

運用報告書 (全体版)

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

第98期 <決算日 2023年7月11日>
第99期 <決算日 2023年9月11日>
第100期 <決算日 2023年11月13日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>」は、2023年11月13日に第100期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	投資信託(資産)組入比率	純資産額
		(分配落)	税込み	騰落率							
第30作成期	86期(2021年7月12日)	円 12,665	円 15	% 2.9	% 48.7	% 0.9	% 34.5	% -	% -	% 14.4	百万円 430
	87期(2021年9月13日)	12,905	15	2.0	49.6	1.4	33.7	-	-	14.0	433
	88期(2021年11月11日)	13,083	15	1.5	50.0	1.3	33.1	-	-	14.2	433
第31作成期	89期(2022年1月11日)	13,020	15	△0.4	50.1	0.8	32.8	-	-	14.2	431
	90期(2022年3月11日)	12,262	15	△5.7	47.9	1.5	36.1	-	-	14.3	410
	91期(2022年5月11日)	12,591	15	2.8	44.1	1.3	38.1	-	-	11.7	418
第32作成期	92期(2022年7月11日)	12,744	15	1.3	47.1	1.4	36.7	-	-	13.2	425
	93期(2022年9月12日)	13,207	15	3.8	48.4	0.9	35.3	-	-	13.5	442
	94期(2022年11月11日)	13,015	15	△1.3	48.6	1.5	35.7	-	-	13.1	434
第33作成期	95期(2023年1月11日)	12,480	15	△4.0	47.7	2.0	36.3	-	-	12.7	409
	96期(2023年3月13日)	12,692	15	1.8	48.7	1.1	35.7	-	-	12.2	418
	97期(2023年5月11日)	13,207	15	4.2	48.8	1.3	34.0	-	-	14.3	432
第34作成期	98期(2023年7月11日)	13,862	15	5.1	50.9	1.0	32.4	-	-	14.1	439
	99期(2023年9月11日)	14,223	15	2.7	51.9	1.2	31.3	-	-	14.0	453
	100期(2023年11月13日)	14,207	15	△0.0	52.2	1.2	31.3	-	-	13.4	464

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

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

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

(注7) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 率	新 株 予 約 権 付 社 債 (転 換 社 債) 比 率	債 券 先 物 比 率	債 券 物 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		円	騰 落 率							
第98期	(期首) 2023年5月11日	13,207	—	48.8	1.3	34.0	—	—	—	14.3
	5月 末	13,464	1.9	49.6	1.4	33.6	—	—	—	14.2
	6月 末	14,124	6.9	50.9	1.2	32.2	—	—	—	13.9
	(期末) 2023年7月11日	13,877	5.1	50.9	1.0	32.4	—	—	—	14.1
第99期	(期首) 2023年7月11日	13,862	—	50.9	1.0	32.4	—	—	—	14.1
	7月 末	14,151	2.1	51.5	1.3	31.5	—	—	—	14.1
	8月 末	14,280	3.0	51.3	1.7	30.9	—	—	—	14.1
	(期末) 2023年9月11日	14,238	2.7	51.9	1.2	31.3	—	—	—	14.0
第100期	(期首) 2023年9月11日	14,223	—	51.9	1.2	31.3	—	—	—	14.0
	9月 末	14,069	△1.1	51.8	1.2	31.5	—	—	—	13.7
	10月 末	13,700	△3.7	51.1	1.4	32.0	—	—	—	13.5
	(期末) 2023年11月13日	14,222	△0.0	52.2	1.2	31.3	—	—	—	13.4

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

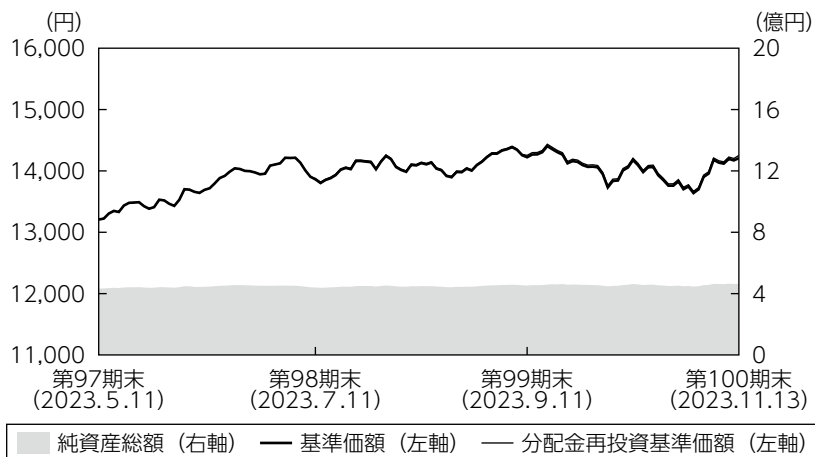
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第98期～第100期の運用経過（2023年5月12日から2023年11月13日まで）

