31/25		国	債	証	券	0.5000	9,000		8,321		1,135,847		2025/03/31				
US T N/B 1.25 03/31/28		国	債	証	券	1.2500	6,880		6,108		833,774		2028/03/31				
US T N/B 0.75 03/31/26		国	債	証	券	0.7500	10,640		9,640		1,315,821		2026/03/31				
US T N/B 2.25 03/31/24		国	債	証	券	2.2500	2,510		2,468		336,955		2024/03/31				
US T N/B 2.5 03/31/27		国	債	証	券	2.5000	9,400		9,032		1,232,788		2027/03/31				
US T N/B 1.75 03/15/25		国	債	証	券	1.7500	6,100		5,848		798,309		2025/03/15				
US T N/B 2.875 04/30/25		国	債	証	券	2.8750	3,920		3,866		527,767		2025/04/30				
US T N/B 2.0 04/30/24		国	債	証	券	2.0000	6,860		6,714		916,424		2024/04/30				
US T N/B 2.375 04/30/26		国	債	証	券	2.3750	4,280		4,122		562,658		2026/04/30				
US T N/B 2.25 04/30/24		国	債	証	券	2.2500	5,000		4,915		670,933		2024/04/30				
US T N/B 1.25 04/30/28		国	債	証	券	1.2500	11,000		9,746		1,330,254		2028/04/30				
US T N/B 0.375 04/15/24		国	債	証	券	0.3750	7,740		7,356		1,004,147		2024/04/15				
US T N/B 0.5 04/30/27		国	債	証	券	0.5000	5,560		4,840		660,629		2027/04/30				
US T N/B 0.75 04/30/26		国	債	証	券	0.7500	8,290		7,495		1,023,081		2026/04/30				
US T N/B 0.375 04/30/25		国	債	証	券	0.3750	6,870		6,314		861,828		2025/04/30				
US T N/B 2.625 04/15/25		国	債	証	券	2.6250	2,280		2,235		305,106		2025/04/15				
US T N/B 6.25 05/15/30		国	債	証	券	6.2500	2,000		2,402		327,853		2030/05/15				
US T N/B 4.375 05/15/40		国	債	証	券	4.3750	2,770		3,092		422,058		2040/05/15				
US T N/B 4.375 05/15/41		国	債	証	券	4.3750	870		964		131,576		2041/05/15				
US T N/B 3.0 05/15/42		国	債	証	券	3.0000	3,270		2,966		404,950		2042/05/15				
US T N/B 4.25 05/15/39		国	債	証	券	4.2500	2,000		2,209		301,621		2039/05/15				
US T N/B 2.875 05/15/43		国	債	証	券	2.8750	3,820		3,368		459,761		2043/05/15				
US T N/B 2.375 05/15/51		国	債	証	券	2.3750	13,620		10,974		1,497,942		2051/05/15				
US T N/B 3.375 05/15/44		国	債	証	券	3.3750	3,580		3,418		466,531		2044/05/15				
US T N/B 3.0 05/15/45		国	債	証	券	3.0000	1,930		1,727		235,807		2045/05/15				
US T N/B 3.0 05/15/47		国	債	証	券	3.0000	2,810		2,528		345,063		2047/05/15				
US T N/B 2.5 05/15/46		国	債	証	券	2.5000	360		293		40,080		2046/05/15				
US T N/B 3.125 05/15/48		国	債	証	券	3.1250	5,440		5,059		690,530		2048/05/15				
US T N/B 1.125 05/15/40		国	債	証	券	1.1250	5,610		3,765		513,922		2040/05/15				
US T N/B 2.875 05/15/49		国	債	証	券	2.8750	4,730		4,231		577,608		2049/05/15				
US T N/B 4.5 05/15/38		国	債	証	券	4.5000	2,140		2,440		333,163		2038/05/15				
US T N/B 2.25 05/15/41		国	債	証	券	2.2500	5,460		4,401		600,729		2041/05/15				
US T N/B 2.5 05/15/24		国	債	証	券	2.5000	9,050		8,931		1,219,022		2024/05/15				
US T N/B 2.125 05/15/25		国	債	証	券	2.1250	10,000		9,659		1,318,408		2025/05/15				
US T N/B 2.875 05/15/28		国	債	証	券	2.8750	11,000		10,686		1,458,576		2028/05/15				
US T N/B 2.375 05/15/29		国	債	証	券	2.3750	9,450		8,862		1,209,619		2029/05/15				
US T N/B 2.375 05/15/27		国	債	証	券	2.3750	5,000		4,765		650,433		2027/05/15				
US T N/B 5.0 05/15/37		国	債	証	券	5.0000	1,450		1,737		237,136		2037/05/15				
US T N/B 1.625 05/15/26		国	債	証	券	1.6250	10,000		9,339		1,274,795		2026/05/15				
US T N/B 1.625 05/31/23		国	債	証	券	1.6250	5,460		5,393		736,181		2023/05/31				
US T N/B 2.0 05/31/24		国	債	証	券	2.0000	8,440		8,250		1,126,146		2024/05/31				
US T N/B 1.25 05/15/50		国	債	証	券	1.2500	9,150		5,528		754,647		2050/05/15				
US T N/B 2.125 05/31/26		国	債	証	券	2.1250	5,000		4,764		650,246		2026/05/31				
US T N/B 1.625 05/15/31		国	債	証	券	1.6250	14,320		12,467		1,701,668		2031/05/15				
US T N/B 2.75 05/31/23		国	債	証	券	2.7500	7,220		7,205		983,533		2023/05/31				
US T N/B 2.875 05/31/25		国	債	証	券	2.8750	4,550		4,489		612,732		2025/05/31				
US T N/B 0.5 05/31/27		国	債	証	券	0.5000	4,830		4,195		572,591		2027/05/31				
US T N/B 1.25 05/31/28		国	債	証	券	1.2500	10,850		9,597		1,309,916		2028/05/31				
US T N/B 0.25 05/15/24		国	債	証	券	0.2500	10,750		10,167		1,387,771		2024/05/15				
US T N/B 0.625 05/15/30		国	債	証	券	0.6250	12,420		10,104		1,379,142		2030/05/15				

銘	柄	当		期				末		
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日
(アメリカ)					%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.75 05/31/26		国	債	証	券	0.7500	7,000	6,314	861,827	2026/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25		国	債	証	券	0.2500	8,970	8,189	1,117,761	2025/05/31
US T N/B 2.0 06/30/24		国	債	証	券	2.0000	6,710	6,552	894,382	2024/06/30
US T N/B 2.75 06/30/25		国	債	証	券	2.7500	1,150	1,129	154,192	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26		国	債	証	券	1.8750	4,920	4,638	633,101	2026/06/30
US T N/B 1.75 06/30/24		国	債	証	券	1.7500	6,760	6,564	896,001	2024/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27		国	債	証	券	0.5000	5,170	4,481	611,630	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28		国	債	証	券	1.2500	10,000	8,830	1,205,270	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25		国	債	証	券	0.2500	8,990	8,186	1,117,377	2025/06/30
US T N/B 0.25 06/15/24		国	債	証	券	0.2500	11,000	10,375	1,416,115	2024/06/15
US T N/B 0.875 06/30/26		国	債	証	券	0.8750	6,250	5,655	771,921	2026/06/30
US T N/B 2.125 07/31/24		国	債	証	券	2.1250	6,170	6,033	823,524	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23		国	債	証	券	1.2500	8,400	8,236	1,124,212	2023/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25		国	債	証	券	2.8750	3,270	3,222	439,836	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26		国	債	証	券	1.8750	5,000	4,708	642,595	2026/07/31
US T N/B 1.75 07/31/24		国	債	証	券	1.7500	8,000	7,757	1,058,821	2024/07/31
US T N/B 2.75 07/31/23		国	債	証	券	2.7500	8,860	8,832	1,205,522	2023/07/31
US T N/B 0.125 07/15/23		国	債	証	券	0.1250	9,000	8,728	1,191,365	2023/07/15
US T N/B 0.125 07/31/23		国	債	証	券	0.1250	1,850	1,792	244,635	2023/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28		国	債	証	券	1.0000	10,670	9,262	1,264,292	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27		国	債	証	券	0.3750	5,000	4,296	586,427	2027/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25		国	債	証	券	0.2500	8,980	8,152	1,112,687	2025/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26		国	債	証	券	0.6250	8,000	7,149	975,775	2026/07/31
US T N/B 0.375 07/15/24		国	債	証	券	0.3750	9,000	8,489	1,158,736	2024/07/15
US T N/B 6.25 08/15/23		国	債	証	券	6.2500	2,390	2,479	338,494	2023/08/15
US T N/B 3.75 08/15/41		国	債	証	券	3.7500	3,000	3,053	416,763	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40		国	債	証	券	3.8750	2,580	2,690	367,192	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42		国	債	証	券	2.7500	3,000	2,602	355,215	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44		国	債	証	券	3.1250	3,650	3,338	455,725	2044/08/15
US T N/B 4.5 08/15/39		国	債	証	券	4.5000	2,510	2,856	389,936	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43		国	債	証	券	3.6250	4,000	3,971	542,121	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51		国	債	証	券	2.0000	15,110	11,145	1,521,315	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45		国	債	証	券	2.8750	2,400	2,102	286,936	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25		国	債	証	券	2.0000	10,000	9,589	1,308,917	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47		国	債	証	券	2.7500	4,900	4,209	574,594	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49		国	債	証	券	2.2500	7,430	5,830	795,847	2049/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23		国	債	証	券	2.5000	5,000	4,970	678,397	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24		国	債	証	券	2.3750	4,000	3,927	536,128	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46		国	債	証	券	2.2500	5,510	4,274	583,375	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48		国	債	証	券	3.0000	8,070	7,327	1,000,104	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27		国	債	証	券	2.2500	6,190	5,850	798,537	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26		国	債	証	券	1.5000	7,990	7,396	1,009,530	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28		国	債	証	券	2.8750	8,860	8,590	1,172,549	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25		国	債	証	券	2.7500	3,000	2,943	401,824	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23		国	債	証	券	1.3750	7,880	7,726	1,054,618	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29		国	債	証	券	1.6250	8,400	7,478	1,020,757	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24		国	債	証	券	1.8750	7,030	6,830	932,313	2024/08/31
US T N/B 2.75 08/31/23		国	債	証	券	2.7500	7,030	7,008	956,601	2023/08/31
US T N/B 1.75 08/15/41		国	債	証	券	1.7500	14,040	10,316	1,408,045	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40		国	債	証	券	1.1250	6,760	4,500	614,297	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50		国	債	証	券	1.3750	11,760	7,356	1,004,079	2050/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31		国	債	証	券	1.2500	17,690	14,831	2,024,414	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30		国	債	証	券	0.6250	16,280	13,156	1,795,699	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26		国	債	証	券	1.3750	4,750	4,371	596,714	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24		国	債	証	券	1.2500	5,400	5,173	706,182	2024/08/31

銘	柄	当		期				末		
		種	類	利	率	額	面	金	額	償還年月日
(アメリカ)					%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.25 08/31/25		国	債	証	券	0.2500	9,920	8,979	1,225,669	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24		国	債	証	券	0.3750	10,000	9,408	1,284,232	2024/08/15
US T N/B 0.125 08/15/23		国	債	証	券	0.1250	8,310	8,037	1,097,103	2023/08/15
US T N/B 0.125 08/31/23		国	債	証	券	0.1250	11,040	10,665	1,455,757	2023/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28		国	債	証	券	1.1250	9,870	8,616	1,176,025	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27		国	債	証	券	0.5000	9,520	8,210	1,120,668	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26		国	債	証	券	0.7500	10,000	8,966	1,223,878	2026/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25		国	債	証	券	3.0000	2,000	1,977	269,844	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24		国	債	証	券	2.1250	2,400	2,344	319,975	2024/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23		国	債	証	券	2.8750	7,810	7,788	1,063,072	2023/09/30
US T N/B 0.125 09/15/23		国	債	証	券	0.1250	6,120	5,903	805,723	2023/09/15
US T N/B 0.375 09/30/27		国	債	証	券	0.3750	7,670	6,557	895,040	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26		国	債	証	券	1.6250	3,820	3,550	484,568	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28		国	債	証	券	1.2500	10,000	8,785	1,199,192	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25		国	債	証	券	0.2500	10,000	9,026	1,232,035	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24		国	債	証	券	1.5000	6,490	6,239	851,563	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/15/24		国	債	証	券	0.3750	10,000	9,382	1,280,660	2024/09/15
US T N/B 2.25 10/31/24		国	債	証	券	2.2500	6,560	6,415	875,718	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25		国	債	証	券	3.0000	3,620	3,576	488,149	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26		国	債	証	券	1.6250	5,100	4,730	645,659	2026/10/31
US T N/B 0.125 10/15/23		国	債	証	券	0.1250	10,000	9,615	1,312,436	2023/10/15
US T N/B 1.375 10/31/28		国	債	証	券	1.3750	7,000	6,190	844,883	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24		国	債	証	券	1.5000	8,000	7,679	1,048,157	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27		国	債	証	券	0.5000	6,000	5,149	702,848	2027/10/31
US T N/B 0.625 10/15/24		国	債	証	券	0.6250	10,000	9,417	1,285,458	2024/10/15
US T N/B 0.25 10/31/25		国	債	証	券	0.2500	7,500	6,750	921,387	2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28		国	債	証	券	5.2500	1,700	1,880	256,722	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27		国	債	証	券	6.1250	3,000	3,396	463,532	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44		国	債	証	券	3.0000	40	35	4,886	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40		国	債	証	券	4.2500	3,320	3,632	495,859	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42		国	債	証	券	2.7500	4,920	4,258	581,241	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41		国	債	証	券	3.1250	80	74	10,140	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43		国	債	証	券	3.7500	4,000	4,051	553,040	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47		国	債	証	券	2.7500	4,880	4,200	573,341	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50		国	債	証	券	1.6250	8,770	5,873	801,721	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51		国	債	証	券	1.8750	11,990	8,580	1,171,131	2051/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45		国	債	証	券	3.0000	2,370	2,125	290,147	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46		国	債	証	券	2.8750	4,030	3,539	483,059	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24		国	債	証	券	2.2500	10,000	9,757	1,331,843	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39		国	債	証	券	4.3750	1,200	1,341	183,084	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48		国	債	証	券	3.3750	5,050	4,938	674,035	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49		国	債	証	券	2.3750	3,120	2,519	343,939	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25		国	債	証	券	2.2500	7,560	7,281	993,854	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28		国	債	証	券	3.1250	7,380	7,256	990,376	2028/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23		国	債	証	券	2.7500	2,500	2,487	339,545	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26		国	債	証	券	2.0000	10,580	9,968	1,360,579	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27		国	債	証	券	2.2500	8,040	7,578	1,034,451	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23		国	債	証	券	2.1250	8,000	7,886	1,076,479	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24		国	債	証	券	2.1250	6,670	6,495	886,561	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25		国	債	証	券	2.8750	4,140	4,070	555,577	2025/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23		国	債	証	券	2.8750	8,670	8,639	1,179,208	2023/11/30
US T N/B 1.375 11/15/40		国	債	証	券	1.3750	10,970	7,619	1,040,035	2040/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41		国	債	証	券	2.0000	6,400	4,913	670,643	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26		国	債	証	券	1.6250	5,310	4,922	671,848	2026/11/30
US T N/B 1.75 11/15/29		国	債	証	券	1.7500	6,900	6,192	845,174	2029/11/15

銘	柄	当			期		末	
		種	類	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)				%	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.375 11/15/31		国 債 証 券		1.3750	20,420	17,237	2,352,726	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30		国 債 証 券		0.8750	18,710	15,388	2,100,441	2030/11/15
US T N/B 0.25 11/15/23		国 債 証 券		0.2500	12,280	11,806	1,611,410	2023/11/15
US T N/B 0.5 11/30/23		国 債 証 券		0.5000	2,000	1,925	262,860	2023/11/30
US T N/B 0.625 11/30/27		国 債 証 券		0.6250	8,510	7,331	1,000,639	2027/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28		国 債 証 券		1.5000	7,000	6,230	850,407	2028/11/30
US T N/B 1.5 11/30/24		国 債 証 券		1.5000	7,100	6,802	928,423	2024/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25		国 債 証 券		0.3750	9,020	8,133	1,110,141	2025/11/30
US T N/B 0.75 11/15/24		国 債 証 券		0.7500	4,040	3,803	519,109	2024/11/15
US T N/B 2.25 12/31/23		国 債 証 券		2.2500	8,000	7,891	1,077,119	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25		国 債 証 券		2.6250	2,000	1,949	266,038	2025/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24		国 債 証 券		2.2500	7,210	7,032	959,874	2024/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26		国 債 証 券		1.7500	4,990	4,647	634,340	2026/12/31
US T N/B 0.75 12/31/23		国 債 証 券		0.7500	4,940	4,765	650,398	2023/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26		国 債 証 券		1.2500	9,100	8,280	1,130,225	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28		国 債 証 券		1.3750	6,900	6,094	831,857	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25		国 債 証 券		0.3750	8,400	7,558	1,031,595	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27		国 債 証 券		0.6250	10,160	8,740	1,192,974	2027/12/31
US T N/B 1.0 12/15/24		国 債 証 券		1.0000	9,760	9,224	1,259,082	2024/12/15
小 計		—		—	1,610,280	1,464,100	199,835,047	—
(カナダ)				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.75 02/01/24		国 債 証 券		0.7500	4,010	3,850	405,886	2024/02/01
CANADA 2.25 03/01/24		国 債 証 券		2.2500	2,400	2,359	248,735	2024/03/01
CANADA 1.25 03/01/25		国 債 証 券		1.2500	2,200	2,082	219,522	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26		国 債 証 券		0.2500	2,200	1,963	206,954	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27		国 債 証 券		1.2500	2,380	2,157	227,468	2027/03/01
CANADA 0.25 04/01/24		国 債 証 券		0.2500	2,600	2,464	259,807	2024/04/01
CANADA 1.5 04/01/25		国 債 証 券		1.5000	2,080	1,976	208,381	2025/04/01
CANADA 1.5 05/01/24		国 債 証 券		1.5000	1,000	967	101,948	2024/05/01
CANADA 1.5 06/01/26		国 債 証 券		1.5000	1,900	1,770	186,609	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29		国 債 証 券		5.7500	1,440	1,642	173,177	2029/06/01
CANADA 5.0 06/01/37		国 債 証 券		5.0000	1,190	1,391	146,646	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24		国 債 証 券		2.5000	1,090	1,073	113,153	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41		国 債 証 券		4.0000	600	640	67,526	2041/06/01
CANADA 1.5 06/01/23		国 債 証 券		1.5000	1,110	1,092	115,208	2023/06/01
CANADA 2.25 06/01/25		国 債 証 券		2.2500	1,260	1,221	128,803	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27		国 債 証 券		1.0000	1,610	1,435	151,353	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29		国 債 証 券		2.2500	1,910	1,768	186,454	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30		国 債 証 券		1.2500	5,690	4,808	506,896	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31		国 債 証 券		1.5000	7,200	6,094	642,398	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32		国 債 証 券		2.0000	1,500	1,311	138,265	2032/06/01
CANADA 0.25 08/01/23		国 債 証 券		0.2500	810	784	82,642	2023/08/01
CANADA 1.5 09/01/24		国 債 証 券		1.5000	800	769	81,098	2024/09/01
CANADA 2.0 09/01/23		国 債 証 券		2.0000	2,220	2,187	230,636	2023/09/01
CANADA 0.5 09/01/25		国 債 証 券		0.5000	3,990	3,647	384,457	2025/09/01
CANADA 1.0 09/01/26		国 債 証 券		1.0000	1,660	1,505	158,698	2026/09/01
CANADA 0.75 10/01/24		国 債 証 券		0.7500	3,250	3,067	323,329	2024/10/01
CANADA 0.5 11/01/23		国 債 証 券		0.5000	3,490	3,362	354,423	2023/11/01
CANADA 3.5 12/01/45		国 債 証 券		3.5000	1,920	1,926	203,098	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48		国 債 証 券		2.7500	1,120	988	104,166	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51		国 債 証 券		2.0000	7,720	5,722	603,220	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53		国 債 証 券		1.7500	2,650	1,816	191,456	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64		国 債 証 券		2.7500	780	666	70,307	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30		国 債 証 券		0.5000	4,500	3,514	370,453	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31		国 債 証 券		1.5000	4,310	3,621	381,716	2031/12/01
小 計		—		—	84,590	75,656	7,974,905	—

銘	柄	当		額 面 金 額	期 価 額		末
		種 類	利 率		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国 債 証 券	3.0000	3,690	2,975	281,770	2047/03/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国 債 証 券	3.2500	1,440	1,428	135,276	2025/04/21	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国 債 証 券	4.7500	2,760	2,877	272,574	2027/04/21	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国 債 証 券	2.7500	2,100	2,084	197,469	2024/04/21	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国 債 証 券	4.2500	3,170	3,232	306,109	2026/04/21	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国 債 証 券	3.2500	3,500	3,359	318,184	2029/04/21	
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国 債 証 券	4.5000	3,290	3,407	322,751	2033/04/21	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国 債 証 券	3.7500	1,830	1,740	164,830	2037/04/21	
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国 債 証 券	2.2500	2,000	1,828	173,215	2028/05/21	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国 債 証 券	2.5000	4,540	4,083	386,710	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国 債 証 券	2.7500	1,890	1,523	144,262	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国 債 証 券	1.2500	3,220	2,487	235,583	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国 債 証 券	3.2500	2,670	2,353	222,870	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国 債 証 券	1.5000	2,320	1,877	177,844	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国 債 証 券	2.7500	1,140	978	92,681	2035/06/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国 債 証 券	1.7500	810	474	44,924	2051/06/21	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国 債 証 券	0.5000	3,290	2,874	272,252	2026/09/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国 債 証 券	2.7500	950	888	84,162	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国 債 証 券	2.7500	2,120	2,007	190,143	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国 債 証 券	2.7500	2,060	1,898	179,845	2029/11/21	
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国 債 証 券	3.0000	3,000	2,697	255,433	2033/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国 債 証 券	1.7500	2,190	1,759	166,683	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国 債 証 券	1.0000	3,470	2,646	250,678	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国 債 証 券	0.2500	3,500	3,120	295,526	2025/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国 債 証 券	0.2500	4,500	4,175	395,486	2024/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国 債 証 券	1.0000	4,210	3,299	312,490	2030/12/21	
小 計	—	—	69,660	62,081	5,879,760	—	
(シンガポール)			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国 債 証 券	2.0000	750	743	73,201	2024/02/01	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国 債 証 券	3.5000	1,430	1,462	143,907	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国 債 証 券	2.7500	1,100	1,027	101,085	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国 債 証 券	1.8750	770	600	59,093	2050/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国 債 証 券	2.7500	1,160	1,090	107,328	2042/04/01	
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国 債 証 券	2.6250	1,180	1,156	113,754	2028/05/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国 債 証 券	2.3750	1,140	1,125	110,740	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国 債 証 券	2.1250	1,380	1,339	131,772	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国 債 証 券	2.8750	1,330	1,312	129,157	2029/07/01	
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国 債 証 券	2.3750	260	233	22,946	2039/07/01	
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国 債 証 券	2.7500	660	662	65,171	2023/07/01	
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国 債 証 券	1.6250	400	354	34,830	2031/07/01	
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国 債 証 券	2.2500	1,120	1,004	98,850	2036/08/01	
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国 債 証 券	3.0000	1,050	1,055	103,888	2024/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国 債 証 券	2.8750	1,200	1,179	116,001	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国 債 証 券	3.3750	1,600	1,634	160,808	2033/09/01	
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国 債 証 券	1.8750	400	317	31,215	2051/10/01	
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国 債 証 券	1.2500	830	772	76,053	2026/11/01	
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国 債 証 券	0.5000	610	564	55,516	2025/11/01	
小 計	—	—	18,370	17,637	1,735,324	—	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国 債 証 券	3.2500	3,080	3,240	541,625	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国 債 証 券	3.5000	3,530	3,866	646,178	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国 債 証 券	4.0000	2,340	3,015	503,901	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国 債 証 券	1.7500	1,300	1,030	172,247	2049/01/22	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国 債 証 券	0.8750	2,970	1,939	324,064	2046/01/31	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国 債 証 券	1.1250	1,360	1,043	174,462	2039/01/31	

銘	柄	当		額 面 金 額	期 価 額		末
		種 類	利 率		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国 債 証 券	1.0000	770	662	110,659	2032/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国 債 証 券	0.1250	5,940	5,730	957,700	2024/01/31	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国 債 証 券	0.5000	1,550	1,364	228,104	2029/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国 債 証 券	0.1250	1,790	1,579	264,037	2028/01/31	
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国 債 証 券	0.2500	960	907	151,632	2025/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国 債 証 券	0.1250	1,740	1,609	268,979	2026/01/30	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国 債 証 券	5.0000	2,270	2,424	405,101	2025/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国 債 証 券	4.2500	2,120	2,456	410,613	2036/03/07	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国 債 証 券	1.0000	2,490	2,432	406,559	2024/04/22	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国 債 証 券	4.2500	2,960	3,377	564,399	2032/06/07	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国 債 証 券	0.6250	2,110	2,010	335,961	2025/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国 債 証 券	1.5000	2,980	2,245	375,253	2047/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国 債 証 券	1.2500	1,270	870	145,530	2051/07/31	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国 債 証 券	3.7500	2,160	2,554	426,973	2052/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国 債 証 券	1.5000	670	488	81,633	2053/07/31	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国 債 証 券	1.7500	2,210	1,696	283,582	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国 債 証 券	2.5000	2,150	2,034	339,987	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国 債 証 券	3.5000	1,970	2,371	396,334	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国 債 証 券	1.5000	2,780	2,691	449,795	2026/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国 債 証 券	1.2500	2,000	1,898	317,260	2027/07/22	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国 債 証 券	0.7500	3,400	3,345	559,160	2023/07/22	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国 債 証 券	0.8750	2,560	2,112	353,064	2033/07/31	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国 債 証 券	0.2500	1,680	1,363	227,826	2031/07/31	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国 債 証 券	0.6250	2,920	2,211	369,550	2035/07/31	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国 債 証 券	4.2500	1,720	2,036	340,382	2039/09/07	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国 債 証 券	2.2500	910	908	151,897	2023/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国 債 証 券	2.7500	2,000	2,015	336,847	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国 債 証 券	2.0000	1,800	1,780	297,585	2025/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国 債 証 券	1.7500	3,760	3,236	540,906	2037/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国 債 証 券	1.6250	2,120	1,587	265,327	2054/10/22	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国 債 証 券	0.5000	1,810	846	141,448	2061/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国 債 証 券	1.6250	2,440	1,746	291,855	2071/10/22	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	国 債 証 券	1.1250	710	411	68,700	2073/10/22	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国 債 証 券	1.2500	2,590	1,961	327,790	2041/10/22	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国 債 証 券	0.6250	1,430	818	136,843	2050/10/22	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国 債 証 券	1.6250	1,320	1,263	211,175	2028/10/22	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国 債 証 券	0.8750	3,120	2,794	467,067	2029/10/22	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国 債 証 券	0.3750	2,240	1,886	315,201	2030/10/22	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	国 債 証 券	0.3750	3,340	3,065	512,285	2026/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国 債 証 券	6.0000	1,450	1,759	294,124	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国 債 証 券	4.7500	2,060	2,567	429,002	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国 債 証 券	4.5000	3,010	3,743	625,670	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国 債 証 券	4.2500	2,060	2,542	424,946	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国 債 証 券	4.2500	3,170	4,153	694,115	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国 債 証 券	4.2500	3,000	3,284	548,825	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国 債 証 券	4.2500	1,190	1,418	236,985	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国 債 証 券	4.7500	2,500	2,932	490,102	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国 債 証 券	4.2500	2,280	2,866	478,991	2049/12/07	
小 計	—	—	120,060	116,205	19,420,263	—	
(イスラエル)			%	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国 債 証 券	5.5000	2,330	2,983	117,847	2042/01/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国 債 証 券	0.5000	3,170	2,913	115,095	2026/02/27	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国 債 証 券	3.7500	5,110	5,183	204,773	2047/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国 債 証 券	2.0000	360	346	13,683	2027/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国 債 証 券	3.7500	3,360	3,439	135,861	2024/03/31	

銘	柄	当		期			末																					
		種	類	利	率	額		面	金	額	評	価	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月
(イスラエル)					%	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	千円																				
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30		国	債	証	券	1.0000	2,810	2,424	95,761	2030/03/31																		
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32		国	債	証	券	1.3000	2,690	2,283	90,207	2032/04/30																		
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25		国	債	証	券	0.5000	4,380	4,121	162,826	2025/04/30																		
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37		国	債	証	券	1.5000	1,370	1,071	42,311	2037/05/31																		
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25		国	債	証	券	1.7500	2,330	2,260	89,290	2025/08/31																		
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28		国	債	証	券	2.2500	1,620	1,557	61,517	2028/09/28																		
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26		国	債	証	券	6.2500	3,700	4,208	166,254	2026/10/30																		
ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24		国	債	証	券	0.4000	5,490	5,209	205,803	2024/10/31																		
ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23		国	債	証	券	1.5000	1,630	1,618	63,934	2023/11/30																		
小	計	—	—	—	—	—	40,350	39,620	1,565,167	—																		
(デンマーク)					%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円																				
DENMARK 0.25 11/15/52		国	債	証	券	0.2500	7,060	3,939	75,991	2052/11/15																		
DENMARK 4.5 11/15/39		国	債	証	券	4.5000	18,120	23,727	457,700	2039/11/15																		
DENMARK 1.75 11/15/25		国	債	証	券	1.7500	6,330	6,353	122,566	2025/11/15																		
DENMARK 1.5 11/15/23		国	債	証	券	1.5000	3,600	3,626	69,962	2023/11/15																		
DENMARK 0.5 11/15/27		国	債	証	券	0.5000	5,450	5,062	97,656	2027/11/15																		
DENMARK 0.5 11/15/29		国	債	証	券	0.5000	18,520	16,608	320,371	2029/11/15																		
DENMARK 0.0 11/15/31		国	債	証	券	0.0000	8,860	7,278	140,410	2031/11/15																		
DENMARK 0.0 11/15/24		国	債	証	券	0.0000	11,030	10,655	205,543	2024/11/15																		
小	計	—	—	—	—	—	78,970	77,252	1,490,202	—																		
(ノルウェー)					%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円																				
NORWAY 1.5 02/19/26		国	債	証	券	1.5000	4,220	3,975	54,905	2026/02/19																		
NORWAY 1.75 02/17/27		国	債	証	券	1.7500	9,840	9,219	127,328	2027/02/17																		
NORWAY 3.0 03/14/24		国	債	証	券	3.0000	12,770	12,800	176,774	2024/03/14																		
NORWAY 1.75 03/13/25		国	債	証	券	1.7500	1,250	1,205	16,643	2025/03/13																		
NORWAY 2.0 04/26/28		国	債	証	券	2.0000	13,360	12,553	173,357	2028/04/26																		
NORWAY 2.125 05/18/32		国	債	証	券	2.1250	5,560	4,992	68,943	2032/05/18																		
NORWAY 1.375 08/19/30		国	債	証	券	1.3750	8,130	7,017	96,915	2030/08/19																		
NORWAY 1.75 09/06/29		国	債	証	券	1.7500	5,720	5,157	71,231	2029/09/06																		
NORWAY 1.25 09/17/31		国	債	証	券	1.2500	2,450	2,048	28,294	2031/09/17																		
小	計	—	—	—	—	—	63,300	58,971	814,395	—																		
(スウェーデン)					%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円																				
SWEDEN 3.5 03/30/39		国	債	証	券	3.5000	6,290	7,714	103,684	2039/03/30																		
SWEDEN 0.75 05/12/28		国	債	証	券	0.7500	12,680	11,752	157,947	2028/05/12																		
SWEDEN 2.5 05/12/25		国	債	証	券	2.5000	16,220	16,349	219,743	2025/05/12																		
SWEDEN 0.125 05/12/31		国	債	証	券	0.1250	6,650	5,687	76,436	2031/05/12																		
SWEDEN 2.25 06/01/32		国	債	証	券	2.2500	7,530	7,796	104,783	2032/06/01																		
SWEDEN 1.5 11/13/23		国	債	証	券	1.5000	5,230	5,205	69,961	2023/11/13																		
SWEDEN 1.0 11/12/26		国	債	証	券	1.0000	21,800	20,773	279,197	2026/11/12																		
SWEDEN 0.75 11/12/29		国	債	証	券	0.7500	4,810	4,402	59,172	2029/11/12																		
小	計	—	—	—	—	—	81,210	79,682	1,070,927	—																		
(メキシコ)					%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円																				
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26		国	債	証	券	5.7500	63,554	56,014	378,924	2026/03/05																		
MEXICAN BONDS 03/04/27		国	債	証	券	5.5000	20,000	17,032	115,219	2027/03/04																		
MEXICAN BONDS 03/06/25		国	債	証	券	5.0000	19,510	17,383	117,593	2025/03/06																		
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29		国	債	証	券	8.5000	47,501	45,711	309,223	2029/05/31																		
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31		国	債	証	券	7.7500	63,290	57,776	390,840	2031/05/29																		
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27		国	債	証	券	7.5000	54,445	50,476	341,458	2027/06/03																		
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24		国	債	証	券	8.0000	38,590	37,354	252,693	2024/09/05																		
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42		国	債	証	券	7.7500	24,328	21,114	142,833	2042/11/13																		
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47		国	債	証	券	8.0000	37,956	33,559	227,019	2047/11/07																		
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38		国	債	証	券	8.5000	41,653	39,190	265,108	2038/11/18																		
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34		国	債	証	券	7.7500	16,011	14,312	96,819	2034/11/23																		
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24		国	債	証	券	10.0000	55,000	55,429	374,962	2024/12/05																		
小	計	—	—	—	—	—	481,838	445,355	3,012,696	—																		

銘	柄	当		期			末																							
		種	類	利	率	額	面	金	額	外	貨	建	金	額	邦	貨	換	算	金	額	償	還	年	月	日					
(中国)					%	千	オ	フ	シ	ョ	ア	・	人	民	元	千	オ	フ	シ	ョ	ア	・	人	民	元	千	円			
CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	国	債	証	券	2.3700	25,000	24,759	504,326	2027/01/20																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国	債	証	券	2.7500	17,000	16,888	343,999	2032/02/17																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国	債	証	券	2.2600	52,000	51,861	1,056,381	2025/02/24																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国	債	証	券	2.8000	18,000	18,012	366,896	2029/03/24																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国	債	証	券	2.2800	25,000	25,008	509,395	2024/03/17																					
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国	債	証	券	3.7200	12,950	13,855	282,223	2051/04/12																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国	債	証	券	2.4800	10,000	9,950	202,679	2027/04/15																					
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国	債	証	券	3.0200	21,500	21,773	443,504	2031/05/27																					
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国	債	証	券	3.0100	22,000	22,404	456,361	2028/05/13																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国	債	証	券	2.6800	23,500	23,253	473,660	2030/05/21																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国	債	証	券	2.6900	56,500	56,740	1,155,762	2026/08/12																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国	債	証	券	2.4700	34,000	34,124	695,077	2024/09/02																					
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国	債	証	券	3.5300	24,400	25,349	516,337	2051/10/18																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国	債	証	券	2.9100	15,500	15,697	319,748	2028/10/14																					
CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	国	債	証	券	2.5600	18,600	18,699	380,897	2023/10/21																					
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国	債	証	券	3.2800	23,500	24,353	496,050	2027/12/03																					
小計	—	—	—	—	—	399,450	402,732	8,203,301	—																					
(マレーシア)					%	千	マ	レ	ー	シ	ア	・	リ	ン	ギ	ット	千	マ	レ	ー	シ	ア	・	リ	ン	ギ	ット	千	円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国	債	証	券	3.8920	1,370	1,362	42,255	2027/03/15																					
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国	債	証	券	4.7360	1,480	1,439	44,652	2046/03/15																					
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国	債	証	券	4.3920	2,030	2,067	64,131	2026/04/15																					
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国	債	証	券	4.4980	3,050	3,085	95,732	2030/04/15																					
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国	債	証	券	3.8440	3,510	3,302	102,459	2033/04/15																					
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国	債	証	券	4.7620	3,640	3,655	113,417	2037/04/07																					
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国	債	証	券	2.6320	2,090	1,829	56,746	2031/04/15																					
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国	債	証	券	3.5020	200	195	6,051	2027/05/31																					
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国	債	証	券	3.7570	3,750	3,287	102,002	2040/05/22																					
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国	債	証	券	4.2540	1,370	1,318	40,911	2035/05/31																					
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国	債	証	券	3.7330	5,090	4,951	153,619	2028/06/15																					
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国	債	証	券	4.2320	4,200	4,156	128,951	2031/06/30																					
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国	債	証	券	4.8930	1,030	1,048	32,523	2038/06/08																					
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国	債	証	券	3.4780	1,830	1,832	56,845	2024/06/14																					
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国	債	証	券	4.0650	4,520	3,877	120,303	2050/06/15																					
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国	債	証	券	4.1810	3,500	3,558	110,389	2024/07/15																					
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国	債	証	券	4.9210	2,400	2,381	73,880	2048/07/06																					
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国	債	証	券	3.9060	1,810	1,808	56,094	2026/07/15																					
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国	債	証	券	3.8280	1,860	1,712	53,117	2034/07/05																					
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国	債	証	券	3.8850	3,910	3,808	118,153	2029/08/15																					
MALAYSIA 3.8 08/17/23	国	債	証	券	3.8000	1,070	1,082	33,584	2023/08/17																					
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国	債	証	券	3.9550	4,750	4,783	148,399	2025/09/15																					
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国	債	証	券	4.9350	580	583	18,101	2043/09/30																					
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国	債	証	券	4.0590	1,920	1,944	60,319	2024/09/30																					
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国	債	証	券	4.6960	920	904	28,047	2042/10/15																					
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国	債	証	券	3.9000	3,090	3,078	95,511	2026/11/30																					
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国	債	証	券	3.8990	2,000	1,978	61,374	2027/11/16																					
小計	—	—	—	—	—	66,970	65,034	2,017,579	—																					
(ポーランド)					%	千	ポ	ー	ラ	ン	ド	・	ズ	ロ	チ	千	ポ	ー	ラ	ン	ド	・	ズ	ロ	チ	千	円			
POLAND 2.75 04/25/28	国	債	証	券	2.7500	11,010	8,483	262,562	2028/04/25																					
POLAND 1.75 04/25/32	国	債	証	券	1.7500	2,200	1,282	39,688	2032/04/25																					
POLAND 2.5 04/25/24	国	債	証	券	2.5000	7,510	6,832	211,451	2024/04/25																					
POLAND 0.75 04/25/25	国	債	証	券	0.7500	8,370	6,932	214,564	2025/04/25																					
POLAND 2.5 07/25/26	国	債	証	券	2.5000	9,000	7,309	226,215	2026/07/25																					
POLAND 3.25 07/25/25	国	債	証	券	3.2500	2,440	2,133	66,030	2025/07/25																					
POLAND 2.5 07/25/27	国	債	証	券	2.5000	6,690	5,193	160,720	2027/07/25																					
POLAND 07/25/24	国	債	証	券	0.0000	2,220	1,892	58,555	2024/07/25																					

銘	柄	当			期		末										
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
(ポーランド)																	
POLAND 4.0 10/25/23		国	債	証	券	4.0000	1,070	1,023	31,673	千ポーランド・ズロチ	千円						
POLAND 2.75 10/25/29		国	債	証	券	2.7500	4,360	3,190	98,746								
POLAND 2.25 10/25/24		国	債	証	券	2.2500	4,690	4,149	128,414								
POLAND 1.25 10/25/30		国	債	証	券	1.2500	6,690	4,138	128,089								
POLAND 0.25 10/25/26		国	債	証	券	0.2500	1,100	797	24,695								
小計		—		—		67,350		53,359		1,651,407		—					
(ユーロ…アイルランド)																	
IRISH 2.0 02/18/45		国	債	証	券	2.0000	2,460	2,172	311,611	千ユーロ	千円						
IRISH 1.35 03/18/31		国	債	証	券	1.3500	1,420	1,323	189,871								
IRISH 3.4 03/18/24		国	債	証	券	3.4000	60	62	8,955								
IRISH 5.4 03/13/25		国	債	証	券	5.4000	1,170	1,295	185,832								
IRISH 0.55 04/22/41		国	債	証	券	0.5500	50	34	4,916								
IRISH 1.5 05/15/50		国	債	証	券	1.5000	80	60	8,639								
IRISH 1.3 05/15/33		国	債	証	券	1.3000	70	62	8,943								
IRISH 2.4 05/15/30		国	債	証	券	2.4000	2,610	2,675	383,898								
IRISH 0.9 05/15/28		国	債	証	券	0.9000	100	94	13,498								
IRISH 1.1 05/15/29		国	債	証	券	1.1000	420	394	56,584								
IRISH 1.0 05/15/26		国	債	証	券	1.0000	4,980	4,869	698,510								
IRISH 1.7 05/15/37		国	債	証	券	1.7000	130	116	16,735								
IRISH 0.4 05/15/35		国	債	証	券	0.4000	3,670	2,818	404,366								
IRISH 0.0 10/18/31		国	債	証	券	0.0000	930	750	107,645								
IRISH 0.2 10/18/30		国	債	証	券	0.2000	1,660	1,408	202,014								
小計		—		—		19,810		18,137		2,602,024		—					
(ユーロ…オランダ)																	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42		国	債	証	券	3.7500	2,410	2,958	424,380	千ユーロ	千円						
NETHERLANDS 2.75 01/15/47		国	債	証	券	2.7500	3,480	3,840	550,972								
NETHERLANDS 0.0 01/15/52		国	債	証	券	0.0000	2,240	1,177	168,957								
NETHERLANDS 5.5 01/15/28		国	債	証	券	5.5000	980	1,171	168,062								
NETHERLANDS 4.0 01/15/37		国	債	証	券	4.0000	3,260	3,985	571,738								
NETHERLANDS 2.5 01/15/33		国	債	証	券	2.5000	1,620	1,683	241,538								
NETHERLANDS 0.0 01/15/38		国	債	証	券	0.0000	1,660	1,173	168,357								
NETHERLANDS 0.5 01/15/40		国	債	証	券	0.5000	1,450	1,082	155,302								
NETHERLANDS 01/15/24		国	債	証	券	0.0000	4,330	4,263	611,643								
NETHERLANDS 0.0 01/15/29		国	債	証	券	0.0000	990	875	125,575								
NETHERLANDS 0.0 01/15/27		国	債	証	券	0.0000	2,860	2,647	379,846								
NETHERLANDS 1.75 07/15/23		国	債	証	券	1.7500	680	687	98,629								
NETHERLANDS 0.5 07/15/26		国	債	証	券	0.5000	2,000	1,914	274,625								
NETHERLANDS 2.0 07/15/24		国	債	証	券	2.0000	3,960	4,024	577,379								
NETHERLANDS 0.25 07/15/25		国	債	証	券	0.2500	3,770	3,633	521,314								
NETHERLANDS 0.75 07/15/28		国	債	証	券	0.7500	4,460	4,191	601,323								
NETHERLANDS 0.75 07/15/27		国	債	証	券	0.7500	2,330	2,219	318,354								
NETHERLANDS 0.25 07/15/29		国	債	証	券	0.2500	1,110	991	142,186								
NETHERLANDS 0.0 07/15/30		国	債	証	券	0.0000	3,640	3,123	448,053								
NETHERLANDS 0.0 07/15/31		国	債	証	券	0.0000	980	821	117,841								
小計		—		—		48,210		46,466		6,666,083		—					
(ユーロ…ベルギー)																	
BELGIUM 5.5 03/28/28		国	債	証	券	5.5000	2,140	2,571	368,924	千ユーロ	千円						
BELGIUM 4.25 03/28/41		国	債	証	券	4.2500	1,860	2,243	321,855								
BELGIUM 4.5 03/28/26		国	債	証	券	4.5000	2,200	2,435	349,342								
BELGIUM 4.0 03/28/32		国	債	証	券	4.0000	1,950	2,240	321,455								
BELGIUM 5.0 03/28/35		国	債	証	券	5.0000	3,430	4,355	624,783								
BELGIUM 1.25 04/22/33		国	債	証	券	1.2500	2,400	2,152	308,765								
BELGIUM 3.75 06/22/45		国	債	証	券	3.7500	2,240	2,576	369,591								
BELGIUM 1.6 06/22/47		国	債	証	券	1.6000	630	486	69,850								
BELGIUM 1.7 06/22/50		国	債	証	券	1.7000	2,650	2,046	293,623								