基準価額等の推移



第98期首：13,207円
 第100期末：14,207円
 （既払分配金45円）
 騰落率：7.9%
 （分配金再投資ベース）

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注2) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注3) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

主要国の金融引き締め等を背景に外国の長期金利が上昇したこと、日銀が長短金利操作の更なる柔軟化を決めたこと等から国内の長期金利も上昇したことなどがマイナスに寄与しました。一方、主要通貨に対して円安となったこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から日米の株式市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、当作成期の基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	13.4%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.4%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△3.7%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.0%
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	△0.7%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.3%

投資環境

国内株式市場は、作成期初から2023年9月半ばまでは、円安ドル高の進行、日銀の金融緩和姿勢継続、好調な企業決算や欧米投資家による積極的な日本株買いなどを要因として大きく上昇しました。作成期末にかけては、米国の金利動向や一部政府機関の閉鎖懸念、中東情勢の緊迫化、日銀による金融政策の動向などを材料として、一進一退の展開となりました。

外国株式市場は上昇しました。米国株式市場では米物価上昇の伸び鈍化からF R B（米連邦準備理事会）による利上げ継続観測の後退や大型ハイテク企業の決算が好感され上昇しましたが、2023年9月のF O M C（米連邦公開市場委員会）において高金利長期化が示唆されたこと等を受け上げ幅をやや縮小して作成期末を迎えました。欧州株式市場ではE C B（欧州中央銀行）による利上げや域内の景気悪化懸念を受けて多くの市場が下落して作成期末を迎えました。

国内債券市場では利回りは上昇（価格は下落）しました。作成期初から2023年7月にかけて、日銀が金融政策の現状維持を決めたことや金融政策修正を巡る思惑などから、国内債券市場はもみ合いの展開となりました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどをを受けて、利回りは大きく上昇しました。

外国債券市場では、米国債およびドイツ国債の利回りはともに上昇しました。米国債は、米国の堅調な経済指標により米金融引き締め長期化観測が高まったことなどをを受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についても、インフレ抑制のためE C Bが金融引き締めを継続したことなどから利回りは上昇しました。

作成期間において国内リート市場は下落しました。米国の金融引き締め長期化や日銀による政策修正などが警戒される一方で、相対的に高い分配金利回りに着目した資金流入などが相場の支えとなり、方向感に乏しい展開となりました。2023年8月後半から9月初旬にかけては米国の追加利上げ観測後退などを背景に上昇しましたが、作成期末にかけては中東情勢の緊迫化を背景とした投資家心理の悪化などにより軟調な推移となりました。

外国リート市場（現地通貨建て）は下落しました。米国リート市場は作成期半ばにコアC P I（消費者物価指数）の伸び鈍化からF R Bの利上げ継続観測が後退したことから上昇した後、作成期後半にF O M Cで高金利長期化が示唆され下落しました。欧州リート市場は作成期前半に英中央銀行が利上げ幅を再拡大したことなどを受け英国などで下落しました。オーストラリアリート市場は同国の長期金利が米国金利に連れ高し、作成期後半に下落しました。

為替市場では主要通貨に対して円安の動きとなりました。ドル／円相場は、内外金利差の拡大や内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安ドル高基調の動きとなりました。その他主要通貨に対しても、内外金利差の拡大等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととしていますが、当作成期において変更はありませんでした。組入れる6資産の保有比率が概ね基本資産配分比率に維持されるように資産配分を行いました。なお、時価変動による基本資産配分比率からの乖離分についてはリバランスを行いませんでした。

<基本資産配分比率>

日本株式：24% 外国株式：26% 日本債券：24% 外国債券：12% 日本リート：7% 外国リート：7%

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

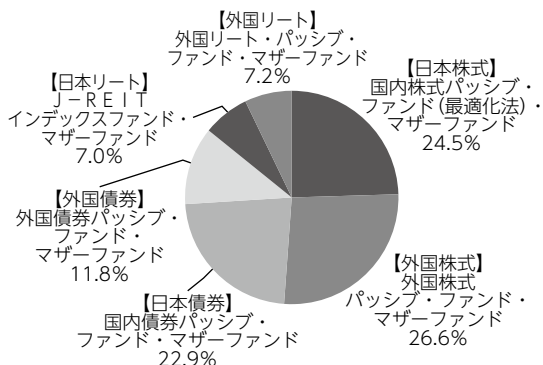
●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

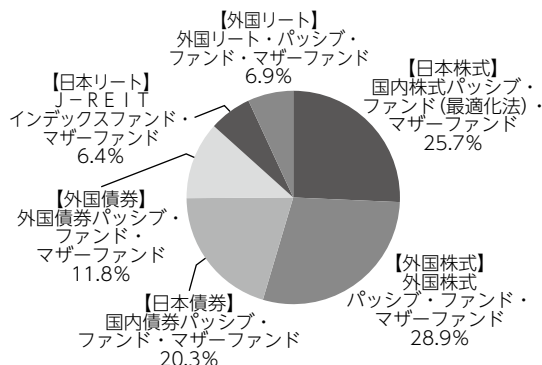
【運用状況】 2023年11月13日現在

○マザーファンド組入比率

前作成期末



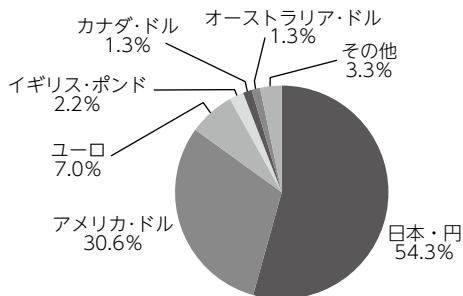
当作成期末



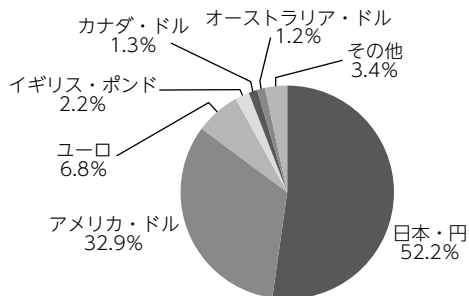
(注) 組入比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

○通貨別構成比

前作成期末



当作成期末



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

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

分配金

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

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第98期	第99期	第100期
	2023年5月12日 ～2023年7月11日	2023年7月12日 ～2023年9月11日	2023年9月12日 ～2023年11月13日
当期分配金（税引前）	15円	15円	15円
対基準価額比率	0.11%	0.11%	0.11%
当期の収益	15円	15円	15円
当期の収益以外	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	4,585円	4,943円	4,979円

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

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

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

●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

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

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

■1万口当たりの費用明細

項目	第98期～第100期		項目の概要
	(2023年5月12日 ～2023年11月13日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	39円	0.279%	(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13,962円です。
(投信会社)	(20)	(0.145)	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)	(16)	(0.112)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.004	(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)	(0.001)	
(d) その他費用	1	0.007	(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)	(0.005)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	41	0.290	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

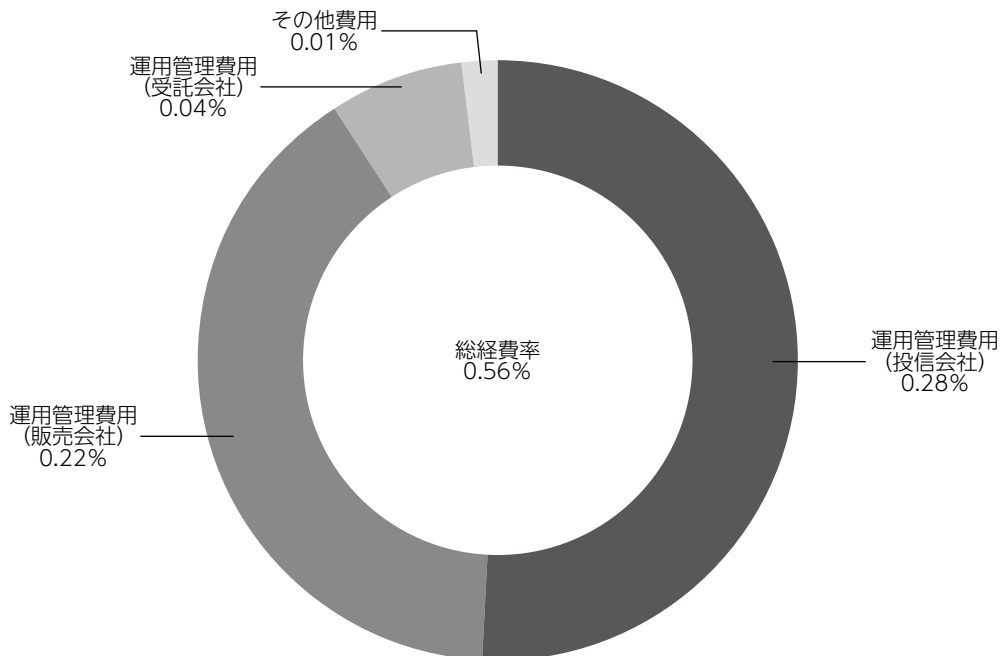
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.56%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年5月12日から2023年11月13日まで）