銘	柄	当		期			末
		種	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ベルギー)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国 債 証 券	1.4000	160	110	15,850	2053/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国 債 証 券	2.2500	870	750	107,665	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国 債 証 券	2.1500	740	608	87,348	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71	国 債 証 券	0.6500	1,040	443	63,613	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国 債 証 券	1.0000	3,000	2,923	419,426	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国 債 証 券	2.6000	850	873	125,321	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国 債 証 券	1.0000	2,110	1,899	272,503	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国 債 証 券	0.8000	2,000	1,879	269,676	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国 債 証 券	0.4000	1,120	747	107,167	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国 債 証 券	0.9000	2,400	2,225	319,201	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国 債 証 券	3.0000	1,540	1,618	232,211	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国 債 証 券	1.9000	2,120	1,908	273,850	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国 債 証 券	0.8000	2,750	2,692	386,277	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国 債 証 券	0.8000	3,830	3,643	522,759	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国 債 証 券	1.4500	310	263	37,858	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国 債 証 券	0.1000	3,100	2,638	378,550	2030/06/22	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国 債 証 券	0.5000	5,100	5,006	718,222	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国 債 証 券	0.0000	3,190	2,582	370,416	2031/10/22	
BELGIUM 0.2 10/22/23	国 債 証 券	0.2000	70	69	9,963	2023/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国 債 証 券	0.0000	800	725	104,122	2027/10/22	
小 計	—	—	56,600	54,720	7,850,197	—	
(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	1,640	1,506	216,186	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国 債 証 券	0.0000	8,050	7,582	1,087,723	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国 債 証 券	0.0000	5,000	4,922	706,180	2024/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国 債 証 券	0.0000	3,500	3,364	482,607	2025/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国 債 証 券	0.0000	2,000	1,964	281,792	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国 債 証 券	0.0000	2,310	2,217	318,190	2025/03/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国 債 証 券	3.5000	6,430	6,871	985,819	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国 債 証 券	4.5000	5,040	6,349	910,913	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国 債 証 券	4.0000	4,040	5,018	719,952	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国 債 証 券	4.0000	3,110	3,930	563,835	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国 債 証 券	5.5000	4,460	5,457	782,953	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国 債 証 券	4.7500	4,900	6,120	878,100	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国 債 証 券	3.2500	4,690	5,095	731,033	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国 債 証 券	2.0000	4,280	3,697	530,431	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国 債 証 券	1.5000	5,420	4,111	589,786	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国 債 証 券	0.7500	3,610	2,133	306,023	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国 債 証 券	0.7500	1,420	817	117,237	2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国 債 証 券	1.7500	1,930	1,425	204,499	2066/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国 債 証 券	0.5000	1,510	603	86,532	2072/05/25	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国 債 証 券	2.2500	6,880	7,021	1,007,373	2024/05/25	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国 債 証 券	2.5000	8,620	8,905	1,277,614	2030/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国 債 証 券	0.7500	5,900	5,515	791,273	2028/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国 債 証 券	1.5000	8,910	8,427	1,209,061	2031/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国 債 証 券	0.5000	7,760	7,537	1,081,263	2025/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国 債 証 券	0.5000	13,600	12,293	1,763,672	2029/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国 債 証 券	1.2500	3,300	2,884	413,790	2034/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国 債 証 券	0.5000	6,220	5,940	852,176	2026/05/25	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国 債 証 券	1.0000	8,000	7,690	1,103,234	2027/05/25	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国 債 証 券	0.5000	2,270	1,572	225,529	2040/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国 債 証 券	1.2500	5,240	4,447	637,993	2036/05/25	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国 債 証 券	1.2500	1,160	955	137,008	2038/05/25	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国 債 証 券	0.0000	1,200	954	136,895	2032/05/25	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国 債 証 券	1.7500	5,750	5,102	731,987	2039/06/25	

銘	柄	当			期			末
		種	類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フランス)				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44		国	債 証 券	0.5000	2,880	1,831	262,723	2044/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23		国	債 証 券	4.2500	8,000	8,373	1,201,259	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25		国	債 証 券	6.0000	6,320	7,234	1,037,895	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27		国	債 証 券	2.7500	6,390	6,677	957,972	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38		国	債 証 券	4.0000	3,530	4,198	602,324	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32		国	債 証 券	5.7500	7,690	10,104	1,449,629	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24		国	債 証 券	1.7500	6,990	7,056	1,012,363	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25		国	債 証 券	1.0000	6,200	6,077	871,870	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26		国	債 証 券	0.2500	7,530	7,045	1,010,697	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28		国	債 証 券	0.7500	9,010	8,342	1,196,767	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31		国	債 証 券	0.0000	7,570	6,133	879,915	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30		国	債 証 券	0.0000	9,180	7,656	1,098,465	2030/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29		国	債 証 券	0.0000	6,760	5,809	833,491	2029/11/25
小 計		—	—	—	246,200	238,979	34,284,051	—
(ユーロ…ドイツ)				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24		国	債 証 券	6.2500	1,180	1,279	183,500	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28		国	債 証 券	5.6250	2,200	2,669	383,023	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30		国	債 証 券	6.2500	2,930	3,880	556,686	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31		国	債 証 券	5.5000	3,340	4,345	623,358	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37		国	債 証 券	4.0000	4,600	5,788	830,362	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25		国	債 証 券	0.5000	4,330	4,244	608,975	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26		国	債 証 券	0.5000	6,490	6,283	901,373	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29		国	債 証 券	0.2500	5,540	5,068	727,062	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28		国	債 証 券	0.5000	4,470	4,207	603,630	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24		国	債 証 券	1.7500	3,000	3,041	436,264	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27		国	債 証 券	0.2500	4,650	4,390	629,918	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31		国	債 証 券	0.0000	3,300	2,853	409,378	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32		国	債 証 券	0.0000	5,210	4,400	631,306	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30		国	債 証 券	0.0000	3,490	3,077	441,540	2030/02/15
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24		国	債 証 券	0.0000	1,930	1,898	272,334	2024/03/15
BUNDESUBL 04/05/24		国	債 証 券	0.0000	3,490	3,429	492,032	2024/04/05
BUNDESUBL 0.0 04/11/25		国	債 証 券	0.0000	4,620	4,457	639,440	2025/04/11
BUNDESUBL 0.0 04/10/26		国	債 証 券	0.0000	3,100	2,937	421,409	2026/04/10
BUNDESUBL 0.0 04/16/27		国	債 証 券	0.0000	2,000	1,857	266,476	2027/04/16
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24		国	債 証 券	1.5000	4,280	4,316	619,307	2024/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35		国	債 証 券	0.0000	90	70	10,071	2035/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36		国	債 証 券	0.0000	4,350	3,320	476,338	2036/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27		国	債 証 券	6.5000	1,670	2,066	296,449	2027/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28		国	債 証 券	4.7500	2,000	2,361	338,843	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39		国	債 証 券	4.2500	1,990	2,638	378,533	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42		国	債 証 券	3.2500	2,740	3,322	476,680	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44		国	債 証 券	2.5000	4,840	5,325	764,003	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40		国	債 証 券	4.7500	2,810	3,976	570,487	2040/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34		国	債 証 券	4.7500	3,150	4,132	592,900	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46		国	債 証 券	2.5000	4,590	5,110	733,165	2046/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52		国	債 証 券	0.0000	1,950	1,084	155,623	2052/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48		国	債 証 券	1.2500	5,220	4,494	644,829	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25		国	債 証 券	1.0000	6,640	6,568	942,362	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27		国	債 証 券	0.5000	5,000	4,738	679,791	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26		国	債 証 券	0.0000	3,680	3,466	497,310	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28		国	債 証 券	0.2500	3,500	3,222	462,362	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23		国	債 証 券	2.0000	3,730	3,788	543,540	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24		国	債 証 券	1.0000	6,600	6,578	943,715	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29		国	債 証 券	0.0000	3,930	3,499	502,093	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50		国	債 証 券	0.0000	3,660	2,131	305,716	2050/08/15

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国 債 証 券	0.0000	5,610	4,795	687,960	2031/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国 債 証 券	0.0000	2,370	1,383	198,481	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国 債 証 券	0.0000	5,000	4,368	626,748	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国 債 証 券	0.0000	820	717	102,906	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国 債 証 券	0.0000	1,000	856	122,883	2031/08/15
BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	国 債 証 券	0.0000	3,000	2,974	426,765	2023/09/15
BUNDESobl 10/13/23	国 債 証 券	0.0000	3,940	3,905	560,275	2023/10/13
BUNDESobl 0.0 10/09/26	国 債 証 券	0.0000	3,720	3,489	500,610	2026/10/09
BUNDESobl 0.0 10/10/25	国 債 証 券	0.0000	2,000	1,916	274,918	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国 債 証 券	0.0000	4,500	4,135	593,259	2027/11/15
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国 債 証 券	0.0000	3,000	2,710	388,833	2028/11/15
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	国 債 証 券	0.0000	2,080	2,057	295,132	2023/12/15
小 計	—	—	183,330	179,638	25,770,977	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国 債 証 券	6.0000	1,140	1,394	200,121	2029/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国 債 証 券	4.2000	3,360	3,817	547,647	2037/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国 債 証 券	0.0000	3,650	3,491	500,903	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/27	国 債 証 券	0.0000	2,000	1,810	259,791	2027/01/31
SPAIN 0.0 01/31/28	国 債 証 券	0.0000	3,000	2,639	378,605	2028/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国 債 証 券	0.0000	3,690	3,434	492,711	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国 債 証 券	1.6000	3,790	3,775	541,590	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国 債 証 券	3.8000	4,220	4,407	632,351	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国 債 証 券	1.5000	4,340	4,210	604,031	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国 債 証 券	1.9500	2,770	2,765	396,764	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国 債 証 券	1.4000	3,530	3,357	481,718	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国 債 証 券	1.4500	3,930	3,691	529,638	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国 債 証 券	0.7000	5,090	4,162	597,166	2032/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国 債 証 券	0.5000	4,540	3,892	558,444	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国 債 証 券	0.1000	2,890	2,296	329,399	2031/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国 債 証 券	0.0000	2,740	2,668	382,798	2024/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国 債 証 券	0.0000	2,000	1,894	271,790	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国 債 証 券	5.9000	3,100	3,574	512,854	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国 債 証 券	4.9000	3,210	3,985	571,718	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国 債 証 券	4.7000	2,890	3,532	506,716	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国 債 証 券	3.4500	2,460	2,401	344,575	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国 債 証 券	4.6500	1,250	1,356	194,587	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国 債 証 券	1.9500	3,660	3,495	501,528	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国 債 証 券	5.7500	4,810	6,076	871,765	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国 債 証 券	2.3500	470	448	64,392	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国 債 証 券	1.4000	5,000	4,733	679,032	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国 債 証 券	1.8500	3,850	3,363	482,551	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国 債 証 券	0.2500	3,060	2,982	427,835	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国 債 証 券	0.3500	270	268	38,532	2023/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国 債 証 券	0.8500	1,810	1,309	187,841	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国 債 証 券	1.0000	1,180	797	114,469	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国 債 証 券	0.8000	4,500	4,192	601,477	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国 債 証 券	0.8000	1,000	890	127,693	2029/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国 債 証 券	2.7500	3,100	3,189	457,561	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国 債 証 券	5.1500	3,520	4,089	586,710	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国 債 証 券	5.1500	1,220	1,598	229,269	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国 債 証 券	2.9000	3,480	3,267	468,747	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国 債 証 券	2.7000	1,650	1,476	211,861	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国 債 証 券	1.9000	780	553	79,348	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国 債 証 券	1.4500	1,900	984	141,285	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国 債 証 券	1.0000	3,270	1,881	269,891	2050/10/31

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	
(ユーロ…スペイン)				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 2.15 10/31/25		国	債 証 券	2.1500	4,460	4,502	645,968	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27		国	債 証 券	1.4500	5,000	4,799	688,584	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26		国	債 証 券	1.3000	3,540	3,430	492,185	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29		国	債 証 券	0.6000	2,530	2,215	317,774	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23		国	債 証 券	4.4000	6,420	6,702	961,543	2023/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31		国	債 証 券	0.5000	3,000	2,445	350,829	2031/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40		国	債 証 券	1.2000	1,580	1,140	163,612	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30		国	債 証 券	1.2500	4,770	4,287	615,121	2030/10/31
小 計		—		—	149,420	143,687	20,613,341	—
(ユーロ…イタリア)				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27		国	債 証 券	0.8500	3,000	2,755	395,304	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24		国	債 証 券	0.0000	1,850	1,806	259,222	2024/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/30/24		国	債 証 券	0.0000	3,000	2,926	419,835	2024/01/30
ITALY BTPS 5.75 02/01/33		国	債 証 券	5.7500	2,890	3,399	487,734	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37		国	債 証 券	4.0000	6,440	6,638	952,430	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28		国	債 証 券	2.0000	4,200	3,999	573,802	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25		国	債 証 券	0.3500	2,810	2,685	385,289	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26		国	債 証 券	0.5000	4,100	3,814	547,283	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29		国	債 証 券	0.4500	5,000	4,175	598,945	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47		国	債 証 券	2.7000	2,650	2,194	314,779	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48		国	債 証 券	3.4500	2,180	2,045	293,402	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24		国	債 証 券	4.5000	5,190	5,446	781,354	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67		国	債 証 券	2.8000	1,440	1,113	159,812	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72		国	債 証 券	2.1500	1,380	883	126,743	2072/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25		国	債 証 券	5.0000	1,620	1,741	249,907	2025/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26		国	債 証 券	4.5000	3,220	3,450	494,969	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32		国	債 証 券	1.6500	30	25	3,628	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40		国	債 証 券	3.1000	2,770	2,516	361,059	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35		国	債 証 券	3.3500	3,000	2,880	413,246	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30		国	債 証 券	3.5000	3,860	3,922	562,694	2030/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36		国	債 証 券	1.4500	2,050	1,551	222,598	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41		国	債 証 券	1.8000	3,570	2,613	374,946	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37		国	債 証 券	0.9500	2,210	1,518	217,811	2037/03/01
ITALY BTPS 0.25 03/15/28		国	債 証 券	0.2500	4,610	3,934	564,396	2028/03/15
ITALY BTPS 1.5 04/30/45		国	債 証 券	1.5000	2,130	1,394	200,025	2045/04/30
ITALY BTPS 1.35 04/01/30		国	債 証 券	1.3500	4,000	3,454	495,532	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31		国	債 証 券	0.9000	3,770	3,026	434,159	2031/04/01
ITALY BTPS 0.0 04/01/26		国	債 証 券	0.0000	3,420	3,097	444,366	2026/04/01
ITALY BTPS 1.1 04/01/27		国	債 証 券	1.1000	2,000	1,840	264,023	2027/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31		国	債 証 券	6.0000	4,300	5,118	734,269	2031/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24		国	債 証 券	1.8500	2,800	2,805	402,463	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25		国	債 証 券	1.4500	5,490	5,362	769,323	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26		国	債 証 券	1.6000	3,790	3,654	524,302	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25		国	債 証 券	1.5000	5,910	5,780	829,280	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27		国	債 証 券	2.2000	2,060	2,001	287,075	2027/06/01
ITALY BTPS 0.95 06/01/32		国	債 証 券	0.9500	3,250	2,523	362,039	2032/06/01
ITALY BTPS 0.6 06/15/23		国	債 証 券	0.6000	3,500	3,492	501,100	2023/06/15
ITALY BTPS 2.1 07/15/26		国	債 証 券	2.1000	3,540	3,466	497,343	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24		国	債 証 券	1.7500	1,000	998	143,226	2024/07/01
ITALY BTPS 0.5 07/15/28		国	債 証 券	0.5000	1,500	1,290	185,192	2028/07/15
ITALY BTPS 1.85 07/01/25		国	債 証 券	1.8500	3,250	3,201	459,344	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34		国	債 証 券	5.0000	690	773	110,984	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39		国	債 証 券	5.0000	4,170	4,800	688,740	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23		国	債 証 券	4.7500	5,830	6,064	869,993	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27		国	債 証 券	2.0500	3,000	2,882	413,507	2027/08/01

銘	柄	当			期			末							
		種	類	利	率	額	面		金	額					
											外	貨	建	金	額
(ユーロ…イタリア)					%		千	ユーロ		千	ユーロ		千	円	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国	債	証	券	3.0000	4,790	4,716	676,666	2029/08/01						
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国	債	証	券	0.6000	3,000	2,310	331,509	2031/08/01						
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国	債	証	券	0.9500	4,750	3,917	561,979	2030/08/01						
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国	債	証	券	0.3000	3,710	3,681	528,090	2023/08/15						
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国	債	証	券	0.0000	1,000	960	137,778	2024/08/15						
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国	債	証	券	0.0000	2,000	1,793	257,223	2026/08/01						
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国	債	証	券	2.9500	2,240	2,022	290,211	2038/09/01						
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国	債	証	券	4.7500	2,810	3,192	458,053	2044/09/01						
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国	債	証	券	3.2500	1,940	1,774	254,501	2046/09/01						
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国	債	証	券	4.7500	5,480	5,988	859,101	2028/09/01						
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国	債	証	券	5.0000	2,950	3,408	488,931	2040/09/01						
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国	債	証	券	2.4500	1,770	1,346	193,160	2050/09/01						
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国	債	証	券	1.7000	3,660	2,312	331,739	2051/09/01						
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国	債	証	券	2.4500	2,960	2,621	376,064	2033/09/01						
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国	債	証	券	2.1500	1,180	811	116,415	2052/09/01						
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国	債	証	券	3.7500	2,000	2,078	298,168	2024/09/01						
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国	債	証	券	3.8500	1,800	1,793	257,324	2049/09/01						
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国	債	証	券	2.2500	2,260	1,896	272,117	2036/09/01						
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国	債	証	券	0.9500	2,000	1,812	260,035	2027/09/15						
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国	債	証	券	0.6500	3,840	3,810	546,636	2023/10/15						
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国	債	証	券	2.4500	1,240	1,258	180,534	2023/10/01						
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国	債	証	券	6.5000	3,400	4,018	576,439	2027/11/01						
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国	債	証	券	5.2500	6,440	7,308	1,048,421	2029/11/01						
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国	債	証	券	1.4500	1,000	985	141,344	2024/11/15						
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国	債	証	券	2.5000	3,000	3,008	431,570	2025/11/15						
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国	債	証	券	2.0000	3,610	3,557	510,358	2025/12/01						
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国	債	証	券	1.2500	3,020	2,838	407,185	2026/12/01						
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国	債	証	券	2.5000	4,090	4,129	592,374	2024/12/01						
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国	債	証	券	2.8000	4,660	4,579	657,041	2028/12/01						
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国	債	証	券	0.9500	70	55	7,925	2031/12/01						
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国	債	証	券	1.6500	3,660	3,174	455,361	2030/12/01						
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国	債	証	券	0.0000	3,000	2,845	408,150	2024/12/15						
小計	—	—	—	—	235,800	225,079	32,289,916	—	—						
(ユーロ…フィンランド)					%	千	ユーロ	千	ユーロ	千	円				
FINLAND 0.125 04/15/52	国	債	証	券	0.1250	420	214	30,830	2052/04/15						
FINLAND 2.0 04/15/24	国	債	証	券	2.0000	3,460	3,523	505,452	2024/04/15						
FINLAND 0.75 04/15/31	国	債	証	券	0.7500	980	872	125,099	2031/04/15						
FINLAND 1.375 04/15/47	国	債	証	券	1.3750	330	263	37,861	2047/04/15						
FINLAND 0.5 04/15/26	国	債	証	券	0.5000	2,900	2,778	398,623	2026/04/15						
FINLAND 1.125 04/15/34	国	債	証	券	1.1250	1,900	1,656	237,687	2034/04/15						
FINLAND 0.5 04/15/43	国	債	証	券	0.5000	100	66	9,561	2043/04/15						
FINLAND 0.125 04/15/36	国	債	証	券	0.1250	180	131	18,869	2036/04/15						
FINLAND 4.0 07/04/25	国	債	証	券	4.0000	290	312	44,819	2025/07/04						
FINLAND 2.75 07/04/28	国	債	証	券	2.7500	160	167	24,050	2028/07/04						
FINLAND 2.625 07/04/42	国	債	証	券	2.6250	1,720	1,737	249,196	2042/07/04						
FINLAND 0.5 09/15/29	国	債	証	券	0.5000	1,060	951	136,494	2029/09/15						
FINLAND 0.5 09/15/28	国	債	証	券	0.5000	90	82	11,800	2028/09/15						
FINLAND 0.5 09/15/27	国	債	証	券	0.5000	10	9	1,339	2027/09/15						
FINLAND 0.25 09/15/40	国	債	証	券	0.2500	1,020	684	98,268	2040/09/15						
FINLAND 0.125 09/15/31	国	債	証	券	0.1250	180	149	21,404	2031/09/15						
FINLAND 0.0 09/15/30	国	債	証	券	0.0000	880	739	106,062	2030/09/15						
FINLAND 0.0 09/15/24	国	債	証	券	0.0000	100	97	13,981	2024/09/15						
小計	—	—	—	—	15,780	14,438	2,071,402	—	—						
(ユーロ…オーストリア)					%	千	ユーロ	千	ユーロ	千	円				
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国	債	証	券	3.8000	1,640	2,084	299,028	2062/01/26						

銘	柄	当			期		末										
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
(ユーロ…オーストリア)					%		千ユーロ		千ユーロ		千円						
AUSTRIA 1.5	02/20/47	国	債	証	券	1.5000	490		398		57,234					2047/02/20	
AUSTRIA 0.5	02/20/29	国	債	証	券	0.5000	3,200		2,896		415,569					2029/02/20	
AUSTRIA 0.75	02/20/28	国	債	証	券	0.7500	1,930		1,806		259,228					2028/02/20	
AUSTRIA 0.0	02/20/31	国	債	証	券	0.0000	1,000		825		118,461					2031/02/20	
AUSTRIA 0.9	02/20/32	国	債	証	券	0.9000	1,500		1,317		189,066					2032/02/20	
AUSTRIA 0.0	02/20/30	国	債	証	券	0.0000	2,760		2,351		337,322					2030/02/20	
AUSTRIA 4.15	03/15/37	国	債	証	券	4.1500	2,360		2,842		407,836					2037/03/15	
AUSTRIA 0.75	03/20/51	国	債	証	券	0.7500	740		470		67,487					2051/03/20	
AUSTRIA 0.7	04/20/71	国	債	証	券	0.7000	130		62		8,923					2071/04/20	
AUSTRIA 0.5	04/20/27	国	債	証	券	0.5000	4,010		3,769		540,748					2027/04/20	
AUSTRIA 0.0	04/20/25	国	債	証	券	0.0000	890		854		122,603					2025/04/20	
AUSTRIA 2.4	05/23/34	国	債	証	券	2.4000	1,660		1,668		239,317					2034/05/23	
AUSTRIA 0.85	06/30/20	国	債	証	券	0.8500	390		157		22,666					2120/06/30	
AUSTRIA 3.15	06/20/44	国	債	証	券	3.1500	920		1,016		145,857					2044/06/20	
AUSTRIA 07/15/24		国	債	証	券	0.0000	20		19		2,802					2024/07/15	
AUSTRIA 2.1	09/20/17	国	債	証	券	2.1000	970		754		108,266					2117/09/20	
AUSTRIA 1.65	10/21/24	国	債	証	券	1.6500	3,600		3,638		521,960					2024/10/21	
AUSTRIA 0.75	10/20/26	国	債	証	券	0.7500	3,230		3,100		444,789					2026/10/20	
AUSTRIA 1.2	10/20/25	国	債	証	券	1.2000	500		495		71,045					2025/10/20	
AUSTRIA 0.25	10/20/36	国	債	証	券	0.2500	1,540		1,122		161,100					2036/10/20	
AUSTRIA 1.75	10/20/23	国	債	証	券	1.7500	3,280		3,323		476,837					2023/10/20	
AUSTRIA 1.5	11/02/86	国	債	証	券	1.5000	400		252		36,272					2086/11/02	
小	計	—	—	—	—	—	37,160		35,232		5,054,427				—	—	
合	計	—	—	—	—	—	—		—		391,873,402				—	—	

■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千円 391,873,402	% 98.5	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,999,761	1.5	
投 資 信 託 財 産 総 額	397,873,163	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、396,133,568千円、99.6％です。
- (注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝136.49円、1カナダ・ドル＝105.41円、1オーストラリア・ドル＝94.71円、1シンガポール・ドル＝98.39円、1イギリス・ポンド＝167.12円、1イスラエル・シェケル＝39.504円、1デンマーク・クローネ＝19.29円、1ノルウェー・クローネ＝13.81円、1スウェーデン・クローナ＝13.44円、1メキシコ・ペソ＝6.764円、1オフショア・人民元＝20.369円、1マレーシア・リンギット＝31.023円、1ポーランド・ズロチ＝30.948円、1ユーロ＝143.46円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	788,924,148,833円
コ ー ル ・ ロ ー ド 等	3,634,753,446
公 社 債(評価額)	391,873,402,035
未 収 入 金	391,051,521,204
未 収 利 息	1,445,393,884
前 払 費 用	919,078,264
(B) 負 債	413,073,939,788
未 払 金	413,067,141,788
未 払 解 約 金	6,798,000
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	375,850,209,045
元 本	301,416,347,543
次 期 繰 越 損 益 金	74,433,861,502
(D) 受 益 権 総 口 数	301,416,347,543口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,469円

(注1) 期首元本額 400,458,673,144円
追加設定元本額 896,564,854,783円
一部解約元本額 995,607,180,384円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	7,983,267,042円
たわらノーロード バランス (堅実型)	922,989,511円
たわらノーロード バランス (標準型)	2,397,639,042円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,142,290,705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)	51,823,060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)	1,480,060,981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)	1,839,784,196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)	585,887,924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)	296,552,475円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	8,098,987円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	21,432,813円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	196,275,572円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	13,786,350円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	20,674,350円
投資のソムリエ	154,657,465,328円
投資のソムリエ<DC年金>	9,674,975,477円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,729,805,477円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	49,791,164,842円
ワールドアセットバランス (基本コース)	2,318,936,250円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	1,473,306,935円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	464,088,184円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	234,326,172円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	64,705,631円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,502,094,089円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,690,173,872円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,045,976,355円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	564,248,623円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	239,455,331円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	154,826,999円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	27,056,178円
外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ) (適格機関投資家限定)	19,895,820,997円
先進国債券パッシブファンド (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	8,036,406,080円

投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 4,004,181,571円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用) 178,452,757円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) 854,354,230円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定) 525,449,535円
D I A M世界アセットバランスファンド40 V A (適格機関投資家限定) 48,155,676円
D I A M世界アセットバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定) 334,162,100円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定) 639,323,897円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定) 899,271,353円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1212) (適格機関投資家限定) 698,032,316円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1303) (適格機関投資家限定) 2,403,879,369円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1306) (適格機関投資家限定) 3,179,279,422円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1309) (適格機関投資家限定) 126,409,489円
期末元本合計 301,416,347,543円

■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益	9,182,555,387円	
受	取 利 息	9,184,824,272	
そ	の 他 収 益	241,313	
支	払 利 息	△2,510,198	
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	△73,578,958,793	
売	買 益	118,689,796,094	
売	買 損	△192,268,754,887	
(C) そ	の 他 費 用	△77,317,894	
(D) 当	期 損 益 金(A + B + C)	△64,473,721,300	
(E) 前	期 繰 越 損 益 金	173,515,474,368	
(F) 解	約 差 損 益 金	△383,745,218,616	
(G) 追	加 信 託 差 損 益 金	349,137,327,050	
(H) 合	計(D + E + F + G)	74,433,861,502	
次	期 繰 越 損 益 金(H)	74,433,861,502	

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2022年2月15日）

（計算期間 2021年2月16日～2022年2月15日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
	円	期騰落率	(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	期騰落率			
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	ポイント 1,070,930.74	% 10.2	% 95.7	% 2.2	百万円 284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565
20期(2022年2月15日)	56,820	20.7	1,849,569.21	20.9	93.1	1.8	642,642

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

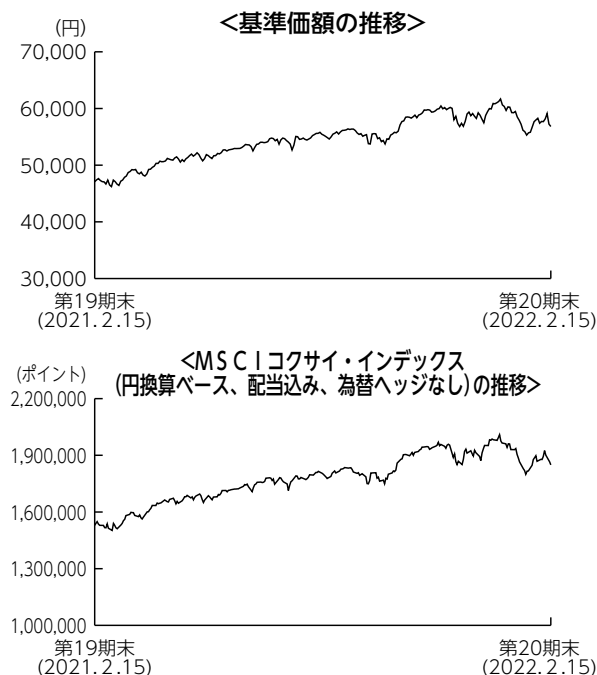
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021 年 2 月 15 日	円 47,083	% ー	ポイント 1,529,401.79	% ー	% 95.5	% 2.5
2 月 末	46,501	△1.2	1,513,956.06	△1.0	95.5	2.4
3 月 末	49,621	5.4	1,611,609.95	5.4	94.8	3.1
4 月 末	51,949	10.3	1,687,947.89	10.4	94.9	3.0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

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年2月16日から2022年2月15日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は56,820円となり、前期末比で20.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

金融緩和策の急速な転換への懸念や新型コロナウイルス変異株の感染拡大などにより、先進国株式市場が調整する場面はあったものの、新型コロナウイルスへの警戒感後退や経済活動正常化への期待などから主要国の株式市場が上昇したことに加え、為替市場でも米ドルなど多くの通貨が対円で上昇したことがプラス寄与となり、当ファンドの基準価額は上昇しました。

投資環境

先進国株式市場は上昇しました。前半は新型コロナウイルスのワクチン接種進展による経済活動正常化や、米国の経済対策法案への期待などから堅調に推移しました。その後はインフレ加速への懸念や、新型コロナウイルス変異株の感染拡大などから下落する場面もありましたが、良好な企業

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

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

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

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



期末

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

（注1）比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で20.9%上昇しました。

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

今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 受 益 証 券) (投 資 証 券)	3円 (3) (0) (1) (0) (0)	0.006% (0.005) (0.000) (0.001) (0.000) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有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)	14 (14) (0) (0)	0.025 (0.025) (0.000) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	22 (0) (22)	0.040 (0.000) (0.040)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	39	0.071	
期中の平均基準価額は54,626円です。			

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

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

(1) 株 式

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ス イ ス	証券 －	千スイス・フラン －	証券 87,844 (－)	千スイス・フラン 28 (－)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7.915 (－)	1,611 (－)	6.133 (－)	1,247 (－)
BOSTON PROPERTIES INC	4.07 (－)	473 (－)	2.216 (－)	274 (－)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	－ (－)	－ (－)	22.693 (－)	657 (－)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	81.1 (－)	686 (－)	58.509 (－)	493 (－)
PROLOGIS INC	46.303 (－)	6,342 (－)	40.623 (－)	5,636 (－)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	9.677 (－)	2,226 (－)	8.65 (－)	2,022 (－)
CAMDEN PROPERTY TRUST	12.453 (－)	1,811 (－)	11.656 (－)	1,653 (－)
EQUINIX INC	6.083 (－)	4,781 (－)	5.373 (－)	4,212 (－)
DUKE REALTY TRUST	12.617 (－)	708 (－)	9.24 (－)	546 (－)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28.217 (－)	5,245 (－)	25.02 (－)	4,595 (－)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.092 (－)	988 (－)	2.464 (－)	802 (－)
EQUITY RESIDENTIAL	30.821 (－)	2,566 (－)	31.532 (－)	2,583 (－)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23.858 (－)	795 (－)	19.455 (－)	665 (－)
SBA COMMUNICATIONS CORP	6.199 (－)	2,128 (－)	5.486 (－)	1,933 (－)
WELLTOWER INC	32.254 (－)	2,651 (－)	29.921 (－)	2,444 (－)
IRON MOUNTAIN INC	3.849 (－)	175 (－)	－ (－)	－ (－)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22.487 (－)	1,784 (－)	22.001 (－)	1,743 (－)
HOST HOTELS & RESORTS INC	44.413 (－)	716 (－)	32.749 (－)	518 (－)
MID AMERICA	5.789 (－)	1,109 (－)	4.944 (－)	931 (－)
REALTY INCOME CORP	41.631 (18.05)	2,829 (－)	35.88 (－)	2,454 (－)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
REGENCY CENTERS CORP	3.639	260	3.473	270
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	38.514	2,062	37.282	1,986
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	21.117	2,879	17.329	2,452
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	10.449	3,254	9.007	2,855
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	5.79	1,099	4.394	857
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	19.098	1,052	13.711	712
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	23.728	1,062	21.319	914
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	48.016	1,759	39.928	1,479
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	8.076	1,464	6.463	1,122
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	19.54	3,025	15.672	2,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	76.011	1,576	75.842	1,601
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	50.845	783	52.553	814
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	23.054	1,081	17.984	838
	(△25.604)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	28.174	7,568	23.609	6,307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	20.944	1,621	17.027	1,295
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	47.749	1,885	43.017	1,704
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	5.738	100
	(5.738)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	43.226	1,246	32.427	906
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	4.337	241	4.071	223
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	84.707	247	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	49.06	236	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	49.463	231	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	119.11	1,246	126.88	1,329
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	122.45	2,770	112.622	2,653
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	179.768	543	120.66	390
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	212.6 (-)	14,716 (-)	213.1 (-)	14,405 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	295.4 (57.741)	611 (89)	291.6 (-)	604 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	478 (-)	1,446 (△6)	522 (-)	1,533 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	- (-)	- (-)	192.1 (-)	272 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	473 (-)	849 (△4)	258.6 (-)	480 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	- (-)	- (△1)	- (-)	- (-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	76.052 (-)	389 (-)	70.101 (-)	371 (-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	18.185 (-)	127 (-)	- (-)	- (-)
SEGRO PLC	53.28 (-)	602 (-)	33.876 (-)	385 (-)
ユーロ（フランス）	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	1.093 (-)	145 (-)	- (-)	- (-)
KLEPIERRE	- (-)	- (△17)	- (-)	- (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	株 式 先 物 取 引	百万円 213,419	百万円 216,105	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	744,105,008千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	572,165,051千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	1.30

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年2月16日から2022年2月15日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期 首(前期末)	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	380.64	444.06	137,806	15,905,674	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,585.92	1,727.2	21,206	2,447,661	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	567.35	654.52	1,404	162,118	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	39.87	42.71	1,240	143,170	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	798.02	873.09	11,363	1,311,548	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,053.11	1,223.07	13,976	1,613,112	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	429.77	464.19	22,003	2,539,594	ソフトウェア
CHUBB LTD	406.4	429.3	8,674	1,001,252	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	198.54	216.51	5,271	608,471	化学
ALLEGHANY CORP	12.63	12.56	844	97,447	保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	—	—	—	バイオテクノロジー
ALLSTATE CORP	283.81	305.8	3,816	440,487	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	627.86	674.78	12,597	1,453,999	コングロマリット
AMGEN INC	524.53	552.91	12,400	1,431,220	バイオテクノロジー
HESS CORP	247.76	269.32	2,551	294,467	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	616.15	655.69	12,612	1,455,699	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	450.17	484.16	4,172	481,588	電力
AFLAC INC	582.83	624.14	4,008	462,629	保険
AMERICAN INTL GROUP	754.5	830.45	4,898	565,422	保険
AMERCO	9.29	9.29	536	61,889	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	335.79	518.67	7,986	921,799	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	192.19	—	—	—	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	653.14	696.42	4,631	534,532	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	374	422.88	3,794	437,912	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	79.7	83.94	2,661	307,237	ソフトウェア
APPLE INC	15,286.24	16,106.99	272,014	31,395,953	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	818.51	881.06	11,617	1,340,909	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	95.36	111.8	2,545	293,797	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	517.45	544.75	4,146	478,604	食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	92.78	—	—	—	電力
AMEREN CORP	222.73	254.36	2,165	249,926	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	66.51	62.95	784	90,508	電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	75.7	—	—	—	自動車部品
AUTODESK INC	198.42	214.23	4,860	561,042	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	386.31	413.9	8,359	964,905	情報技術サービス
AUTOZONE INC	21.6	20.86	4,014	463,378	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	76.27	80.95	1,471	169,841	容器・包装
BALL CORP	288.47	315.98	2,915	336,548	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,250.78	1,292.71	40,627	4,689,201	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	702.98	794.62	4,884	563,772	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	443.26	484.18	4,137	477,529	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	260.87	280.24	7,535	869,765	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	200.08	226.36	2,946	340,062	電気設備
VERIZON COMM INC	3,685.67	4,048.08	21,564	2,488,930	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	125.11	128.04	1,145	132,251	保険
BEST BUY CO INC	215.6	212.38	2,137	246,697	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	18.59	23.24	1,443	166,569	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	273.93	286.66	3,480	401,667	ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FIRSTENERGY CORP	478	518.27	2,111	243,701	電力
BOEING CO	481.42	542.08	11,385	1,314,154	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	111.11	112.38	1,343	155,106	専門サービス
BORGWARNER INC	219.38	209.23	894	103,262	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,290.98	1,387.96	5,930	684,527	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	117.19	123.82	1,104	127,492	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	106.87	107.92	1,803	208,104	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.08	22.29	3,156	364,326	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,018.55	2,157.51	14,414	1,663,701	医薬品
ONEOK INC	392.84	420.2	2,643	305,158	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	80.93	74.44	1,011	116,694	保険
UNITED RENTALS INC	61.81	69.35	2,172	250,737	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	261.13	310.48	4,195	484,246	総合公益事業
FEDEX CORP	224.18	247.48	5,653	652,576	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	87.62	103.4	2,208	254,871	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	262.07	581.23	4,377	505,221	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	260.85	297.33	1,973	227,767	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	971.36	599	69,174	メディア
CSX CORP	686.59	2,203.61	7,474	862,723	陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	314.16	785.16	1,823	210,517	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	166.23	203.34	895	103,336	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	196.41	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	146.75	164.21	3,840	443,218	飲料
CARDINAL HEALTH INC	247.18	290.05	1,516	175,054	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	471.45	763.02	1,629	188,112	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	486.12	532.89	10,651	1,229,446	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	102.58	1,330	153,538	ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	99.33	115.3	1,175	135,687	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	921.88	913	105,445	各種電気通信サービス
CERNER CORP	272.58	285.28	2,614	301,809	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,725.45	2,913.79	44,432	5,128,385	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	212.87	245.63	2,396	276,616	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	128.72	144.65	1,728	199,477	保険
CINTAS CORP	80.99	89.31	3,308	381,917	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,769.58	4,107.04	21,841	2,520,915	通信機器
CLOROX COMPANY	117.85	114.55	1,637	188,999	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,644.71	4,005.62	24,306	2,805,410	飲料
COPART INC	186.28	203.22	2,494	287,871	商業サービス・用品
COGNEX CORP	146.77	162.62	1,028	118,717	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	712.97	784.14	6,215	717,346	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	256.86	265.14	4,542	524,311	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	52.03	55.04	1,692	195,352	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	210.39	227.63	880	101,624	電力
COMCAST CORP-CL A	4,081.73	4,460.29	21,141	2,440,183	メディア
CONAGRA BRANDS INC	461.45	454.72	1,605	185,267	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	298.44	340.89	2,830	326,646	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	259.36	272.38	1,699	196,142	総合公益事業
COOPER COS INC	50.31	47.32	1,851	213,742	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	165.13	169.84	839	96,858	飲料
CORNING INC	710.11	838.66	3,462	399,679	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	133.82	847	97,785	容器・包装

銘柄	期 首(前期末)	当		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
HEICO CORP-CL A	62.36	74.77	855	98,761	航空宇宙・防衛	
CUMMINS INC	137.18	139.26	3,055	352,714	機械	
DR HORTON INC	322.07	327.87	2,719	313,905	家庭用耐久財	
DANAHER CORP	572.81	625.65	16,986	1,960,569	ライフサイエンス・ツール／サービス	
MOODY'S CORP	151.99	163.35	5,283	609,865	資本市場	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	470.43	512.62	4,420	510,252	情報技術サービス	
TARGET CORP	449.86	474.94	9,905	1,143,330	複合小売り	
DEERE & CO	267.97	286.89	11,110	1,282,327	機械	
MORGAN STANLEY	1,216.65	1,330.94	13,651	1,575,650	資本市場	
REPUBLIC SERVICES INC	191.36	215.52	2,555	294,946	商業サービス・用品	
COSTAR GROUP INC	34.38	412.01	2,718	313,810	専門サービス	
THE WALT DISNEY CO	1,619.66	1,767.79	26,667	3,077,918	娯楽	
DOLLAR TREE INC	219.16	231.67	3,172	366,222	複合小売り	
DOVER CORP	126.52	141.72	2,283	263,614	機械	
OMNICOM GROUP	196.63	203.13	1,721	198,675	メディア	
DTE ENERGY CO	177.93	184.19	2,137	246,713	総合公益事業	
DUKE ENERGY CORP	642.05	753.03	7,526	868,712	電力	
DARDEN RESTAURANTS INC	109.02	133.37	1,912	220,774	ホテル・レストラン・レジャー	
EBAY INC	614.91	628.16	3,654	421,817	インターネット販売・通信販売	
BANK OF AMERICA CORP	6,976.37	7,384.33	35,016	4,041,603	銀行	
CITIGROUP INC	1,867.17	1,979.43	13,155	1,518,383	銀行	
EASTMAN CHEMICAL CO	122.29	133.26	1,608	185,631	化学	
EATON CORP PLC	364.97	390.25	5,938	685,414	電気設備	
CADENCE DESIGN SYS INC	246.39	268.13	3,809	439,702	ソフトウェア	
DISH NETWORK CORP	214.2	226.45	701	80,945	メディア	
ECOLAB INC	230.5	252.97	4,627	534,056	化学	
PERKINELMER INC	97.55	118.35	2,143	247,422	ライフサイエンス・ツール／サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	251.42	275.61	3,676	424,357	娯楽	
SALESFORCE.COM INC	815.12	953.48	19,679	2,271,445	ソフトウェア	
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	411	47,526	保険	
EMERSON ELECTRIC CO	522.99	583.88	5,486	633,277	電気設備	
ATMOS ENERGY CORP	115.03	124.29	1,317	152,034	ガス	
ENTERGY CORP	171.95	188.13	1,965	226,910	電力	
EOG RESOURCES INC	540.41	567.51	6,436	742,858	石油・ガス・消耗燃料	
EQUIFAX INC	103.22	116.63	2,577	297,470	専門サービス	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	202.15	226.64	6,886	794,834	パーソナル用品	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	139.42	163.66	1,751	202,138	航空貨物・物流サービス	
EXXON MOBIL CORP	3,789.44	4,127.07	32,595	3,762,184	石油・ガス・消耗燃料	
FMC CORP	114.16	121.83	1,410	162,763	化学	
NEXTERA ENERGY INC	1,752.42	1,911.83	14,323	1,653,210	電力	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	32.46	38.74	1,549	178,868	資本市場	
FAIR ISAAC CORP	24.82	28.1	1,439	166,186	ソフトウェア	
ASSURANT INC	55.23	55.23	894	103,262	保険	
FASTENAL CO	504.82	549.13	2,851	329,071	商社・流通業	
FIFTH THIRD BANCORP	636.46	666.81	3,216	371,193	銀行	
M&T BANK CORP	114.32	121.75	2,196	253,519	銀行	
FISERV INC	514.04	576.52	5,643	651,379	情報技術サービス	
FORD MOTOR CO	3,423.19	3,805.63	6,644	766,923	自動車	
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	276.05	839	96,859	資本市場	
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,269.73	1,425.79	6,052	698,577	金属・鉱業	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	－	11.92	917	105,937	銀行	