	第 98 期 ～ 第 100 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	588	2,405	903	3,513
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	367	2,651	541	3,790
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,658	2,047	2,653	3,372
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	503	1,100	792	1,724
J-R E I Tインデックス ファンド・マザーファンド	269	642	432	1,020
外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	397	677	580	997

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 98 期 ～ 第 100 期	
	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	外国株式パッシブ・ ファンド・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	170,411,047千円	437,552,956千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	435,245,911千円	1,032,409,466千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.39	0.42

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年5月12日から2023年11月13日まで）

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 98 期 ~ 第 100 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.037千円
(B)／(A)	0.7%

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

【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	第 98 期 ~			第 100 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 84,530	百万円 61,535	% 72.8	百万円 85,880	百万円 35,216	% 41.0

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 98 期 ~ 第 100 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 859	百万円 1,135	百万円 4,773

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 98 期 ~ 第 100 期	
	買 付 額	
株 式	百万円 111	

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	第 98 期 ~			第 100 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 251,018	百万円 25,110	% 10.0	百万円 289,612	百万円 27,829	% 9.6

平均保有割合 0.0%

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

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【J-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	第 98 期 ~			第 100 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 62,957	百万円 5,133	% 8.2	百万円 74,652	百万円 4,839	% 6.5
不動産投信指数先物取引	10,747	-	-	9,854	4,374	44.4

平均保有割合 0.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 98 期 ~ 第 100 期	
	買	付 額
投 資 証 券		百万円 3,622

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

■組入資産の明細
親投資信託残高

	第33作成期末	第34作成期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	29,168	28,853	117,452
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17,883	17,709	132,117
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	76,877	75,882	92,781
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	24,213	23,923	53,789
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	12,819	12,656	29,428
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,689	18,506	31,557

■投資信託財産の構成

2023年11月13日現在

項 目	第34作成期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	117,452	25.2
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	132,117	28.4
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	92,781	19.9
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	53,789	11.6
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	29,428	6.3
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	31,557	6.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,393	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	465,520	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11月13日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,183,027,558千円、99.9％、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは246,589,696千円、97.1％、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは81,364,332千円、99.9％です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年11月13日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.71円、1カナダ・ドル=109.86円、1オーストラリア・ドル=96.35円、1香港・ドル=19.42円、1シンガポール・ドル=111.52円、1ニュージーランド・ドル=89.31円、1イギリス・ポンド=185.45円、1イスラエル・シケル=39.261円、1スイス・フラン=168.04円、1デンマーク・クローネ=21.73円、1ノルウェー・クローネ=13.64円、1スウェーデン・クローナ=13.91円、1メキシコ・ペソ=8.594円、100韓国・ウォン=11.51円、1オフショア・人民元=20.756円、1マレーシア・リンギット=32.204円、1ポーランド・ズロチ=36.591円、1ユーロ=162.07円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年7月11日)、 (2023年9月11日)、 (2023年11月13日)現在

項 目	第 98 期 末	第 99 期 末	第 100 期 末
(A) 資 産	441,101,604円	454,231,674円	465,520,833円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,235,206	7,033,265	8,393,170
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)	109,077,407	115,171,338	117,452,962
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	121,227,244	127,003,769	132,117,083
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	93,826,330	91,740,641	92,781,570
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	50,177,692	51,442,381	53,789,759
J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)	29,275,586	29,933,367	29,428,474
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	31,282,139	31,906,913	31,557,815
(B) 負 債	1,116,008	1,227,050	925,121
未 払 収 益 分 配 金	476,106	477,760	490,530
未 払 解 約 金	228,909	329,608	—
未 払 信 託 報 酬	408,115	416,744	431,549
そ の 他 未 払 費 用	2,878	2,938	3,042
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	439,985,596	453,004,624	464,595,712
元 本	317,404,484	318,506,754	327,020,489
次 期 繰 越 損 益 金	122,581,112	134,497,870	137,575,223
(D) 受 益 権 総 口 数	317,404,484口	318,506,754口	327,020,489口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	13,862円	14,223円	14,207円