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	179.22	200.01	3,067	354,010	保険
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	202.22	1,082	124,963	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	215.99	231.98	4,898	565,410	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	538.66	588.18	3,977	459,124	食品
GENUINE PARTS CO	133.93	136.11	1,729	199,608	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,130.1	1,218.49	7,446	859,439	バイオテクノロジー
GARTNER INC	75.22	88.55	2,555	294,941	情報技術サービス
MCKESSON CORP	142.89	150.01	4,060	468,642	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	552.38	2,433.72	59,059	6,816,599	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,857.77	1,070.26	10,338	1,193,294	コングロマリット
VWV GRAINGER INC	42.34	41.48	1,934	223,289	商社・流通業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	—	309.23	1,708	197,194	ソフトウェア
HALLIBURTON CO	774.83	838.43	2,713	313,152	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	345.68	386.22	3,189	368,076	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	293.78	329.9	11,884	1,371,687	資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	189.69	193.75	4,259	491,575	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	113.83	121.84	1,152	132,977	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	115.16	143.58	1,088	125,599	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	36.23	35.96	500	57,725	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	136.22	152.45	3,100	357,810	食品
HP INC	1,251.84	1,162.73	4,245	489,972	コンピュータ・周辺機器
F5 INC	55.29	55.57	1,076	124,301	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	120.24	123.36	1,460	168,523	容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	352.9	1,192	137,632	通信機器
HOLOGIC INC	240.09	243.1	1,709	197,280	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	963.81	1,028.3	36,150	4,172,538	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	162.88	198.15	1,783	205,857	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	262.54	290.21	1,377	158,972	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	490.65	611.05	1,644	189,789	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	34.21	898	103,747	建設関連製品
HUMANA INC	119.37	125.74	5,276	609,019	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	75.44	87.52	1,684	194,444	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	938.57	1,419.2	2,228	257,172	銀行
BIOGEN INC	144.18	143.44	3,071	354,493	バイオテクノロジー
IDEX CORP	72.94	73.32	1,405	162,211	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	275.8	307.86	6,747	778,781	機械
INTUIT INC	233.97	266.2	14,083	1,625,495	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	77.82	82.25	4,157	479,914	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	—	—	—	バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	218.91	230.51	3,491	402,939	建設関連製品
INTEL CORP	3,802.57	3,947.83	18,783	2,168,023	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	199.06	239.91	3,157	364,433	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	319.83	343.88	1,589	183,489	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	353.17	369.48	1,296	149,599	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	110.33	131.48	1,586	183,121	専門サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	68.74	77.48	1,318	152,187	情報技術サービス
INCYTE CORP	159.42	179.58	1,185	136,840	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,351.55	2,569.27	42,547	4,910,787	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	334.76	328	2,284	263,717	保険
KLA CORPORATION	141.3	147.87	5,399	623,224	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	560.14	624.62	3,264	376,761	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
KELLOGG CO	219.54	265.78	1,720	198,629	食品	
KEYCORP	875.97	916.12	2,373	273,968	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	308.61	326.7	4,324	499,137	家庭用品	
BLACKROCK INC/NEW YORK	136.68	147.89	11,244	1,297,808	資本市場	
KROGER CO	712.62	684.81	3,128	361,137	食品・生活必需品小売り	
LAM RESEARCH CORP	130.86	138.76	7,746	894,075	半導体・半導体製造装置	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	33.02	44.17	1,841	212,560	電子装置・機器・部品	
PACKAGING CORP OF AMERICA	84.38	105.55	1,551	179,108	容器・包装	
AKAMAI TECHNOLOGIES	141.53	152.64	1,688	194,939	情報技術サービス	
PLUG POWER INC	—	526.24	1,129	130,405	電気設備	
LENNAR CORP	258.81	264.83	2,399	276,903	家庭用耐久財	
ELI LILLY & CO	771.11	791.98	18,586	2,145,309	医薬品	
BATH & BODY WORKS INC	—	269.67	1,483	171,282	専門小売り	
LINCOLN NATIONAL CORP	180.9	170.02	1,206	139,210	保険	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	633.18	709.53	15,183	1,752,448	航空貨物・物流サービス	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	284.52	292.04	3,948	455,755	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LOCKHEED MARTIN CORP	225.05	244.24	9,451	1,090,875	航空宇宙・防衛	
LOEWS CORP	217.59	223.94	1,368	158,003	保険	
LOWE'S COS INC	679.92	674.34	15,236	1,758,621	専門小売り	
DOMINION ENERGY INC	733.73	787.03	6,197	715,357	総合公益事業	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	458.5	387	1,727	199,440	ホテル・レストラン・レジャー	
MCCORMICK & CO INC	215.14	249.05	2,500	288,603	食品	
MCDONALD'S CORPORATION	664.19	727.78	18,441	2,128,485	ホテル・レストラン・レジャー	
S&P GLOBAL INC	215.72	233.63	8,894	1,026,606	資本市場	
EVEREST RE GROUP LTD	34.16	42.82	1,255	144,868	保険	
MARKEL CORPORATION	12.01	14.47	1,787	206,344	保険	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	561.91	605.91	6,527	753,400	ヘルスケア機器・用品	
MARSH & MCLENNAN COS	442.08	495.58	7,518	867,778	保険	
MASCO CORP	231.51	232.33	1,330	153,518	建設関連製品	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	52.58	58.93	2,174	251,016	建設資材	
METLIFE INC	679.99	714.43	5,010	578,288	保険	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	235.91	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,200.14	1,313.85	13,441	1,551,475	ヘルスケア機器・用品	
ACTIVISION BLIZZARD INC	696.43	756.57	6,166	711,684	娯楽	
CVS HEALTH CORP	1,175.45	1,287.35	13,259	1,530,435	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MERCK & CO.INC.	2,257.06	2,465.91	18,856	2,176,453	医薬品	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	366.51	413.6	2,426	280,029	半導体・半導体製造装置	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	85.88	92.82	2,531	292,129	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MICROSOFT CORP	6,425.29	6,957.86	205,256	23,690,747	ソフトウェア	
MICRON TECH INC	999.6	1,090.85	9,802	1,131,390	半導体・半導体製造装置	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	218.94	533.22	3,795	438,133	半導体・半導体製造装置	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	612.87	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
3M CO	515.39	566.66	8,953	1,033,446	コングロマリット	
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	59.63	857	98,984	家庭用耐久財	
ENTEGRIS INC	—	136.39	1,719	198,413	半導体・半導体製造装置	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	—	54.58	1,787	206,274	ライフサイエンス・ツール/サービス	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	150.06	163.01	3,485	402,275	通信機器	
KANSAS CITY SOUTHERN	83.46	—	—	—	陸運・鉄道	
ILLUMINA INC	131.34	142.46	4,693	541,705	ライフサイエンス・ツール/サービス	
XCEL ENERGY INC	465.91	516.15	3,427	395,571	電力	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	80.58	97.13	840	96,995	バイオテクノロジー	

銘柄	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
NETAPP INC	198.04	212.2	1,862	215,016	コンピュータ・周辺機器	
NEWELL BRANDS INC	333.17	404.89	1,008	116,457	家庭用耐久財	
NEWMONT CORP	726.65	774.43	4,983	575,190	金属・鉱業	
NOVAVAX INC	—	78.86	631	72,916	バイオテクノロジー	
NVR INC	3.05	3.38	1,682	194,199	家庭用耐久財	
NIKE INC-CL B	1,116.09	1,245.17	17,630	2,034,896	繊維・アパレル・贅沢品	
NORDSON CORP	46.44	47.87	1,063	122,719	機械	
NORFOLK SOUTHERN CORP	229.57	242.35	6,598	761,594	陸運・鉄道	
EVERSOURCE ENERGY	305.69	328.72	2,702	311,911	電力	
NISOURCE INC	314.27	420.35	1,194	137,836	総合公益事業	
NORTHERN TRUST CORP	173.65	200.11	2,431	280,647	資本市場	
NORTHROP GRUMMAN CORP	136.98	148.6	5,804	669,934	航空宇宙・防衛	
WELLS FARGO & CO	3,503.46	4,001.7	23,149	2,671,953	銀行	
NUCOR CORP	288.6	282.85	3,319	383,107	金属・鉱業	
CHENIERE ENERGY INC	191.9	231.2	2,702	311,922	石油・ガス・消耗燃料	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	417.51	430.6	6,680	771,043	消費者金融	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	852.06	902.66	3,721	429,554	石油・ガス・消耗燃料	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	87.12	95.78	2,815	324,959	陸運・鉄道	
OGE ENERGY CORP	160.28	—	—	—	電力	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	65.76	66.72	4,410	509,055	専門小売り	
ORACLE CORP	1,782.61	1,632.21	12,886	1,487,336	ソフトウェア	
PACCAR INC	304.46	359.38	3,341	385,677	機械	
PTC INC	94.33	110.92	1,241	143,271	ソフトウェア	
EXELON CORP	853.23	956.45	4,036	465,860	電力	
PARKER HANNIFIN CORP	119	125.93	3,792	437,702	機械	
PAYCHEX INC	298.42	313.87	3,718	429,216	情報技術サービス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	65.29	73.03	3,692	426,235	ヘルスケア機器・用品	
PPL CORPORATION	713.2	734.82	2,083	240,444	電力	
PEPSICO INC	1,235.16	1,349.24	22,491	2,596,007	飲料	
PENTAIR PLC	155.64	163.39	963	111,189	機械	
PFIZER INC	4,971.81	5,460.72	27,194	3,138,775	医薬品	
ESSENTIAL UTILITIES INC	229.37	215.43	972	112,190	水道	
CONOCOPHILLIPS	1,233.91	1,306.12	11,957	1,380,137	石油・ガス・消耗燃料	
PG&E CORP	1,239.99	1,524.96	1,720	198,540	電力	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	181.44	222.38	4,982	575,071	石油・ガス・消耗燃料	
ALTRIA GROUP INC	1,673.74	1,796.13	8,996	1,038,412	タバコ	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	382.89	415.17	8,493	980,277	銀行	
BROWN & BROWN INC	203.08	217.93	1,437	165,962	保険	
GARMIN LTD	123.65	145.29	1,754	202,506	家庭用耐久財	
PPG INDUSTRIES INC	206.85	230.64	3,442	397,363	化学	
IPG PHOTONICS CORP	33.53	33.53	491	56,765	電子装置・機器・部品	
COSTCO WHOLESALE CORP	394.44	429.9	21,777	2,513,503	食品・生活必需品小売り	
T ROWE PRICE GROUP INC	200.07	218.51	3,149	363,527	資本市場	
QUEST DIAGNOSTICS	119.26	124.93	1,627	187,870	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PROCTER & GAMBLE CO	2,223.79	2,369.3	37,136	4,286,284	家庭用品	
PROGRESSIVE CORP	528.87	569.36	6,047	697,964	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	445.03	490.59	3,177	366,752	総合公益事業	
PULTE GROUP INC	243.05	238.14	1,138	131,438	家庭用耐久財	
GLOBAL PAYMENTS INC	271.25	283.31	4,163	480,553	情報技術サービス	
QUALCOMM INC	1,010	1,096.16	18,100	2,089,204	半導体・半導体製造装置	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	107.44	197.29	2,159	249,299	資本市場	

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EXACT SCIENCES CORP	139.11	179.82	1,408	162,572	バイオテクノロジー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	40.52	—	—	—	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	95.04	101.93	6,355	733,568	バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	60.97	—	—	—	保険
RESMED INC	132.86	140.92	3,292	379,982	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,226.62	1,379.88	7,985	921,670	銀行
SEAGEN INC	102.96	128.63	1,601	184,853	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	343.83	370.32	1,719	198,409	保険
ROSS STORES INC	311.97	342.98	3,233	373,184	専門小売り
ROLLINS INC	185.67	191.56	590	68,186	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	91.27	103.18	4,562	526,605	コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	107.18	111.67	2,996	345,900	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	158.79	212.92	1,761	203,359	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	110.04	128.97	1,090	125,843	化学
ACCENTURE PLC-CL A	568.7	618.55	20,172	2,328,341	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,278.63	1,364.94	9,027	1,041,978	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	117.94	124.53	2,725	314,573	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	221.48	241.52	4,124	476,042	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	557.29	599.27	6,681	771,220	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	36.87	39.84	10,141	1,170,579	ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,309.4	1,365.54	5,366	619,409	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,376.29	1,406.74	12,342	1,424,598	資本市場
POOL CORP	35.32	43.36	1,955	225,677	販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	181.87	200.7	2,347	271,004	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	133.04	135.81	1,369	158,052	食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	102.94	611	70,575	資本市場
ANTHEM INC	226.07	238.09	10,570	1,220,045	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	138.36	149.22	2,091	241,431	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	250.38	257.42	1,909	220,428	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	73.88	243.75	6,592	760,958	化学
CENTENE CORP	509.9	563.86	4,624	533,726	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	45.32	56.17	3,491	402,946	銀行
SMITH (A.O.) CORP	113.51	140.37	999	115,403	建設関連製品
SNAP-ON INC	48.25	57.83	1,218	140,643	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	372.26	375.64	4,349	502,066	保険
ADVANCE AUTO PARTS	62.26	56.94	1,277	147,397	専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	350.41	362.4	2,176	251,220	電力
SOUTHERN CO	923.98	1,035.27	6,817	786,847	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,215.55	1,291.44	8,136	939,065	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	117.91	132.2	599	69,243	旅客航空輸送業
AT&T INC	6,363.97	6,960.38	16,739	1,932,097	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,721.63	1,886.45	25,782	2,975,771	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	140.26	153.85	2,528	291,806	機械
STATE STREET CORP	324.04	351.58	3,469	400,437	資本市場
STARBUCKS CORP	1,049.03	1,144.57	10,718	1,237,175	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	219.29	1,351	155,937	金属・鉱業
STRYKER CORP	304.36	331.3	8,297	957,686	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	394.98	430.24	17,062	1,969,299	娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	552.31	1,628	187,927	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	158.87	873	100,797	陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	133.81	147.52	4,351	502,221	ソフトウェア

銘 柄	期 首(前期末)	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SYSCO CORP	421.71	496.62	4,071	469,965	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	105.44	346.96	9,754	1,125,856	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	40.02	44.66	1,417	163,577	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	1,057.57	901	103,999	医薬品
TERADYNE INC	142.84	154.54	1,735	200,327	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	818.5	895.92	14,556	1,680,054	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	194.86	206.83	1,418	163,668	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	354.62	382.78	21,481	2,479,363	ライフサイエンス・ツール／サービス
GLOBE LIFE INC	105.78	91.68	953	110,081	保険
DAVITA INC	64.97	64.97	738	85,224	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	104.62	109.61	2,388	275,707	専門小売り
BIO-TECHNE CORP	—	42.2	1,745	201,472	ライフサイエンス・ツール／サービス
TRIMBLE INC	224.42	260.37	1,714	197,891	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	34.73	39.35	1,838	212,228	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	249.8	277.88	2,636	304,307	食品
UGI CORP	200.72	184.69	692	79,917	ガス
UNION PACIFIC CORP	605.64	637.38	15,459	1,784,353	陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,372.1	1,472.36	13,776	1,590,126	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	849.87	920.02	43,645	5,037,592	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	61.53	77.37	1,022	118,073	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	81.39	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	287.12	356.87	2,137	246,686	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	493.63	570.34	1,997	230,597	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	239.38	250.92	5,802	669,669	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	121.7	126.76	2,330	269,042	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	668.71	704.44	3,336	385,067	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,264.14	1,502.63	20,127	2,323,142	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	383.57	406.53	5,763	665,208	商業サービス・用品
WATERS CORP	52.11	57.5	1,828	211,078	ライフサイエンス・ツール／サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	204.18	1,248	144,132	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	70.09	71.03	2,725	314,551	ライフサイエンス・ツール／サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	103.06	99.44	1,366	157,733	食品
VAIL RESORTS INC	35.9	41.8	1,134	130,957	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	258.67	293.01	1,548	178,768	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	162.57	170.97	1,495	172,627	機械
WHIRLPOOL CORP	56.56	57.37	1,128	130,194	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	153.31	159.24	2,145	247,626	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	86.39	120.04	1,105	127,549	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	100.97	110.34	1,897	218,960	資本市場
CME GROUP INC	321.8	348.92	8,345	963,193	資本市場
WILLIAMS COS INC	1,125.35	1,163.01	3,498	403,777	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	236.91	287.85	1,547	178,643	販売
ALLIANT ENERGY CORP	228.29	238.72	1,357	156,694	電力
WEC ENERGY GROUP INC	290.02	305.23	2,735	315,763	総合公益事業
CARMAX INC	142.09	152.87	1,696	195,780	専門小売り
XILINX INC	214	253.18	4,934	569,595	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,081.5	1,168.23	7,942	916,757	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	45.61	56.09	2,391	276,060	電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,087	620	71,638	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	206	204	1,228	141,815	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	—	—	—	コングロマリット

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	102.39	108.82	1,617	186,717	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	—	56.1	1,858	214,564	銀行
CBRE GROUP INC	296.17	323.38	3,175	366,564	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	145.97	404	46,634	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	855.82	974.23	2,388	275,716	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	36.41	38.08	1,640	189,305	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	37.37	40.44	1,752	202,255	半導体・半導体製造装置
T-MOBILE US INC	499.8	607.01	7,618	879,336	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	302.77	367.69	1,699	196,109	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	325.92	385.15	1,718	198,353	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32.09	39.59	1,466	169,221	資本市場
CELANESE CORP	115.88	109.17	1,683	194,260	化学
DEXCOM INC	87.06	93.5	3,805	439,225	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	153.62	130.68	384	44,374	メディア
EXPEDIA GROUP INC	115.08	136.45	2,690	310,524	ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	202.05	1,443	166,649	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	106.14	108.96	3,279	378,479	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23	943	108,933	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	487.85	551.66	6,886	794,888	資本市場
LIVE NATION	138.04	153.12	1,765	203,717	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	23.26	27.13	4,242	489,726	ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	47.45	50.93	3,212	370,770	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	798.24	858.46	32,120	3,707,306	情報技術サービス
WESTERN UNION CO	353.67	448.68	888	102,537	情報技術サービス
OWENS CORNING	99.65	97.4	881	101,705	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	128.66	123.03	1,074	124,052	専門サービス
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	188	21,747	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	99.59	117.8	1,706	196,931	情報技術サービス
DELTA AIR LINES INC	147.23	147.23	617	71,320	旅客航空輸送業
INSULET CORP	55.66	64.81	1,591	183,687	ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	269.75	286.45	3,556	410,498	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	289.3	318.46	4,570	527,568	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	45.05	54.04	1,213	140,083	ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	108.17	114.58	3,593	414,783	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	74.64	213.2	2,634	304,100	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	40.41	43.13	4,826	557,050	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	45.38	52.74	1,912	220,754	専門小売り
INVESCO LTD	334.43	369.04	842	97,200	資本市場
MSCI INC	76.17	79.74	4,249	490,523	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,392.7	1,520.6	16,611	1,917,245	タバコ
VISA INC	1,505.8	1,644.41	37,055	4,276,903	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	484.8	709.52	2,703	312,011	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	169.15	173.37	2,566	296,213	水道
DISCOVERY INC-C	304.21	303.88	891	102,871	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	595.87	618.96	4,899	565,521	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	117.44	127.87	1,141	131,707	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,859.92	1,960.57	3,370	388,990	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	172.22	170.83	1,524	175,995	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	246.36	261.91	2,623	302,749	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.84	34.82	631	72,847	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	146.41	156.99	1,961	226,442	ソフトウェア

銘 柄	期 首(前期末)	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EPAM SYSTEMS INC	53.33	53.99	2,310	266,678	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC	53.66	76.58	439	50,690	不動産管理・開発
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	148.14	—	—	—	資本市場
HCA HEALTHCARE INC	236.31	250.49	5,897	680,635	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	136.44	146.24	2,805	323,756	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	52.57	61.52	875	101,049	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	78.06	73.99	1,810	208,963	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	149.86	169.47	2,910	335,986	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	243.75	258.51	4,805	554,614	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	116.67	136.87	1,017	117,423	専門サービス
LEAR CORP	46.81	52.16	872	100,683	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	104.72	105.27	1,269	146,507	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	202.43	215.54	1,619	186,930	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	218.25	225.66	4,526	522,502	複合小売り
FORTINET INC	121.46	134.08	4,161	480,282	ソフトウェア
HORIZON PHARMA PLC	189.86	204.15	1,969	227,359	バイオテクノロジー
TESLA INC	667.04	819.66	71,782	8,285,141	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	54.02	59.93	1,620	187,073	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	101.63	122.17	1,758	202,953	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,164.31	1,267.27	6,133	707,938	自動車
XPO LOGISTICS INC	76.14	—	—	—	陸運・鉄道
ALLY FINANCIAL INC	338.57	374.66	1,811	209,037	消費者金融
VOYA FINANCIAL INC	135.03	—	—	—	各種金融サービス
APTIV PLC	236.97	260.18	3,554	410,209	自動車部品
PHILLIPS 66	399.51	424.28	3,840	443,280	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	71.72	86.28	815	94,077	ソフトウェア
META PLATFORMS INC	2,150.14	2,321.43	50,537	5,833,041	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	168.96	185.72	4,455	514,244	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	157.27	2,051	236,830	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	172.89	192.63	11,164	1,288,600	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	84.6	94.41	4,918	567,745	ソフトウェア
WORKDAY INC	155.26	186.02	4,333	500,218	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,581.52	1,721.56	24,618	2,841,445	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	426.6	460.53	9,046	1,044,111	医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	383.72	854	98,675	メディア
CDW CORP	127.68	129.43	2,279	263,072	電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	381.27	404.34	1,377	159,001	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	119	158.35	3,099	357,694	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	62.46	77.32	1,010	116,586	ソフトウェア
SNAP INC	822.23	1,027.74	4,071	469,979	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	36.48	418.52	3,202	369,585	ソフトウェア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	195.46	221.57	1,380	159,298	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	83.24	421	48,671	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	143.46	725	83,767	メディア
OKTA INC	106.51	116.92	2,214	255,607	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	130.42	167.75	1,099	126,877	ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	572.74	779.09	2,223	256,639	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	131.81	—	—	—	食品
ALTICE USA INC-A	215.06	—	—	—	メディア
BROADCOM INC	360.27	398.94	23,081	2,664,109	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	67.99	73.05	1,228	141,782	ソフトウェア

銘 柄	期 首(前期末)	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MONGODB INC	41.88	61.01	2,623	302,746	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	56.02	68.61	1,540	177,852	専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	358.24	404.49	1,016	117,322	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	118.32	132.96	3,030	349,786	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	690.05	829.81	2,961	341,826	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	132.14	159.85	906	104,647	電気設備
EVERGY INC	210.39	223.98	1,386	160,048	電力
ALLEGION PLC	90.22	89.24	1,055	121,880	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	114.54	133.6	934	107,863	ソフトウェア
STERIS PLC	73.9	96.49	2,185	252,305	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	152.47	185.2	2,236	258,176	ソフトウェア
WIX.COM LTD	49.18	55.67	626	72,363	情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	281.7	687	79,301	ソフトウェア
KKR & CO INC	472.67	503.37	3,048	351,905	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	—	—	—	医薬品
FUTU HOLDINGS LTD ADR	—	47.58	209	24,229	資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	155.78	209	2,969	342,760	ソフトウェア
MODERNA INC	240.31	334.13	4,760	549,439	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	258.78	266.16	4,030	465,195	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	186.32	213.87	769	88,816	ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	—	571.24	1,013	117,030	娯楽
CIGNA CORP	331.16	331.11	7,457	860,793	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	205.86	277.83	1,628	187,913	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	647.07	722.56	4,395	507,309	化学
AMCOR PLC	1,461.49	1,618.22	1,872	216,098	容器・包装
PINTEREST INC	420.97	521.77	1,289	148,810	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	178.7	254.18	834	96,314	レジャー用品
FOX CORP-A	317.51	346.81	1,479	170,802	メディア
FOX CORP-B	130.09	150.8	584	67,445	メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	—	408.46	672	77,599	専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	130.78	182.31	3,292	380,022	ソフトウェア
CHEWY INC	65.86	90.68	477	55,084	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	445.09	486.39	1,719	198,507	ライフサイエンス・ツール/サービス
LYFT INC	—	245.89	983	113,494	陸運・鉄道
DYNATRACE INC	159.49	194.17	829	95,740	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	132.18	225.54	2,380	274,791	情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	70.65	98.86	815	94,067	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	750.77	798.71	3,577	412,906	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	375.35	422.26	3,367	388,679	機械
INMODE LTD	—	55.11	251	29,005	ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	838.27	1,191.09	4,119	475,528	陸運・鉄道
CORTEVA INC	686.39	717.05	3,649	421,258	化学
MATCH GROUP INC	215.66	253.22	2,881	332,540	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	325.12	—	—	—	ソフトウェア
BILL.COM HOLDINGS INC	—	78.3	1,879	216,897	ソフトウェア
BLACKSTONE INC	585.87	665.78	8,069	931,353	資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	32.02	263	30,379	インターネット販売・通信販売
CARLYLE GROUP INC	125.09	170.2	796	91,877	資本市場
10X GENOMICS INC	53.12	76.67	685	79,130	ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	130.21	183.67	3,018	348,408	ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	—	209.24	2,220	256,309	コンピュータ・周辺機器

銘柄	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株		百株	千アメリカ・ドル	千円	
UPSTART HOLDINGS INC	—		20.8	217	25,111	消費者金融
INGERSOLL RAND INC	312.82		405.29	2,180	251,668	機械
PAYCOM SOFTWARE INC	43.3		52.5	1,815	209,490	ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	—		177.12	1,109	128,076	自動車
PPD INC	108.28		—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
ASANA INC	—		71.34	489	56,535	ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	—		53.67	577	66,647	ソフトウェア
AON PLC	208.07		220.29	6,165	711,619	保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	—		547.34	656	75,808	消費者金融
BENTLEY SYSTEMS INC	—		160.02	624	72,086	ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	—		39.76	776	89,602	資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	—		92.04	402	46,423	情報技術サービス
IAC/INTERACTIVECORP	70.64		72.5	954	110,189	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	—		227.11	3,853	444,730	ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	100.21		119.15	1,386	160,062	ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	—		318.81	1,533	177,030	電力
ROYALTY PHARMA PLC	103.61		355.64	1,390	160,538	医薬品
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—		235.77	1,304	150,621	インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,128.66		1,248.58	1,876	216,598	医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—		218.14	1,771	204,518	ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	146.71		334.59	742	85,732	ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	28.05		203.94	5,937	685,283	情報技術サービス
DOORDASH INC	—		109.22	1,060	122,418	インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	—		91.44	155	17,973	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	50.42		218.59	2,684	309,870	通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—		371.77	2,439	281,616	各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	—		1,532.71	2,032	234,576	ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	344.11		367.14	3,957	456,805	専門サービス
FNFG GROUP	245.67		254.51	1,216	140,415	保険
MARVELL TECHNOLOGY INC	—		794.17	5,380	621,017	半導体・半導体製造装置
ROBINHOOD MARKETS INC	—		198.72	265	30,619	資本市場
LUCID GROUP INC	—		421.36	1,156	133,449	自動車
CATALENT INC	146.73		174.39	1,725	199,207	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	454.91		599.85	2,641	304,840	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	415.03		435.54	2,337	269,748	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57		34.57	529	61,119	ソフトウェア
WAYFAIR INC	55.43		69.59	989	114,224	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.07		174.12	2,889	333,468	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	37.41		43.07	2,351	271,369	ソフトウェア
QORVO INC	101.68		111.07	1,436	165,771	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	29.47		24.25	361	41,762	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	131.89		145.2	2,207	254,786	メディア
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18		—	—	—	化学
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	42.57		49.59	1,235	142,645	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	145.4		165.74	1,332	153,745	情報技術サービス
KORNIT DIGITAL LTD	—		49.78	489	56,485	機械
ETSY INC	102.37		117.13	1,670	192,850	インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	167.6		189.9	1,910	220,453	専門サービス
BLOCK INC	335.06		489.39	5,463	630,602	情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	477.57		506.8	4,019	463,981	化学
CARVANA CO	53.47		77.35	1,087	125,550	専門小売り

銘柄		期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC		182.96	215.37	1,227	141,640	飲料
TELADOC HEALTH INC		104.54	147.9	1,047	120,928	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO		227.78	262.97	1,204	138,981	容器・包装
KRAFT HEINZ CO		568.79	640.01	2,213	255,516	食品
NOVOCURE LTD		74.08	97.72	770	88,967	ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP		259.81	329.64	2,144	247,496	機械
WASTE CONNECTIONS INC		247.78	261.86	3,126	360,903	商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A		269	293.14	79,456	9,170,832	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO		1,162.57	1,231.01	2,076	239,694	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC		1,000.53	1,086.55	12,399	1,431,174	情報技術サービス
SEA LTD ADR		—	132.32	1,709	197,273	娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC		352.77	343.46	1,165	134,545	各種金融サービス
SUNRUN INC		100	162.13	366	42,291	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C		133.76	156.65	909	104,993	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C		267.96	280.94	76,022	8,774,501	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC		61.93	77.59	2,129	245,764	ソフトウェア
CABLE ONE INC		3.92	5.42	813	93,881	メディア
LINDE PLC		470.49	503.98	14,792	1,707,329	化学
ATHENE HOLDING LTD		118.47	—	—	—	保険
ROKU INC		95.87	119.01	1,892	218,432	娯楽
AVALARA INC		71.02	78.24	776	89,636	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC		129.32	124.76	7,584	875,421	メディア
VISTRA CORP		380.32	397.58	858	99,119	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	278,491.28 592銘柄	309,096.71 608銘柄	3,769,273 —	435,049,586 <67.7%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES LTD		205.78	455.67	3,042	275,894	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE TARD INC		784.79	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP		1,559.61	1,736.87	4,663	422,885	金属・鉱業
ATCO LTD		71.93	—	—	—	総合公益事業
BALLARD POWER SYSTEMS INC		—	212.72	251	22,780	電気設備
BANK OF MONTREAL		584.93	630.76	9,381	850,695	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA		1,094.36	1,191.19	11,020	999,374	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA		291.32	326	3,339	302,800	銀行
BCE INC		149.59	72.75	483	43,836	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT		1,159.24	1,379.3	9,951	902,415	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC		281.92	281.92	888	80,604	医薬品
SAPUTO INC		253.95	253.95	755	68,485	食品
BLACKBERRY LTD		466.71	466.71	409	37,158	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO		561.93	622.22	1,103	100,037	総合公益事業
CGI INC		198.59	229.85	2,458	222,955	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC		153.58	153.58	981	89,019	容器・包装
CAE INC		250.06	304.43	967	87,730	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP		326.27	346.76	959	87,006	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B		315.43	373.08	2,458	222,979	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		409.56	436.21	7,043	638,742	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		1,007.58	1,152.17	7,725	700,530	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A		48.62	58.89	1,068	96,912	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD		91.19	97.93	343	31,116	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO		634.82	691.09	10,810	980,316	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC		843.17	—	—	—	金属・鉱業

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

銘柄		期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		218.4	—	—	—	金属・鉱業
IVANHOE MINES LTD		—	619.3	699	63,402	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD		418.63	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD		506.3	555.64	5,191	470,751	化学
TFI INTERNATIONAL INC		—	89.99	1,223	110,963	陸運・鉄道
SSR MINING INC		180	—	—	—	金属・鉱業
LIGHTSPEED COMMERCE INC		—	113.46	415	37,676	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC		101.94	129.91	2,103	190,733	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC		122.78	116.6	947	85,939	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC		164.85	164.85	630	57,193	商業サービス・用品
NUVEI CORP		—	49.6	391	35,496	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP		108.45	108.45	477	43,290	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CANADA		107.22	179.4	434	39,433	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		251.76	264.43	1,922	174,299	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC		97.39	109.46	11,810	1,070,947	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP		35.03	32.93	636	57,700	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP		186.34	186.34	199	18,113	医薬品
HYDRO ONE LTD		273.4	357.38	1,151	104,448	電力
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	35,759.37 87銘柄	38,115.54 86銘柄	251,560 —	22,811,543 <3.5%>
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD		168.54	171.34	1,089	89,695	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT		2,577.13	2,757.53	7,776	640,061	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION		3,180.22	3,565.97	8,515	700,913	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,535.17	1,622.22	3,690	303,769	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD		3,644.09	3,896.81	1,582	130,223	各種電気通信サービス
AMP LTD		3,024.14	—	—	—	各種金融サービス
ASX LTD		191.62	189.26	1,569	129,172	資本市場
BHP GROUP LTD		2,637.49	3,064.96	14,812	1,219,254	金属・鉱業
AMPOL LTD		209.46	209.46	677	55,773	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT		380.4	516.04	1,189	97,947	情報技術サービス
CSL LIMITED		407.66	464.24	11,307	930,681	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD		57.45	58.28	789	64,970	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP		2,508.16	2,937.86	3,769	310,248	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD		526.93	—	—	—	飲料
COCHLEAR LTD		55.33	58.75	1,116	91,912	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		1,328.6	1,463.6	908	74,811	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,589.4	1,728.88	17,295	1,423,610	銀行
RIO TINTO LIMITED		338.59	359.15	4,366	359,410	金属・鉱業
APA GROUP		1,182.05	1,182.05	1,182	97,294	ガス
ARISTOCRAT LEISU		517.17	620.13	2,494	205,345	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT		2,251.8	2,694.3	1,271	104,674	保険
TPG TELECOM LTD		287.19	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		398.39	462.46	2,159	177,725	建設資材
ORICA LTD		413.11	413.11	608	50,052	化学
CIMIC GROUP LTD		87.09	—	—	—	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD		621.16	621.16	623	51,332	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD		496.93	469.46	882	72,606	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT		1,160.56	1,422.58	1,240	102,104	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD		298.21	337.36	6,552	539,312	資本市場
SUNCORP GROUP LTD		1,174.54	1,202.9	1,411	116,139	保険

銘 柄		期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		2,998.19	3,188.61	9,702	798,649	銀行
NEWCREST MINING LTD		732.02	868.79	2,059	169,478	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,978.95	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
QANTAS AIRWAYS LIMITED		622.82	1,074.83	570	46,977	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED		1,448.68	1,336.24	1,697	139,682	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		934.04	966.92	870	71,628	金属・鉱業
REECE LTD		—	303.19	605	49,811	商社・流通業
SANTOS LTD		1,596.18	3,333.93	2,573	211,848	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE		401.48	406.13	1,523	125,390	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD		84.06	247.11	655	53,940	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD		2,056.49	2,145.97	1,115	91,850	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD		1,015.75	1,094.81	5,897	485,443	複合小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD		861.96	906.41	2,486	204,645	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,117.03	1,204.4	4,084	336,163	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		99.95	155.53	283	23,337	資本市場
SEEK LTD		358.36	361.4	1,003	82,636	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD		—	60.86	615	50,664	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES		1,650.66	1,650.66	427	35,189	電力
AGL ENERGY LTD		490.76	—	—	—	総合公益事業
BRAMBLES LTD		1,271.66	1,300.28	1,224	100,818	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD		328.61	328.61	415	34,188	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD		1,409.64	1,502.3	594	48,967	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD		1,501.5	1,381.66	500	41,168	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD		576.67	759.03	806	66,411	飲料
XERO LTD		104.98	140.63	1,532	126,170	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD		—	228.52	627	51,650	各種消費者サービス
AFTERPAY LTD		183.22	—	—	—	情報技術サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA		—	1,195.74	749	61,710	食品・生活必需品小売り
MEDIBANK PVT LTD		2,831.54	2,831.54	900	74,114	保険
SOUTH32 LTD(AUD)		4,123.45	4,093.17	1,854	152,619	金属・鉱業
COLES GROUP LTD		1,210.32	1,227.26	2,002	164,857	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		136.04	136.04	621	51,116	ソフトウェア
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	65,373.59 58銘柄	66,920.43 55銘柄	146,885 —	12,090,177 <1.9%>	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH		329	—	—	—	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,640	1,640	2,692	39,827	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,038.6	—	—	—	銀行
CLP HOLDINGS LTD		1,345	1,620	12,935	191,319	電力
PCCW LTD		3,310	—	—	—	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		495	535	2,725	40,314	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		1,090.4	1,164.4	50,930	753,267	資本市場
MTR CORP		1,260	1,375	5,878	86,937	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD		657	758	12,726	188,229	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		1,154.5	1,204.5	4,185	61,905	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,345	1,460	7,285	107,751	電力
HONG KONG & CHINA GAS		9,132.92	11,754.56	14,223	210,358	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD		1,970	2,000	9,150	135,328	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,175	3,535	11,241	166,258	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,630.66	1,630.66	5,348	79,105	不動産管理・開発
SINO LAND CO		2,554	5,054	5,195	76,841	不動産管理・開発

銘柄	株数	当期首(前期末)	株数	期末		業種等
				評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,085	1,385	13,510	199,822	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC LTD A	495	495	2,393	35,397	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,285	1,320	17,608	260,434	機械	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,660	1,660	3,585	53,031	建設関連製品	
SJM HOLDINGS LTD	1,560	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
WYNN MACAU LTD	1,244	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	—	2,172	3,492	51,655	専門小売り	
AIA GROUP LTD	10,872.27	11,750.27	102,462	1,515,418	保険	
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	4,450	4,841	71,607	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	1,988	2,520	5,544	81,995	ホテル・レストラン・レジャー	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	—	1,330	4,176	61,765	海運業	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,188	32,363	不動産管理・開発	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,497.5	1,517.5	5,455	80,685	不動産管理・開発	
ESR CAYMAN LTD	1,474	2,038	5,319	78,670	不動産管理・開発	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,812	26,805	電力	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,506	1,506	3,471	51,340	飲料	
WH GROUP LTD	8,970	8,970	5,139	76,017	食品	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,553.32	2,563.32	15,315	226,521	コングロマリット	
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,248.32	1,863.32	9,745	144,130	不動産管理・開発	
小計	株数・金 銘柄数<比率>	76,797.49	82,613.53	350,582	5,185,109	
		33銘柄	30銘柄	—	<0.8%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,095	418	35,843	航空宇宙・防衛	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,557	1,766	6,569	562,942	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	259	22,270	不動産管理・開発	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	674	656	56,253	資本市場	
CAPITALAND LTD	3,088.15	—	—	—	不動産管理・開発	
GENTING SINGAPORE LTD	4,268	7,242	557	47,783	ホテル・レストラン・レジャー	
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,349	814	69,819	コングロマリット	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,716.53	3,209.53	4,281	366,882	銀行	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,768.22	8,084.22	2,061	176,647	各種電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,608.5	1,580.5	823	70,560	旅客航空輸送業	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,024	1,113	3,639	311,869	銀行	
UOL GROUP LIMITED	405	405	295	25,334	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	210	421	762	65,368	電子装置・機器・部品	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,814	1,814	823	70,570	食品	
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	—	2,952.15	1,068	91,575	不動産管理・開発	
小計	株数・金 銘柄数<比率>	27,111.4	32,069.4	23,033	1,973,722	
		14銘柄	14銘柄	—	<0.3%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,102.26	1,102.26	796	60,909	運送インフラ	
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	494.49	462	35,337	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
A2 MILK CO LTD	550.91	—	—	—	食品	
FISHER & PAYKEL	490.44	573.88	1,607	122,856	ヘルスケア機器・用品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	2,629.43	1,156	88,425	各種電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	357	27,319	電力	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,241.62	1,241.62	607	46,404	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小計	株数・金 銘柄数<比率>	5,897.74	6,659.02	4,988	381,252	
		7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	317.98	352.61	489	76,550	金属・鉱業	

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

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

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
NESTLE SA-REGISTERED		2,570.32	2,745.36	32,203	4,023,451	食品
CIE FINANC RICHEMONT		474.14	508.16	6,654	831,395	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		628.85	680.16	23,275	2,907,987	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		34.67	41.22	917	114,639	機械
SIKA INHABER		123.63	138.38	4,097	511,933	化学
SGS SA-REG		5.4	6.13	1,579	197,291	専門サービス
NOVARTIS AG-REG SHS		1,981.27	2,138.86	16,937	2,116,187	医薬品
BALOISE HOLDING AG -R		42.59	42.59	683	85,405	保険
BARRY CALLEBAUT AG		2.65	3.29	687	85,909	食品
CLARIANT AG-REG		199.79	199.79	335	41,935	化学
SWISSCOM AG-REG		24.89	24.19	1,325	165,621	各種電気通信サービス
ABB LTD		1,657.76	1,605.91	5,042	630,017	電気設備
ADECCO GROUP AG-REG		129.44	140.95	657	82,169	専門サービス
GEBERIT AG		31.81	35.39	2,109	263,528	建設関連製品
LONZA GROUP AG-REG		68.69	71.69	4,322	540,104	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDT & SPRUENGLI PART		0.95	1.1	1,108	138,533	食品
LINDT & SPRUENGLI NAMEN		0.09	0.1	1,031	128,813	食品
GIVAUDAN-REG		8.12	9.01	3,230	403,566	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		135.85	147.34	6,527	815,503	保険
ROCHE HOLDING AG-BEARER		—	36.04	1,338	167,235	医薬品
HOLCIM LTD		478.95	511.47	2,593	323,988	建設資材
TEMENOS GROUP		57.23	67.53	730	91,290	ソフトウェア
BACHEM HOLDING AG		—	5	252	31,547	ライフサイエンス・ツール/サービス
SONOVA HOLDING AG		46.98	52.1	1,661	207,583	ヘルスケア機器・用品
KUEHNE & NAGEL INTL AG		45.18	49.34	1,248	156,024	海運業
STRAUMANN HOLDING AG		9.19	11.25	1,553	194,109	ヘルスケア機器・用品
THE SWATCH GROUP AG-B		24.41	29.91	859	107,325	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		45.92	45.92	254	31,755	繊維・アパレル・贅沢品
SCHINDLER NAMEN		16.63	14.94	330	41,326	機械
SWISS LIFE HOLDING AG		27.61	30.53	1,806	225,737	保険
BANQUE CANTONALE VAUD		25	—	—	—	銀行
VIFOR PHARMA AG		46.45	52.56	856	107,039	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING		8.27	6.16	562	70,305	化学
SWISS PRIME SITE AG		83.37	80.4	717	89,653	不動産管理・開発
PARTNERS GROUP HOLDING AG		16.58	21.76	2,706	338,205	資本市場
JULIUS BAER GROUP LTD		201.18	210.08	1,222	152,707	資本市場
SWISS RE LTD		248.71	292.13	2,864	357,906	保険
ALCON INC		429.61	485.73	3,446	430,635	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG		3,314.28	3,427.79	6,535	816,493	資本市場
VAT GROUP AG		—	24.12	819	102,400	機械
小 計	株 数 銘 柄 数<比率>	15,648.45 39銘柄	16,704.59 41銘柄	148,505 —	18,554,267 <2.9%>	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
CARLSBERG AS-B		99.74	104.57	10,765	188,826	飲料
A P MOLLER A/S		5.68	5.27	11,936	209,367	海運業
AP MOLLER MAERSK A		2.55	3.41	7,311	128,235	海運業
DANSKE BANK A/S		593.05	687.25	9,002	157,912	銀行
GENMAB A/S		61.9	62.51	13,745	241,103	バイオテクノロジー
NOVOZYMES-B SHS		177.4	191.32	7,444	130,572	化学
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS		8.13	8.13	1,990	34,908	建設関連製品
NOVO NORDISK A/S-B		1,540.44	1,640.82	105,521	1,850,840	医薬品

銘柄	株数	当	期 末		業 種 等
			評 価	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
GN STORE NORD A/S	128.95	104.48	3,823	67,072	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	181.27	979.91	15,952	279,814	電気設備
COLOPLAST-B	107.34	119.22	10,925	191,630	ヘルスケア機器・用品
DSV A/S	190.49	198.61	25,044	439,284	航空貨物・物流サービス
DEMANT A/S	107.39	107.39	2,870	50,349	ヘルスケア機器・用品
H LUNDBECK A/S	48.4	—	—	—	医薬品
TRYG A/S	111.07	357.84	5,439	95,403	保険
PANDORA A/S	82.51	92.65	6,650	116,648	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	93.36	89.84	4,288	75,228	化学
AMBU A/S B	141.56	141.56	1,705	29,919	ヘルスケア機器・用品
ORSTED A/S	164.71	192.05	12,586	220,775	電力
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,845.94 19銘柄	5,086.83 18銘柄	257,006 —	4,507,892 <0.7%>
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	435.37	432.02	10,161	132,094	食品
DNB ASA	807.09	—	—	—	銀行
NORSK HYDRO ASA	1,290.36	1,290.36	9,984	129,802	金属・鉱業
TELENOR ASA	630.38	674.35	9,258	120,364	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	75.37	75.37	1,746	22,702	メディア
ORKLA ASA	652.83	694.4	5,862	76,207	食品
EQUINOR ASA	831.49	943.06	25,816	335,611	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	151.93	151.93	6,730	87,496	化学
AKER BP ASA	—	152.17	4,129	53,688	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	294.84	6,262	81,411	保険
ADEVINTA ASA	222.65	222.65	1,847	24,023	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	—	895.96	19,003	247,043	銀行
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	1,514	19,686	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,338.75 11銘柄	5,901.56 12銘柄	102,317 —	1,330,132 <0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	564.89	636.97	31,695	389,856	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	360.51	401.9	17,474	214,937	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,649.68	2,794.5	32,175	395,763	通信機器
GETINGE AB-B SHS	—	244.21	8,667	106,604	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	—	557.33	11,531	141,833	各種金融サービス
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,471	42,702	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	348.49	322.28	6,055	74,484	機械
SANDVIK AB	1,034	1,143.71	26,637	327,635	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,449.9	1,664.38	20,072	246,890	銀行
SKANSKA AB-B SHS	316.53	319.68	7,624	93,779	建設・土木
SWEDBANK AB	798.25	893.78	15,061	185,262	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	529.45	543.82	8,807	108,328	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,392.3	1,340.2	12,981	159,668	銀行
VOLVO AB-A SHS	—	236.91	5,041	62,009	機械
VOLVO AB-B SHS	1,305.9	1,342.82	28,320	348,336	機械
SWEDISH MATCH AB	138.45	1,583.29	11,026	135,620	タバコ
TELE2 AB-B SHS	470.55	460.83	6,020	74,055	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	119.55	142.73	4,104	50,490	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	119.4	3,371	41,473	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	252.19	4,546	55,927	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	483.54	5,751	70,746	商業サービス・用品

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

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

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BNP PARIBAS	1,017.91	1,099.14	6,787	886,135	銀行
THALES SA	105.13	104.48	867	113,301	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	149.12	155.19	2,996	391,251	情報技術サービス
NATIXIS	701.66	—	—	—	資本市場
EIFFAGE	84.65	84.77	813	106,248	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	185.95	253.45	1,604	209,462	メディア
FAURECIA	61.17	107.74	445	58,165	自動車部品
L'OREAL	224.47	245.54	8,670	1,131,957	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	248.73	270.69	18,136	2,367,866	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	708.07	345	45,094	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	148.02	162.26	2,348	306,648	自動車部品
PERNOD-RICARD	190.38	204.47	3,890	507,883	飲料
RENAULT SA	190.19	190.19	653	85,382	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.47	324	42,369	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	445.6	491.74	2,981	389,254	建設関連製品
SEB SA	22.18	24.39	328	42,925	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	695.95	788.64	2,665	347,969	銀行
VINCI S.A.	472.57	523.44	5,236	683,676	建設・土木
SODEXO	91.78	93.25	788	102,925	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	483.76	528.92	7,517	981,420	電気設備
VIVENDI SE	709.95	687.46	805	105,147	メディア
TOTALENERGIES SE	2,258.11	2,445.35	12,503	1,632,401	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	196.53	253.93	646	84,440	自動車部品
ORANGE	1,840.93	1,917.27	2,086	272,396	各種電気通信サービス
HERMES INTL	28.8	30.76	3,649	476,501	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	121.83	645.96	2,601	339,665	ソフトウェア
KERING	68.27	72.93	4,493	586,729	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	305	39,864	保険
CARREFOUR SA	499.26	611.89	1,052	137,447	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	89.72	—	—	—	情報技術サービス
SANOFI	1,014.54	1,108.56	10,220	1,334,443	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	76.86	71.51	360	47,092	娯楽
TELEPERFORMANCE	53.12	59.18	1,896	247,558	専門サービス
EURAZEO	52.29	30.08	212	27,687	各種金融サービス
ESSILORLUXOTTICA	249.84	278.64	4,582	598,292	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	986.85	1,149.26	1,558	203,464	銀行
ORPEA	49.32	49.32	182	23,850	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	22.2	206	26,926	各種金融サービス
ILIAD SA	10.46	—	—	—	各種電気通信サービス
BIOMERIEUX	32.48	46.12	466	60,846	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	23.87	24.56	865	112,998	ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,660.61	1,774.63	2,537	331,278	総合公益事業
ALSTOM	217.79	285.33	733	95,739	機械
ELECTRICITE DE FRANCE	547.78	415.49	338	44,134	電力
IPSEN SA	36.46	36.46	340	44,450	医薬品
ARKEMA SA	63.93	60.09	750	97,988	化学
LEGRAND SA	238.06	259.78	2,216	289,378	電気設備
ADP	23.13	23.13	299	39,061	運送インフラ
SCOR SE	156.67	—	—	—	保険
BUREAU VERITAS SA	298.1	298.1	730	95,392	専門サービス
GETLINK	376.46	415.25	574	75,006	運送インフラ

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	総合公益事業 情報技術サービス ホテル・レストラン・レジャー 情報技術サービス 資本市場
SUEZ SA		266.2	—	—	—	
EDENRED		214.88	248.65	953	124,530	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		80.92	80.92	292	38,213	
WORLDLINE SA		223.86	235.7	1,071	139,955	
AMUNDI SA		59.24	59.24	402	52,555	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	23,068.91 64銘柄	24,298.59 59銘柄	150,074 —	19,593,711 <3.0%>	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	繊維・アパレル・贅沢品 自動車 銀行 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス 各種電気通信サービス 化学 保険 機械 自動車部品 航空貨物・物流サービス 自動車 医薬品 総合公益事業 ソフトウェア 総合公益事業 家庭用品 コングロマリット 繊維・アパレル・贅沢品 医薬品 家庭用品 自動車 化学 パーソナル用品 建設・土木 建設資材 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス 保険 旅客航空輸送業 保険 自動車 自動車 ソフトウェア 資本市場 自動車 各種電気通信サービス ヘルスケア機器・用品 半導体・半導体製造装置 機械 ヘルスケア機器・用品 情報技術サービス 資本市場 化学 航空宇宙・防衛
ADIDAS AG		172.02	184.33	4,260	556,288	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		312.17	329.21	3,048	397,967	
COMMERZBANK AG		831.18	1,062.15	910	118,885	
FRESENIUS SE & CO KGAA		390.3	388.3	1,420	185,447	
UNITED INTERNET		98.82	98.82	340	44,460	
FUCHS PETROLUB SE PREF		55.46	55.46	203	26,631	
HANNOVER RUECK SE		48.68	53.21	913	119,281	
GEA GROUP AG		118.38	164.92	670	87,484	
CONTINENTAL AG		103.36	97.95	859	112,243	
DEUTSCHE POST AG-REG		869.75	959.37	4,912	641,432	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD		126.49	159.12	1,360	177,582	
MERCK KGAA		118.74	123.64	2,176	284,187	
RWE AG		592.73	644.26	2,352	307,186	
SAP SE		934.54	1,015.97	10,706	1,397,813	
E.ON SE		2,098.42	2,086.41	2,491	325,247	
HENKEL AG & CO KGAA		86.02	103.66	730	95,345	
SIEMENS AG-REG		686.52	746.31	10,411	1,359,263	
PUMA AG		92.39	104.48	918	119,876	
BAYER AG		887.08	948.61	5,005	653,559	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		162.41	175	1,286	167,978	
MERCEDES-BENZ GROUP AG		780.56	827.56	6,149	802,891	
BASF SE		832.15	895.92	5,953	777,274	
BEIERSDORF AG		83.71	103.42	904	118,120	
HOCHTIEF AG		17.07	—	—	—	
HEIDELBERGCEMENT AG		145.71	140.32	900	117,542	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO		201.91	188.36	1,089	142,192	
ALLIANZ SE		375.04	401.57	8,959	1,169,690	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		279.9	702.48	512	66,943	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		123.01	135.09	3,547	463,156	
VOLKSWAGEN AG		27.58	31.53	757	98,962	
VOLKSWAGEN AG PFD		163.61	179.03	3,270	427,045	
NEMETSCHEK SE		50.95	48.41	370	48,414	
DEUTSCHE BANK AG-REG		1,659.49	2,132.85	2,963	386,954	
BMW VORZUG		41.16	69.57	539	70,439	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		2,993.58	3,241.17	5,619	733,687	
SARTORIUS AG		30.44	26.86	1,104	144,166	
INFINEON TECHNOLOGIES AG		1,188.79	1,266.18	4,111	536,769	
RATIONAL AG		4.79	4.79	326	42,613	
CARL ZEISS MEDITEC AG		37.71	35.01	461	60,267	
BECHTLE AG		25.11	75.33	354	46,303	
DEUTSCHE BOERSE AG		167.52	196.7	3,101	404,991	
LANXESS AG		68.56	71.94	371	48,559	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG		48.73	48.07	931	121,660	

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

銘 柄	期 首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	975.69	1,117.77	2,051	267,865	保険
INTESA SANPAOLO	15,123.69	15,981.58	4,422	577,349	銀行
UNICREDIT SPA	1,939.1	2,056.36	3,089	403,415	銀行
ENI SPA	2,193.31	2,418.13	3,221	420,653	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	574.42	574.42	583	76,233	銀行
ENEL SPA	7,299.44	7,880.51	4,980	650,251	電力
SNAM SPA	1,712.94	1,989.63	944	123,310	ガス
TELECOM ITALIA SPA	7,626.75	8,325.8	343	44,893	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	—	—	—	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	452.99	457.18	739	96,547	運送インフラ
TERNA SPA	1,136.54	1,671.4	1,106	144,460	電力
RECORDATI SPA	103.03	103.03	461	60,236	医薬品
AMPLIFON SPA	113.72	113.72	395	51,579	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	223.28	218.22	600	78,463	電気設備
DIASORIN SPA	22.23	22.23	266	34,755	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	175.67	228.55	1,244	162,446	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	430.97	435.86	551	71,957	情報技術サービス
FINECOBANK SPA	538.18	652.74	1,011	132,008	銀行
POSTE ITALIANE SPA	400.15	557.49	601	78,572	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	233.44	232.81	206	26,979	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	
	46,251.5 20銘柄	45,037.43 19銘柄	26,822 —	3,501,981 <0.5%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	240.85	238.04	630	82,358	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	349.35	486.12	496	64,832	機械
UPM-KYMMENE OYJ	448.29	559.82	1,837	239,881	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	532.5	555.48	1,009	131,811	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	448.22	499.85	2,214	289,103	保険
FORTUM OYJ	394.09	408.2	962	125,615	電力
NOKIA OYJ	5,185.32	5,106.9	2,489	325,043	通信機器
ELISA OYJ	136.42	136.42	691	90,266	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	367.96	432.9	1,627	212,456	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	298.9	319.56	1,750	228,551	機械
ORION OYJ	80.51	81.06	281	36,797	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	
	8,482.41 11銘柄	8,824.35 11銘柄	13,991 —	1,826,718 <0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	128.17	170.07	951	124,255	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	69.24	69.16	650	84,877	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	98.75	301	39,426	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	242.04	315.46	1,319	172,324	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	179.11	195.72	509	66,489	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	
	717.31 5銘柄	849.16 5銘柄	3,732 —	487,372 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	
	974,571.62 1,224銘柄	1,063,294.07 1,228銘柄	— —	598,417,771 <93.1%>	

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

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

(2) 外国新株予約権証券

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

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘 柄	期 首 (前期末)		当 期 末		
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
不動産ファンド (アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12.006	13.788	2,531	292,214	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	12.947	14.801	1,730	199,789	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	22.693	—	—	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127.559	150.15	1,079	124,604	0.0
PROLOGIS INC	66.35	72.03	10,468	1,208,313	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12.329	13.356	3,180	367,120	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	9.643	10.44	1,691	195,243	0.0
EQUINIX INC	7.992	8.702	5,824	672,315	0.1
DUKE REALTY TRUST	31.929	35.306	1,925	222,292	0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	38.831	42.028	7,043	812,909	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.504	6.132	1,939	223,898	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	35.108	34.397	2,955	341,111	0.1
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45.543	49.946	1,603	185,049	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	9.838	10.551	3,263	376,725	0.1
WELLTOWER INC	38.411	40.744	3,246	374,661	0.1
IRON MOUNTAIN INC	24.591	28.44	1,241	143,283	0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16.087	16.573	1,268	146,429	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	63.952	75.616	1,355	156,485	0.0
MID AMERICA	10.854	11.699	2,428	280,294	0.0
REALTY INCOME CORP	29.466	53.267	3,563	411,244	0.1
REGENCY CENTERS CORP	14.499	14.665	955	110,292	0.0
UDR INC	27.057	28.289	1,544	178,308	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	28.083	31.871	4,458	514,629	0.1
PUBLIC STORAGE	13.834	15.276	5,432	627,048	0.1
SUN COMMUNITIES INC	9.67	11.066	2,093	241,678	0.0
VENTAS INC	35.021	40.408	2,022	233,474	0.0
VORNADO REALTY TRUST	12.714	15.123	616	71,111	0.0
WEYERHAEUSER CO	64.096	72.184	2,953	340,840	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	12.385	13.998	2,718	313,775	0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	23.492	27.36	3,724	429,915	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	53.911	54.08	1,123	129,706	0.0
AGNC INVESTMENT CORP	46.028	44.32	607	70,132	0.0
VEREIT INC	20.534	—	—	—	—
AMERICAN TOWER CORP	39.736	44.301	10,379	1,197,976	0.2
WP CAREY INC	15.529	19.446	1,474	170,174	0.0

銘 柄		期 首(前期末)	当 期			末	
		口 数	口 数	外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	比 率	
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
INVITATION HOMES INC		50.475	55.207	2,285	263,800	0.0	
VICI PROPERTIES INC		47.083	57.882	1,629	188,129	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,135.78 37銘柄<1.8%>	1,233.442 35銘柄<1.8%>	102,365 —	11,814,981 —	— 1.8	
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
CANADIAN APT PPTYS REIT		7.954	8.22	456	41,361	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		13.467	13.467	319	28,966	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	21.421 2銘柄<0.0%>	21.687 2銘柄<0.0%>	775 —	70,328 —	— 0.0	
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%	
MIRVAC GROUP		329.418	414.125	1,031	84,875	0.0	
GPT GROUP		158.232	207.292	1,048	86,334	0.0	
STOCKLAND		194.018	243.481	954	78,560	0.0	
DEXUS		108.972	101.202	1,028	84,632	0.0	
GOODMAN GROUP		148.357	158.185	3,609	297,121	0.0	
VICINITY CENTRES		371.711	371.711	631	52,012	0.0	
SCENTRE GROUP		420.268	479.376	1,414	116,399	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,730.976 7銘柄<0.1%>	1,975.372 7銘柄<0.1%>	9,718 —	799,936 —	— 0.1	
(香港)		千口	千口	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT		200.2	199.7	13,280	196,411	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	200.2 1銘柄<0.0%>	199.7 1銘柄<0.0%>	13,280 —	196,411 —	— 0.0	
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		483.636	545.177	1,117	95,768	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT		292.606	248.606	703	60,287	0.0	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		192.1	—	—	—	—	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		270.1	484.5	838	71,824	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		192.3	192.3	348	29,825	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,430.742 5銘柄<0.1%>	1,470.583 4銘柄<0.0%>	3,007 —	257,705 —	— 0.0	
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC		69.819	75.77	407	63,737	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC		55.843	74.028	583	91,233	0.0	
SEGRO PLC		100.956	120.36	1,486	232,242	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	226.618 3銘柄<0.1%>	270.158 3銘柄<0.1%>	2,478 —	387,213 —	— 0.1	
(フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円	%	
GECINA SA		3.67	4.763	530	69,212	0.0	
KLEPIERRE		17.099	17.099	404	52,819	0.0	
COVIVIO		4.663	4.663	337	44,077	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12.92	12.92	884	115,480	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	38.352 4銘柄<0.0%>	39.445 4銘柄<0.0%>	2,156 —	281,590 —	— 0.0	
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	4,784.089 59銘柄<2.1%>	5,210.387 56銘柄<2.1%>	— —	13,808,167 —	— 2.1	

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		期末	
		買建額	売建額	買建額	売建額
外国	S & P 5 0 0 E M I N I F U T	8,545			百万円
	S & P / T S E 6 0 I X F U T	421			百万円
	S P I 2 0 0 F U T U R E S	264			百万円
	F T S E 1 0 0 I N D E X F U T U R E	536			百万円
	D J E U R O S T O X X 5 0	1,772			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

2022年2月15日現在

項目	当期		期末	
	評価額	比率	評価額	比率
株式	598,417,771	92.9		%
投資信託受益証券、投資証券	13,808,167	2.1		
コール・ローン等、その他	31,698,088	4.9		
投資信託財産総額	643,924,027	100.0		

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、642,251,567千円、99.7％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.42円、1カナダ・ドル＝90.68円、1オーストラリア・ドル＝82.31円、1香港・ドル＝14.79円、1シンガポール・ドル＝85.69円、1ニュージーランド・ドル＝76.43円、1イギリス・ポンド＝156.24円、1イスラエル・シェケル＝35.452円、1スイス・フラン＝124.94円、1デンマーク・クローネ＝17.54円、1ノルウェー・クローネ＝13.00円、1スウェーデン・クローナ＝12.30円、1ユーロ＝130.56円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年2月15日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資 産	産 等	663,074,590,376円
コ ー ル ・ 口 ー ン	式(評価額)	8,092,389,228
株 投 資 信 託 受 益 証	券(評価額)	598,417,771,479
投 資 信 資 証	券(評価額)	1,057,641,470
未 収 入 当	金 金	12,750,525,590
差 入 収 配 託 証 当 拠	金 金	37,918,383,393
(B) 負 債	債 金	461,392,808
未 払 解 約	金 金	4,376,486,408
未 払 解 約	金 金	20,432,094,210
(C) 純 資 産 総 額(A - B)		20,346,719,210
元 次 期 繰 越 損 益	金 金	85,375,000
(D) 受 益 権 越 損 益	金 金	113,101,593,550
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	数	529,540,902.616
		113,101,593,550口
		56,820円

(注1)	期首元本額	101,430,005,374円
	追加設定元本額	93,876,718,442円
	一部解約元本額	82,205,130,266円
(注2)	期末における元本の内訳	
	D I A M外国株式バッシブ・ファンド	3,311,871,905円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,512,255円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,337,563円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	57,023,138円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	20,046,091円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	11,721,611円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	11,183,927円
	たわらノーロード 先進国株式	29,209,837,872円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	379,011,003円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,783,685,914円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	582,139,859円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	67,491,775円
	たわらノーロード バランス (標準型)	540,044,742円
	たわらノーロード バランス (積極型)	666,401,105円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	881,601円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	148,165,312円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	439,640,001円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	332,155,340円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	491,044,760円
	たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,241,327円
	たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	18,750,438円
	たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,399,492円
	たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,200,746円
	たわらノーロード 全世界株式	228,421,540円
	D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,140,481,555円
	One DC 先進国株式インデックスファンド	2,232,942,901円
	One グローバルバランス	2,978,639円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1 安定型	152,382,039円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	773,961,717円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3 成長型	1,005,264,576円
	D I A M DC バランス30インデックスファンド	95,122,258円
	D I A M DC バランス50インデックスファンド	265,971,133円
	D I A M DC バランス70インデックスファンド	248,725,315円
	メネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	20,541,627円
	メネックス資産設計ファンド (育成型)	686,570,224円
	メネックス資産設計ファンド エボリューション	133,496,490円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	172,284,428円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	172,035,194円
	D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	304,995,876円
	投資のソムリエ	4,886,217,076円
	グルースコントロール	36,245,544円
	投資のソムリエ<DC年金>	294,714,139円
	D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	187,167,284円
	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	142,899,507円
	D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	31,756,762円
	D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	1,000,259円
	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	162,957,398円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,118,793,304円

ワールドアセットバランス (基本コース)	203,026,933円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	434,831,464円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	26,209,400円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	12,968,412円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,345,477円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	39,369,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	95,606,011円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	361,901,590円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,502,748円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	25,023,763円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	11,301,608円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	9,568,065円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	29,534,589円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	622,063円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	126,295円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	83,555円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	1,732,862円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	13,744円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家限定)	557,287円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 21-06	57,490,733円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	75,883円
M S C I コクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	958,242,351円
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	63,352,968円
D I A M外国株式バッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,191,786,446円
D I A M先進国株式バッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,189,774,417円
外国株式バッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,052,411,163円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	73,837,834円
D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定)	8,226,089円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	206,917円
リスクコントロール世界8資産(フランスファンド (F O F 5 用) (適格機関投資家専用)	2,898,910円
D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	31,546,987円
D I A Mグローバル・バランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	56,354,600円
D I A M国際分散(フランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	2,722,727円
D I A M国際分散(フランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	22,177,017円
D I A M国内重視(フランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	1,568,925円
D I A M国内重視(フランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	489,870円
D I A M世界(フランスファンド40 V A (適格機関投資家限定)	3,953,136円
D I A M世界(フランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	28,909,778円
D I A M(フランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	204,390,999円
D I A M(フランスファンド37.5 V A (適格機関投資家限定)	306,392,875円
D I A M(フランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	998,858,127円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	86,555,947円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	51,952,941円
D I A M アサ グローバル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	332,991,420円
D I A M世界アセット(フランスファンドV A (適格機関投資家向け)	13,689,728円
D I A M世界(フランスファンド55 V A (適格機関投資家限定)	3,498,398円
D I A M世界アセット(フランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	128,366,149円
D I A M世界アセット(フランスファンド40 V A (適格機関投資家限定)	11,208,160円
D I A M世界アセット(フランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	40,455,375円
D I A M世界アセット(フランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	63,324,997円
D I A M世界アセット(フランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	130,176,054円
期末元本合計	113,101,593,550円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月15日

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

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

《お知らせ》

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

(2021年12月21日)

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16期（決算日 2022年6月6日）

（計算期間 2021年6月8日～2022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16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	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 指 数 比 率	純 資 産 額
	円	期 中 騰 落 率	(配当込み) ポイント	期 中 騰 落 率			
12期（2018年6月6日）	18,181	3.1	3,386.35	3.1	97.8	1.7	35,462
13期（2019年6月6日）	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154
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

（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

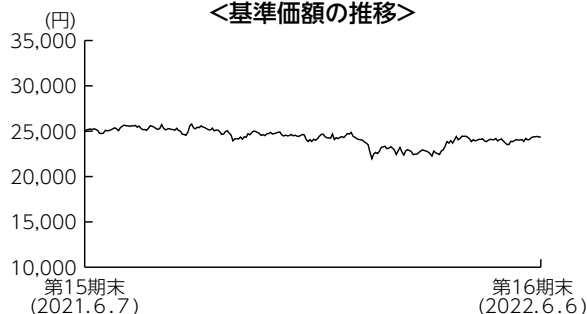
年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数 (配当込み) (ベンチマーク)		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021 年 6 月 7 日	円	%	ポイント	%	%	%
	24,869	—	4,660.79	—	97.6	2.2
6 月 末	25,249	1.5	4,732.24	1.5	97.6	2.2
7 月 末	25,437	2.3	4,767.40	2.3	98.8	1.2
8 月 末	25,373	2.0	4,755.00	2.0	98.2	1.7
9 月 末	24,579	△1.2	4,605.71	△1.2	95.8	2.4
10 月 末	24,872	0.0	4,660.54	△0.0	97.8	2.2
11 月 末	23,858	△4.1	4,470.13	△4.1	90.7	2.4
12 月 末	24,686	△0.7	4,624.94	△0.8	97.8	2.2
2022 年 1 月 末	23,340	△6.1	4,372.24	△6.2	97.4	2.5
2 月 末	22,657	△8.9	4,243.65	△8.9	97.3	2.6
3 月 末	24,221	△2.6	4,536.64	△2.7	97.5	2.4
4 月 末	23,935	△3.8	4,483.12	△3.8	92.3	2.4
5 月 末	24,363	△2.0	4,563.32	△2.1	97.3	2.6
(期 末) 2022 年 6 月 6 日	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3

(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（2021年6月8日から2022年6月6日まで）

＜基準価額の推移＞



基準価額の推移

当期末の基準価額は24,389円となり、前期末比で1.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

インフレ懸念を背景とした米国の金融引き締め加速への警戒感や世界的な長期金利の上昇などから東証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。期の前半は長期金利の低位安定と相対的に高い配当利回りに注目した資金流入などを背景に堅調に推移していましたが、その後は公募増資による需給悪化懸念などにより上値の重い展開となりました。後半に入ると、米国の金融引き締め加速などへの警戒感から調整する局面もありましたが、期末にかけては日銀の金融緩和姿勢維持、新型コロナウイルスのまん延防止等重点措置解除、外国人観光客の入国規制緩和報道などからやや値を戻しました。

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2.0%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)	1円 (0)	0.003% (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)	(1)	(0.002)	
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は24,325円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月8日から2022年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
	千口	千円		千円	千口	千円		千円
国内								
エスコンジャパンリート投資法人	6.445	908,630			4.145	564,705		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
サンケイリアルエステート投資法人	10.171	1,246,519			6.459	742,665		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
S O S I L A 物流リート投資法人	15.036	2,470,185			8.857	1,421,183		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
東海道リート投資法人	2.916	328,060			1.573	171,150		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
日本アコモデーションファンド投資法人	10.755	6,938,240			7.296	4,612,569		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
森ヒルズリート投資法人	36.655	5,780,543			24.881	3,701,548		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
産業ファンド投資法人	44.19	9,054,056			29.941	5,900,481		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
アドバンス・レジデンス投資法人	31.297	11,328,675			20.918	7,288,268		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	22.034	4,924,796			14.619	3,083,776		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
アクティビア・プロパティーズ投資法人	16.738	7,748,557			11.166	4,729,881		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
G L P 投資法人	101.462	18,894,832			68.202	12,402,848		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	14.234	4,834,233			9.463	3,081,956		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
日本プロロジスリート投資法人	50.834	18,357,708			34.051	12,361,202		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
星野リゾート・リート投資法人	5.226	3,589,786			3.433	2,267,405		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
One リート投資法人	5.253	1,639,088			3.384	997,445		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
イオンリート投資法人	37.466	5,903,228			24.481	3,659,415		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
ヒューリックリート投資法人	29.329	5,210,000			19.213	3,218,632		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
日本リート投資法人	9.815	4,160,973			6.85	2,765,100		
	(-)	(-)			(-)	(-)		
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	91.241	2,070,962			139.141	3,156,012		
	(-)	(-)			(-)	(-)		

	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		94.815		8,336,334		63.737		5,281,290
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		6.667		915,689		4.67		615,424
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		12.429		3,614,914		8.423		2,341,576
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		7.36		1,134,365		4.671		706,878
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		7.147		903,361		4.624		565,039
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		100.834		17,143,184		68.482		11,021,949
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		5.272		485,596		3.684		312,470
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		38.003		7,098,551		25.646		4,706,781
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		33.349		2,078,792		22.966		1,373,192
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		3.553		475,972		2.205		287,513
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		12.071		7,118,255		7.792		4,507,353
		(-)		(-)		(-)		(-)
大江戸温泉リート投資法人		5.031		393,948		3.417		244,968
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		37.702		1,987,584		24.594		1,256,245
		(-)		(-)		(-)		(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人		7.386		996,245		4.902		612,429
		(-)		(-)		(-)		(-)
三菱地所物流リート投資法人		8.741		4,213,761		5.541		2,611,455
		(-)		(-)		(-)		(-)
C R E ロジスティクスファンド投資法人		12.336		2,525,598		7.954		1,634,581
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		4.999		611,499		3.323		390,695
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		12.651		1,521,341		7.998		921,597
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人		12.135		1,954,846		8.219		1,319,609
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		36.124		25,428,950		24.156		16,411,837
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		31.182		21,023,426		21.178		13,581,977
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		156.564		17,207,488		105.6		10,606,437
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		62.129		12,088,815		42.196		7,622,256
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		21.282		8,882,224		13.988		5,482,023
		(-)		(-)		(-)		(-)
N T T 都市開発リート投資法人		29.99		4,740,285		19.983		3,006,886
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		20.91		4,116,189		14.203		2,638,050
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		21.595		2,610,692		14.811		1,709,256
		(-)		(-)		(-)		(-)
ユナイテッド・アーバン投資法人		70.453		10,570,416		47.083		6,646,022
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
森トラスト総合リート投資法人	22.288 (-)	3,354,263 (-)	15.138 (-)	2,160,020 (-)
インヴィンシブル投資法人	137.746 (-)	5,793,937 (-)	92.055 (-)	3,654,156 (-)
フロンティア不動産投資法人	11.014 (-)	5,602,506 (-)	7.365 (-)	3,594,447 (-)
平和不動産リート投資法人	20.777 (-)	3,355,067 (-)	13.69 (-)	2,067,239 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	20.853 (-)	6,919,284 (-)	13.95 (-)	4,495,685 (-)
福岡リート投資法人	16.127 (-)	2,846,543 (-)	10.953 (-)	1,800,359 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	9.646 (-)	7,224,561 (-)	6.551 (-)	4,619,046 (-)
いちごオフィスリート投資法人	25.548 (-)	2,372,398 (-)	17.35 (-)	1,487,895 (-)
大和証券オフィス投資法人	6.585 (-)	4,953,141 (-)	4.482 (-)	3,236,468 (-)
阪急阪神リート投資法人	14.088 (-)	2,264,248 (-)	9.57 (-)	1,472,807 (-)
スターツプロシード投資法人	4.858 (-)	1,178,307 (-)	3.3 (-)	769,149 (-)
大和ハウスリート投資法人	47.036 (-)	15,472,383 (-)	31.452 (-)	10,149,811 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	97.424 (-)	6,309,714 (-)	67.966 (-)	4,153,483 (-)
大和証券リビング投資法人	42.193 (-)	4,957,843 (-)	28.333 (-)	3,203,570 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	28.87 (-)	4,164,397 (-)	19.772 (-)	2,621,059 (-)

(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	百万円	百万円	百万円
		18,774	15,886	—	—

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2021年6月8日から2022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 362,336	百万円 422	% 0.1	百万円 234,027	百万円 21,734	% 9.3

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 15,547

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

■組入資産の明細

(1) 国内投資証券

銘	柄	期首(前期末)	当 期			末
		□ 数	□ 数	評 価	額	比 率
不動産ファンド		千□	千□	千円		%
エスコンジャパンリート投資法人		1.232	3.532	474,347		0.2
サンケイリアルエステート投資法人		1.844	5.556	548,932		0.3
S O S I L A物流リート投資法人		1.982	8.161	1,260,058		0.6
東海道リート投資法人		—	1.343	159,145		0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		2.598	6.057	4,058,190		2.0
森ヒルズリート投資法人		8.854	20.628	3,139,581		1.6
産業ファンド投資法人		10.655	24.904	4,674,480		2.3
アドバンス・レジデンス投資法人		7.16	17.539	6,314,040		3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		5.137	12.552	2,688,638		1.3
アクティビア・プロパティーズ投資法人		3.777	9.349	3,870,486		1.9
G L P 投資法人		23.554	56.814	9,584,521		4.8
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		3.389	8.16	2,762,160		1.4
日本フロロジスリート投資法人		11.917	28.7	9,987,600		5.0
星野リゾート・リート投資法人		1.147	2.94	2,043,300		1.0
O n e リート投資法人		1.175	3.044	851,711		0.4
イオンリート投資法人		7.645	20.63	3,177,020		1.6
ヒューリックリート投資法人		6.249	16.365	2,654,403		1.3
日本リート投資法人		2.448	5.413	2,054,233		1.0
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		47.9	—	—		—
積水ハウス・リート投資法人		22.17	53.248	4,259,840		2.1
トーセイ・リート投資法人		1.668	3.665	489,644		0.2
ケネディクス商業リート投資法人		2.998	7.004	1,948,512		1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		1.608	4.297	697,832		0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		1.451	3.974	551,193		0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		24.375	56.727	9,552,826		4.8
いちごホテルリート投資法人		1.318	2.906	285,078		0.1
ラサールロジポート投資法人		9.118	21.475	3,841,877		1.9
スターアジア不動産投資法人		7.745	18.128	1,114,872		0.6
マリモ地方創生リート投資法人		0.706	2.054	281,192		0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		2.631	6.91	3,821,230		1.9
大江戸温泉リート投資法人		1.217	2.831	201,567		0.1
投資法人みらい		8.141	21.249	1,075,199		0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		1.632	4.116	548,662		0.3
三菱地所物流リート投資法人		1.896	5.096	2,377,284		1.2
C R E ロジスティクスファンド投資法人		2.412	6.794	1,387,334		0.7
ザイマックス・リート投資法人		1.155	2.831	363,783		0.2
タカラレーベン不動産投資法人		2.265	6.918	821,166		0.4

銘柄		期首(前期末)	当期			期末
		□数	□数	評価額	比率	
不動産ファンド		千□	千□	千円	%	
アドバンス・ロジスティクス投資法人		2.924	6.84	1,093,716	0.5	
日本ビルファンド投資法人		8.483	20.451	14,602,014	7.3	
ジャパンリアルエステイト投資法人		7.538	17.542	11,279,506	5.6	
日本都市ファンド投資法人		37.545	88.509	9,417,357	4.7	
オリックス不動産投資法人		15.019	34.952	6,431,168	3.2	
日本プライムリアルティ投資法人		4.693	11.987	4,962,618	2.5	
N T T 都市開発リート投資法人		6.808	16.815	2,525,613	1.3	
東急リアル・エステート投資法人		5.054	11.761	2,269,873	1.1	
グローバル・ワン不動産投資法人		5.234	12.018	1,307,558	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人		16.12	39.49	5,773,438	2.9	
森トラスト総合リート投資法人		5.387	12.537	1,790,283	0.9	
インヴィンシブル投資法人		31.518	77.209	3,254,359	1.6	
フロンティア不動産投資法人		2.501	6.15	3,265,650	1.6	
平和不動産リート投資法人		4.871	11.958	1,751,847	0.9	
日本ロジスティクスファンド投資法人		4.925	11.828	3,873,670	1.9	
福岡リート投資法人		3.898	9.072	1,533,168	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人		2.332	5.427	3,598,101	1.8	
いちごオフィスリート投資法人		6.176	14.374	1,239,038	0.6	
大和証券オフィス投資法人		1.606	3.709	2,518,411	1.3	
阪急阪神リート投資法人		3.405	7.923	1,201,126	0.6	
スターツプロシード投資法人		1.174	2.732	672,891	0.3	
大和ハウスリート投資法人		10.755	26.339	8,362,632	4.2	
ジャパン・ホテル・リート投資法人		24.283	53.741	3,584,524	1.8	
大和証券リビング投資法人		9.843	23.703	2,754,288	1.4	
ジャパンエクセレント投資法人		6.994	16.092	2,087,132	1.0	
合	計	□数・金額	472.255	1,025.069	195,071,937	—
		銘柄数<比率>	61銘柄<97.6%>	61銘柄<97.6%>	—	97.6

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当期		期末
		買建額	売建額	
国内	東証REIT	百万円 4,692	百万円 －	

■投資信託財産の構成

2022年6月6日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
投資証券	千円 195,071,937	% 94.5	
コール・ローン等、その他	11,337,248	5.5	
投資信託財産総額	206,409,185	100.0	

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	206,409,185,963円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,924,691,323
投 資 証 券(評価額)	195,071,937,150
未 収 入 金	373,786,980
未 収 配 当 金	1,098,130,310
差 入 委 託 証 拠 金	△59,359,800
(B) 負 債	6,487,439,313
未 払 金	6,096,928,313
未 払 解 約 金	390,511,000
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	199,921,746,650
元 本	81,973,373,034
次 期 繰 越 損 益 金	117,948,373,616
(D) 受 益 権 総 口 数	81,973,373,034口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	24,389円

(注1) 期首元本額 35,599,014,873円
追加設定元本額 150,824,103,694円
一部解約元本額 104,449,745,533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)	484,095円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,717,515円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	9,111,206円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	2,267,895円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	1,248,266円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	1,183,169円
たわらノーロード 国内リート	4,872,150,904円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	780,898,538円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,571,632,416円
たわらノーロード バランス (堅実型)	29,133,736円
たわらノーロード バランス (標準型)	543,338,028円
たわらノーロード バランス (積極型)	592,133,017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)	75,324,606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)	378,001,932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)	218,376,989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)	284,143,618円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,463,171円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	33,763,995円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,546,963円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	13,122,590円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	12,475,526円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	430,321,307円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	3,270,803円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	127,599,856円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	168,835,185円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	338,747,680円
投資のソムリエ	9,844,600,548円
投資のソムリエ<DC年金>	615,851,556円
D I A M 8資産/バランスファンドN<DC年金>	138,640,897円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	407,049,793円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,093,350,810円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	23,670,570円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	11,955,495円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,715,586円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	59,914,647円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	258,104,151円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	105,387,836円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	27,927,213円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	11,933,960円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	7,880,111円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	1,382,274円

Jリートインデックスファンド (DC) 50,855,522円
D I A M J-R-E-I-Tインデックス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定) 79,667,856円
D I A M J-R-E-I-Tインデックス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定) 720,422,023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) 760,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4 226,208,631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) 708,067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) 43,732,109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) 551,421円
固定比率マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) 190,209,302円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略 (適格機関投資家限定) 59,683,551円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03 220,977,582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) 527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定) 2,869,206円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-05 148,330,752円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-07 244,308,833円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-08 170,659,574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 60,842,765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) 588,327円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-09 170,407,397円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ) 21-12 245,929,724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) 4,526,901,363円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 254,449,768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) 614,705,854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) 1,014,158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) 9,480,923円
日米資産配分戦略ファンド (T I P S活用型) 141,000,699円
しあわせの歩・私募 (適格機関投資家限定) 30,493,320円
D I A Mグローバル・リスクファクター・バリエティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) 1,968,658,850円
MHAM J-R-E-I-Tインデックスファンド<DC年金> 7,710,368,183円
MHAM J-R-E-I-Tインデックスファンド (毎月決算型) 37,275,651,521円
MHAM J-R-E-I-Tインデックスファンド (年1回決算型) 2,584,025,619円
MHAM J-R-E-I-Tインデックスファンド (ファンドラップ) 111,687,629円
期末元本合計 81,973,373,034円

■損益の状況

当期 自2021年6月8日 至2022年6月6日

項 目					当 期				
(A) 配	当	等	収	益	6,593,740,373円				
受	取	配	当	金	6,590,445,292				
受	取		利	息	12,539				
そ	の	他	収	益	4,406,968				
支	払		利	息	△1,124,426				
(B) 有	価	証	券	売	買	損	益	△19,639,284,044	
売			買				益	2,322,804,698	
売			買				損	△21,962,088,742	
(C) 先	物	取	引	等	取	引	損	益	△181,506,240
取			引				益	395,559,860	
取			引				損	△577,066,100	
(D) 当	期	損	益	金(A + B + C)				△13,227,049,911	
(E) 前	期	繰	越	損	益	金	52,932,492,732		
(F) 解	約	差	損	益	金	△144,599,972,511			
(G) 追	加	信	託	差	損	益	金	222,842,903,306	
(H) 合	計(D + E + F + G)							117,948,373,616	
次	期	繰	越	損	益	金(H)	117,948,373,616		

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

(注 2) (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15期（決算日 2022年6月22日）

（対象期間 2021年6月23日～2022年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2007年4月11日から無期限です。
運 用 方 針	S & P 先進国 R E I Tインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主 要 投 資 対 象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		S & P 先進国 R E I T インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投 資 信 託 受益証券、 投 資 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額 総
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率		
11期(2018年6月22日)	円	%	ポイント	%	%	百万円
	11,979	1.8	120,101.82	2.4	99.3	53,148
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	47,410
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	78,959
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3	56,003

（注1）ベンチマークはS & P 先進国 R E I Tインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注2）S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I Tインデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

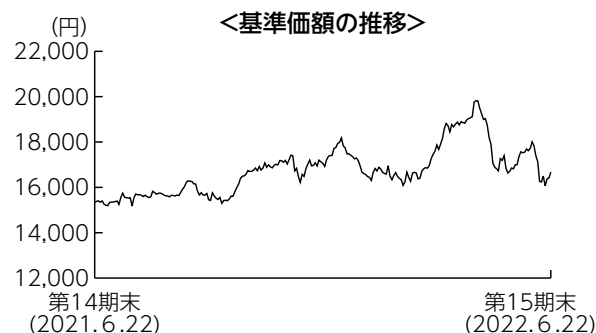
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	期 騰 落	中 率	
(期 首) 2021 年 6 月 22 日	円 15,336	% －	ポイント 157,949.66	% －	% 99.4
6 月 末	15,211	△0.8	156,754.65	△0.8	99.4
7 月 末	15,595	1.7	160,838.73	1.8	99.7
8 月 末	15,916	3.8	164,194.41	4.0	99.6
9 月 末	15,552	1.4	160,446.64	1.6	90.7
10 月 末	16,916	10.3	174,463.23	10.5	99.8
11 月 末	16,840	9.8	173,578.70	9.9	89.5
12 月 末	17,934	16.9	185,199.89	17.3	100.1
2022 年 1 月 末	16,668	8.7	172,188.18	9.0	99.6
2 月 末	16,669	8.7	172,409.41	9.2	99.2
3 月 末	18,724	22.1	193,705.17	22.6	98.9
4 月 末	19,029	24.1	196,763.47	24.6	85.6
5 月 末	17,570	14.6	181,951.19	15.2	99.6
(期 末) 2022 年 6 月 22 日	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2021年6月23日から2022年6月22日まで）

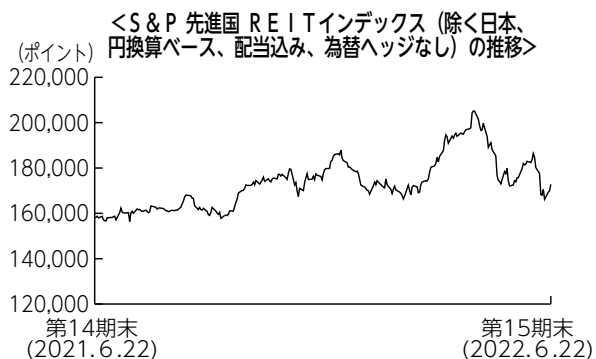


基準価額の推移

当期末の基準価額は16,673円となり、前期末比で8.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

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



投資環境

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

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

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で9.4%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマークを0.7%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	7円 (1) (6)	0.040% (0.005) (0.034)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	19 (1) (18)	0.114 (0.008) (0.106)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	15 (9) (6)	0.091 (0.054) (0.038)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	41	0.246	
期中の平均基準価額は16,756円です。			

(注 1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年6月23日から2022年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	158.855	30,863	177.915	33,766
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	2.05	527	2.378	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	156.582	18,204	179.035	20,293
	(-)	(-)	(-)	(-)
CEDAR REALTY TRUST INC	13.188	322	9.407	233
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	262.595	7,890	300.123	8,767
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVLT & MGMT CO-A	154.331	1,101	172.485	1,167
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	80.982	5,528	87.507	5,934
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	10.767	233	10.379	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	72.343	5,274	85.8	6,083
	(0.084)	(60)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	83.255	4,147	95.169	4,603
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	818.549	118,157	937.537	133,627
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	154.585	35,866	177.182	40,584
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXP INDUSTRIAL TRUST	313.011	4,441	355.629	4,842
	(-)	(-)	(-)	(-)