(注) 第97期末における元本額は327,802,086円、当作成期間(第98期~第100期)中における追加設定元本額は14,648,116円、同解約元本額は15,429,713円です。

■損益の状況

[自 2023年5月12日]
至 2023年7月11日] [自 2023年7月12日]
至 2023年9月11日] [自 2023年9月12日]
至 2023年11月13日]

項 目	第 98 期	第 99 期	第 100 期
(A) 配 当 等 収 益	△634円	△669円	△404円
受 取 利 息	26	17	15
支 払 利 息	△660	△686	△419
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	21,632,073	12,307,872	450,448
売 買 益	22,754,902	14,418,749	3,745,065
売 買 損	△1,122,829	△2,110,877	△3,294,617
(C) 信 託 報 酬 等	△410,993	△419,682	△434,591
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	21,220,446	11,887,521	15,453
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	103,685,671	123,844,390	134,210,628
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,848,899	△756,281	3,839,672
(配 当 等 相 当 額)	(21,114,230)	(22,205,823)	(27,460,382)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△22,963,129)	(△22,962,104)	(△23,620,710)
(G) 合 計(D+E+F)	123,057,218	134,975,630	138,065,753
(H) 収 益 分 配 金	△476,106	△477,760	△490,530
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	122,581,112	134,497,870	137,575,223
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,848,899	△756,281	3,839,672
(配 当 等 相 当 額)	(21,114,769)	(22,207,947)	(27,482,223)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△22,963,668)	(△22,964,228)	(△23,642,551)
分 配 準 備 積 立 金	124,430,011	135,254,151	135,345,497
繰 越 損 益 金	-	-	△1,609,946

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	第 98 期	第 99 期	第 100 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,309,869円	1,110,135円	1,625,399円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	17,079,646	10,777,386	0
(c) 収 益 調 整 金	21,114,769	22,207,947	27,482,223
(d) 分 配 準 備 積 立 金	106,516,602	123,844,390	134,210,628
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	146,020,886	157,939,858	163,318,250
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	4,600.47	4,958.76	4,994.13
(g) 分 配 金	476,106	477,760	490,530
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	15	15	15

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 98 期	第 99 期	第 100 期
1万口当たり分配金	15円	15円	15円

分配金の課税上の取扱いについて

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

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

- 新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。
(2023年8月11日)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第21期（決算日 2023年2月7日）

（計算期間 2022年2月8日～2023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21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(配当込み) ベンチマーク	期騰落率			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586
20期 (2022年2月7日)	31,896	2.2	3,073.66	2.2	97.4	2.5	397,336
21期 (2023年2月7日)	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9	396,982

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

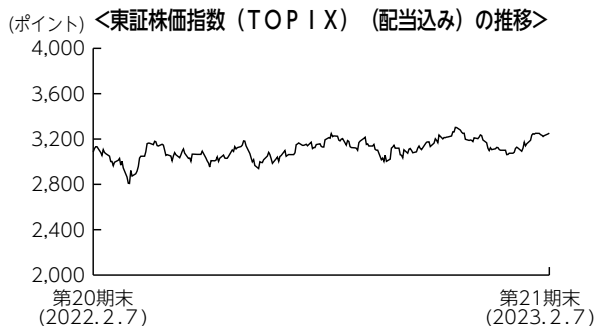
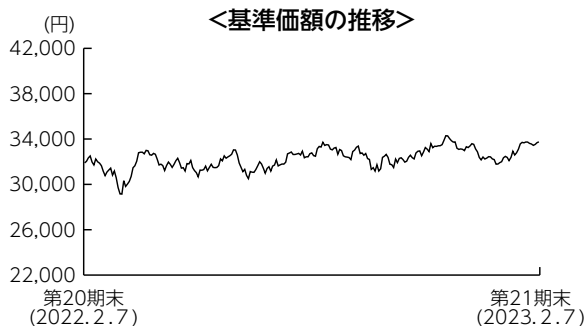
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2022年 2月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	31,896	—	3,073.66	—	97.4	2.5
2 月 末	31,265	△2.0	3,012.57	△2.0	98.0	1.3
3 月 末	32,610	2.2	3,142.06	2.2	96.9	3.1
4 月 末	31,831	△0.2	3,066.68	△0.2	96.2	3.9
5 月 末	32,079	0.6	3,090.73	0.6	96.7	3.4
6 月 末	31,424	△1.5	3,027.34	△1.5	96.7	3.3
7 月 末	32,592	2.2	3,140.07	2.2	97.1	2.9
8 月 末	32,985	3.4	3,177.98	3.4	98.0	2.0
9 月 末	31,176	△2.3	3,003.39	△2.3	96.3	3.7
10 月 末	32,765	2.7	3,156.44	2.7	97.1	2.8
11 月 末	33,730	5.7	3,249.61	5.7	97.7	2.3
12 月 末	32,189	0.9	3,101.25	0.9	96.9	3.1
2023年 1 月 末	33,613	5.4	3,238.48	5.4	97.7	2.3
(期 末) 2023年 2月7日	33,751	5.8	3,251.81	5.8	98.0	1.9