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

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	62.974	1,258	111.145	2,252
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	194.158	2,576	224.432	2,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	321.912	15,741	368.218	17,411
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	253.283	4,034	266.867	4,192
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	189.867	15,052	216.131	16,956
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	88.709	1,870	104.132	2,130
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	790.713	14,017	901.597	15,719
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	128.065	25,645	146.132	28,775
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	28.468	270	35.964	328
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	50.263	2,891	57.379	3,174
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	14.129	1,378	15.148	1,452
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13.695	431	15.942	487
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	-	-	-
	(△27.137)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	40.703	1,204	44.454	1,277
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	21.502	3,641	24.658	4,208
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	82.25	1,054	94.901	1,193
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	584.127	39,839	653.082	44,164
	(78.539)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	171.045	11,811	198.104	13,458
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	328.034	17,860	375.091	20,166
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	121.783	3,354	139.582	3,723
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	10.583	523	12.187	598
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	362.903	48,983	415.796	55,867
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	91.613	11,861	101.298	12,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	169.181	57,924	193.522	65,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	130.759	24,233	145.676	26,873
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
TANGER FACTORY OUTLET	106.177	1,863	121.975	2,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	47.409	1,092	52.036	1,175
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	28.55	623	34.347	729
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	10.073	573	12.287	676
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	439.274	24,263	497.685	26,335
	(5.792)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	173.513	7,268	198.638	8,069
	(-)	(-)	(-)	(-)
WASHINGTON REIT	91.284	2,266	106.807	2,616
	(-)	(-)	(-)	(-)
GEO GROUP INC	56.667	435	113.771	836
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEINGARTEN REALTY INVST	2.249	72	2.895	92
	(△55.441)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	155.979	8,545	177.913	9,751
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	203.121	4,330	237.77	4,935
	(61.224)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	148.735	28,506	169.96	32,134
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	84.762	476	98.234	538
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	248.858	2,905	281.805	3,222
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	246.264	12,480	271.595	13,495
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	313.291	46,748	357.633	53,438
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	225.157	2,161	263.596	2,475
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	660.812	13,574	753.532	15,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	196.573	6,295	220.349	6,883
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	131.563	2,409	152.251	2,715
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	136.96	2,353	156.261	2,657
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	107.883	1,018	124.997	1,161
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	82.201	5,770	91.032	6,357
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	54.651	1,990	62.171	2,225
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	184.183	2,567	209.54	2,858
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
AMERICOLD REALTY TRUST	297.472	9,005	334.363	10,023
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORESITE REALTY CORP	25.471	3,900	45.824	7,385
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	76.731	3,719	73.294	3,508
	(△111.404)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	148.192	3,331	169.08	3,739
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	49.842	1,223	55.834	1,335
	(-)	(-)	(-)	(-)
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	42.333	843	66.485	1,382
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	41.619	544	46.767	608
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	242.499	3,438	270.593	3,663
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	30.051	340	31.519	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	168.856	4,237	192.685	4,688
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	193.093	7,849	213.439	8,528
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	65.179	847	71.259	900
	(△98.273)	(-)	(-)	(-)
CYRUSONE INC	105.596	8,887	162.579	14,064
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	210.112	16,632	234.439	18,278
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	69.323	1,570	80.565	1,759
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	27.504	826	29.64	894
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	245.899	7,727	278.614	8,619
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	60.92	5,233	69.644	5,879
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	61.2	878	68.946	951
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	140.335	6,460	153.757	6,966
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	240.602	4,332	271.156	4,816
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	174.777	11,927	186.063	12,703
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	320.322	12,673	356.064	13,967
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	192.864	4,636	171.557	4,038
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	28.261	5,885	31.086	6,187
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
JBG SMITH PROPERTIES	125.167	3,561	143.727	3,970
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	123.05	996	136.478	1,087
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL VALUE INC	-	-	8.794	59
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	662.529	26,758	741.06	29,572
	(-)	(-)	(-)	(-)
QTS REALTY TRUST INC	6.185	480	38.531	3,002
	(-)	(-)	(-)	(-)
COREPOINT LODGING INC	17.747	276	36.853	576
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	703	523	829.9	613
	(-)	(△6)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	143.677	1,350	164.141	1,499
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	31.417	816	30.922	824
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	11.544	756	13.211	867
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	136.877	3,623	149.645	3,909
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	64.209	1,437	72.39	1,566
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	41.819	753	97.996	1,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	258.816	12,034	289.654	13,167
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	335.239	8,066	383.42	9,069
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	41.527	231	21.354	121
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	17.653	326
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	518.8	408	570.4	437
	(-)	(△4)	(-)	(-)
POSTAL REALTY TRUST INC	10.309	187	4.889	81
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	7.927	148	5.242	98
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	41.679	1,235	20.925	593
	(-)	(-)	(-)	(-)
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	-	-	8.408	70
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	28.71	624	31.016	653
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	9.908	138	11.177	159
	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	28.766	495	34.307	570
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ORION OFFICE REIT INC	39.605	640	48.132	741
	(25.252)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	44.288	998	40.525	872
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	101.179	2,066	118.155	2,325
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	6.505	459	4.193	299
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	75.398	2,506	40.473	1,326
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	175.962	8,883	201.213	10,018
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	184.386	4,342	200.821	4,641
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	17.195	501	9.655	261
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	104.2	92	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	-	-	-	-
	(△37.108)	(-)	(-)	(-)
STORE CAPITAL CORP	273.837	8,650	309.496	9,663
	(-)	(-)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	170.958	1,603	196.416	1,765
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	58.406	904	66.316	1,002
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	119.903	2,211	139.674	2,506
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	86.651	1,831	95.154	1,961
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	120.487	2,167	137.758	2,426
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	21.491	1,635	24.993	1,892
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	95.075	5,565	102.268	5,919
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	24.167	1,037	27.658	1,164
	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	228.907	3,733	260.4	4,186
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	99.803	1,541	109.932	1,623
	(-)	(-)	(-)	(-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,550.6	1,029	1,682.7	1,105
	(-)	(△4)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	262.611	4,907	300.433	5,501
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	825.144	23,992	781.141	22,152
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	27.482	391	43.132	502
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	86.209 (-)	2,367 (-)	99.799 (-)	2,704 (-)
DIGITALBRIDGE GROUP INC	507.857 (-)	3,628 (-)	746.406 (-)	5,083 (-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	82.001 (-)	2,538 (-)	93.831 (-)	2,852 (-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	98.869 (-)	5,540 (-)	112.949 (-)	6,224 (-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	163.1 (-)	2,404 (-)	187.431 (-)	2,674 (-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	120.497 (-)	2,118 (-)	140.726 (-)	2,433 (-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	180.005 (-)	4,146 (-)	206.404 (-)	4,636 (-)
ALLIED PROPERTIES REIT	72.475 (-)	3,100 (-)	82.519 (-)	3,455 (-)
COMINAR REAL ESTATE INVT TR	45.618 (-)	491 (-)	89.864 (-)	1,009 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	25.422 (-)	627 (-)	30.075 (-)	720 (-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	21.997 (-)	1,166 (-)	25.326 (-)	1,323 (-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71.575 (-)	871 (-)	85.193 (-)	1,025 (-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	60.208 (-)	1,082 (-)	65.052 (-)	1,137 (-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	73.381 (-)	1,176 (-)	82.337 (-)	1,290 (-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	114.429 (-)	1,541 (-)	125.376 (-)	1,653 (-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7.605 (-)	140 (-)	9.73 (-)	172 (-)
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9.894 (-)	95 (-)	5.251 (-)	48 (-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	123.339 (-)	1,975 (-)	129.832 (-)	2,030 (-)
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	55.971 (-)	230 (-)	40.548 (-)	161 (-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	99.256 (-)	2,162 (-)	109.602 (-)	2,325 (-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37.522 (-)	3,550 (-)	42.255 (-)	3,931 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	36.59 (-)	263 (-)	41.806 (-)	293 (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	188.86 (-)	2,812 (-)	214.484 (-)	3,137 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20.446 (-)	429 (-)	24.011 (-)	490 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54.846	954	61.879	1,060
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLAZA RETAIL REIT	19.973	97	24.208	111
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31.114	144	20.998	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3.678	101	22.823	602
	(-)	(-)	(-)	(-)
SLATE GROCERY REIT	24.906	375	27.594	406
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEXUS INDUSTRIAL REIT	25.992	323	18.534	221
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARIS REIT	27.937	409	30.815	432
	(16.822)	(-)	(-)	(-)
SLATE OFFICE REIT	13.763	69	9.662	47
	(-)	(-)	(-)	(-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19.151	257	18.758	251
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	56.911	1,224	63.719	1,353
	(-)	(-)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	487.34	2,006	567.653	2,296
	(-)	(-)	(-)	(-)
MIRVAC GROUP	4,433.852	11,968	5,063.359	13,566
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,623.195	1,367	2,021.448	1,693
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	588.821	2,446	667.187	2,724
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	2,122.435	10,629	2,441.97	12,145
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	667.191	1,992	706.835	2,074
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS PROPERTY GROUP	389.68	1,307	459.942	1,545
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	374.896	1,412	431.125	1,596
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	2,676.734	11,481	3,068.152	12,943
	(-)	(-)	(-)	(-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	396.075	2,214	421.207	2,294
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	1,187.661	12,724	1,360.328	14,489
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	1,877.623	42,634	2,143.587	48,201
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	4,277.345	7,548	4,910.399	8,384
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	516.531	8,756	591.78	9,827
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	316.124 (-)	1,315 (-)	355.879 (-)	1,454 (-)
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	1,270.733 (-)	3,623 (-)	1,443.294 (-)	4,068 (-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	502.755 (-)	1,892 (-)	553.307 (-)	2,038 (-)
ARENA REIT	331.702 (-)	1,507 (-)	387.191 (-)	1,736 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	685.451 (-)	3,464 (-)	760.017 (-)	3,767 (-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	182.33 (-)	613 (-)	191.542 (-)	615 (-)
NATIONAL STORAGE REIT	1,263.971 (-)	3,102 (-)	1,450.937 (-)	3,490 (-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	157.555 (-)	578 (-)	165.859 (-)	602 (-)
GDI PROPERTY GROUP	528.845 (-)	601 (-)	597.735 (-)	656 (-)
HOME CONSORTIUM LTD	86.906 (-)	617 (-)	101.174 (-)	713 (-)
RURAL FUNDS GROUP	482.295 (-)	1,393 (-)	516.198 (-)	1,466 (-)
IRONGATE GROUP	634.385 (-)	1,088 (-)	709.339 (-)	1,201 (-)
SCENTRE GROUP	5,803.8 (-)	17,298 (-)	6,635.014 (-)	19,248 (-)
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	220.813 (-)	203 (-)	80.47 (-)	73 (-)
HOME CONSORTIUM LTD	116.968 (6.46)	765 (42)	141.533 (-)	877 (-)
HOMECON DAILY NEEDS REIT	759.24 (374.004)	1,082 (530)	906.771 (-)	1,216 (-)
HEALTHCO REIT	159.265 (-)	293 (-)	87.778 (-)	138 (-)
CENTURIA OFFICE REIT	437.602 (-)	1,003 (-)	488.986 (-)	1,095 (-)
AVENTUS GROUP	226.775 (△170.002)	774 (△572)	233.236 (-)	774 (-)
WAYPOINT REIT LTD	806.09 (△21.228)	2,178 (△58)	954.977 (-)	2,531 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	2,297.2 (-)	157,065 (-)	2,626.3 (-)	177,032 (-)
PROSPERITY REIT	982 (-)	2,883 (-)	1,226 (-)	3,547 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,369 (-)	8,026 (0.21457)	2,448 (-)	8,162 (-)
CHAMPION REIT	1,925 (-)	7,538 (-)	2,230 (-)	8,597 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,122 (-)	4,751 (-)	1,231 (-)	5,219 (-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,628 (-)	12,412 (-)	1,872 (-)	14,300 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	- (305.25)	- (△0.21457)	305.25 (-)	3 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	5,835.4 (-)	12,379 (-)	6,430.8 (-)	13,626 (-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	3,817.6 (-)	11,202 (△31)	4,324.4 (-)	12,585 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	2,479.8 (-)	3,906 (△1)	2,818.3 (-)	4,420 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	3,586 (-)	6,671 (△26)	3,970.8 (-)	7,346 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	1,526.6 (-)	939 (-)	1,771 (-)	1,081 (-)
ASCOTT RESIDENCE TRUST	2,078.5 (-)	2,174 (△4)	2,382 (-)	2,473 (-)
KEPPEL REIT	2,247.6 (-)	2,576 (-)	2,600.2 (-)	2,947 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	1,279 (-)	2,967 (-)	1,575.3 (-)	3,629 (-)
ESR LOGOS REIT	3,408.8 (1,069.91)	1,506 (458)	4,069.2 (-)	1,766 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	849.4 (-)	1,023 (△3)	937.5 (-)	1,103 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	1,144.8 (-)	1,373 (-)	1,256.8 (-)	1,488 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	715.6 (-)	216 (△9)	996.7 (-)	293 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	451.7 (-)	647 (△3)	504.8 (-)	715 (-)
PARKWAY LIFE REIT	387.3 (-)	1,859 (△2)	448.9 (-)	2,164 (-)
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	- (-)	- (△2)	2,759.1 (-)	130 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	2,173.1 (-)	5,826 (△0.68061)	2,488.6 (-)	6,606 (-)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	2,461.2 (-)	4,840 (△5)	2,816.3 (-)	5,479 (-)
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	1,195 (△603.48)	1,047 (△517)	1,179.4 (-)	1,040 (-)
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	- (-)	- (-)	313.2 (-)	131 (-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	2,360.4 (-)	2,600 (△33)	3,255 (-)	3,558 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	1,074.8 (-)	665 (-)	1,262.5 (-)	767 (-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
SPH REIT	968.7	937	1,127.6	1,080
	(-)	(-)	(-)	(-)
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	209.3	147	224.3	157
	(-)	(△0.00001)	(-)	(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	510	439	523.6	449
	(-)	(-)	(-)	(-)
QUE COMMERCIAL REIT	2,366.1	996	2,698.5	1,135
	(-)	(△2)	(-)	(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	1,194.9	978	1,044.1	852
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRASERS HOSPITALITY TRUST	-	-	377.1	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	103.9	74	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
IREIT GLOBAL	369.8	235	415.7	261
	(-)	(△2)	(-)	(-)
KEPPEL DC REIT	1,490.3	3,454	1,678.3	3,828
	(-)	(△7)	(-)	(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	3,272.5	4,773	3,692.7	5,352
	(-)	(△15)	(-)	(-)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	1,380.504	2,161	1,498.848	2,319
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	407.484	1,269	445.327	1,348
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	1,177.028	2,864	1,379.893	3,328
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,667.156	1,864	1,942.429	2,154
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	975.321	1,430	1,073.46	1,561
	(-)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	1,072.95	5,611	1,222.357	6,288
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	125.389	4,157	143.656	4,719
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	192.7	2,890	217.342	3,169
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	4,584.197	1,514	5,513.049	1,763
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	862.339	6,480	987.714	7,287
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	138.79	1,096	160.203	1,247
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	444.964	4,967	507.935	5,528
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	1,505.98	2,276	1,715.62	2,532
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	321.302	1,959	377.658	2,287
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	1,340.273	17,188	1,534.87	19,450
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	287.251	2,072	328.823	2,355
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	3,335.879	2,348	3,675.459	2,521
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	257.64	212	321.322	256
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	421.073	227	515.379	276
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	617.37	608	695.399	685
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	877.238	709	969.076	786
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	233.808	2,887	266.972	3,216
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,067.091	2,817	1,190.237	3,070
	(-)	(-)	(-)	(-)
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	785.572	845	916.961	978
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	959.617	1,598	1,098.079	1,806
	(-)	(-)	(-)	(-)
GCP STUDENT LIVING PLC	204.051	435	414.247	877
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	121.045	109	147.303	129
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	564.808	522	675.904	619
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRS REIT PLC/THE	723.891	778	542.722	569
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	384.572	372	456.276	429
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	996.24	1,244	986.42	1,207
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,062.787	4,738	2,297.396	5,221
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUSTODIAN REIT PLC	394.227	406	468.275	478
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME REIT PLC	468.725	566	383.46	457
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	682.508	613	766.56	673
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK REIT PLC	80.881	95	106.184	118
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	820.716	1,204	835.877	1,208
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	414.619	370	470.723	416
	(-)	(-)	(-)	(-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	313.459	370	330.806	388
	(-)	(-)	(-)	(-)

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

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■利害関係人との取引状況等（2021年6月23日から2022年6月22日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	期 首(前期末)	当 期				末
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比	率
不動産ファンド (アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		354.4	227.5	154	21,115		0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0		0.0
PRIME US REIT		211.4	159.8	107	14,613		0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		—	104.2	93	12,728		0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		658.4	526.3	302	41,304		0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		64.515	45.455	5,982	816,590		1.5
ALEXANDER'S INC.		0.989	0.661	143	19,630		0.0
BOSTON PROPERTIES INC		66.493	44.04	3,963	540,991		1.0
CEDAR REALTY TRUST INC		—	3.781	101	13,830		0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		109.6	72.072	1,982	270,618		0.5
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		68.881	50.727	297	40,642		0.1
AGREE REALTY CORP		29.676	23.151	1,606	219,295		0.4
BRT APARTMENTS CORP		3.832	4.22	93	12,746		0.0
SL GREEN		33.08	19.707	951	129,837		0.2
EPR PROPERTIES		34.918	23.004	1,042	142,327		0.3
PROLOGIS INC		346.969	227.981	25,615	3,496,320		6.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC		65.657	43.06	8,241	1,124,907		2.0
LXP INDUSTRIAL TRUST		129.482	86.864	904	123,421		0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		45.941	32.805	4,276	583,738		1.0
VERIS RESIDENTIAL INC		39.452	26.897	371	50,698		0.1
EQUINIX INC		42.011	28.058	17,962	2,451,656		4.4
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		82.875	54.298	2,245	306,450		0.5
CTO REALTY GROUTH INC		2.965	1.858	111	15,155		0.0
COUSINS PROPERTIES INC		70.851	45.843	1,340	182,957		0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		14.44	9.712	155	21,209		0.0
SITE CENTERS CORP		81.132	54.965	711	97,078		0.2
DUKE REALTY TRUST		175.583	118.933	6,254	853,702		1.5
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		—	15.107	86	11,814		0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		30.569	20.121	5,140	701,601		1.3
EQUITY RESIDENTIAL		161.226	105.387	7,509	1,025,023		1.8
FEDERAL REALTY INVS TRUST		33.02	21.871	2,072	282,874		0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		60.986	40.254	1,869	255,153		0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		253.462	166.168	4,134	564,285		1.0
EQUITY COMMONWEALTH		56.714	34.761	964	131,660		0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		65.332	45.424	1,201	163,925		0.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC		48.629	32.282	1,089	148,664		0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST		76.025	55.097	278	38,052		0.1
WELLTOWER INC		196.362	139.809	11,000	1,501,413		2.7
EAST GROUP		18.728	12.57	1,902	259,719		0.5
KIMCO REALTY		204.567	191.008	3,632	495,864		0.9
KILROY REALTY CORP		50.045	32.424	1,659	226,543		0.4
LTC PROPERTIES INC		17.932	11.949	451	61,632		0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		112.836	80.9	152	20,759		0.0
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A		48.171	—	—	—		—
BRANDYWINE REALTY TRUST		83.055	52.781	503	68,654		0.1
IRON MOUNTAIN INC		135.791	89.485	4,222	576,369		1.0
THE MACERICH COMPANY		78.672	65.088	581	79,421		0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		79.741	53.477	3,719	507,723		0.9
ACADIA REALTY TRUST		42.275	26.852	422	57,687		0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC		332.075	221.191	3,643	497,235		0.9
MID AMERICA		53.615	35.548	5,818	794,166		1.4

銘 柄	期 首(前期末)	当 期				末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比	率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16.618	9.122	85	11,728		0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	21.18	14.064	826	112,872		0.2
CENTERSPACE	6.06	5.041	391	53,495		0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7.856	5.609	142	19,414		0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29.075	1.938	7	1,031		0.0
GETTY REALTY CORP	16.951	13.2	340	46,537		0.1
PS BUSINESS PARKS	9.349	6.193	1,151	157,222		0.3
RPT REALTY	37.794	25.143	239	32,704		0.1
REALTY INCOME CORP	175.691	185.275	12,129	1,655,617		3.0
REGENCY CENTERS CORP	74.742	47.683	2,783	379,886		0.7
UDR INC	139.707	92.65	4,085	557,679		1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	52.297	34.498	914	124,778		0.2
SAUL CENTERS INC	6.198	4.594	199	27,294		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	154.013	101.12	9,767	1,333,122		2.4
LIFE STORAGE INC	35.667	25.982	2,759	376,615		0.7
PUBLIC STORAGE	71.371	47.03	14,207	1,939,153		3.5
SUN COMMUNITIES INC	52.37	37.453	5,792	790,564		1.4
TANGER FACTORY OUTLET	47.408	31.61	444	60,704		0.1
UMH PROPERTIES INC	18.196	13.569	227	31,058		0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16.822	11.025	201	27,447		0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5.995	3.781	191	26,128		0.0
VENTAS INC	175.714	123.095	5,976	815,700		1.5
VORNADO REALTY TRUST	74.163	49.038	1,386	189,216		0.3
WASHINGTON REIT	41.358	25.835	553	75,566		0.1
GEO GROUP INC	57.104	—	—	—		—
WEINGARTEN REALTY INVST	56.087	—	—	—		—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	65	43.066	2,760	376,843		0.7
KITE REALTY GROUP TRUST	40.874	67.449	1,180	161,106		0.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	62.579	41.354	6,691	913,378		1.6
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46.648	33.176	138	18,927		0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100.104	67.157	671	91,662		0.2
CUBESMART	94.451	69.12	2,799	382,084		0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	132.013	87.671	11,234	1,533,350		2.7
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	102.73	64.291	538	73,447		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	277.416	184.696	2,707	369,566		0.7
DOUGLAS EMMETT INC	77.84	54.064	1,200	163,818		0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	57.754	37.066	577	78,821		0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	57.283	37.982	494	67,445		0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	48.846	31.732	225	30,837		0.1
TERRENO REALTY CORP	32.097	23.266	1,300	177,546		0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	23.736	16.216	473	64,651		0.1
RLJ LODGING TRUST	76.242	50.885	560	76,537		0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	119.402	82.511	2,331	318,262		0.6
CORESITE REALTY CORP	20.353	—	—	—		—
VEREIT INC	107.967	—	—	—		—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	61.175	40.287	705	96,283		0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	22.164	16.172	310	42,424		0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES	24.152	—	—	—		—
CHATHAM LODGING TRUST	22.362	17.214	176	24,106		0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	98.359	70.265	971	132,636		0.2
WHITESTONE REIT	17.85	16.382	175	23,992		0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	70.573	46.744	739	100,996		0.2
STAG INDUSTRIAL INC	74.75	54.404	1,662	226,926		0.4
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	104.353	—	—	—		—
CYRUSONE INC	56.983	—	—	—		—

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

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

銘柄		期首(前期末)		当期		期末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(オーストラリア)		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%	
GOODMAN GROUP		789.54	523.576	9,178	869,275	1.6	
VICINITY CENTRES		1,826.547	1,193.493	2,243	212,507	0.4	
CHARTER HALL GROUP		220.887	145.638	1,625	153,934	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA		136.67	96.915	332	31,483	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		513.792	341.231	934	88,551	0.2	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		212.974	162.422	469	44,456	0.1	
ARENA REIT		159.242	103.753	422	39,993	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT		260.875	186.309	806	76,404	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT		73.145	63.933	172	16,348	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT		516.215	329.249	740	70,162	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD		73.965	65.661	206	19,589	0.0	
GDI PROPERTY GROUP		247.876	178.986	170	16,104	0.0	
HOME CONSORTIUM LTD		85.98	—	—	—	—	
RURAL FUNDS GROUP		160.193	126.29	334	31,696	0.1	
IRONGATE GROUP		256.148	181.194	341	32,348	0.1	
SCENTRE GROUP		2,437.607	1,606.393	4,208	398,610	0.7	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY		—	140.343	115	10,899	0.0	
HOME CONSORTIUM LTD		—	53.607	241	22,847	0.0	
HOMECO DAILY NEEDS REIT		213.11	439.583	580	54,955	0.1	
HEALTHCO REIT		—	71.487	105	10,020	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT		179.274	127.89	225	21,317	0.0	
AVENTUS GROUP		176.463	—	—	—	—	
WAYPOINT REIT LTD		382.777	212.662	480	45,519	0.1	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	15,356.239 31銘柄<6.9%>	10,522.248 32銘柄<6.4%>	37,590 —	3,560,193 —	— 6.4	
(香港)		千□	千□	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT		977.72	648.62	41,835	727,527	1.3	
PROSPERITY REIT		597	353	843	14,671	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR		761	682	2,066	35,935	0.1	
CHAMPION REIT		937.07	632.07	2,218	38,580	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		451	342	1,231	21,410	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T		680	436	2,816	48,979	0.1	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	4,403.79 6銘柄<1.7%>	3,093.69 6銘柄<1.6%>	51,012 —	887,106 —	— 1.6	
(シンガポール)		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		2,169.309	1,573.909	3,368	331,393	0.6	
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT		1,544.76	1,037.96	2,854	280,843	0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		1,006.99	668.49	1,076	105,894	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		1,370.62	985.82	1,616	159,071	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT		656.8	412.4	239	23,534	0.0	
ASCOTT RESIDENCE TRUST		891.616	588.116	670	65,965	0.1	
KEPPEL REIT		951.5	598.9	676	66,586	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST		622.9	326.6	728	71,659	0.1	
ESR LOGOS REIT		1,148.73	1,558.24	638	62,859	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS		365.2	277.1	357	35,170	0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST		450.18	338.18	388	38,264	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU		608.8	327.7	91	9,027	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		216.895	163.795	221	21,756	0.0	
PARKWAY LIFE REIT		179	117.4	564	55,560	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRU		2,759.1	—	—	—	—	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		913.12	597.62	1,500	147,587	0.3	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		1,028.2	673.1	1,204	118,545	0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		587.88	—	—	—	—	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		313.2	—	—	—	—	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		1,019	124.4	149	14,687	0.0	

銘柄		期首(前期末)		当期		期末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(シンガポール)		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		491.5	303.8	191	18,831	0.0	
SPH REIT		471.9	313	294	28,948	0.1	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT		127.4	112.4	62	6,193	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T		208.1	194.5	146	14,448	0.0	
OUE COMMERCIAL REIT		1,120.355	787.955	303	29,847	0.1	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT		422.2	573	449	44,256	0.1	
FRASERS HOSPITALITY TRUST		377.1	—	—	—	—	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		—	103.9	72	7,104	0.0	
IREIT GLOBAL		214.5	168.6	104	10,284	0.0	
KEPPEL DC REIT		591.5	403.5	778	76,621	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T		1,314.964	894.764	1,207	118,848	0.2	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	24,143.319	14,225.149	19,959	1,963,791	—	
		30銘柄<3.3%>	27銘柄<3.5%>	—	—	3.5	
(ニュージーランド)		千□	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%	
PRECINCT PROPERTIES		510.038	391.694	524	45,117	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		180.112	142.269	382	32,897	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST		520.345	317.48	628	54,035	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD		742.461	467.188	455	39,155	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD		388.009	289.87	343	29,526	0.1	
小計	□数・金 銘柄数<比率>	2,340.965	1,608.501	2,335	200,732	—	
		5銘柄<0.4%>	5銘柄<0.4%>	—	—	0.4	
(イギリス)		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%	
BRITISH LAND CO PLC		437.522	288.115	1,452	242,674	0.4	
DERWENT LONDON PLC		52.817	34.55	945	157,976	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC		77.686	53.044	668	111,784	0.2	
HAMMERSON PLC		1,976.821	1,047.969	222	37,128	0.1	
LAND SECURITIES GROUP PLC		355.626	230.251	1,655	276,744	0.5	
WORKSPACE GROUP PLC		63.229	41.816	261	43,711	0.1	
INTU PROPERTIES PLC		231.04	231.04	0	0	0.0	
UNITE GROUP PLC		186.15	123.179	1,326	221,707	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC		617.519	407.879	567	94,817	0.2	
SHAFTESBURY PLC		144.406	88.05	492	82,329	0.1	
SEGRO PLC		564.915	370.318	3,647	609,592	1.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		119.078	77.506	477	79,789	0.1	
ASSURA PLC		1,242.776	903.196	602	100,678	0.2	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI		179.591	115.909	90	15,147	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT		255.156	160.85	86	14,462	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD		257.572	179.543	168	28,174	0.1	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD		347.914	256.076	201	33,637	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS LTD		97.821	64.657	679	113,565	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		423.479	300.333	697	116,545	0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LT		370.408	239.019	274	45,856	0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PL		397.993	259.531	390	65,232	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC		210.196	—	—	—	—	
NEWRIVER REIT PLC		139.604	113.346	103	17,313	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		294.033	182.937	146	24,488	0.0	
PRS REIT PLC/THE		—	181.169	195	32,699	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT		177.39	105.686	92	15,401	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		371.767	381.587	492	82,264	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC		810.128	575.519	1,083	181,012	0.3	
CUSTODIAN REIT PLC		202.92	128.872	133	22,355	0.0	
HOME REIT PLC		100.813	186.078	210	35,202	0.1	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		281.997	197.945	168	28,118	0.1	
AEW UK REIT PLC		83.963	58.66	69	11,607	0.0	
LXI REIT PLC		292.448	277.287	380	63,671	0.1	

銘 柄		期 首(前期末)		当 期		末	
		□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		%
REGIONAL REIT LTD		206.337	150.233	115	19,332		0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		153.417	136.07	166	27,879		0.0
小 計	□ 数 : 金 額	11,724.532	8,148.22	18,267	3,052,903		—
	銘 柄 数<比 率>	34銘柄<5.6%>	34銘柄<5.5%>	—	—		5.5
(イスラエル)		千口	千口	千イスラエル・シェケル	千円		%
REIT 1 LTD		85.363	61.727	1,132	44,721		0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD		—	63.623	613	24,241		0.0
小 計	□ 数 : 金 額	85.363	125.35	1,745	68,963		—
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<0.1%>	2銘柄<0.1%>	—	—		0.1
(韓国)		千口	千口	千韓国・ウォン	千円		%
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE		39.843	28.835	129,757	13,689		0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		19.635	19.52	151,670	16,001		0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		9.958	11.032	60,124	6,343		0.0
LOTTE REIT CO LTD		54.509	39.603	224,152	23,648		0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		17.86	11.152	66,688	7,035		0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD		—	4.123	21,315	2,248		0.0
JR REIT XXVII		56.222	45.194	239,076	25,222		0.0
SK REITS CO LTD		—	17.691	109,861	11,590		0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD		46.423	43.616	244,249	25,768		0.0
D&D PLATFORM REIT CO LTD		—	14.329	71,286	7,520		0.0
NH ALL-ONE REIT CO LTD		—	11.162	57,261	6,041		0.0
小 計	□ 数 : 金 額	244.45	246.257	1,375,444	145,109		—
	銘 柄 数<比 率>	7銘柄<0.2%>	11銘柄<0.3%>	—	—		0.3
(ユーロ…シンガポール)		千口	千口	千ユーロ	千円		%
CROMWELL REIT EUR		131.74	101.34	198	28,494		0.1
小 計	□ 数 : 金 額	131.74	101.34	198	28,494		—
	銘 柄 数<比 率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.1%>	—	—		0.1
(ユーロ…アイルランド)		千口	千口	千ユーロ	千円		%
HIBERNIA REIT PLC		306.848	—	—	—		—
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI		214.307	125.78	158	22,808		0.0
小 計	□ 数 : 金 額	521.155	125.78	158	22,808		—
	銘 柄 数<比 率>	2銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	—	—		0.0
(ユーロ…オランダ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		18.21	—	—	—		—
VASTNED RETAIL		8.822	5.188	115	16,634		0.0
WERELDHAVE NV		18.894	13.152	192	27,565		0.0
NSI NV		8.112	5.696	195	27,987		0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		—	11.992	263	37,779		0.1
小 計	□ 数 : 金 額	54.038	36.028	766	109,967		—
	銘 柄 数<比 率>	4銘柄<0.2%>	4銘柄<0.2%>	—	—		0.2
(ユーロ…ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円		%
BEFIMMO		12.281	7.331	346	49,640		0.1
COFINIMMO SA		13.734	9.07	1,028	147,554		0.3
RETAIL ESTATES		5.045	3.376	218	31,287		0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		10.415	6.965	179	25,679		0.0
WAREHOUSES DE PAUW		64.409	43.839	1,386	198,862		0.4
MONTEA SCA		4.725	3.06	283	40,606		0.1
AEDIFICA		15.707	11.176	1,058	151,913		0.3
CARE PROPERTY INVEST NV		12.034	8.849	213	30,657		0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		8.239	6.95	287	41,178		0.1
小 計	□ 数 : 金 額	146.589	100.616	5,000	717,379		—
	銘 柄 数<比 率>	9銘柄<1.3%>	9銘柄<1.3%>	—	—		1.3
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%
GECINA SA		25.599	16.786	1,636	234,791		0.4
ICADE		14.526	9.819	478	68,656		0.1

銘柄		期首(前期末)		当期			期末	
		□数	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率		
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210		0.5	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	264.252	169.448	6,641	952,743	—	—	
(ユーロ…ドイツ)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
HAMBORNER REIT AG		32.106	23.534	200	28,697		0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		84.625	3.67	44	6,391		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	116.731	27.204	244	35,089	—	—	
(ユーロ…スペイン)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		119.135	82.605	530	76,139		0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA		27.656	18.955	93	13,474		0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		158.63	102.599	998	143,214		0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	305.421	204.159	1,622	232,828	—	—	
(ユーロ…イタリア)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE		25.287	14.36	51	7,323		0.0	
COIMA RES SPA		—	7.596	75	10,777		0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	25.287	21.956	126	18,100	—	—	
(ユーロ…フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円		%	
ALTAREA		1.643	1.248	160	23,095		0.0	
KLEPIERRE		93.81	60.076	1,241	178,144		0.3	
COVIVIO		22.853	14.518	829	119,029		0.2	
MERCIALYS		19.022	17.947	151	21,678		0.0	
CARMILA SA		21.853	13.198	196	28,135		0.1	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		64.946	35.856	1,946	279,210			

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

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

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

■投資信託財産の構成

2022年6月22日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	千円	%	55,595,607	98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	842,071	1.5		
投 資 信 託 財 産 総 額	56,437,679	100.0		

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、55,938,040千円、99.1％です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年6月22日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	56,437,679,196円
コ	等	288,322,757
一		5,691,222,488
ル		49,904,384,713
・		369,386,292
口		184,362,946
ー		434,601,501
ン		431,473,501
等		3,128,000
投	券(評価額)	
資	証 券(評価額)	
信		
託		
受		
益		
証		
資		
収		
入		
金		
未		
未		
収		
配		
当		
金		
(B) 負	債	
未		
未		
払		
払		
解		
約		
金		
(C) 純	資 産 総 額(A－B)	56,003,077,695
元		33,589,773,063
次		22,413,304,632
期		
繰		
越		
損		
益		
金		
(D) 受	益 権 総 口 数	33,589,773,063口
1		16,673円
万		
口		
当		
た		
り		
基		
準		
価		
額		
(C/D)		

(注1) 期首元本額 51,487,595,373円
追加設定元本額 123,561,181,960円
一部解約元本額 141,459,004,270円

(注2) 期末における元本の内訳
先進国REITインデックスF<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) 89,931,914円
先進国REITインデックスF<為替ヘッジあり> (ファンドラップ) 50,563,654円
MITO ラップ型ファンド (安定型) 6,720,407円
MITO ラップ型ファンド (中立型) 23,507,005円
MITO ラップ型ファンド (積極型) 124,969,213円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 31,704,221円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 17,648,722円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 28,738,279円
たわらノーロード 先進国リート 12,630,933,969円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> 1,109,201,766円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> 313,831,478円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 2,325,859,048円
たわらノーロード バランス (堅実型) 21,585,836円
たわらノーロード バランス (標準型) 393,429,232円
たわらノーロード バランス (積極型) 783,248,768円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 5,559,853円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 92,995,102円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) 219,476,091円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 126,975円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 5,370,883円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 2,144,625円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 11,960,422円
One DC先進国リートインデックスファンド 1,184,878,273円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 14,409,019円
マネックス資産設計ファンド (育成型) 497,283,471円
マネックス資産設計ファンド エゴリーション 42,883,778円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国10) 179,983,530円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国20) 232,723,605円
DIAMDC 8資産バランスファンド (新興国30) 466,414,247円
投資のソムリエ 6,257,726,433円
投資のソムリエ<DC年金> 394,192,597円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> 192,368,902円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 358,133,162円

リスク抑制世界8資産バランスファンド 1,813,208,729円
ワールドアセットバランス (基本コース) 355,965,633円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 243,707,293円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 36,458,019円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 18,413,243円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 2,367,743円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 82,448,556円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 319,237,578円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 147,067,136円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 42,933,275円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 19,741,762円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 12,168,821円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 2,125,847円
DIAMパッシブ資産分散ファンド 276,893,448円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金> 252,886,121円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) 983,915円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-4 53,121,417円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) 656,048円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) 459,027円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 21-03 56,379,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) 583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定) 826,526円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) 692,408円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 153,285,243円
AMOneマルチアセット・インカム戦略 (適格機関投資家限定) 8,623,168円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) 1,380,735円
リスクコントロール世界8資産/バランスファンド (FOF s用) (適格機関投資家専用) 7,212,770円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) 31,286,199円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) 80,722,535円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 194,641,132円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) 823,557,498円
DIAM海外リートインデックスファンド (適格機関投資家限定) 436,383,528円
期末元本合計 33,589,773,063円

■損益の状況

当期 自2021年6月23日 至2022年6月22日

項 目					当 期
(A)	配 当 受 取	等 配 取	収 当 利	益 金 息	2,249,560,788円
					2,170,878,662
					1,204,472
	の	他	収 益	金	77,775,326
	支 払		利 息		△297,672
(B)	有 価 証 券	売 買	損 益		1,466,080,453
	売 買		益 損		20,774,196,674
					△19,308,116,221
(C)	そ の	他	費 用		△65,480,614
(D)	当 期 損 益		金(A + B + C)		3,650,160,627
(E)	前 期 繰 越		損 益 金		27,471,618,273
(F)	解 約 差 損 益		金		△94,232,927,308
(G)	追 加 信 託 差 損 益		金		85,524,453,040
(H)	合 計(D + E + F + G)				22,413,304,632
	次 期 繰 越 損 益 金(H)				22,413,304,632

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2022年4月18日）

（計算期間 2021年4月20日～2022年4月18日）

エマージング債券パッシブ・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2008年3月6日から無期限です。
運 用 方 針	主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主 要 投 資 対 象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース・為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比 率	債券先物 率 率	純 資 産 総 額
		期 騰 落 率		期 騰 落 率			
10期 (2018年4月18日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
	17,815	△0.6	87,698.99	△1.0	96.4	—	111,615
11期 (2019年4月18日)	19,206	7.8	93,647.60	6.8	97.5	—	108,066
12期 (2020年4月20日)	19,435	1.2	88,952.63	△5.0	96.5	—	78,076
13期 (2021年4月19日)	21,087	8.5	98,265.18	10.5	98.4	—	152,776
14期 (2022年4月18日)	19,947	△5.4	93,033.64	△5.3	97.6	—	137,292

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します（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）。

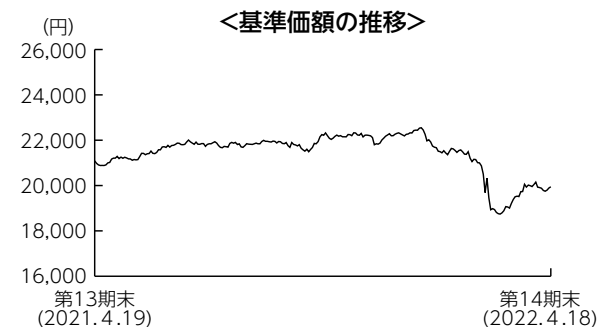
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ＪＰモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース・ 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021 年 4 月 19 日	円 21,087	% －	ポイント 98,265.18	% －	% 98.4	% －
4 月 末	21,020	△0.3	98,056.84	△0.2	98.2	－
5 月 末	21,419	1.6	100,513.37	2.3	98.2	－
6 月 末	21,816	3.5	102,177.41	4.0	98.0	－
7 月 末	21,668	2.8	101,776.22	3.6	98.3	－
8 月 末	21,941	4.0	103,575.81	5.4	97.8	－
9 月 末	21,803	3.4	102,494.39	4.3	91.4	－
10 月 末	22,177	5.2	104,130.69	6.0	98.3	－
11 月 末	21,843	3.6	101,547.56	3.3	91.6	－
12 月 末	22,441	6.4	104,567.15	6.4	97.6	－
2022 年 1 月 末	21,616	2.5	100,953.92	2.7	98.2	－
2 月 末	20,330	△3.6	94,159.30	△4.2	97.2	－
3 月 末	20,021	△5.1	95,873.44	△2.4	96.4	－
(期 末) 2022 年 4 月 18 日	19,947	△5.4	93,033.64	△5.3	97.6	－

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月20日から2022年4月18日まで）

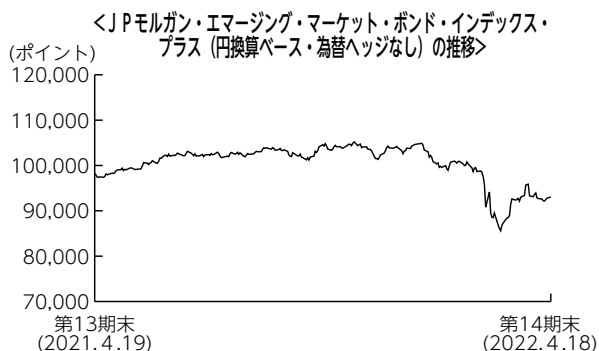


基準価額の推移

当期末の基準価額は19,947円となり、前期末比で5.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米長期金利の上昇（価格は下落）を主因に、基準価額は下落しました。



投資環境

新興国債券市場は大幅に下落しました。期初から2021年8月にかけては、欧米での景気回復期待や欧州復興基金の創設でEU（欧州連合）首脳が合意したことなどから堅調に推移したものの、その後は新型コロナウイルス感染の再拡大やタカ派的な米金融当局の姿勢、労働市場の引き締めなどから下落しました。2022年2月後半にはロシアがウクライナに軍事侵攻したことで急落し、続く経済・金融面での対ロシア制裁が世界経済にも不確実性をもたらすとの思惑などから期末にかけても荒い展開となりました。

為替市場では、米ドルは対円で大幅に上昇しました。2021年9月から10月にかけては、米国の金融政策正常化観測や景気改善期待などから上昇しました。2022年3月以降は、欧米各国が利上げなどタカ派的な政策に向かう一方、日銀が金融緩和を維持していることから、政策の違いが意識され、大幅な円安米ドル高が進みました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）とポートフォリオのリスク特性を概ね一致させたポートフォリオを構築しました。なお、運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国の債券には投資しませんでした。当期はロシアを全売却しました。

【運用状況】

○国別構成比

期首（前期末）

国	ファンド	ベンチマーク	差
中南米			
アルゼンチン	－	6.0%	△6.0%
ブラジル	10.4%	8.5%	1.9%
メキシコ	15.7%	13.1%	2.6%
パナマ	5.9%	4.1%	1.8%
ペルー	5.6%	3.9%	1.7%
ベネズエラ	－	0.0%	△0.0%
コロンビア	9.4%	7.6%	1.8%
計	47.0%	43.2%	3.8%
欧州			
ハンガリー	4.1%	2.3%	1.8%
ロシア	12.9%	10.4%	2.6%
トルコ	－	14.1%	△14.1%
ウクライナ	－	4.2%	△4.2%
クロアチア	2.1%	1.0%	1.0%
ルーマニア	3.6%	2.0%	1.5%
計	22.7%	34.1%	△11.4%
アジア・オセアニア			
インドネシア	13.5%	11.2%	2.3%
フィリピン	9.0%	7.1%	1.8%
計	22.4%	18.3%	4.1%
アフリカ			
南アフリカ	6.3%	4.4%	1.9%
計	6.3%	4.4%	1.9%
現金など	1.6%	－	－
合計	100.0%	100.0%	－



期末

国	ファンド	ベンチマーク	差
中南米			
アルゼンチン	－	4.4%	△4.4%
ブラジル	9.5%	7.7%	1.8%
チリ	2.2%	1.5%	0.7%
メキシコ	11.7%	9.3%	2.4%
パナマ	7.5%	6.4%	1.1%
ペルー	7.1%	5.9%	1.3%
ベネズエラ	－	0.0%	△0.0%
エクアドル	－	0.9%	△0.9%
コロンビア	7.9%	6.2%	1.7%
ドミニカ共和国	1.3%	1.1%	0.2%
ウルグアイ	0.8%	0.5%	0.3%
計	48.2%	43.9%	4.2%
欧州			
ハンガリー	4.5%	3.3%	1.2%
トルコ	－	9.8%	△9.8%
ウクライナ	－	2.5%	△2.5%
クロアチア	2.1%	1.4%	0.7%
ルーマニア	3.4%	2.6%	0.8%
計	10.0%	19.7%	△9.7%
アジア・オセアニア			
中国	0.2%	1.0%	△0.8%
インドネシア	11.4%	8.9%	2.5%
フィリピン	8.7%	7.4%	1.3%
スリランカ	－	0.1%	△0.1%
計	20.3%	17.4%	2.9%
中近東			
カタール	3.9%	3.0%	0.8%
アラブ首長国連邦	3.7%	3.0%	0.7%
サウジアラビア	4.6%	4.8%	△0.1%
オマーン	－	1.3%	△1.3%
計	12.2%	12.0%	0.2%
アフリカ			
南アフリカ	7.0%	5.9%	1.1%
エジプト	－	0.8%	△0.8%
ナイジェリア	－	0.3%	△0.3%
計	7.0%	7.0%	0.0%
現金など	2.4%	－	－
合計	100.0%	100.0%	－

（注１）ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

（注２）ベンチマークは、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスです。

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5.3%下落しました。
当ファンドはベンチマークを0.1%下回りました。当期は概ねベンチマークに連動しました。

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めざして運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.013%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(3)	(0.013)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は21,435円です。			

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

■売買及び取引の状況 (2021年4月20日から2022年4月18日まで)

			買 付 額	売 付 額
外国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
			2,747,556	2,826,988 (12,350)

(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。

■利害関係人との取引状況等 (2021年4月20日から2022年4月18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 1,105,238	千アメリカ・ドル 1,057,538	千円 133,968,997	% 97.6	% 17.8	% 77.6	% 12.1	% 7.9
合 計	—	—	133,968,997	97.6	17.8	77.6	12.1	7.9

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

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末					
	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	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国 債 証 券	6.0500	9,900	10,594	1,342,096	2040/01/11
BRAZIL 5.625 01/07/41	国 債 証 券	5.6250	10,100	9,413	1,192,502	2041/01/07
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	国 債 証 券	4.6000	11,000	9,812	1,242,984	2046/01/23
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	国 債 証 券	3.1000	3,000	2,242	284,098	2061/01/22
PANAMA 4.5 01/19/63	国 債 証 券	4.5000	2,000	1,804	228,609	2063/01/19
PANAMA 7.125 01/29/26	国 債 証 券	7.1250	3,800	4,292	543,780	2026/01/29
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	国 債 証 券	7.7500	3,100	3,956	501,162	2031/01/14
ROMANIA 6.125 01/22/44	国 債 証 券	6.1250	8,400	9,288	1,176,657	2044/01/22
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	国 債 証 券	3.7500	2,000	1,820	230,593	2055/01/21
INDONESIA 5.25 01/17/42	国 債 証 券	5.2500	10,300	10,882	1,378,614	2042/01/17
INDONESIA 6.75 01/15/44	国 債 証 券	6.7500	6,500	8,200	1,038,837	2044/01/15
BRAZIL 5.0 01/27/45	国 債 証 券	5.0000	10,800	9,156	1,159,926	2045/01/27
INDONESIA 5.125 01/15/45	国 債 証 券	5.1250	8,400	8,782	1,112,590	2045/01/15
INDONESIA 4.35 01/11/48	国 債 証 券	4.3500	5,000	4,873	617,405	2048/01/11
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	国 債 証 券	5.8750	6,000	4,830	611,864	2060/01/30
BRAZIL 8.25 01/20/34	国 債 証 券	8.2500	7,200	8,654	1,096,339	2034/01/20
PANAMA 6.7 01/26/36	国 債 証 券	6.7000	11,900	14,093	1,785,322	2036/01/26
INDONESIA 7.75 01/17/38	国 債 証 券	7.7500	4,500	5,926	750,709	2038/01/17
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	国 債 証 券	3.9500	7,800	7,412	939,008	2040/01/20
INDONESIA 5.95 01/08/46	国 債 証 券	5.9500	4,200	4,880	618,322	2046/01/08
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	国 債 証 券	3.6000	4,200	4,267	540,547	2025/01/30
INDONESIA 4.125 01/15/25	国 債 証 券	4.1250	5,800	5,930	751,235	2025/01/15
INDONESIA 4.35 01/08/27	国 債 証 券	4.3500	6,000	6,232	789,528	2027/01/08
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	国 債 証 券	3.7500	8,000	8,083	1,023,998	2029/01/14
ROMANIA 4.875 01/22/24	国 債 証 券	4.8750	5,600	5,773	731,408	2024/01/22
COLOMBIA 4.5 01/28/26	国 債 証 券	4.5000	9,000	8,843	1,120,333	2026/01/28
CROATIA 6.0 01/26/24	国 債 証 券	6.0000	11,400	11,985	1,518,359	2024/01/26

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	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	国 債 証 券	4.1250	7,000	7,222	914,896	2026/01/21
INDONESIA 5.875 01/15/24	国 債 証 券	5.8750	6,200	6,520	826,055	2024/01/15
INDONESIA 4.75 01/08/26	国 債 証 券	4.7500	7,800	8,169	1,034,857	2026/01/08
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	国 債 証 券	4.2000	6,800	6,969	882,864	2024/01/21
BRAZIL 4.625 01/13/28	国 債 証 券	4.6250	12,800	12,785	1,619,614	2028/01/13
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	国 債 証 券	3.7500	5,200	5,164	654,273	2028/01/11
INDONESIA 3.5 01/11/28	国 債 証 券	3.5000	5,200	5,231	662,749	2028/01/11
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	国 債 証 券	5.2500	2,000	2,245	284,449	2050/01/16
PERU 3.0 01/15/34	国 債 証 券	3.0000	5,000	4,380	554,858	2034/01/15
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	国 債 証 券	3.5000	3,000	2,544	322,395	2050/01/25
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	国 債 証 券	3.5000	2,000	1,887	239,045	2034/01/31
PANAMA 3.16 01/23/30	国 債 証 券	3.1600	10,000	9,486	1,201,686	2030/01/23
BRAZIL 4.75 01/14/50	国 債 証 券	4.7500	12,000	9,639	1,221,068	2050/01/14
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	国 債 証 券	2.5500	2,000	1,800	228,024	2032/01/27
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	国 債 証 券	4.5000	6,000	5,281	669,098	2050/01/31
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	国 債 証 券	2.4500	2,000	1,804	228,591	2031/01/31
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	国 債 証 券	4.3750	4,000	4,210	533,322	2031/01/23
PERU 2.783 01/23/31	国 債 証 券	2.7830	20,000	18,025	2,283,407	2031/01/23
COLOMBIA 3.0 01/30/30	国 債 証 券	3.0000	8,000	6,658	843,531	2030/01/30
PERU 2.392 01/23/26	国 債 証 券	2.3920	6,000	5,712	723,649	2026/01/23
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	国 債 証 券	2.7500	2,000	1,920	243,225	2027/01/31
COLOMBIA 3.875 02/15/61	国 債 証 券	3.8750	4,000	2,669	338,113	2061/02/15
BRAZIL 8.75 02/04/25	国 債 証 券	8.7500	4,800	5,550	703,074	2025/02/04
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	国 債 証 券	3.7000	8,000	7,344	930,337	2042/02/02
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	国 債 証 券	4.6000	8,400	7,420	940,009	2048/02/10
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	国 債 証 券	3.4500	3,000	2,513	318,420	2061/02/02
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	国 債 証 券	9.5000	5,800	8,005	1,014,097	2030/02/02
COLOMBIA 4.125 02/22/42	国 債 証 券	4.1250	9,000	6,600	836,152	2042/02/22
COLOMBIA 5.625 02/26/44	国 債 証 券	5.6250	11,000	9,358	1,185,558	2044/02/26
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	国 債 証 券	3.5000	2,000	1,760	223,020	2034/02/12
INDONESIA 5.35 02/11/49	国 債 証 券	5.3500	3,000	3,309	419,203	2049/02/11
ROMANIA 4.0 02/14/51	国 債 証 券	4.0000	9,000	7,485	948,324	2051/02/14
BRAZIL 5.625 02/21/47	国 債 証 券	5.6250	7,600	6,864	869,572	2047/02/21
INDONESIA 4.75 02/11/29	国 債 証 券	4.7500	5,000	5,366	679,802	2029/02/11
HUNGARY 5.375 02/21/23	国 債 証 券	5.3750	5,358	5,482	694,492	2023/02/21
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	国 債 証 券	3.0000	10,000	9,816	1,243,564	2028/02/01
ROMANIA 3.0 02/14/31	国 債 証 券	3.0000	9,000	8,080	1,023,690	2031/02/14
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	国 債 証 券	3.2400	3,000	2,932	371,430	2028/02/06
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	国 債 証 券	2.2500	4,000	3,566	451,741	2033/02/02
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国 債 証 券	6.0000	5,000	4,693	594,604	2033/02/22
INDONESIA 2.85 02/14/30	国 債 証 券	2.8500	4,000	3,800	481,386	2030/02/14
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国 債 証 券	5.5000	5,000	4,797	607,747	2029/02/22
PANAMA 3.875 03/17/28	国 債 証 券	3.8750	7,100	7,085	897,638	2028/03/17
COLOMBIA 4.5 03/15/29	国 債 証 券	4.5000	9,000	8,456	1,071,211	2029/03/15

銘	柄	当			期		末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(アメリカ)					%	千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル		千円			
HUNGARY 7.625 03/29/41		国	債	証	券	7.6250	7,000	9,485	1,201,651	2041/03/29			
HUNGARY 5.375 03/25/24		国	債	証	券	5.3750	14,380	14,997	1,899,853	2024/03/25			
PANAMA 3.75 03/16/25		国	債	証	券	3.7500	7,200	7,291	923,679	2025/03/16			
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27		国	債	証	券	4.1500	7,400	7,611	964,247	2027/03/28			
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49		国	債	証	券	4.8170	6,000	6,732	852,857	2049/03/14			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.875 03/04/23		国	債	証	券	2.8750	2,000	2,008	254,424	2023/03/04			
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42		国	債	証	券	4.3400	3,000	2,893	366,501	2042/03/07			
PERU 3.3 03/11/41		国	債	証	券	3.3000	10,000	8,387	1,062,541	2041/03/11			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28		国	債	証	券	3.6250	6,000	6,057	767,376	2028/03/04			
PERU 3.55 03/10/51		国	債	証	券	3.5500	10,000	8,397	1,063,807	2051/03/10			
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29		国	債	証	券	4.0000	5,000	5,225	661,998	2029/03/14			
INDONESIA 3.05 03/12/51		国	債	証	券	3.0500	6,000	5,132	650,197	2051/03/12			
INDONESIA 1.85 03/12/31		国	債	証	券	1.8500	7,000	6,100	772,799	2031/03/12			
ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31		国	債	証	券	1.7000	4,000	3,565	451,664	2031/03/02			
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24		国	債	証	券	3.3750	4,000	4,035	511,179	2024/03/14			
PANAMA 4.5 04/16/50		国	債	証	券	4.5000	12,300	11,420	1,446,770	2050/04/16			
PANAMA 4.5 04/01/56		国	債	証	券	4.5000	13,000	12,008	1,521,268	2056/04/01			
INDONESIA 4.45 04/15/70		国	債	証	券	4.4500	3,000	2,910	368,641	2070/04/15			
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71		国	債	証	券	3.7500	7,000	5,068	642,014	2071/04/19			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60		国	債	証	券	4.5000	4,000	4,112	521,028	2060/04/22			
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51		国	債	証	券	5.0000	7,000	6,583	834,006	2051/04/27			
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29		国	債	証	券	4.5000	8,000	8,159	1,033,693	2029/04/22			
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32		国	債	証	券	4.7500	9,000	9,138	1,157,712	2032/04/27			
CROATIA 5.5 04/04/23		国	債	証	券	5.5000	10,400	10,713	1,357,127	2023/04/04			
INDONESIA 4.1 04/24/28		国	債	証	券	4.1000	4,000	4,154	526,251	2028/04/24			
COLOMBIA 3.25 04/22/32		国	債	証	券	3.2500	12,000	9,648	1,222,269	2032/04/22			
BRAZIL 6.0 04/07/26		国	債	証	券	6.0000	9,800	10,521	1,332,829	2026/04/07			
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26		国	債	証	券	4.8750	9,400	9,537	1,208,268	2026/04/14			
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48		国	債	証	券	5.1030	6,000	6,952	880,780	2048/04/23			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49		国	債	証	券	5.0000	3,000	3,233	409,563	2049/04/17			
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55		国	債	証	券	4.9750	4,000	4,366	553,176	2055/04/20			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29		国	債	証	券	4.3750	6,000	6,357	805,357	2029/04/16			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30		国	債	証	券	4.5000	4,000	4,271	541,059	2030/04/17			
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30		国	債	証	券	3.2500	10,000	9,290	1,176,958	2030/04/16			
COLOMBIA 3.125 04/15/31		国	債	証	券	3.1250	12,000	9,741	1,234,005	2031/04/15			
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28		国	債	証	券	4.5000	5,000	5,362	679,258	2028/04/23			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25		国	債	証	券	4.0000	5,000	5,142	651,388	2025/04/17			
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50		国	債	証	券	4.4000	5,000	5,327	674,887	2050/04/16			
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50		国	債	証	券	3.8750	5,000	4,922	623,577	2050/04/16			
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30		国	債	証	券	3.1250	5,000	4,997	633,087	2030/04/16			
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30		国	債	証	券	3.7500	4,000	4,133	523,644	2030/04/16			
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25		国	債	証	券	3.9000	3,000	3,054	386,884	2025/04/27			
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25		国	債	証	券	3.4000	4,000	3,985	504,819	2025/04/16			
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25		国	債	証	券	2.5000	3,000	2,959	374,947	2025/04/16			

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		
COLOMBIA 4.125 05/15/51	国債証券	4.1250	5,000	3,532	447,503	2051/05/15	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	国債証券	3.7710	10,000	7,493	949,308	2061/05/24	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	国債証券	5.2000	8,000	6,423	813,690	2049/05/15	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	国債証券	3.1000	3,000	2,473	313,342	2041/05/07	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	国債証券	2.6590	14,000	12,206	1,546,278	2031/05/24	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	国債証券	2.9500	4,000	3,190	404,174	2045/05/05	
BRAZIL 4.5 05/30/29	国債証券	4.5000	8,000	7,697	975,131	2029/05/30	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	国債証券	2.4570	12,000	10,949	1,387,128	2030/05/05	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	国債証券	5.8750	9,400	9,664	1,224,300	2030/06/22	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	5.0000	17,000	13,403	1,697,909	2045/06/15	
ROMANIA 5.125 06/15/48	国債証券	5.1250	6,600	6,516	825,457	2048/06/15	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	国債証券	6.3000	4,000	3,673	465,414	2048/06/22	
PERU 2.844 06/20/30	国債証券	2.8440	6,000	5,497	696,468	2030/06/20	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	国債証券	1.6480	9,000	7,700	975,552	2031/06/10	
BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	3.8750	13,000	11,734	1,486,585	2030/06/12	
ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	国債証券	1.6250	2,000	1,837	232,787	2028/06/02	
BRAZIL 2.875 06/06/25	国債証券	2.8750	6,000	5,831	738,774	2025/06/06	
PANAMA 3.87 07/23/60	国債証券	3.8700	2,000	1,619	205,160	2060/07/23	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	国債証券	2.5500	4,000	3,483	441,226	2033/07/27	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	国債証券	3.2000	7,000	5,835	739,248	2046/07/06	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	国債証券	4.2800	2,000	1,740	220,423	2041/08/14	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	国債証券	2.7000	2,000	1,458	184,711	2070/09/02	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	国債証券	5.8750	10,200	10,795	1,367,538	2025/09/16	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	国債証券	5.6500	9,200	7,811	989,553	2047/09/27	
HUNGARY 3.125 09/21/51	国債証券	3.1250	2,000	1,543	195,492	2051/09/21	
INDONESIA 3.4 09/18/29	国債証券	3.4000	4,000	3,968	502,686	2029/09/18	
PANAMA 2.252 09/29/32	国債証券	2.2520	15,000	12,676	1,605,840	2032/09/29	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	国債証券	3.1250	2,000	1,725	218,583	2049/09/30	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	国債証券	5.7500	14,000	11,993	1,519,374	2049/09/30	
BRAZIL 3.75 09/12/31	国債証券	3.7500	6,000	5,304	671,910	2031/09/12	
HUNGARY 2.125 09/22/31	国債証券	2.1250	3,000	2,551	323,163	2031/09/22	
ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	国債証券	1.8750	4,000	3,597	455,713	2031/09/15	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	国債証券	2.5000	3,000	2,883	365,334	2029/09/30	
ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	国債証券	0.7500	3,000	2,929	371,109	2023/09/02	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	国債証券	4.8500	12,000	11,580	1,466,954	2029/09/30	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,000	1,963	248,772	2024/09/30	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	国債証券	5.7500	5,800	5,449	690,280	2110/10/12	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	国債証券	3.2500	2,000	1,736	219,992	2061/10/19	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	国債証券	6.3750	9,000	10,900	1,380,930	2034/10/23	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	国債証券	4.3000	11,200	10,661	1,350,650	2028/10/12	
INDONESIA 4.2 10/15/50	国債証券	4.2000	5,000	4,803	608,485	2050/10/15	
ABU DHABI GOVT INT'L 4.125 10/11/47	国債証券	4.1250	2,000	2,045	259,085	2047/10/11	
INDONESIA 3.7 10/30/49	国債証券	3.7000	3,000	2,706	342,901	2049/10/30	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.625 10/04/47	国債証券	4.6250	3,000	3,046	385,959	2047/10/04	

銘	柄	当			期		末						
		種	類	利	率	額	面	金	額	評	価	額	償還年月日
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル		千アメリカ・ドル		千円					
INDONESIA 3.85 10/15/30		国	債	証	券	3.8500	6,000	6,099	772,654	2030/10/15			
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30		国	債	証	券	1.2000	2,000	1,729	219,096	2030/10/21			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30		国	債	証	券	3.2500	2,000	1,967	249,262	2030/10/22			
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25		国	債	証	券	2.9000	4,000	3,980	504,186	2025/10/22			
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27		国	債	証	券	3.1250	3,000	3,022	382,859	2027/10/11			
PERU 5.625 11/18/50		国	債	証	券	5.6250	11,000	12,872	1,630,733	2050/11/18			
HUNGARY 5.75 11/22/23		国	債	証	券	5.7500	14,000	14,604	1,850,153	2023/11/22			
PERU 2.78 12/01/60		国	債	証	券	2.7800	11,000	7,699	975,338	2060/12/01			
PERU 1.862 12/01/32		国	債	証	券	1.8620	8,000	6,432	814,805	2032/12/01			
PHILIPPINES 2.65 12/10/45		国	債	証	券	2.6500	5,000	3,846	487,249	2045/12/10			
合	計	—		—		—	1,105,238	1,057,538	133,968,997	—			

■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
公 社 債	千円 133,968,997	% 96.3	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,083,944	3.7	
投 資 信 託 財 産 総 額	139,052,942	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、137,112,810千円、98.6％です。
(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝126.68円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

項	目	当 期 末
(A)	資 産	139,052,942,122円
	コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,558,351,761
	公 社 債(評価額)	133,968,997,674
	未 収 利 息	534,037,882
	前 払 費 用	991,554,805
(B)	負 債	1,760,168,800
	未 払 金	1,758,951,800
	未 払 解 約 金	1,217,000
(C)	純 資 産 総 額(A-B)	137,292,773,322
	元 本	68,830,241,594
	次 期 繰 越 損 益 金	68,462,531,728
(D)	受 益 権 総 口 数	68,830,241,594口
	1万口当たり基準価額(C/D)	19,947円

(注1) 期首元本額 72,451,871,684円
 追加設定元本額 145,248,490,978円
 一部解約元本額 148,870,121,068円

(注2) 期末における元本の内訳

DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>	193,172,059円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,842,717,308円
たわらノーロード バランス (堅実型)	137,186,833円
たわらノーロード バランス (標準型)	384,233,606円
たわらノーロード バランス (積極型)	163,093,610円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,133,115円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	3,132,310円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	29,703,612円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	2,217,012円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,217,582円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,256,549円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	236,077,296円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	325,129,552円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	670,583,251円
投資のソムリエ	21,826,975,940円
クルーズコントロール	269,846,036円
投資のソムリエ<DC年金>	1,327,285,815円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	243,760,761円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,135,044,315円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,330,686,040円
ワールドアセットバランス (基本コース)	536,425,776円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	600,825,759円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	33,112,488円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	16,727,971円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	7,764,190円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	124,678,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	798,577,422円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	222,519,382円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	36,355,348円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	14,482,845円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	11,120,595円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	1,277,092円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	21,510,968,507円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	555,387,723円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,435,421,495円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2 (適格機関投資家限定)	589,689,490円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	19,931,763円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	92,241,468円
エマージング債券パッシブファンドVA (適格機関投資家専用)	9,327,182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)	174,538,113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)	86,381,611円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	5,769,033,876円
期末元本合計	68,830,241,594円

■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

項	目	当 期
(A)	配 当 等 収 益	6,283,492,883円
	受 取 利 息	6,283,975,110
	支 払 利 息	△482,227
(B)	有 価 証 券 売 買 損 益	△12,859,825,221
	売 買 損 益	17,626,879,424
	売 買 損 益	△30,486,704,645
(C)	そ の 他 費 用	△17,925,399
(D)	当 期 損 益 金(A+B+C)	△6,594,257,737
(E)	前 期 繰 越 損 益 金	80,324,854,399
(F)	解 約 差 損 益 金	△168,137,236,956
(G)	追 加 信 託 差 損 益 金	162,869,172,022
(H)	合 計(D+E+F+G)	68,462,531,728
	次 期 繰 越 損 益 金(H)	68,462,531,728

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2022年4月18日）

（計算期間 2021年4月20日～2022年4月18日）

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第14期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2008年2月20日から無期限です。
運 用 方 針	主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主 要 投 資 対 象	海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。 ※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。
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エマージング・マーケット・インデックス		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純 資 産 額 総
		期 中 騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	期 中 騰落率				
10期(2018年4月18日)	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
11期(2019年4月18日)	12,241	20.9	273,007.15	21.9	92.1	7.1	0.7	66,443
12期(2020年4月20日)	12,260	0.2	276,323.22	1.2	94.4	4.4	0.6	61,535
13期(2021年4月19日)	9,723	△20.7	225,442.54	△18.4	64.7	34.8	0.4	41,166
14期(2022年4月18日)	14,848	52.7	347,921.32	54.3	93.2	6.1	0.7	58,156
	14,507	△2.3	343,415.90	△1.3	84.0	15.2	0.6	62,888

（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エマージング・マーケット・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エマージング・マーケット・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

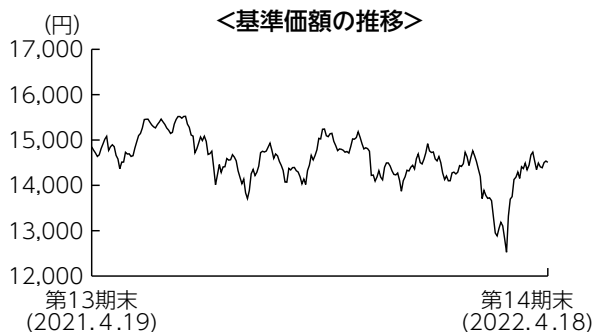
年 月 日	基 準 価 額		MSCIエマージング・ マーケット・インデックス		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入 比率
		騰落率	(円換算ベース、 配当込み、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)	騰落率			
(期 首) 2021年 4 月19日	円 14,848	% －	ポイント 347,921.32	% －	% 93.2	% 6.1	% 0.7
4 月 末	15,081	1.6	353,070.95	1.5	92.6	6.7	0.7
5 月 末	15,145	2.0	355,462.51	2.2	89.3	10.6	0.7
6 月 末	15,480	4.3	363,603.66	4.5	88.1	11.2	0.7
7 月 末	14,459	△2.6	340,066.34	△2.3	85.8	13.5	0.7
8 月 末	14,424	△2.9	339,465.31	△2.4	87.7	11.5	0.7
9 月 末	14,324	△3.5	337,651.14	△3.0	90.6	7.7	0.7
10 月 末	14,874	0.2	349,962.23	0.6	90.0	9.3	0.6
11 月 末	14,227	△4.2	334,849.20	△3.8	90.5	7.2	0.6
12 月 末	14,363	△3.3	339,256.12	△2.5	88.0	12.5	0.6
2022年 1 月 末	14,102	△5.0	333,169.94	△4.2	94.5	4.9	0.6
2 月 末	13,886	△6.5	328,370.31	△5.6	89.5	9.6	0.6
3 月 末	14,489	△2.4	342,137.40	△1.7	89.6	9.6	0.7
(期 末) 2022年 4 月18日	14,507	△2.3	343,415.90	△1.3	84.0	15.2	0.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年4月20日から2022年4月18日まで）

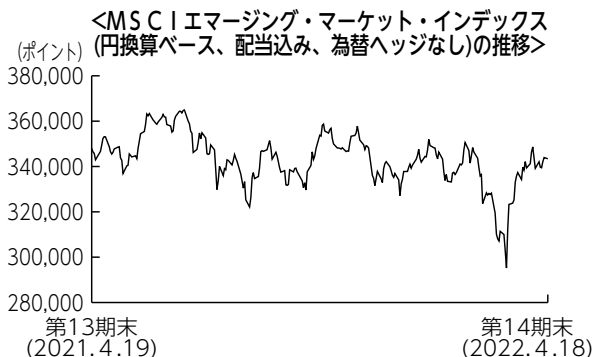


基準価額の推移

当期末の基準価額は14,507円となり、前期末比で2.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

為替市場では多くの組入通貨に対して円安となったものの、中国や韓国、台湾などの株式市場が下落したことから、当ファンドの基準価額は下落しました。



投資環境

新興国株式市場は下落しました。2021年は先進国株式市場の上昇に連れ高となる場面もありましたが、中国の大手不動産企業の破綻懸念や特定の業種に対する規制強化、米国の金融政策の転換見通しなどが株価押し下げ要因となり、比較的狭い範囲での値動きとなりました。2022年はロシアによるウクライナ侵攻を受け、米欧などが制裁を強化したことでロシア株式を中心に下落しました。3月中旬以降は急速に持ち直しましたが、前期末の水準を下回って期末を迎えました。

為替市場では、米ドルは米国の経済活動正常化やインフレ率の上昇により、金融緩和策の転換や継続的な利上げが意識されたことなどから対円で上昇しました。他の多くの通貨も対円で上昇しましたが、トルコではエルドアン大統領の度重なる介入により中央銀行の独立性が危惧されたことなどからトルコリラは対円で大きく下落しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIEマージング・マーケット・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。

保有するロシア関連銘柄につきましてはベンチマークからは削除されているものの、取引所等の制約により売却できない状態が続いています。

【運用状況】

○組入上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	組入比率
1	銀行	12.2%
2	小売	10.7
3	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.9
4	メディア・娯楽	8.8
5	半導体・半導体製造装置	8.8
6	素材	7.9
7	エネルギー	4.4
8	食品・飲料・タバコ	3.1
9	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.1
10	自動車・自動車部品	3.1

期末

No.	業種	組入比率
1	銀行	14.2%
2	素材	8.1
3	半導体・半導体製造装置	8.1
4	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.9
5	メディア・娯楽	5.8
6	小売	5.3
7	エネルギー	4.2
8	食品・飲料・タバコ	3.2
9	電気通信サービス	3.0
10	資本財	2.8



（注1）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（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1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.0%下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、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。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

■ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) (投 資 信 託 受 益 証 券) (投 資 証 券)	17円 (14) (0) (2) (0) (0)	0.116% (0.098) (0.000) (0.016) (0.001) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (投 資 信 託 受 益 証 券) (投 資 証 券)	27 (27) (0) (0) (0)	0.189 (0.189) (0.000) (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)	71 (18) (53)	0.485 (0.124) (0.361)	(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	115	0.789	
期中の平均基準価額は14,559円です。			

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

■ 売買及び取引の状況 (2021年 4 月20日から2022年 4 月18日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 20,146.02 (△824.92)	千アメリカ・ドル 58,144 (-)	百株 16,543.25	千アメリカ・ドル 77,287
	香 港	百株 616,544.18 (105.96)	千香港・ドル 1,376,880 (△262)	百株 618,091.69	千香港・ドル 983,742
	台 湾	百株 254,227.68 (2,768.45)	千台湾・ドル 2,547,939 (△3,777)	百株 264,897.71	千台湾・ドル 2,464,130
	イ ギ リ ス	百株 371.85 (-)	千イギリス・ポンド 531 (-)	百株 528.52	千イギリス・ポンド 273
	ト ル コ	百株 5,577.81 (-)	千トルコ・リラ 12,088 (-)	百株 8,363.98	千トルコ・リラ 15,167
	メ キ シ コ	百株 42,372.7 (-)	千メキシコ・ペソ 181,080 (△283)	百株 43,439.65	千メキシコ・ペソ 189,768
	フ ィ リ ピ ン	百株 36,563.6 (-)	千フィリピン・ペソ 200,591 (-)	百株 37,358.7	千フィリピン・ペソ 197,158
	チ リ	百株 135,635.14 (1.33)	千チリ・ペソ 1,787,010 (-)	百株 132,638.16	千チリ・ペソ 2,027,983

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	コ ロ ン ビ ア	百株 2,474.83 (-)	千コロンビア・ペソ 4,262,317 (-)	百株 2,351.82	千コロンビア・ペソ 5,156,904
	ク ウ ェ ー ト	百株 9,476.64 (768.56)	千クウェート・ディナール 882 (-)	百株 11,022.63	千クウェート・ディナール 945
	カ タ ー ル	百株 13,991.54 (-)	千カタール・リアル 13,116 (-)	百株 14,153.17	千カタール・リアル 14,742
	サ ウ ジ ア ラ ビ ア	百株 12,280.49 (108.98)	千サウジアラビア・リアル 69,371 (-)	百株 12,682.28	千サウジアラビア・リアル 72,767
	イ ン ド	百株 64,736.61 (1,481.04)	千インド・ルピー 5,595,119 (-)	百株 64,216.43	千インド・ルピー 5,385,934
	パ キ ス タ ン	百株 70 (-)	千パキスタン・ルピー 6,367 (-)	百株 605.68	千パキスタン・ルピー 11,225
	イ ン ド ネ シ ア	百株 234,540 (35,713.31)	千インドネシア・ルピア 112,524,368 (-)	百株 240,572.31	千インドネシア・ルピア 108,450,071
	ア ラ ブ 首 長 国 連 邦	百株 20,159.66 (39.92)	千アラブ首長国連邦・ディルハム 25,454 (-)	百株 18,602.71	千アラブ首長国連邦・ディルハム 22,145
	ブ ラ ジ ル	百株 53,158 (6,541.86)	千ブラジル・レアル 148,194 (△274)	百株 55,963.57	千ブラジル・レアル 149,909
	チ ェ コ	百株 301.59 (-)	千チェコ・コルナ 24,670 (-)	百株 337.74	千チェコ・コルナ 27,798
国	韓 国	百株 11,449.68 (193.35)	千韓国・ウォン 95,478,180 (-)	百株 11,582.72	千韓国・ウォン 88,653,527
	中 国	百株 125,580.09 (1,388.19)	千オフショア・人民元 206,239 (-)	百株 121,571.97	千オフショア・人民元 182,375
	マ レ ー シ ア	百株 57,040 (788)	千マレーシア・リンギット 27,434 (-)	百株 58,387.71	千マレーシア・リンギット 27,121
	南 ア フ リ カ	百株 21,398.27 (-)	千南アフリカ・ランド 308,836 (△807)	百株 20,769.72	千南アフリカ・ランド 343,620
	タ イ	百株 114,059 (-)	千タイ・バーツ 334,982 (△82)	百株 120,757	千タイ・バーツ 369,144
	ポ ー ラ ン ド	百株 3,983.18 (-)	千ポーランド・ズロチ 17,822 (-)	百株 3,295.52	千ポーランド・ズロチ 16,589
	ハ ン ガ リ ー	百株 499.33 (-)	千ハンガリー・フォリント 423,627 (-)	百株 537.49	千ハンガリー・フォリント 400,239
	ユ ー ロ ギ リ シ ャ	百株 5,064.15 (-)	千ユーロ 1,160 (-)	百株 2,058.9	千ユーロ 777

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外国	イ	証券 135,777	千タイ・パーツ 82	証券 145,242 (-)	千タイ・パーツ 155 (-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
メキシコ		千□	千メキシコ・ペソ	千□	千メキシコ・ペソ
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV		157.9 (-)	26,174 (-)	165.6 (-)	26,352 (-)
GRUPO TELEvisa SAB		142.6 (-)	6,842 (-)	163.7 (-)	7,271 (-)
CEMEX SAB DE CV		1,334.6 (-)	18,177 (-)	1,428.3 (-)	17,273 (-)
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV		18.1 (-)	1,255 (-)	21.1 (-)	1,558 (-)
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		61.5 (-)	1,312 (△63)	67.4 (-)	1,513 (-)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		58.1 (-)	6,152 (-)	71.3 (-)	7,478 (-)
ブラジル		千□	千ブラジル・レアル	千□	千ブラジル・レアル
SUL AMERICA SA		- (-)	- (-)	15.356 (-)	516 (-)
BANCO SANTANDER BRASIL SA		23.4 (-)	916 (-)	12.8 (-)	469 (-)
ENERGISA SA		11.7 (-)	547 (-)	21.1 (-)	962 (-)
KLABIN SA		19.1 (-)	468 (-)	17.3 (-)	471 (-)
BANCO INTER SA		10.2 (9)	758 (-)	2.2 (-)	399 (-)
GETNET ADQUIRENCIA E SERVICOS		- (5.275)	- (-)	5.275 (-)	29 (-)
BANCO BTG PACTUAL SA		65 (50.1)	2,107 (-)	60.4 (-)	1,491 (-)
南アフリカ		千□	千南アフリカ・ランド	千□	千南アフリカ・ランド
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		541.065 (-)	7,803 (-)	610.638 (-)	8,367 (-)

(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 107,439	百万円 101,899	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	145,146,459千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	62,687,269千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	2.31

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年4月20日から2022年4月18日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
			株数	評価額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TRIP.COM GROUP LTD ADR	294.2	289.44	669	84,845	ホテル・レストラン・レジャー
CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	154.93	127.55	139	17,693	金属・鉱業
SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	242.1	242.1	12	1,564	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD	43.46	38.93	563	71,415	銀行
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	316.8	423.11	232	29,479	無線通信サービス
NETEASE INC-ADR	254.46	—	—	—	娯楽
SOUTHERN COPPER CORP	45.18	51.98	378	47,930	金属・鉱業
TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	37.89	—	—	—	各種電気通信サービス
YPF SA ADR	42.48	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL SPON ADR	261.36	338.45	24	3,086	石油・ガス・消耗燃料
GAZPROM PAO ADR	3,686.81	4,834.71	280	35,583	石油・ガス・消耗燃料
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	893.51	1,284.21	289	36,685	銀行
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	963.88	963.88	89	11,306	不動産管理・開発
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	—	125	47	5,993	ソフトウェア
SURGUTNEFTEGAZ ADR	550.84	710.84	33	4,232	石油・ガス・消耗燃料
51JOB INC ADR	21.3	21.01	127	16,174	専門サービス
X5 RETAIL GROUP NV GDR	70.85	160.03	8	1,076	食品・生活必需品小売り
NOVATEK PJSC GDR	58.75	74.13	4	610	石油・ガス・消耗燃料
BAIDU INC -SPON ADR	165.07	161.28	2,089	264,703	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOVOLIPETSK STEEL GDR	73.5	132.6	4	530	金属・鉱業
MMC NORILSK NICKEL ADR	410.9	539.53	101	12,917	金属・鉱業
ROSNEFT OIL CO GDR	678.41	1,079.51	64	8,218	石油・ガス・消耗燃料
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	947.65	127.33	141	17,872	各種消費者サービス
SEVERSTAL GDR	167.71	186.08	1	141	金属・鉱業
TATNEFT ADR	157.61	195.09	45	5,807	石油・ガス・消耗燃料
VTB BANK OJSC GDR	1,120	1,520	1	192	銀行
MAGNIT PJSC GDR	230.51	378.7	0.45444	57	食品・生活必需品小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	274.29	246.13	190	24,101	インターネット販売・通信販売
VNET GROUP INC ADR	41.06	—	—	—	情報技術サービス
TAL EDUCATION GROUP-ADR	234.7	246.28	74	9,422	各種消費者サービス
VK CO LTD GDR	68.53	98.58	8	1,068	インタラクティブ・メディアおよびサービス
YANDEX NV	190.65	256.01	484	61,424	インタラクティブ・メディアおよびサービス
NOAH HOLDINGS LTD ADR	17.16	6.8	14	1,866	資本市場
SBERBANK ADR	1,688.88	2,242.78	112	14,205	銀行
PHOSAGRO PJSC GDR	83.08	181.63	0.94447	119	化学
HUAZHU GROUP LTD ADR	88.28	97.48	325	41,281	ホテル・レストラン・レジャー
JOYY INC-ADR	36.17	28.36	112	14,219	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	35.01	30.17	133	16,885	半導体・半導体製造装置
GDS HOLDINGS LTD ADR	58.26	46.54	168	21,324	情報技術サービス
ZAI LAB LTD ADR	44.44	39.33	174	22,126	バイオテクノロジー
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	79.99	99.61	31	4,029	銀行
HUYA INC ADR	42.04	—	—	—	娯楽
360 DIGITECH INC ADR	—	58.13	82	10,486	消費者金融
BILIBILI INC ADR	98.16	91.62	228	28,946	娯楽
NIO INC ADR	785.09	763.43	1,500	190,037	自動車
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	235.57	342.05	167	21,275	娯楽
AUTOHOME INC ADR	37.89	38.67	110	13,936	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	73.6	—	—	—	娯楽
GAOTU TECHEDU INC ADR	42.75	—	—	—	各種消費者サービス
I-MAB ADR	—	34.03	45	5,742	バイオテクノロジー
WEIBO CORP ADR	30.03	43.86	100	12,668	インタラクティブ・メディアおよびサービス
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	29.11	29.11	12	1,611	情報技術サービス
KANZHUN LTD ADR	—	56.5	134	16,998	インタラクティブ・メディアおよびサービス

銘柄		期首(前期末)	当		期末		業種等
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
RLX TECHNOLOGY INC ADR		80	490.92	101	12,811	タバコ	
DIDI GLOBAL INC ADR		—	268.13	65	8,355	陸運・鉄道	
KE HOLDINGS INC ADR		68.69	205.47	288	36,544	不動産管理・開発	
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR		—	63.36	34	4,358	情報技術サービス	
DADA NEXUS LTD ADR		—	41.79	38	4,859	インターネット販売・通信販売	
JD.COM INC ADR		528.21	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
LEGEND BIOTECH CORP ADR		—	33.09	134	17,035	バイオテクノロジー	
LI AUTO INC ADR		121.2	320.49	823	104,381	自動車	
XPENG INC ADR		93.72	224.58	604	76,615	自動車	
OZON HOLDINGS PLC ADR		—	45.37	52	6,667	インターネット販売・通信販売	
LUFAX HOLDING LTD ADR		112.72	328.01	179	22,687	消費者金融	
GLOBANT SA		21.45	—	—	—	情報技術サービス	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR		1,154.1	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
HELLO GROUP INC ADR		77.93	126.41	61	7,814	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
BAOZUN INC-SPN ADR		41.12	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
PINDUODUO INC ADR		240.48	253.68	1,015	128,641	インターネット販売・通信販売	
YUM CHINA HOLDINGS INC		244.85	243.75	1,019	129,194	ホテル・レストラン・レジャー	
IQIYI INC ADR		154.4	154.4	63	8,058	娯楽	
POLYUS PJSC GDR		39.46	67.87	26	3,353	金属・鉱業	
HUTCHMED CHINA LTD ADR		37.61	61.36	105	13,385	医薬品	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR		256.08	245.84	646	81,937	航空貨物・物流サービス	
BEIGENE LTD ADR		28.31	25.97	473	59,994	バイオテクノロジー	
小計		株数・金額 銘柄数<比率>	19,505.23 66銘柄	22,283.08 64銘柄	15,303 —	1,938,597 <3.1%>	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円		
JIANGXI COPPER CO LTD		670	670	946	15,278	金属・鉱業	
JIANGSU EXPRESS		900	900	741	11,976	運送インフラ	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD		1,620	1,800	846	13,662	旅客航空輸送業	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD		64	64	672	10,860	飲料	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD		785	735	3,109	50,211	建設資材	
BEIJING ENTERPRISES		215	150	406	6,564	ガス	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN		1,800	3,420	1,200	19,386	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY		2,580	1,980	950	15,348	インターネット販売・通信販売	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD		700	1,080	2,808	45,349	石油・ガス・消耗燃料	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD		460	515.9	877	14,164	不動産管理・開発	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP		405	330	1,207	19,505	パーソナル用品	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		1,420	1,420	0	0	自動車	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD		5,656	5,036	4,285	69,213	医薬品	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME		2,436.2	2,321.2	6,302	101,778	不動産管理・開発	
CHINA RESOURCES LAND LTD		1,988.88	1,908.88	7,511	121,309	不動産管理・開発	
CITIC LTD		3,470	3,300	2,877	46,473	コングロマリット	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL		960	680	318	5,139	運送インフラ	
LENOVO GROUP LTD		4,540	4,120	3,193	51,566	コンピュータ・周辺機器	
PETRO CHINA CO LTD		11,200	11,920	4,863	78,543	石油・ガス・消耗燃料	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD		1,121.9	1,105.9	1,066	17,217	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR		15,432	13,872	5,548	89,613	石油・ガス・消耗燃料	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H		490	370	449	7,254	情報技術サービス	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD		1,530	1,430	2,293	37,043	ソフトウェア	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD		501	451	4,929	79,610	ガス	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD		2,080	2,760	1,854	29,953	ガス	
COSCO SHIPPING PORTS LTD		1,520	740	436	7,051	運送インフラ	
YUEXIU PROPERTY CO LTD		3,160	1,252	1,116	18,036	不動産管理・開発	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD		1,140	740	1,040	16,803	運送インフラ	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD		1,460	2,440	1,168	18,875	金属・鉱業	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD		870	760	1,843	29,764	不動産管理・開発	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING		910	965	837	13,527	運送インフラ	
CHINA EVERBRIGHT LTD		440	—	—	—	資本市場	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,654	1,570	1,513	24,442	ガス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	460	350	1,281	20,688	電子装置・機器・部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	3,680	3,350	3,953	63,840	自動車
SHENZHEN INVESTMENT LTD	2,160	—	—	—	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	560	500	1,652	26,687	ガス
BYD CO LTD	480	485	11,630	187,829	自動車
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	1,180	1,180	1,000	16,160	エネルギー設備・サービス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	5,400	10,300	700	11,311	娯楽
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	2,525.92	1,745.92	843	13,618	商業サービス・用品
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	—	2,080	1,401	22,641	情報技術サービス
MMG LTD	—	1,840	732	11,826	金属・鉱業
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	700	700	273	4,420	紙製品・林産品
CHINA YOUZAN LTD	8,800	—	—	—	ソフトウェア
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	4,337.88	3,917.88	3,267	52,770	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	1,350	1,350	564	9,113	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	912	1,312	1,968	31,783	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	1,795	1,645	1,898	30,658	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	4,600	4,370	5,313	85,819	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	3,390	3,170	4,399	71,059	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	1,520	1,224	1,079	17,435	ヘルスケア機器・用品
WEICHAI POWER CO LTD	1,354.4	1,274.4	1,506	24,327	機械
TINGYI HOLDING CORP	1,060	1,040	1,535	24,790	食品
TSINGTAO BREWERY CO LTD	280	400	2,548	41,150	飲料
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	1,780	1,540	1,583	25,567	水道
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	2,140	2,380	944	15,259	医薬品
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	913.33	813.33	3,765	60,816	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	680	540	367	5,939	運送インフラ
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	710	318	5,136	化学
SINO BIOPHARMACEUTICAL	6,512.5	5,562.5	2,347	37,910	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,740	1,820	7,880	127,271	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	3,503	3,375	126,360	2,040,714	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	3,635	3,710	21,258	343,321	保険
LI NING CO LTD	1,325	1,350	8,633	139,426	繊維・アパレル・贅沢品
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	2,600	3,620	948	15,317	水道
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	6,892.4	6,892.4	323	5,231	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	5,000	3,490	1,357	21,925	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA / HONG KONG	760	580	337	5,451	旅客航空輸送業
ZTE CORP	442.88	442.88	682	11,029	通信機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	1,965	2,015	5,299	85,586	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	1,855	1,772.5	2,297	37,099	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS	5,752.05	5,182.05	2,933	47,368	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	1,102.5	1,242.5	1,233	19,925	建設・土木
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	415	600	1,022	16,511	電子装置・機器・部品
CHINA CONSTRUCTION BANK	58,105.3	56,795.3	33,282	537,505	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	514	466	4,771	77,065	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,400	2,060	1,200	19,395	自動車
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	980	980	413	6,678	不動産管理・開発
MINTH GROUP LTD	460	440	798	12,890	自動車部品
SSY GROUP LTD	1,320	—	—	—	医薬品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	840	1,380	1,006	16,247	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	2,380	2,280	2,421	39,104	建設資材
BANK OF CHINA LTD	48,042	47,872	14,936	241,217	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	675	—	—	—	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	600	600	970	15,678	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	992	—	—	—	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	2,399.7	2,299.7	13,740	221,912	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	36,942.35	33,392.35	15,861	256,161	銀行

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	495	—	—	—	金属・鉱業
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	535	535	667	10,783	電子装置・機器・部品
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	1,676	1,676	581	9,392	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO	—	1,020	750	12,124	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	330	250	474	7,655	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	313	446	1,168	18,871	電気設備
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	4,941.42	4,741.42	2,915	47,092	不動産管理・開発
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	2,400	2,370	1,080	17,453	金属・鉱業
CHINA CITIC BANK-H	5,968	5,798	2,359	38,110	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	650	1,380	487	7,867	不動産管理・開発
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	448	403	4,465	72,113	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	670	610	5,679	91,717	繊維・アパレル・贅沢品
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	200	200	364	5,878	家庭用品
FOSUN INTERNATIONAL	1,430.28	1,080.28	896	14,480	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	3,000	3,060	853	13,787	不動産管理・開発
CHINA AOYUAN GROUP LTD	850	—	—	—	不動産管理・開発
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	1,620	2,640	934	15,093	繊維・アパレル・贅沢品
KINGSOFT CORP LTD	520	492	1,170	18,911	娯楽
SINOTRUK HONG KONG LTD	350	340	318	5,139	機械
CHINA RAILWAY GROUP LTD	3,180	2,350	1,203	19,431	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	1,010	1,110	788	12,727	食品
DONGYUE GROUP	—	780	693	11,198	化学
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	425	475	715	11,552	通信機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,840	2,520	1,695	27,389	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	1,604	1,570	3,011	48,631	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,100	—	—	—	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD - H	—	2,390	700	11,309	機械
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	980	610	718	11,605	医薬品
SUN ART RETAIL GROUP LTD	835	2,265	586	9,474	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO	760	672	1,185	19,144	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA SUNTIE GREEN ENERGY CORP LTD	—	1,690	799	12,909	石油・ガス・消耗燃料
CHINA RESOURCES CEMENT	1,120	1,040	693	11,202	建設資材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	1,785.27	1,865.27	1,270	20,514	自動車
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,290	1,505	1,595	25,764	金属・鉱業
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	1,980	—	—	—	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	1,940	1,900	3,241	52,348	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	642	466	616	9,964	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,640	—	—	—	不動産管理・開発
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	612	1,250	661	10,679	機械
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	—	900	723	11,686	機械
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,020	1,075	4,590	74,132	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	603	650	1,482	23,934	保険
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	3,996.56	3,556.56	1,070	17,288	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,250	—	—	—	不動産管理・開発
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	310	688	843	13,622	電気設備
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	790	810	759	12,270	建設関連製品
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	2,500	2,500	735	11,870	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	15,470	15,850	4,739	76,537	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	300	410	2,218	35,822	専門小売り
FAR EAST HORIZON LTD	1,030	1,030	734	11,860	各種金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	460	446	718	11,596	ヘルスケア機器・用品
CITIC SECURITIES CO LTD	1,305	1,405	2,593	41,887	資本市場
SEAZEN GROUP LIMITED	1,180	980	443	7,169	不動産管理・開発
HAITONG SECURITIES CO LTD	936	1,940	1,162	18,767	資本市場
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	4,610	6,750	1,748	28,234	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	255	345	1,190	19,222	医薬品
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,260	1,960	901	14,560	不動産管理・開発

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	1,065	2,165	1,028	16,608	資本市場
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	9,860	9,860	0	0	半導体・半導体製造装置
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	3,230	3,230	0	0	食品
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	720	1,360	1,135	18,339	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	5,370	4,490	2,922	47,206	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	260	360	802	12,965	食品
GENSCRIPT BIOTECH CORP	780	780	1,786	28,847	ライフサイエンス・ツール／サービス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	125	—	—	—	各種消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	900	1,170	4,527	73,125	不動産管理・開発
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	920	—	—	—	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	283	330	726	11,724	インターネット販売・通信販売
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	520	520	337	5,450	各種消費者サービス
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	375	375	663	10,719	金属・鉱業
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	200	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	237.5	442.5	588	9,504	不動産管理・開発
CHINA TOWER CORP LTD	27,060	22,560	2,052	33,155	各種電気通信サービス
XIAOMI CORP	8,778	8,246	10,291	166,199	コンピュータ・周辺機器
WUXI APPTec CO LTD	165.6	207.12	2,444	39,470	ライフサイエンス・ツール／サービス
WEIMOB INC	1,070	1,660	828	13,377	ソフトウェア
MEITUAN	2,200	2,391	37,108	599,299	インターネット販売・通信販売
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	444	712	1,028	16,604	ホテル・レストラン・レジャー
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	440	870	1,405	22,705	ホテル・レストラン・レジャー
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,340	2,760	3,836	61,957	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	620	610	1,692	27,337	バイオテクノロジー
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	420	820	964	15,573	不動産管理・開発
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	6,650	6,650	897	14,498	資本市場
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	420	400	1,100	17,765	専門小売り
LOGAN GROUP COMPANY LTD	1,110	1,030	270	4,374	不動産管理・開発
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	995	1,055	2,363	38,165	建設・土木
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	58	—	—	—	不動産管理・開発
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	780	1,075	656	10,607	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	270	—	—	—	各種消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC	40	62	644	10,403	医薬品
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	620	1,160	742	11,989	専門小売り
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	660	860	1,133	18,305	医薬品
CHINA FEIHE LTD	830	1,850	1,411	22,796	食品
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	8,894.68	84,944	1,371,848	インターネット販売・通信販売
PHARMARON BEIJING CO LTD	77	74	733	11,849	ライフサイエンス・ツール／サービス
JD.COM INC	—	1,169.35	26,474	427,556	インターネット販売・通信販売
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	350	980	1,809	29,216	タバコ
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	—	155	216	3,494	ヘルスケア機器・用品
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	440	500	835	13,485	ホテル・レストラン・レジャー
KUAISHOU TECHNOLOGY	132	263	1,675	27,056	インタラクティブ・メディアおよびサービス
HAIER SMART HOME CO LTD	1,226	1,234	3,374	54,506	家庭用耐久財
AKESO INC	—	200	308	4,980	バイオテクノロジー
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	—	770	376	6,080	不動産管理・開発
NETEASE INC	—	1,202	18,090	292,155	娯楽
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	250	250	253	4,094	ソフトウェア
NONGFU SPRING CO LTD	190	1,010	4,272	68,997	飲料
CHINA BOHAI BANK CO LTD	2,220	1,340	178	2,878	銀行
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	180	176.5	904	14,608	インターネット販売・通信販売
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	—	298	1,060	17,133	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	—	324	1,274	20,590	不動産管理・開発
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	80	96	868	14,031	ライフサイエンス・ツール／サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	926.61	1,065.61	2,237	36,140	不動産管理・開発
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	280	370	1,132	18,285	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD	4,500	6,090	1,260	20,359	独立系発電事業者・エネルギー販売業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
GF SECURITIES CO LTD	682	682	761	12,291	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	252	276	808	13,060	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD	484	924	1,069	17,280	資本市場
3SBIO INC	905	905	576	9,310	バイオテクノロジー
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	940	—	—	—	医薬品
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,610	—	—	—	資本市場
CHINA LITERATURE LTD	162	284	917	14,814	メディア
FLAT GLASS GROUP CO LTD	—	340	1,004	16,225	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,465	1,465	597	9,653	食品
CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	640	—	—	—	各種消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	650	650	648	10,466	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	107	105	639	10,327	商社・流通業
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	262	340	892	14,413	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	540	900	1,101	17,790	自動車
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	688	796	1,437	23,216	資本市場
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	2,015	2,070	13,165	212,617	ライフサイエンス・ツール/サービス
GANFENG LITHIUM CO LTD	—	132	1,362	22,000	金属・鉱業
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	728,718	11,768,810	
	519,873.43	518,431.88	—	<18.7%>	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	320	270	6,048	26,299	通信機器
ACER INC	2,065.32	1,515.32	4,258	18,515	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	445.54	415.54	14,814	64,417	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	266.16	246.16	9,797	42,602	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	1,319.28	1,159.28	5,437	23,642	建設資材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	190	—	—	—	電子装置・機器・部品
TAIWAN BUSINESS BANK	4,572.67	—	—	—	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	540	480	5,184	22,542	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	380	450	5,422	23,579	コンピュータ・周辺機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	770	700	14,350	62,399	電子装置・機器・部品
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	479.75	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	1,818.58	1,558.58	13,388	58,217	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	807.77	—	—	—	不動産管理・開発
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	437.6	387.6	5,678	24,691	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	2,447.61	2,262.08	4,241	18,443	銀行
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	841.69	1,371.69	4,698	20,428	自動車部品
CHINA STEEL CORP	7,590.58	6,900.58	27,291	118,675	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	889.73	—	—	—	保険
ADVANTECH CO LTD	206.75	216.75	7,943	34,543	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS INC	2,133.04	2,283.04	5,810	25,265	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	1,206.63	1,136.63	28,358	123,315	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CORP	790	900	5,751	25,007	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	2,234.27	2,304.27	29,840	129,757	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	5,371.94	4,671.94	8,900	38,700	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	958	1,158	12,216	53,123	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP	1,278.2	1,478.2	20,916	90,953	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,688.24	1,658.24	5,041	21,920	コンプロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	217.68	317.68	6,178	26,868	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE CO LTD	113.22	103.22	4,815	20,938	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	352.85	322.85	12,914	56,155	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	2,426.33	2,236.33	23,481	102,106	化学
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	2,265.94	2,065.94	16,382	71,239	化学
GIANT MANUFACTURING	161.51	211.51	5,488	23,866	レジャー用品
MEDIATEK INC	915.07	895.07	74,469	323,824	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	4,169.36	4,459.42	33,490	145,628	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	4,669.44	4,927.52	11,949	51,960	銀行
HOTAI MOTOR CO LTD	190	170	9,826	42,727	専門小売り

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	890	890	6,719	29,219	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,001.46	5,381.46	14,314	62,245	各種金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,889.41	4,699.41	30,076	130,783	保険
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	7,274.03	8,940.11	16,986	73,862	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,084.48	7,067.98	23,536	102,345	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	7,622.25	7,372.25	75,934	330,192	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	6,164.95	6,454.95	27,659	120,274	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	62.2	62.2	10,107	43,951	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,280.58	5,861.32	11,722	50,974	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	7,910.61	6,763.45	7,135	31,027	保険
INVENTEC CO LTD	1,200.05	1,300.05	3,295	14,330	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,288.45	1,178.45	7,966	34,640	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	5,534.43	5,654.43	10,460	45,487	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	10,870.48	11,000.48	32,286	140,394	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	5,729.77	6,098.06	17,318	75,307	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	375.6	—	—	—	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	3,258.28	3,038.28	26,979	117,319	化学
WISTRON CORP	1,579.16	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	1,789.9	1,209.9	3,744	16,283	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	3,052.97	2,832.97	19,094	83,029	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	373.92	323.92	8,681	37,748	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	644.8	864.8	7,999	34,784	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	106.58	—	—	—	半導体・半導体製造装置
E INK HOLDINGS INC	—	490	8,354	36,328	電子装置・機器・部品
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	465.89	762.24	5,526	24,030	不動産管理・開発
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	435.88	735.88	4,459	19,391	電子装置・機器・部品
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	628.99	678.99	5,268	22,911	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT CORP	3,131.71	3,011.71	14,185	61,682	建設資材
TAIWAN SEMICONDUCTOR	14,990.83	14,450.83	812,136	3,531,494	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,285.25	6,875.25	32,348	140,662	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LTD	—	395	6,122	26,623	海運業
WINBOND ELECTRONICS CORP	1,800	1,580	4,266	18,550	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORP	201.6	251.6	10,189	44,309	電子装置・機器・部品
YANG MING MARINE TRANSPORT	—	1,010	12,524	54,459	海運業
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,510	1,610	4,572	19,882	運送インフラ
INNOLUX CORPORATION	5,123.45	5,433.45	8,503	36,975	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	1,242.03	1,182.03	6,643	28,886	電子装置・機器・部品
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	140	160	7,056	30,682	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	174.75	179.69	4,043	17,580	機械
EMEMORY TECHNOLOGY INC	—	40	5,520	24,003	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	1,035.54	1,165.54	8,193	35,629	コンピュータ・周辺機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	70	83.71	7,291	31,704	機械
WIN SEMICONDUCTORS CORP	220	230	5,290	23,003	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	674.7	745.93	18,424	80,116	各種金融サービス
ONENESS BIOTECH CO LTD	160	180	3,573	15,536	医薬品
PARADE TECHNOLOGIES LTD	—	50	6,950	30,221	半導体・半導体製造装置
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	20	20	2,960	12,871	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	293.85	353.85	3,715	16,156	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	5,189.54	5,573.93	16,303	70,895	銀行
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	1,999.93	2,029.93	10,058	43,737	銀行
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	—	40	5,560	24,177	電気設備
WIWYNN CORP	40	50	4,810	20,915	コンピュータ・周辺機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	2,049.03	1,879.03	18,395	79,991	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	50	50	13,325	57,942	半導体・半導体製造装置
MOMO.COM INC	—	30	2,715	11,805	インターネット販売・通信販売
GLOBALWAFERS CO LTD	120	120	7,224	31,412	半導体・半導体製造装置

銘柄		期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)		百株	百株	千台湾・ドル	千円	家庭用耐久財
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		120	110	3,355	14,588	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	195,688.08	187,786.5	1,896,266	8,245,725	
		87銘柄	86銘柄	—	<13.1%>	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	金属・鉱業
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		156.67	—	—	—	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	156.67	—	—	—	
		1銘柄	—銘柄	—	<—%>	
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	銀行
AKBANK TAS		2,388.37	2,388.37	2,245	19,452	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		448.98	448.98	1,236	10,713	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS		961.86	891.95	3,148	27,281	金属・鉱業
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		46.68	46.68	1,428	12,376	自動車
KOC HOLDING AS		537.7	537.7	2,190	18,980	コングロマリット
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS		900	510.26	888	7,701	コングロマリット
TURK HAVA YOLLARI		442.06	—	—	—	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		626.54	486.15	1,123	9,738	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI AS		1,141.53	1,814.55	2,522	21,854	銀行
TURKIYE IS BANKASI		662.05	911.35	982	8,512	銀行
TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE		62.01	59.02	1,532	13,280	石油・ガス・消耗燃料
YAPI VE KREDI BANKASI AS		2,392.3	—	—	—	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING AS		210.58	—	—	—	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		277.55	217.03	1,837	15,918	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,098.21	8,312.04	19,136	165,812	
		14銘柄	11銘柄	—	<0.3%>	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	コングロマリット
ALFA SAB DE CV		—	2,223	3,281	20,821	
GRUPO BIMBO SAB DE CV		850	869	5,021	31,862	食品
GRUMA SAB DE CV		106.15	103.6	2,642	16,770	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA		164.6	178.6	2,825	17,927	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV		349	349	2,499	15,859	コングロマリット
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV		1,621	1,514	20,706	131,400	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		530.25	784.25	3,961	25,136	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		76.35	83.35	2,084	13,230	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV		863	753	2,138	13,570	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV		120.4	112.9	4,685	29,733	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV		1,939.52	1,832.52	19,703	125,030	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE CV		21,166.78	18,088.78	39,994	253,791	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA SA		966	1,227	4,979	31,596	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		231	235	2,906	18,446	飲料
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV		3,200	3,093	24,082	152,817	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV		240.85	202.95	6,183	39,238	運送インフラ
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV		292	—	—	—	ガス
TELESITES SAB DE CV		773	—	—	—	各種電気通信サービス
OPERADORA DE SITIOS MEXICANOS SA DE CV		—	773	2,011	12,763	各種電気通信サービス
BECLE SAB DE CV		384	384	1,838	11,664	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	33,873.9	32,806.95	151,545	961,661	
		18銘柄	18銘柄	—	<1.5%>	
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	不動産管理・開発
AYALA LAND INC		4,255	4,567	15,527	37,693	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		943.3	1,133.3	6,533	15,860	コングロマリット
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND		1,075.2	937.2	9,231	22,409	銀行
AYALA CORP		185.83	153.73	11,806	28,660	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC		14.2	25.7	6,291	15,272	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC		461.2	550.3	12,128	29,442	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC		1,934.8	1,578.4	8,760	21,265	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORP		325.9	339.4	7,432	18,043	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST		615.75	800.15	4,400	10,683	銀行

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	
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
BDO UNIBANK INC	1,222.33	1,088.33	13,985	33,948	銀行
MEGAWORLD CORP	8,790	—	—	—	不動産管理・開発
PLDT INC	52.6	52.6	9,636	23,392	無線通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	6,363.75	5,967.75	21,961	53,311	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	548.4	425.5	4,999	12,136	食品
SM INVESTMENTS CORP	164.63	130.43	11,380	27,624	コングロマリット
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	9,019	9,019	3,454	8,385	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP	957	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MANILA ELECTRIC COMPANY	177.1	177.1	6,414	15,571	電力
PUREGOLD PRICE CLUB INC	676	—	—	—	食品・生活必需品小売り
GT CAPITAL HOLDINGS INC	66.01	66.01	3,379	8,204	コングロマリット
AC ENERGY CORP	—	6,894	5,859	14,224	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
MONDE NISSIN CORP	—	3,147	4,191	10,175	食品
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	
	20銘柄	19銘柄	—	<0.6%>	
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	36,313.83	36,020.92	158,095	24,577	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	27.73	30.95	88,857	13,813	銀行
BANCO DE CHILE	27,690.44	25,409.25	220,552	34,286	銀行
EMPRESAS CMPC SA	601.53	630.23	86,656	13,471	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA	224.18	191.38	129,081	20,066	石油・ガス・消耗燃料
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	105.81	105.81	61,845	9,614	飲料
ENEL AMERICAS SA	19,059.81	15,968.88	144,518	22,466	電力
COLBUN SA	5,804.23	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
EMBOTELLADORA ANDINA SA	200.26	—	—	—	飲料
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	74.92	78.85	534,642	83,114	化学
FALABELLA SA	561.57	488.73	125,212	19,465	複合小売り
CENCOSUD SA	811.21	759.72	114,109	17,739	食品・生活必需品小売り
CENCOSUD SHOPPING SA	292.31	—	—	—	不動産管理・開発
ENEL CHILE SA	14,696.15	29,777.57	68,190	10,600	電力
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	
	14銘柄	11銘柄	—	<0.4%>	
(コロンビア)	百株	百株	千コロンビア・ペソ	千円	
INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	231.25	212.84	529,971	17,934	電力
ECOPETROL SA	2,812.3	3,126.78	1,046,220	35,405	石油・ガス・消耗燃料
BANCOLOMBIA SA	129.5	120.06	524,662	17,755	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	309.57	270.16	1,099,010	37,191	銀行
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	228.2	103.99	372,596	12,609	各種金融サービス
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	
	5銘柄	5銘柄	—	<0.2%>	
(クウェート)	百株	百株	千クウェート・ディナール	千円	
KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	2,546.84	3,443.16	340	141,574	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	1,262.48	1,229.02	82	34,234	無線通信サービス
GULF BANK KSCP	1,426.6	—	—	—	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	4,183.85	4,310.49	448	186,556	銀行
AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	532.37	688.52	83	34,894	航空貨物・物流サービス
MABANEE CO KPSC	532.93	272.82	23	9,856	不動産管理・開発
BOUBAYAN BANK KSCP	839.09	602.72	54	22,752	銀行
小 計	株 数	株 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	銘 柄 数<比 率>	
	7銘柄	6銘柄	—	<0.7%>	
(カタール)	百株	百株	千カタール・リアル	千円	
QATAR NATIONAL BANK	2,728.04	2,704.78	6,453	224,391	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	902.99	1,090.64	839	29,199	銀行
OOREDOO QSC	400.49	438.16	311	10,831	各種電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	284.78	295.91	545	18,972	石油・ガス・消耗燃料
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	246.05	271.76	493	17,150	総合公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	510.28	340.3	418	14,541	銀行

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カタル)	百株	百株	千カタル・リアル	千円	
INDUSTRIES QATAR QSC	1,233.12	874.25	1,743	60,612	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK SAQ	758.19	682.74	1,657	57,637	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	1,389.61	1,453.82	515	17,929	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	2,423.81	2,715.27	1,509	52,491	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	1,384.49	1,384.49	482	16,781	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	2,519.21	2,367.31	684	23,787	化学
小計	株数14,781.06 銘柄数<比率>	株数14,619.43 銘柄数12	15,655	544,329	
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	154.78	142.5	929	31,440	化学
JARIR MARKETING CO	40.04	38.7	773	26,165	専門小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	41.55	41.55	298	10,109	保険
ETIHAD ETISALAT CO	185	206.59	900	30,480	無線通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	445.2	480.31	2,146	72,653	銀行
AL RAJHI BANK	746.13	723.19	12,843	434,636	銀行
ARAB NATIONAL BANK	344.64	340.28	1,116	37,769	銀行
BANK ALBILAD	264.91	276.49	1,526	51,647	銀行
BANK AL-JAZIRA	354.4	217.93	675	22,861	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	371.02	340.18	1,884	63,774	銀行
RIYAD BANK	739.24	793.52	3,170	107,276	銀行
SAUDI TELECOM CO	362.86	353.7	4,060	137,406	各種電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	120.5	123	2,186	74,006	化学
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	551.48	536.93	6,958	235,479	化学
SAUDI CEMENT CO	64.77	—	—	—	建設資材
SAUDI ELECTRICITY CO	459.63	472.84	1,279	43,282	電力
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	186.28	222.02	803	27,197	化学
SAVOLA GROUP	145.38	128.55	480	16,247	食品
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	225.28	166.21	393	13,330	化学
ALMARAI CO JSC	165.75	140.57	728	24,640	食品
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	—	15.13	398	13,475	メディア
EMAAR ECONOMIC CITY	283.11	283.11	320	10,845	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	162.78	201.64	1,171	39,644	化学
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	83.95	63.3	463	15,701	化学
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	392.76	413.78	894	30,273	化学
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	310.11	310.11	338	11,438	不動産管理・開発
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	107.17	129.65	413	13,995	石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	218.18	187.22	263	8,907	無線通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	29.68	30.41	526	17,802	保険
ALINMA BANK	615.01	579.56	2,405	81,391	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	35.16	35.16	400	13,563	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO	270.62	253.35	3,511	118,826	金属・鉱業
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	—	33.77	783	26,512	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SAUDI AIRLINES CATERING CO	30.88	—	—	—	商業サービス・用品
SAUDI ARABIAN OIL CO	1,312.38	1,290.7	5,517	186,720	石油・ガス・消耗燃料
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	27.12	42.12	806	27,281	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
THE SAUDI NATIONAL BANK	1,358.29	1,299.16	9,756	330,166	銀行
小計	株数11,206.04 銘柄数35	株数10,913.23 銘柄数35	71,127	2,406,954	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,742.43	1,675.92	427,636	714,152	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	373.5	473.6	17,949	29,975	石油・ガス・消耗燃料
ASIAN PAINTS LTD	242.86	223.52	68,858	114,994	化学
EICHER MOTORS LTD	87.39	76.15	18,972	31,683	自動車
GRASIM INDUSTRIES LTD	166.36	146.14	25,807	43,098	建設資材
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	517.85	504.69	43,711	72,997	自動車
SHREE CEMENT LTD	5.81	7.56	19,174	32,021	建設資材
ICICI BANK LTD	3,142.49	3,017.09	229,977	384,062	銀行

銘柄	株数	期首(前期末)	期末		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	372.98	322.22	9,426	15,742	石油・ガス・消耗燃料
STATE BANK OF INDIA LTD	1,136.74	1,050.57	54,388	90,827	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	206.08	188.88	12,740	21,277	陸運・鉄道
TATA STEEL LTD	473.87	418.51	55,222	92,221	金属・鉱業
TATA MOTORS LTD	929.53	971.29	41,867	69,918	自動車
JSW STEEL LTD	519.94	485.58	37,212	62,144	金属・鉱業
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	370.48	332.8	27,209	45,440	食品
TATA POWER CO LTD	—	810.66	22,139	36,972	電力
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	70.36	57.68	19,320	32,265	食品
NESTLE INDIA LTD	18.49	19.01	34,944	58,358	食品
GAIL INDIA LTD	834.49	828.72	13,976	23,340	ガス
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	345.09	324.21	57,696	96,353	銀行
VEDANTA LTD	1,176.59	646.34	27,521	45,960	金属・鉱業
AXIS BANK LTD	1,410.99	1,329.94	105,470	176,136	銀行
TITAN COMPANY LTD	228.71	204.85	50,420	84,202	繊維・アパレル・贅沢品
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,391.96	1,403.09	24,448	40,829	石油・ガス・消耗燃料
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	65.31	62.95	9,635	16,091	パーソナル用品
BHARAT ELECTRONICS LTD	—	656.79	16,229	27,102	航空宇宙・防衛
LUPIN LTD	127.8	170.03	13,143	21,949	医薬品
MPHASIS LTD	—	45.93	14,012	23,400	情報技術サービス
ACC LTD	35.92	57.06	12,602	21,046	建設資材
BAJAJ FINANCE LTD	167.57	157.42	115,364	192,658	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	1,046.63	1,008.69	239,916	400,661	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	465.43	—	—	—	メディア
INFOSYS LTD	2,079	1,978.88	346,017	577,848	情報技術サービス
WIPRO LTD	631.91	801.12	44,798	74,813	情報技術サービス
MRF LTD	0.96	0.84	5,665	9,461	自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	1,430.83	1,024.14	13,098	21,874	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LTD	504.39	484.22	104,211	174,033	パーソナル用品
TRENT LTD	93.85	98.34	12,123	20,246	複合小売り
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	47.7	56.86	26,976	45,051	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	677.21	636.55	71,618	119,602	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	343.49	337.81	18,778	31,360	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	77.01	64.18	14,597	24,377	自動車
SRF LTD	—	81.95	21,397	35,733	化学
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	70.63	63.57	13,320	22,244	自動車部品
DR REDDYS LABORATORIES LTD	75.27	64.32	27,652	46,179	医薬品
IPCA LABORATORIES LTD	57.43	—	—	—	医薬品
BHARTI AIRTEL LTD	1,524.71	1,450.7	107,446	179,434	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	150.17	159.19	14,230	23,765	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	542.74	482.55	45,202	75,488	医薬品
DIVI'S LABORATORIES LTD	72.41	73.97	33,280	55,579	ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	86.24	79.74	59,561	99,468	自動車
AUROBINDO PHARMA LTD	178.68	147.88	10,111	16,885	医薬品
HAVELLS INDIA LTD	116.19	130.47	16,617	27,751	電気設備
INDRAPRASTHA GAS LTD	246.03	220.37	8,592	14,349	ガス
BIOCON LTD	219.17	183.06	6,419	10,721	バイオテクノロジー
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	676.1	885.01	12,319	20,573	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	93.53	140.71	16,659	27,821	消費者金融
PETRONET LNG LTD	569.37	527.03	10,764	17,976	石油・ガス・消耗燃料
CIPLA LTD/INDIA	277.24	268.78	27,324	45,631	医薬品
LARSEN & TOUBRO LTD	446.07	402.05	70,792	118,224	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	73.11	57.7	38,832	64,850	建設資材
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	572.48	546.28	200,045	334,075	情報技術サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	—	159.22	35,019	58,482	商社・流通業
NTPC LTD	2,766.29	2,758.8	42,471	70,927	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	53.27	78.99	18,036	30,121	各種金融サービス

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	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
YES BANK LTD	7,148.5	7,148.5	10,401	17,369	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	345.17	414.63	15,308	25,564	建設資材
BHARAT FORGE LTD	158.49	180.24	13,212	22,064	自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	967.13	924.72	50,559	84,433	金属・鉱業
ITC LTD	1,874.66	1,739.81	46,896	78,317	タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	86.76	84.2	19,922	33,269	化学
UNITED PHOSPHORUS LTD	297.92	279.32	22,866	38,187	化学
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	25.21	39.29	11,195	18,696	医薬品
SIEMENS INDIA LTD	36.37	36.01	8,883	14,835	コングロマリット
INFO EDGE INDIA LTD	42.16	52.47	24,943	41,655	インタラクティブ・メディアおよびサービス
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	257.69	229.9	18,078	30,190	パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	406.6	366.01	51,623	86,211	情報技術サービス
MINDTREE LTD	—	36.05	14,776	24,677	情報技術サービス
MARICO LTD	266.96	362.41	18,834	31,453	食品
PAGE INDUSTRIES LTD	3.78	2.91	13,041	21,779	繊維・アパレル・贅沢品
DLF LTD	337.09	354.05	13,853	23,136	不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,403.37	1,788.14	41,037	68,533	電力
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE REC LTD	317.46	322.22	27,082	45,227	運送インフラ
BAJAJ FINSERV LTD	450.37	—	—	—	各種金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	24.28	21.74	34,979	58,416	各種金融サービス
JUBILANT FOODWORKS LTD	43.88	49.14	18,168	30,341	自動車
MUTHOOT FINANCE LTD	57.44	40.89	11,370	18,989	ホテル・レストラン・レジャー
COAL INDIA LTD	49.65	88.1	11,777	19,667	消費者金融
INDUS TOWERS LTD	994.58	845.19	15,771	26,337	石油・ガス・消耗燃料
PI INDUSTRIES LTD	373.74	549.46	11,906	19,884	各種電気通信サービス
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	41.33	43.11	12,684	21,183	化学
ADANI GREEN ENERGY LTD	27.48	35.87	21,661	36,174	情報技術サービス
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	253.35	224.36	64,263	107,319	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	445.36	507.11	28,644	47,835	保険
BANDHAN BANK LTD	24.25	40.12	8,819	14,728	資本市場
ADANI TOTAL GAS LTD	389.9	377.5	12,312	20,561	銀行
GODREJ PROPERTIES LTD	—	158.08	39,533	66,020	ガス
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	—	69.71	11,176	18,664	不動産管理・開発
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	—	222.29	16,233	27,110	消費者金融
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	—	166.24	13,856	23,141	消費者金融
ZOMATO LTD	—	129.53	10,107	16,879	商業サービス・用品
BERGER PAINTS INDIA LTD	—	1,256.44	10,541	17,604	インターネット販売・通信販売
ADANI TRANSMISSIONS LTD	125.56	109.81	7,951	13,279	化学
AVENUE SUPERMARTS LTD	—	157.9	42,486	70,953	電力
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	88.1	92.95	38,024	63,501	食品・生活必需品小売り
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	115.17	113.49	15,419	25,750	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	190.44	276.04	14,933	24,939	保険
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	48.93	77.33	14,686	24,526	旅客航空輸送業
	240.46	251.49	28,843	48,168	保険
小 計	株 数 50,386.72	株 数 52,387.94	金 額 4,299,658	金 額 7,180,430	
銘柄数<比率>	96銘柄	106銘柄	—	<11.4%>	
(パキスタン)	百株	百株	千パキスタン・ルピー	千円	
MCB BANK LTD	124	—	—	—	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	218.68	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HABIB BANK LTD	193	—	—	—	銀行
小 計	株 数 535.68	株 数 —	金 額 —	金 額 —	
銘柄数<比率>	3銘柄	—銘柄	—	<—%>	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ANEKA TAMBANG TBK PT	5,717	5,717	1,589,326	14,145	金属・鉱業
BARITO PACIFIC TBK PT	14,709	14,484	1,260,108	11,214	化学
UNITED TRACTORS TBK PT	848.01	905.01	2,696,929	24,002	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	3,529	3,529	2,161,512	19,237	食品

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,805	4,854	1,650,360	14,688	家庭用品
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	13,067	11,683	8,032,062	71,485	自動車
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	31,399	28,718	13,440,024	119,616	各種電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	3,868	3,830	1,911,170	17,009	食品
GUDANG GARAM TBK PT	324	324	991,440	8,823	タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	678	758	761,790	6,779	建設資材
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	1,908	1,908	1,454,850	12,948	紙製品・林産品
BANK MANDIRI	11,831	10,904	8,368,820	74,482	銀行
BANK RAKYAT INDONESIA	34,221	39,992	18,156,368	161,591	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	8,222	—	—	—	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	3,443	4,001	3,360,840	29,911	銀行
KALBE FARMA TBK PT	10,057	10,083	1,598,155	14,223	医薬品
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	1,498	1,257	757,342	6,740	建設資材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	6,028	32,729	25,201,330	224,291	銀行
ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	9,341	9,341	3,091,871	27,517	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	1,650	1,650	1,183,875	10,536	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	—	5,333	1,647,897	14,666	各種電気通信サービス
SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	17,183	17,183	1,735,483	15,445	各種電気通信サービス
BANK JAGO TBK PT	—	2,702	3,512,600	31,262	銀行
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	4,256	6,378	3,348,450	29,801	金属・鉱業
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	188,582.01 22銘柄	218,263.01 23銘柄	1,079,912.604 —	960,422 <1.5%>
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千アラブ首長国連邦・ディルハム	千円	
ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	1,142.69	732.54	646	22,348	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	942.96	1,553.05	973	33,643	銀行
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	1,071.47	2,033.41	7,523	259,940	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	1,764.04	1,582.72	1,646	56,870	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	1,680.85	2,606.27	5,811	200,803	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	1,873.97	2,686.91	1,639	56,627	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	2,243.84	2,215.52	1,134	39,191	不動産管理・開発
EMIRATES NBD BANK PJSC	1,385.97	1,448.03	2,143	74,043	銀行
EMAAR MALLS PJSC	2,679.19	—	—	—	不動産管理・開発
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	—	1,523.4	623	21,527	専門小売り
小計	株数・金・額 銘柄数<比率>	14,784.98 9銘柄	16,381.85 9銘柄	22,141 —	764,997 <1.2%>
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
BRF SA	296.92	472.92	720	19,404	食品
VALE SA	2,252.21	2,405.89	22,155	596,898	金属・鉱業
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	790	—	—	—	電力
RAIA DROGASIL SA	635	599	1,333	35,922	食品・生活必需品小売り
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	112.5	130.5	555	14,973	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	197	197	854	23,033	電力
BANCO DO BRASIL SA	564	519	1,826	49,217	銀行
ITAUSA SA	2,433.6	2,729.88	2,757	74,280	銀行
LOJAS AMERICANAS SA	531.74	—	—	—	インターネット販売・通信販売
GERDAU SA	671.3	652.3	1,919	51,701	金属・鉱業
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,230.1	2,100.1	7,297	196,610	石油・ガス・消耗燃料
VIBRA ENERGIA SA	392	673	1,527	41,139	専門小売り
PETROLEO BRASILEIRO SA	2,958.12	2,885.12	9,021	243,054	石油・ガス・消耗燃料
CCR SA	653.2	909.2	1,227	33,067	運送インフラ
WEG SA	524.72	961.44	3,104	83,637	電気設備
BANCO BRADESCO SA PREF	2,820.85	2,950.93	6,323	170,370	銀行
BANCO BRADESCO SA	713.25	753.57	1,336	35,995	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	410.06	368.06	936	25,225	金属・鉱業
BRADESPAR SA	102	—	—	—	金属・鉱業
SUZANO SA	464.75	426.75	2,287	61,635	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	222	—	—	—	電力

銘柄	株数	期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)						
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2,994.47	百株	2,871.47	千ブラジル・レアル	千円	銀行
AMERICANAS SA	154		361.71	7,560	203,688	インターネット販売・通信販売
BRASKEM SA	—		123	1,018	27,431	化学
ENGIE BRASIL SA	179.87		73.87	536	14,457	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ALPARGATAS SA	85		194	325	8,770	繊維・アパレル・贅沢品
LOCALIZA RENT A CAR	389.89		352.89	440	11,859	陸運・鉄道
LOJAS RENNER SA	450.37		563.2	2,017	54,362	複合小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	379.04		559.04	1,505	40,572	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA	144		575	839	22,621	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	236		279	1,332	35,892	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA	685		560	976	26,307	ソフトウェア
JBS SA	695		483	1,449	39,059	電力
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	508.69		588.17	1,858	50,071	食品
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	179.98		188.98	909	24,497	電力
HYPERA SA	182		195	950	25,599	水道
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	1,271.16		3,546.48	755	20,351	医薬品
MAGAZINE LUIZA SA	1,810		1,682	5,138	138,445	資本市場
HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	—		386	1,010	27,234	複合小売り
TELEFONICA BRASIL SA	322.28		286.28	961	25,893	石油・ガス・消耗燃料
VIA S/A	683		—	1,538	41,440	各種電気通信サービス
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	423		458	—	—	専門小売り
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	342		—	1,198	32,278	保険
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	591		2,456.61	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	299		299	2,554	68,830	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMBEV SA	2,925.95		2,773.95	690	18,615	食品・生活必需品小売り
NATURA &CO HOLDING SA	571		498	4,077	109,857	飲料
TIM SA	622		466	1,245	33,541	パーソナル用品
REDE D'OR SAO LUIZ SA	—		222	636	17,149	無線通信サービス
RUMO SA	797		855	942	25,400	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
				1,573	42,383	陸運・鉄道
小計	株数・金額	37,896.02	株数・金額	41,632.31	109,231	2,942,785
	銘柄数<比率>	47銘柄	銘柄数<比率>	44銘柄	—	<4.7%>
(チェコ)						
KOMERCNI BANKA AS	62.5	百株	36.64	千チェコ・コルナ	千円	銀行
CEZ	98.49		88.2	3,057	17,113	電力
MONETA MONEY BANK AS	269.89		269.89	8,837	49,463	銀行
				2,469	13,821	
小計	株数・金額	430.88	株数・金額	394.73	14,364	80,398
	銘柄数<比率>	3銘柄	銘柄数<比率>	3銘柄	—	<0.1%>
(韓国)						
SKC CO LTD	—	百株	14.72	千韓国・ウォン	千円	化学
CHEIL WORLDWIDE INC	73		50.14	230,368	23,704	メディア
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	20.68		22.26	123,344	12,692	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	18.56		16.95	197,891	20,363	自動車
DB INSURANCE CO LTD	38.43		34.5	361,035	37,150	保険
COWAY CO LTD	23.34		36.97	237,705	24,459	保険
KT&G CORP	64.55		66.64	244,002	25,107	家庭用耐久財
S-1 CORPORATION	7.94		1.07	531,787	54,720	タバコ
KOREA GAS CORP	13.03		—	7,329	754	商業サービス・用品
CJ CORP	10.01		10.01	—	—	ガス
KAKAO CORP	175.75		180.92	87,287	8,981	コンプロマリット
CJ ENM CO LTD	2.99		7.61	1,725,976	177,603	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	24.97		—	99,158	10,203	娯楽
KMW CO LTD	13.34		—	—	—	機械
SK TELECOM CO LTD	25.24		22.04	—	—	通信機器
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	215.11		200.59	131,138	13,494	無線通信サービス
NCSOFT CORPORATION	10.26		9.06	167,492	17,234	資本市場
LG UPLUS CORP	156.81		146.06	401,358	41,299	娯楽
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	152.61		200.52	208,135	21,417	各種電気通信サービス
				420,089	43,227	電気設備

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	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	5.62	5.29	463,933	47,738	パーソナル用品
LG CHEM LTD	28.06	26.33	1,329,665	136,822	化学
LG CHEM LTD	4.99	4.99	130,239	13,401	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	2.03	1.02	50,235	5,169	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	273.94	255.17	1,028,335	105,815	銀行
HYUNDAI MERCHANT MARINE	—	151.96	405,733	41,749	海運業
S-OIL CORP	24.6	23.35	251,012	25,829	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	65.26	83.1	282,955	29,116	化学
MERITZ SECURITIES CO LTD	202.52	202.52	137,106	14,108	資本市場
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	52.63	46.18	187,490	19,292	資本市場
POSCO CHEMICAL CO LTD	13.38	20.82	271,701	27,958	建設資材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	10.44	8.75	168,000	17,287	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	16.75	13.99	114,578	11,790	専門小売り
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	22.28	19.26	188,170	19,362	機械
HYUNDAI MOBIS	41.29	38.05	783,830	80,656	自動車部品
SK HYNIX INC	333.67	318.1	3,435,480	353,510	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	45.34	42.06	185,694	19,108	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO	15.15	15.15	133,320	13,718	自動車
HYUNDAI MOTOR CO	92.1	80.41	1,423,257	146,453	自動車
HYUNDAI STEEL CO	45.33	60.59	250,236	25,749	金属・鉱業
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	211.14	183.71	202,081	20,794	銀行
KIA CORPORATION	163.27	153.03	1,173,740	120,777	自動車
KOREA ZINC CO LTD	4.65	4.7	294,220	30,275	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER CORP	164.88	142.75	310,481	31,948	電力
HANWHA CORP	24.18	—	—	—	コングロマリット
KOREAN AIR CO LTD	97.24	94.37	296,793	30,540	旅客航空輸送業
CJ LOGISTICS	4.51	1.29	16,770	1,725	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10.93	11.99	182,248	18,753	化学
DOUZONE BIZON CO LTD	10.2	—	—	—	ソフトウェア
HLB INC	48.88	67.89	207,064	21,306	レジャー用品
LG ELECTRONICS INC	66.67	60.7	767,855	79,012	家庭用耐久財
LOTTE CORP	15.91	—	—	—	コングロマリット
LG CORP	52.51	48.25	353,672	36,392	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	91.63	91.63	101,709	10,465	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	47.63	46.31	196,122	20,181	建設・土木
NAVER CORP	75.17	71.42	2,203,307	226,720	インタラクティブ・メディアおよびサービス
L&F CO LTD	—	14.49	340,659	35,053	電子装置・機器・部品
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	22.41	29.32	219,020	22,537	資本市場
OTTOGI CORP	0.66	—	—	—	食品
AMOREPACIFIC GROUP	20.01	23.47	111,834	11,507	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	87.13	43.02	118,950	12,239	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO HOLDINGS INC	46.03	42.5	1,200,625	123,544	金属・鉱業
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	88.11	82.93	202,349	20,821	建設・土木
SAMSUNG SDI CO LTD	33.81	31.92	1,956,696	201,344	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	35.6	30.59	480,263	49,419	電子装置・機器・部品
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	—	4.1	78,310	8,058	バイオテクノロジー
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	2,913	2,802.68	18,665,848	1,920,715	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	267.7	354.68	221,320	22,773	機械
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	494.02	485.33	2,907,126	299,143	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	5.13	—	—	—	複合小売り
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	15.63	—	—	—	医薬品
YUHAN CORP	37.2	21.27	126,556	13,022	医薬品
HANON SYSTEMS	101.46	80.78	91,281	9,392	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	31.66	—	—	—	保険
GS HOLDINGS CORP	28.79	26.22	115,892	11,925	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	140.45	125.69	241,953	24,896	電子装置・機器・部品
CELLTRION INC	59.4	56.12	889,502	91,529	バイオテクノロジー

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
HANA FINANCIAL GROUP	190.41	172.18	807,524	83,094	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	11.32	11.38	224,755	23,127	航空貨物・物流サービス
CELLTRION PHARM INC	9.88	10.17	89,089	9,167	医薬品
LOTTE SHOPPING CO	5.38	4.57	43,003	4,425	複合小売り
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	—	24.99	116,078	11,944	保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	43.61	37.28	241,201	24,819	保険
AMOREPACIFIC CORP	17.7	17.9	289,085	29,746	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	30.26	—	—	—	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	34.79	29.24	606,730	62,432	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	4.66	3.85	148,610	15,291	食品
STX PAN OCEAN CO LTD	195.95	201.72	133,336	13,720	海運業
LG INNOTEK CO LTD	7.64	7.85	312,822	32,189	電子装置・機器・部品
SK INC	19.45	24.01	601,450	61,889	コンプロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	245.61	229.45	1,362,933	140,245	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	36.64	34.39	151,831	15,623	航空宇宙・防衛
ILJIN MATERIALS CO LTD	—	19.49	183,790	18,912	電子装置・機器・部品
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	—	28	114,800	11,812	各種金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	2.87	2.35	72,145	7,423	医薬品
FILA HOLDINGS CORP	25.17	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
SEEGENE INC	9.79	19.58	81,452	8,381	バイオテクノロジー
E-MART CO LTD	10.07	14.26	196,788	20,249	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	6.53	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	38.56	52.61	180,978	18,622	自動車部品
HD HYUNDAI CO LTD	23.05	20.56	120,687	12,418	石油・ガス・消耗燃料
BGF RETAIL CO LTD	3.44	4.13	74,133	7,628	食品・生活必需品小売り
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	17.03	17.6	152,944	15,737	食品
SK CHEMICALS CO LTD	4.09	6.13	77,544	7,979	化学
NETMARBLE CORP	14.5	14.78	152,234	15,664	娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	299.5	284.88	433,017	44,557	銀行
ECOPRO BM CO LTD	—	5.86	268,681	27,647	電気設備
SD BIOSENSOR INC	—	30.95	150,107	15,446	ヘルスケア機器・用品
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	11.69	20.02	177,177	18,231	医薬品
KRAFTON INC	—	12.16	321,632	33,095	娯楽
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	—	13.12	160,064	16,470	化学
SK SQUARE CO LTD	—	53.81	307,255	31,616	半導体・半導体製造装置
SK BIOSCIENCE CO LTD	—	16.72	224,048	23,054	バイオテクノロジー
KAKAO GAMES CORP	—	25.15	164,984	16,976	娯楽
HYBE CO LTD	—	11.58	340,452	35,032	娯楽
LG ENERGY SOLUTION	—	11.97	520,695	53,579	電気設備
KAKAOBANK CORP	—	67.67	312,635	32,170	銀行
F&F CO LTD / NEW	—	13.7	205,500	21,145	繊維・アパレル・贅沢品
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD-RTS	—	0.87	17,313	1,781	ライフサイエンス・ツール／サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	21.86	18.25	250,937	25,821	情報技術サービス
ALTEOGEN INC	23.29	20.26	108,796	11,195	バイオテクノロジー
SAMSUNG C&T CORP	54.59	46.39	505,651	52,031	コンプロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	10.33	9.96	831,660	85,577	ライフサイエンス・ツール／サービス
PEARL ABYSS CORP	20.8	20.8	222,976	22,944	娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	29.22	28.05	122,017	12,555	機械
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	38.5	47.15	282,900	29,110	ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス
小計	株数・金額	株数	63,133,776	6,496,465	
	銘柄数<比率>	112銘柄	—	<10.3%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
EVE ENERGY CO LTD	90.32	88.32	629	12,491	電気設備
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	54	59.4	69	1,376	電子装置・機器・部品
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	34	348	6,913	電子装置・機器・部品
ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	58	—	—	—	電子装置・機器・部品
BEIJING THUNISOFT CORP LTD	64	—	—	—	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(中国)	百株	百株	千円	千円			
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	30	30	68	1,362	飲料		
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	120	120	115	2,292	半導体・半導体製造装置		
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	18	52	595	11,810	金属・鉱業		
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	-	52	68	1,357	金属・鉱業		
UNISPLENDOUR CORP LTD	75.4	75.4	131	2,617	電子装置・機器・部品		
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	163	163	112	2,224	電子装置・機器・部品		
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	191	191	229	4,542	紙製品・林産品		
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	40	40	64	1,277	通信機器		
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12	12	126	2,507	ライフサイエンス・ツール/サービス		
JOYOUNG CO LTD	51	-	-	-	家庭用耐久財		
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	164	39	88	1,757	電気設備		
HUAGONG TECH CO LTD	75	75	132	2,618	電子装置・機器・部品		
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	9	21	331	6,571	医薬品		
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	103.3	103.3	162	3,223	機械		
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	66	-	-	-	医薬品		
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	53	53	155	3,078	娯楽		
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	59	59	62	1,231	電子装置・機器・部品		
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	191	191	327	6,501	電子装置・機器・部品		
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	238	-	-	-	保険		
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	66	-	-	-	家庭用耐久財		
BEIJING ORIENTAL YUHOONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	66.5	-	-	-	建設資材		
GEM CO LTD	291	291	218	4,340	金属・鉱業		
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	44	26	230	4,574	ソフトウェア		
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	69	69	381	7,563	バイオテクノロジー		
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	186	186	103	2,055	娯楽		
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	24	65	549	10,898	電気設備		
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	61.2	85.68	145	2,877	電子装置・機器・部品		
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	59.04	59.04	184	3,659	家庭用耐久財		
ZHEJIANG NHU CO LTD	58	32.6	103	2,053	医薬品		
SHUIJIAHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	19	26.6	95	1,898	医薬品		
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	27	-	-	-	電子装置・機器・部品		
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	66	66	126	2,511	食品		
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	39	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	34	34	80	1,590	機械		
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	51	51	160	3,175	建設関連製品		
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	15	15	14	296	情報技術サービス		
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	26	26	30	602	情報技術サービス		
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	46	46	273	5,429	食品		
GOTION HIGH-TECH CO LTD	124	30	85	1,699	電気設備		
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	110	110	107	2,131	航空宇宙・防衛		
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	84	-	-	-	自動車部品		
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	120	196	1,027	20,388	食品		
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	48	72	835	16,564	バイオテクノロジー		
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	-	40	60	1,194	石油・ガス・消耗燃料		
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	-	180	180	3,584	コンプロマリット		
ADDSINO CO LTD	102	102	107	2,136	通信機器		
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	112	112	117	2,330	コンピュータ・周辺機器		
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	-	101	101	2,021	電子装置・機器・部品		
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	314	314	200	3,967	化学		
NAVINFO CO LTD	56	56	72	1,445	ソフトウェア		
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	143	143	74	1,477	不動産管理・開発		
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	27.3	27.3	22	444	ヘルスケア・テクノロジー		
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	26	26	41	832	医薬品		
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	78	78	144	2,870	バイオテクノロジー		
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	259	502.5	728	14,443	化学		
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	60	60	225	4,463	医薬品		
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	32	32	556	11,038	半導体・半導体製造装置		

銘柄	期首(前期末)	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
INSUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	35.7	35.7	97	1,926	コンピュータ・周辺機器
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	149	—	—	—	医薬品
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	127	127	122	2,423	コンピュータ・周辺機器
O-FILM TECH CO LTD	86	86	53	1,067	電子装置・機器・部品
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	500	367	262	5,205	金属・鉱業
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	124.8	233.81	807	16,023	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	139	108	291	5,782	電子装置・機器・部品
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	48	5.6	20	416	飲料
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	69	69	130	2,581	ヘルスケア機器・用品
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	382	382	207	4,114	機械
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	13	—	—	—	医薬品
DONG-E-E-JIAO CO LTD	49	49	159	3,169	医薬品
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	153	153	147	2,919	通信機器
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	210	210	137	2,724	繊維・アパレル・贅沢品
HUADONG MEDICINE CO LTD	75	75	257	5,105	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	50	50	200	3,980	エネルギー設備・サービス
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	—	62	25	504	金属・鉱業
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	66	66	147	2,926	娯楽
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	—	119	254	5,051	航空宇宙・防衛
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	48	45	938	18,611	飲料
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	74	111	583	11,581	機械
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	149.5	149.5	129	2,562	食品
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	177	177	138	2,749	資本市場
TIANJIN ZHONGHUA SEMICONDUCTOR CO LTD	178	153	618	12,264	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	59.4	59.4	81	1,622	ホテル・レストラン・レジャー
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	38	53.2	97	1,924	ソフトウェア
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	160	160	71	1,418	不動産管理・開発
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	21	21	197	3,923	資本市場
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	364.8	364.8	229	4,544	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	143	143	110	2,195	娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	291.54	271.54	793	15,738	電子装置・機器・部品
SHANXI SECURITIES CO LTD	275	275	154	3,065	資本市場
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	445	838	493	9,790	メディア
NEW HOPE LIUHE CO LTD	199	199	311	6,169	食品
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	—	239	375	7,452	電子装置・機器・部品
DHC SOFTWARE CO LTD	38	38	25	506	情報技術サービス
IFLYTEK CO LTD	113	135	561	11,134	ソフトウェア
HESTEEL CO LTD	1,047	1,047	281	5,586	金属・鉱業
GOERTEK INC	87	78	248	4,932	電子装置・機器・部品
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	213	213	163	3,236	資本市場
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	575	—	—	—	商業サービス・用品
BANK OF NINGBO CO LTD	191	192	735	14,590	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD	146	124	132	2,634	電子装置・機器・部品
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	474	474	225	4,475	家庭用耐久財
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	283	283	175	3,480	資本市場
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	376	376	287	5,698	ホテル・レストラン・レジャー
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	124	416.6	432	8,586	自動車
WESTERN SECURITIES CO LTD	227	227	159	3,169	資本市場
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	82	47	145	2,887	食品
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	38	38	296	5,887	医薬品
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUTRY GROUP	107	—	—	—	航空宇宙・防衛
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	278.4	267.08	718	14,251	資本市場
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	48	44	607	12,044	飲料
WULIANGYE YIBIN CO LTD	146	128	2,174	43,137	飲料
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	208	208	119	2,376	バイオテクノロジー
SUNING.COM CO LTD	237	237	83	1,654	専門小売り
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,256	855	351	6,970	電子装置・機器・部品

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	499	253	430	8,536	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	—	34	110	2,183	家庭用耐久財
MIDEA GROUP CO LTD	136	—	—	—	家庭用耐久財
GUOSEN SECURITIES CO LTD	170	—	—	—	資本市場
PING AN BANK CO LTD	614	601	986	19,575	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	302.8	155.8	334	6,625	食品
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	1,287	712	312	6,200	資本市場
CHINA VANKE CO LTD	374	319	679	13,478	不動産管理・開発
ZTE CORP	216	243	551	10,936	通信機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	285	285	190	3,776	機械
WEICHAI POWER CO LTD	170	47	59	1,179	機械
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	42	42	144	2,868	医薬品
GF SECURITIES CO LTD	391	219	391	7,767	資本市場
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	211	211	251	4,997	電気設備
BYD CO LTD	71	59	1,393	27,643	自動車
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	341	341	158	3,138	電子装置・機器・部品
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	39	48.3	393	7,813	化学
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	—	29	209	4,160	化学
LB GROUP CO LTD	110	110	229	4,545	化学
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	—	179	246	4,885	化学
NANJI E-COMMERCE CO LTD	129	—	—	—	メディア
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	—	129	284	5,649	化学
CHACHA FOOD CO LTD	29	29	171	3,397	食品
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	80	80	199	3,952	医薬品
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	15	27	705	13,998	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBOANG TECHNOLOGY CO LTD	36	36	25	505	食品
HUAFON CHEMICAL CO LTD	—	342	292	5,807	化学
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	494	—	—	—	金属・鉱業
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	55.5	55.5	70	1,400	娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12	30	561	11,132	飲料
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	156	156	132	2,627	化学
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	66	66	338	6,713	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	6	6	31	633	家庭用耐久財
NINESTAR CORP	57	57	236	4,683	コンピュータ・周辺機器
YUNDA HOLDING CO LTD	70.2	70.2	121	2,413	航空貨物・物流サービス
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	338	338	109	2,165	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	120	120	109	2,180	娯楽
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	42	67.2	320	6,351	機械
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	16	16	75	1,491	医薬品
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	5	15	463	9,193	医薬品
JIUGUI LIQUOR CO LTD	—	23	368	7,317	飲料
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	151	151	86	1,707	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	53	53	55	1,095	ソフトウェア
SF HOLDING CO LTD	150	142	711	14,114	航空貨物・物流サービス
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	—	18	184	3,659	建設関連製品
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	236	236	134	2,658	資本市場
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	—	25	207	4,124	半導体・半導体製造装置
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	65	—	—	—	化学
BANK OF SHANGHAI CO LTD	637.9	637.9	430	8,541	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	—	389	356	7,068	ソフトウェア
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	—	23	244	4,852	家庭用耐久財
CSC FINANCIAL CO LTD	136	136	330	6,560	資本市場
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	50	—	—	—	航空宇宙・防衛
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	21	29.4	367	7,288	化学
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	—	126	362	7,193	医薬品
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	164	133	292	5,806	化学
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	31	31	256	5,093	飲料

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	225	225	238	4,735	資本市場
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	13	15.6	43	855	食品・生活必需品小売り
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	—	115	143	2,856	金属・鉱業
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	52	52	179	3,559	食品
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	—	102	406	8,064	化学
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	31.5	31.5	230	4,563	通信機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	33	32	609	12,092	化学
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	27	27	180	3,588	電子装置・機器・部品
JUEWEI FOOD CO LTD	31	31	141	2,797	食品
OPPEIN HOME GROUP INC	21	21	277	5,495	家庭用耐久財
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	236	—	—	—	銀行
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	43.2	43.2	350	6,944	金属・鉱業
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	95	95	149	2,967	食品
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	30	30	87	1,737	通信機器
C&S PAPER CO LTD	78	78	90	1,788	家庭用品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	8.4	8.4	77	1,541	電子装置・機器・部品
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	—	7	75	1,489	自動車部品
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	27	27	98	1,948	医薬品
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	16	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	13.3	13.3	58	1,154	ヘルスケア機器・用品
BGI GENOMICS CO LTD	13	13	98	1,960	バイオテクノロジー
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	30	30	146	2,896	化学
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	20	20	161	3,211	バイオテクノロジー
CAITONG SECURITIES CO LTD	127	127	101	2,020	資本市場
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	—	38	351	6,967	化学
BANK OF CHENGDU CO LTD	270	270	446	8,863	銀行
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	19	19	139	2,762	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD	98	98	84	1,683	資本市場
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	144	59	59	1,175	電子装置・機器・部品
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	36	38	1,295	25,688	ヘルスケア機器・用品
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	53	—	—	—	各種消費者サービス
HUAXI SECURITIES CO LTD	155	155	131	2,610	資本市場
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	12	12	118	2,356	ソフトウェア
OVCTEK CHINA INC	29	40.6	148	2,947	ヘルスケア機器・用品
SG MICRO CORP	6	9	255	5,070	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	77	80	3,606	71,546	電気設備
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	24.4	34.16	452	8,971	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTEC CO LTD	55.6	76.72	837	16,604	ライフサイエンス・ツール/サービス
FLAT GLASS GROUP CO LTD	—	3	12	257	半導体・半導体製造装置
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	35	23	160	3,179	電子装置・機器・部品
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	10	16	315	6,258	電子装置・機器・部品
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	—	363	584	11,585	化学
PHARMARON BEIJING CO LTD	—	33	396	7,865	ライフサイエンス・ツール/サービス
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	—	38	405	8,038	半導体・半導体製造装置
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	—	64	387	7,693	半導体・半導体製造装置
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	—	7	69	1,384	電気設備
WILL SEMICONDUCTOR LTD	37	38	660	13,108	半導体・半導体製造装置
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	—	17	225	4,471	機械
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	—	171	386	7,672	電気設備
TIANFENG SECURITIES CO LTD	967	9	3	61	資本市場
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	817	817	312	6,206	金属・鉱業
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	—	107	311	6,186	電子装置・機器・部品
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	—	287	295	5,852	資本市場
PROYA COSMETICS CO LTD	9	9	165	3,286	パーソナル用品
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	609	1,737	856	16,986	陸運・鉄道
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	10	324	6,441	半導体・半導体製造装置
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	—	9.6	276	5,484	電気設備

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	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	1,077	1,077	612	12,155	銀行
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	—	23	195	3,886	バイオテクノロジー
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	61	61	299	5,935	食品
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	—	16	73	1,465	医薬品
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	8	12	52	1,042	ヘルスケア機器・用品
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	—	39	398	7,910	金属・鉱業
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	—	62	473	9,395	半導体・半導体製造装置
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	—	506	419	8,320	資本市場
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	—	19	511	10,141	バイオテクノロジー
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	6	6	74	1,480	食品
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	—	109	454	9,022	資本市場
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	—	10	494	9,799	バイオテクノロジー
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	—	43	376	7,462	コンピュータ・周辺機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	—	24.47	443	8,803	ソフトウェア
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	—	164	369	7,319	半導体・半導体製造装置
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	—	4.55	235	4,662	家庭用耐久財
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	—	660	161	3,194	建設・土木
PETROCHINA CO LTD	1,109	1,109	614	12,187	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	2,118	2,118	1,008	19,998	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	2,744	2,744	842	16,710	銀行
BANK OF CHINA LTD	840	840	275	5,465	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	421	1,585	689	13,676	石油・ガス・消耗燃料
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	100	100	269	5,341	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	155	175	543	10,771	石油・ガス・消耗燃料
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	736	701	3,282	65,117	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	377	370	1,787	35,449	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD	688	686	1,527	30,290	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	978	1,020	831	16,489	銀行
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	1,382	1,382	529	10,499	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD	239	257	433	8,589	自動車
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	46	44	7,946	157,624	飲料
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	1,265	1,265	651	12,922	銀行
CITIC SECURITIES CO LTD	466	565	1,179	23,401	資本市場
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	325	162	371	7,365	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	383	383	237	4,702	運送インフラ
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	758	738	1,726	34,255	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DAQIN RAILWAY CO LTD	977	189	127	2,534	陸運・鉄道
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	1,097	784	262	5,209	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	—	1,223	738	14,652	建設・土木
HAITONG SECURITIES CO LTD	661	—	—	—	資本市場
HUAXIA BANK CO LTD	1,129	829	470	9,323	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	163	190	733	14,551	食品
BANK OF BEIJING CO LTD	879	879	408	8,107	銀行
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	—	407	143	2,849	無線通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	705	548	402	7,989	金属・鉱業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	140	97	387	7,684	建設資材
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	335	335	496	9,841	資本市場
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	78	78	49	988	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR CO LTD	165	141	362	7,182	自動車
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	451	451	871	17,283	不動産管理・開発
CRRG CORP LTD	—	770	405	8,034	機械
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	196.6	172.52	588	11,666	医薬品
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	—	189	656	13,016	金属・鉱業
HUATAI SECURITIES CO LTD	461	52	77	1,537	資本市場
CHINA RAILWAY GROUP LTD	—	1,111	748	14,853	建設・土木
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	120	—	—	—	保険
HAIER SMART HOME CO LTD	317	278	685	13,593	家庭用耐久財

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	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	270	193	355	7,055	機械
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	—	1,273	332	6,590	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	766	103	64	1,272	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	79	79	373	7,410	医薬品
GUANGHUI ENERGY CO LTD	—	72	62	1,239	石油・ガス・消耗燃料
GEMDALE CORP	106	106	161	3,193	不動産管理・開発
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	221	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	103	124	1,049	20,821	化学
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	—	970	383	7,600	電気設備
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	935	927	1,124	22,304	金属・鉱業
FOUNDER SECURITIES CO LTD	580	—	—	—	資本市場
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	316	316	299	5,935	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NARI TECHNOLOGY CO LTD	243	136.2	388	7,707	電気設備
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	298	298	129	2,565	エネルギー設備・サービス
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	67	62	1,129	22,412	専門小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	—	2,359	528	10,481	金属・鉱業
TSINGTAO BREWERY CO LTD	6	—	—	—	飲料
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	250	250	104	2,067	各種金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	951	261	149	2,961	金属・鉱業
AIR CHINA LTD	284	284	293	5,819	旅客航空輸送業
TBEA CO LTD	267	267	525	10,428	電気設備
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	314	—	—	—	建設・土木
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	—	457	170	3,390	建設・土木
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	843	843	652	12,942	建設・土木
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	—	69	120	2,393	機械
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	33	33	173	3,450	運送インフラ
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	69	69	204	4,058	医薬品
JIANGXI COPPER CO LTD	—	172	348	6,908	金属・鉱業
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	343	343	149	2,959	資本市場
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	83	83	166	3,309	自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD	148	148	136	2,697	資本市場
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	48	48	51	1,028	化学
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	237	237	258	5,119	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	—	6	11	230	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AECC AVIATION POWER CO LTD	—	144	547	10,854	航空宇宙・防衛
BANK OF NANJING CO LTD	291	291	346	6,869	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76	76	103	2,060	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	22	599.7	906	17,974	海運業
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	602	641	353	7,018	金属・鉱業
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	327	—	—	—	金属・鉱業
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	282	282	214	4,262	資本市場
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	95.2	229.2	497	9,865	金属・鉱業
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	76	76	254	5,048	電気設備
BBMG CORP	542	542	161	3,203	建設資材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	294	294	130	2,583	食品・生活必需品小売り
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	186	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
YUTONG BUS CO LTD	125	—	—	—	機械
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	386	386	186	3,698	旅客航空輸送業
LIAONING CHENG DA CO LTD	16	—	—	—	販売
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	150.19	150.19	188	3,744	電気設備
SHANXI LUAN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	77	77	137	2,734	石油・ガス・消耗燃料
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	56.4	78.96	302	5,998	ソフトウェア
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	162.5	162.5	337	6,701	ソフトウェア
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	—	33	57	1,133	金属・鉱業
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	327	327	223	4,443	旅客航空輸送業
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	590	590	194	3,862	建設・土木
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	126	109	382	7,584	自動車部品

銘柄	期首(前期末)		当		期末		業種等
	株数	株数	株数	株数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	百株	百株	千円	千円			
XIAMEN C & D INC	189	189	267	5,301			商社・流通業
YOUNGOR GROUP CO LTD	256	256	175	3,473			不動産管理・開発
AVIC HELICOPTER CO LTD	46	46	209	4,156			航空宇宙・防衛
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	168	168	124	2,479			資本市場
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	147	—	—	—			医薬品
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	394	394	194	3,853			化学
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	196	196	157	3,125			電気設備
ZHANGZHOU PIENZHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	18	17	533	10,578			医薬品
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	90	—	—	—			医薬品
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	266	—	—	—			金属・鉱業
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	27	48.8	1,296	25,719			飲料
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	12	12	16	336			通信機器
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	263	—	—	—			石油・ガス・消耗燃料
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	250	250	252	5,003			専門小売り
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	259	—	—	—			航空宇宙・防衛
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	31	—	—	—			ソフトウェア
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	226	226	274	5,446			化学
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	262	262	98	1,959			金属・鉱業
BEIJING TIANJIAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	54	54	114	2,269			バイオテクノロジー
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	129	—	—	—			独立系発電事業者・エネルギー販売業者
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	126	126	182	3,621			電気設備
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	300	300	223	4,433			石油・ガス・消耗燃料
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	42	42	119	2,365			食品
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD	199	—	—	—			機械
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	64	—	—	—			バイオテクノロジー
SICHUAN ROAD & BRIDGE CO LTD	—	56	56	1,114			建設・土木
ZHEJIANG HUAIHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	58.3	58.3	99	1,980			医薬品
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	119	—	—	—			運送インフラ
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	118	118	131	2,609			医薬品
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	45	45	73	1,454			電子装置・機器・部品
TONGWEI CO LTD	103	210	829	16,449			食品
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	11	78.3	370	7,344			ソフトウェア
JCET GROUP CO LTD	—	109	258	5,135			半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	—	68	276	5,476			半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO LTD	25	25	310	6,164			飲料
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	53	53	286	5,687			ホテル・レストラン・レジャー
HUAXIN CEMENT CO LTD	56	56	116	2,301			建設資材
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	93	120.9	404	8,017			化学
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	—	1	15	310			電子装置・機器・部品
CHINA JUSHI CO LTD	234	267.46	428	8,504			建設資材
NINGBO SHANSHAN CO LTD	—	29	70	1,389			化学
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	22.24	73.24	356	7,073			機械
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	—	196	226	4,502			建設関連製品
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	40	308	344	6,836			通信機器
TONGKUN GROUP CO LTD	157	157	259	5,157			化学
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	17	17	202	4,007			化学
ANGEL YEAST CO LTD	49	49	197	3,923			食品
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	—	12	58	1,156			半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD	—	59	284	5,640			半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	—	1,215	684	13,568			独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	128	172.2	1,143	22,680			半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	18	18	228	4,536			自動車部品
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	68	—	—	—			医薬品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	323.51	246.51	432	8,581			石油・ガス・消耗燃料
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	102.8	129.24	1,167	23,164			食品
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	50	50	219	4,350			飲料
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	12	12	15	298			自動車部品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(中国)	百株	百株	千円	千円	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	58	58	255	5,062	電気設備
DONGXING SECURITIES CO LTD	132	132	125	2,482	資本市場
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	—	20	100	1,989	自動車部品
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	506	6	9	188	資本市場
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	597	597	454	9,023	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	34	34	190	3,777	飲料
SKSHU PAINT CO LTD	—	38	316	6,283	化学
HUAAN SECURITIES CO LTD	165	—	—	—	資本市場
BANK OF JIANGSU CO LTD	1,173	334	252	5,002	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD	236	236	361	7,162	銀行
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	90	114	230	4,572	自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	11	14.3	66	1,310	ヘルスケア機器・用品
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	20	20	42	847	医薬品
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	—	96	160	3,176	航空貨物・物流サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	12	12	80	1,591	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	15	15	94	1,865	家庭用耐久財
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	392	392	401	7,970	資本市場
SDIC CAPITAL CO LTD	433	0.16	0.1128	2	資本市場
TOPCHOICE MEDICAL CORP	8	8	119	2,376	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	48	47	460	9,129	半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD	36	50.4	111	2,202	食品
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	22	28.6	103	2,058	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	29.4	29.4	118	2,344	機械
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	—	87	215	4,266	商業サービス・用品
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	194	194	211	4,186	資本市場
SPRING AIRLINES CO LTD	42	—	—	—	旅客航空輸送業
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	160	160	204	4,059	資本市場
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	63	60	290	5,759	商業サービス・用品
GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	292	306.6	165	3,290	不動産管理・開発
FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	107	107	327	6,496	不動産管理・開発
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
銘 柄 数<比 率>	76,994.14	82,390.45	135,213	2,682,111	
	358銘柄	388銘柄	—	<4.3%>	
(マレーシア)	百株	百株	千円	千円	
AMMB HOLDINGS BHD	814	803	293	8,786	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	141	—	—	—	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,589	3,731	1,899	56,774	銀行
DIGI.COM BHD	2,353	1,540	592	17,725	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	897.2	479.2	328	9,827	運送インフラ
RHB BANK BHD	834.8	1,408.8	835	24,975	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	317	317	237	7,088	コンピュータリット
TOP GLOVE CORP BHD	2,627	3,823	684	20,458	ヘルスケア機器・用品
GAMUDA BHD	1,002	—	—	—	建設・土木
GENTING BHD	1,072	1,049	482	14,425	ホテル・レストラン・レジャー
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	252.56	202.56	391	11,711	銀行
HONG LEONG BANK BHD	349.08	339.08	701	20,963	銀行
IOI CORP BHD	1,908.13	1,908.13	822	24,586	食品
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	226	221	601	17,970	食品
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	116	116	272	8,142	飲料
MALAYAN BANKING BHD	2,543.75	2,859.75	2,513	75,149	銀行
MISC BHD	1,008.8	1,008.8	770	23,041	海運業
NESTLE MALAYSIA BHD	41	41	547	16,375	食品
PPB GROUP BHD	462.6	462.6	792	23,704	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD	223	223	474	14,186	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BHD	396	554	932	27,890	ガス
GENTING MALAYSIA BHD	2,198	2,198	652	19,516	ホテル・レストラン・レジャー
TELEKOM MALAYSIA BHD	595	595	299	8,965	各種電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	1,396.5	1,463.5	1,309	39,158	電力

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
QL RESOURCES BHD	509.5	254.5	126	3,781	食品
DIALOG GROUP BHD	2,339.44	1,837.44	477	14,282	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	8,914.5	8,512.5	3,975	118,845	銀行
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	828	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SUPERMAX CORP BHD	745.71	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SIME DARBY BERHAD	1,395	2,348	565	16,916	コンプロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,072	1,058	488	14,612	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD	1,701	1,345	485	14,515	無線通信サービス
MAXIS BHD	1,308	1,052	407	12,171	無線通信サービス
INARI AMERTRON BHD	—	1,313	380	11,383	電子装置・機器・部品
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,362	1,350	1,393	41,650	化学
IHH HEALTHCARE BHD	1,687	1,266	810	24,222	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	357	176	70	2,104	運送インフラ
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	788	1,825	1,189	35,572	金属・鉱業
SIME DARBY PLANTATION BHD	934	1,064	539	16,127	食品
小計	株数・金 銘柄数<比率>	49,304.57	48,744.86	27,348	817,609
		38銘柄	35銘柄	—	<1.3%>
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	71.63	71.63	1,917	16,527	金属・鉱業
BIDVEST GROUP LTD	162	160.66	3,425	29,524	コンプロマリット
CLICKS GROUP LTD	155.31	134.09	4,011	34,582	食品・生活必需品小売り
DISCOVERY LTD	211.37	249.05	4,227	36,439	保険
GOLD FIELDS LTD	557.34	515.31	11,483	98,989	金属・鉱業
REMGRO LTD	260	283.02	4,094	35,291	各種金融サービス
NORTHAM PLATINUM LTD	236.02	—	—	—	金属・鉱業
HARMONY GOLD MINING CO LTD	285.37	363.08	2,504	21,589	金属・鉱業
EXXARO RESOURCES LTD	141.15	154.24	3,612	31,136	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	38.02	47.36	10,182	87,772	銀行
MTN GROUP LTD	1,063.52	992.79	17,383	149,847	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	265.08	241.13	8,283	71,399	金属・鉱業
FIRSTRAND LTD	3,039.68	2,949.79	20,613	177,685	各種金融サービス
NASPERS LTD	265.6	126.73	19,303	166,394	インターネット販売・通信販売
NEDBANK GROUP LTD	234.74	268.1	5,903	50,884	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	29.67	31.16	6,169	53,182	金属・鉱業
SASOL LTD	312.58	330.95	12,202	105,182	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD	325.94	294.74	6,870	59,227	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	182.1	142.2	3,119	26,893	専門小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	842.71	794.67	13,238	114,115	銀行
SPAR GROUP LTD/THE	94.14	95.11	1,563	13,479	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	542.19	560.8	3,293	28,390	複合小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	241.12	217.55	3,917	33,768	医薬品
ABSA GROUP LTD	391.86	420.97	7,475	64,439	銀行
TIGER BRANDS LTD	118.03	129.81	1,906	16,430	食品
SANLAM LTD	1,195.61	1,091.85	7,491	64,573	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	489.66	475.83	10,307	88,854	金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	31.73	44.97	2,923	25,199	金属・鉱業
RMI HOLDINGS	358.36	393.52	1,879	16,197	保険
VODACOM GROUP PTY LTD	432.18	367.03	5,429	46,802	無線通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	221.85	333.57	3,194	27,537	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	2,929.73	2,992.44	3,659	31,547	保険
REINET INVESTMENTS SCA	77.43	64.7	2,140	18,451	資本市場
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	1,003.74	2,231	19,233	専門小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	272.58	270.72	3,471	29,923	メディア
SIBANYE STILLWATER LTD	1,755.33	1,547.9	9,394	80,978	金属・鉱業
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	—	287.27	5,588	48,175	金属・鉱業

銘柄		期首(前期末)	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	食品・生活必需品小売り
BID CORP LTD		180.86	192.56	6,065	52,280	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18,012.49 36銘柄	18,641.04 37銘柄	240,479 —	2,072,930 <3.3%>	
(タイ)		百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL		277	—	—	—	銀行
BERLI JUCKER PCL NVDR		1,011	1,037	3,681	13,841	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK PCL NVDR		1,036	1,538	2,045	7,691	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR		342	27	119	449	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR		432	470	4,864	18,290	銀行
TRUE CORP PCL NVDR		5,093.55	6,857.55	3,373	12,685	各種電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL NVDR		267	—	—	—	銀行
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR		124	184	3,109	11,692	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHIN CORP PCL		1,366	570	4,189	15,752	無線通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL		2,497	2,008	4,718	17,742	食品
ADVANCED INFO SERVICE PCL		664	696	15,520	58,358	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		4,308.2	3,124.2	5,092	19,147	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR		208	210	7,392	27,793	電子装置・機器・部品
PTT PCL		7,056	5,815	21,515	80,898	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		1,471	1,665	2,780	10,454	食品
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR		656	677	3,994	15,018	消費者金融
LAND AND HOUSES PCL NVDR		6,511	4,641	4,362	16,403	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL NVDR		489.5	451.5	16,389	61,624	建設資材
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR		2,345	2,511	17,074	64,201	運送インフラ
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN		686	—	—	—	銀行
CENTRAL PATTANA PCL NVDR		1,328	1,455	8,984	33,782	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR		5,106	5,386	13,868	52,147	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR		415	225	3,645	13,705	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		1,695.1	1,642.1	5,665	21,301	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL NVDR		858	831	4,300	16,169	石油・ガス・消耗燃料
CP ALL PCL NVDR		3,704	3,422	23,098	86,850	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL		3,561	4,271	3,886	14,613	陸運・鉄道
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR		706.45	770.45	11,055	41,570	石油・ガス・消耗燃料
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL		292	—	—	—	無線通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL NVDR		1,234.22	1,313.22	5,942	22,343	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		1,452.08	1,175.08	5,787	21,760	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR		760	807	7,263	27,308	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR		6,136	3,021	2,537	9,541	運送インフラ
B GRIMM POWER PCL NVDR		566	566	1,853	6,969	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR		2,077	1,969	9,697	36,461	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
OSOTSPA PCL NVDR		237	386	1,331	5,007	飲料
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR		1,053	1,053	2,095	7,878	資本市場
ASSET WORLD CORP PCL NVDR		3,536	3,536	1,732	6,514	ホテル・レストラン・レジャー
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR		919.33	1,120.33	4,509	16,955	複合小売り
SCG PACKAGING PCL NVDR		—	904	5,107	19,204	容器・包装
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR		568	236	1,250	4,703	消費者金融
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR		906	419	1,047	3,938	ヘルスケア機器・用品
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR		1,966	1,966	4,915	18,480	専門小売り
CARABAO GROUP PCL NVDR		—	262	2,633	9,900	飲料
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR		611	611	3,055	11,486	消費者金融
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR		491	491	3,412	12,830	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>	77,018.43 44銘柄	70,320.43 42銘柄	258,902 —	973,472 <1.5%>	
(ポーランド)		百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
MBANK		—	6.34	218	6,457	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		97.85	79.89	1,365	40,283	金属・鉱業
BANK PEKAO SA		97.3	98.56	1,079	31,842	銀行
ORANGE POLSKA SA		307.83	589.32	456	13,461	各種電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ポーランド)		百株	百株	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		164.47	166.5	1,349	39,831	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA		0.67	0.61	676	19,959	繊維・アパレル・贅沢品
SANTANDER BANK POLSKA SA		16	19.52	561	16,552	銀行
CD PROJEKT RED SA		42.92	46.78	781	23,050	娯楽
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA		578.12	489.95	1,862	54,961	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA		885.35	1,293.98	864	25,518	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA		122.39	200	546	16,121	メディア
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA		521.92	521.92	486	14,352	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA		363.09	332.7	1,110	32,776	保険
DINO POLSKA SA		34.34	26.31	888	26,222	食品・生活必需品小売り
ALLEGRO.EU SA		228.95	276.48	771	22,759	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 3,461.2 銘 柄 数<比率> 14銘柄	株 数 4,148.86 銘 柄 数 15銘柄	13,019 -	384,153 <0.6%>		
(ハンガリー)		百株	百株	千ハンガリー・フォリント	千円	
RICHTER GEDEON NYRT		83.93	82.72	58,731	21,356	医薬品
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT		307.03	283.77	85,131	30,956	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT		137.82	124.13	132,819	48,297	銀行
小 計	株 数 528.78 銘 柄 数<比率> 3銘柄	株 数 490.62 銘 柄 数 3銘柄	276,681 -	100,609 <0.2%>		
(ユーロ…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ALPHA BANK A.E.		-	1,036.65	112	15,327	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		131.62	113.34	204	27,966	各種電気通信サービス
FF GROUP		31.3	31.3	0	0	繊維・アパレル・贅沢品
EUROBANK ERGASIAS SERVICES		-	1,819.4	185	25,408	銀行
OPAP SA		112.46	155.54	223	30,529	ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA		81.43	45.83	68	9,352	専門小売り
PUBLIC POWER CORP		-	160	132	18,186	電力
小 計	株 数 356.81 銘 柄 数<比率> 4銘柄	株 数 3,362.06 銘 柄 数 7銘柄	926 -	126,771 <0.2%>		
合 計	株 数 1,493,200.07 銘 柄 数<比率> 1,264銘柄	株 数 1,522,645.11 銘 柄 数 1,291銘柄	-	52,841,334 <84.0%>		

(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。

(注4) 銘柄コード等の変更があった銘柄や普通株と優先株は、別銘柄として掲載しております。

(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
(タイ)			千タイ・バート	千円
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	証券 9,465	証券 -	-	-
合 計	証 券 数 9,465 銘 柄 数<比率> 1銘柄	証 券 数 - 銘 柄 数 -	-	-

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘 柄	期 首(前期末)		当 期		末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(メキシコ)	千□	千□	千メキシコ・ペソ	千円	
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D	121.8	114.1	17,846	113,247	
GRUPO TELEvisa SAB	141.9	120.8	5,281	33,514	
CEMEX SAB DE CV	948.675	854.975	8,096	51,378	
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	28	25	1,492	9,470	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	173.9	168	3,860	24,498	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	41.5	28.3	3,124	19,829	
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,455.775 6銘柄<0.5%>	1,311.175 6銘柄<0.4%>	39,702 —	251,939 —
(ブラジル)	千□	千□	千ブラジル・レアル	千円	
SUL AMERICA SA	15.356	—	—	—	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	21.7	32.3	1,127	30,369	
ENERGISA SA	17.5	8.1	383	10,343	
KLABIN SA	48.7	50.5	1,150	31,006	
BANCO INTER SA	6.7	23.7	391	10,554	
BANCO BTG PACTUAL SA	12.8	67.5	1,694	45,644	
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	122.756 6銘柄<0.2%>	182.1 5銘柄<0.2%>	4,748 —	127,918 —
(南アフリカ)	千□	千□	千南アフリカ・ランド	千円	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	259.878	190.305	2,679	23,097	
小 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	259.878 1銘柄<0.0%>	190.305 1銘柄<0.0%>	2,679 —	23,097 —
合 計	□ 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	1,838.409 13銘柄<0.7%>	1,683.58 12銘柄<0.6%>	— —	402,955 —

(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	
外国	百万円 9,569	百万円 —	
MINI MSCI EMG MKT			

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

■投資信託財産の構成

2022年4月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 52,841,334	% 83.8
投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券	402,955	0.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,834,830	15.6
投 資 信 託 財 産 総 額	63,079,120	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、62,754,884千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2022年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=126.68円、1香港・ドル=16.15円、1台湾・ドル=4.348円、1イギリス・ポンド=165.23円、1トルコ・リラ=8.664円、1メキシコ・ペソ=6.345円、1フィリピン・ペソ=2.427円、100チリ・ペソ=15.545円、100コロンビア・ペソ=3.384円、1クウェート・ディナール=415.75円、1カタール・リアル=34.77円、1サウジアラビア・リアル=33.84円、1インド・ルピー=1.67円、100インドネシア・ルピア=0.89円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=34.55円、1ブラジル・レアル=26.94円、1チェコ・コルナ=5.596円、100韓国・ウォン=10.29円、1オフショア・人民元=19.836円、1マレーシア・リングギット=29.895円、1南アフリカ・ランド=8.62円、1タイ・バーツ=3.76円、1ポーランド・ズロチ=29.505円、100ハンガリー・フォリント=36.363円、1ユーロ=136.78円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年4月18日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	63,109,573,624円
コ	等	7,055,858,395
株	式(評価額)	52,841,334,882
投	資 信 託 受 益 証 券(評価額)	355,359,551
投	資 証 券(評価額)	47,595,705
未	収 入 金	37,933,568
未	収 配 当 金	167,890,388
差	入 委 託 証 拠 金	2,603,601,135
(B) 負	債	221,356,632
未	金	217,825,632
未	払 解 約 金	3,531,000
(C) 純	資 産 総 額(A－B)	62,888,216,992
元	本	43,349,645,868
次	期 繰 越 損 益 金	19,538,571,124
(D) 受	益 権 総 口 数	43,349,645,868口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)		14,507円

(注1) 期首元本額 39,168,921,759円
追加設定元本額 57,766,963,374円
一部解約元本額 53,586,239,265円

(注2) 期末における元本の内訳
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>
8,165,233,734円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)
316,451,891円
M I T O ラップ型ファンド (安定型) 5,065,871円
M I T O ラップ型ファンド (中立型) 19,255,020円
M I T O ラップ型ファンド (積極型) 104,695,576円
グローバル8資産ラップファンド (安定型) 26,026,610円
グローバル8資産ラップファンド (中立型) 14,309,083円
グローバル8資産ラップファンド (積極型) 14,356,432円
たわらノーロード 新興国株式 9,234,570,518円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け> 2,873,148,312円
たわらノーロード バランス (8資産均等型) 2,578,644,415円
たわらノーロード バランス (堅実型) 23,686,677円
たわらノーロード バランス (標準型) 88,594,794円
たわらノーロード バランス (積極型) 150,290,585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) 93,091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) 127,975,656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) 212,043,143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) 185,865,372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) 263,319,015円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 538,209円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 18,070,875円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 1,905,741円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 6,342,806円
たわらノーロード 全世界株式 150,472,510円

One DC 新興国株式インデックスファンド 390,365,407円
マネックス資産設計ファンド エボリューション 385,912,567円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10) 345,994,625円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20) 463,152,779円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30) 940,074,201円
投資のソムリエ 8,414,976,041円
クルーズコントロール 371,495,340円
投資のソムリエ<DC年金> 512,003,596円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 377,344,929円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 512,932,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,856,021,516円
ワールドアセットバランス (基本コース) 755,160,967円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 832,729,130円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045) 17,362,940円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055) 8,593,766円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 3,509,820円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035) 60,654,292円
リスクコントロール世界資産分散ファンド 512,298,207円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 334,081,535円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040) 14,127,616円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050) 7,563,166円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060) 5,875,009円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065) 682,711円
エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用) 12,616,953円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 213,862,757円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用) 7,828,376円
しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定) 40,668,920円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定) 248,047,269円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定) 122,753,099円
期末元本合計 43,349,645,868円

■損益の状況

当期 自2021年4月20日 至2022年4月18日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収	益
	受	取	配	当	金
	受	取	利	息	930,536
	そ	の	他	収	益
	支	払	利	息	△96,927
(B)	有	価	証	券	売
	売		買	買	損
	売		買	損	益
					△20,914,181,277
(C)	先	物	取	引	等
	取		引	取	引
	取		引	損	益
					△2,158,447,880
(D)	そ	の	他	費	用
					△354,426,674
(E)	当	期	損	益	金(A + B + C + D)
					△3,917,869,963
(F)	前	期	繰	越	損
					益
					金
(G)	解	約	差	損	益
					金
					△21,955,890,564
(H)	追	加	信	託	差
					損
					益
					金
(I)	合				計(E + F + G + H)
	次	期	繰	越	損
					益
					金(I)
					19,538,571,124

(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。