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月8日から2023年2月7日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は33,751円となり、前期末比で5.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスの感染状況、日本や米国などの金融政策、ウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、米国で金融引き締めの長期化懸念が後退したことや日銀の金融緩和継続などを受けて上昇しました。

投資環境

期初から2022年3月半ばまでは、新型コロナウイルスの感染拡大、金融引き締めへの警戒感の高まりやロシアのウクライナ侵攻を要因として、国内株式市場は下落しました。その後は、米国での金融引き締め、日銀の金融政策への思惑、インフレ動向、国内の新型コロナウイルスの感染状況やウクライナ情勢など材料が多い中、国内株式市場は一進一退の展開となりました。期末にかけては、日銀の金融緩和継続などを要因として上昇しました。

ポートフォリオについて

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

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

○組入上位10業種

期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	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



期末

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

○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	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	



期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.6%
2	ソニーグループ	日本・円	2.9
3	キーエンス	日本・円	2.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	2.0
5	日本電信電話	日本・円	1.7
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.4
7	武田薬品工業	日本・円	1.3
8	ソフトバンクグループ	日本・円	1.2
9	第一三共	日本・円	1.2
10	任天堂	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,161銘柄	

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5.8%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は32,278円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年2月8日から2023年2月7日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		152,381.9 (2,240.729)	362,922,344 (-)	156,466.829	364,983,330

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内 株 式 先 物 取 引	百 万 円	百 万 円	百 万 円	百 万 円
	116,409	119,651	-	-

(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	727,905,675千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	377,008,289千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.93

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月8日から2023年2月7日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 362,922	百万円 231,022	% 63.7	百万円 364,983	百万円 229,125	% 62.8
金 銭 信 託	1.380	1.380	100.0	1.380	1.380	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 3,015	百万円 2,776	百万円 4,163

(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 3

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4,537千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	231千円
(B) / (A)	5.1%

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

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末				
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		
		千株	千円		千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)																						
極洋	7.2	7.3	26,572				矢作建設工業	20.5	18.4	14,536	ウェルネオシユガー	7.6	7	11,501								
ニッスイ	199.7	191.5	100,729				ピーエス三菱	15.4	17.2	10,853	森永製菓	34.8	24.9	92,503								
マルハニチロ	31.4	28.4	67,734				新日本建設	31.7	26.6	10,241	中村屋	2.6	2.8	8,540								
雪国まいたけ	14.8	16.3	16,919				東亜道路工業	19.9	18.8	15,698	江崎グリコ	40.7	38.5	135,905								
カネコ種苗	4.9	5.9	9,735				日本道路	2.6	2.3	14,191	名糖産業	6.9	5.5	9,234								
サカタのタネ	24	21.8	89,162				東亜建設工業	4.6	2.7	16,578	井村屋グループ	8.6	7.2	16,070								
ホフト	17	17	31,654				日本国土開発	11.5	11.5	28,520	不二家	8.5	9.3	23,417								
ホクリヨウ	3.4	2.5	2,262				若築建設	45.5	40.2	21,868	山崎製パン	110.7	90	134,280								
							東洋建設	7.7	6	17,952	第一屋製パン	3.5	2.2	851								
鉱業 (0.3%)							五洋建設	51.7	43.4	37,931	モロゾフ	3.7	4.3	14,620								
住石ホールディングス	35.1	26.4	9,108				世紀東急工業	182.7	189.9	119,826	亀田製菓	8.6	8.6	36,636								
日鉄鉱業	4.6	7.6	25,992				福田組	22.4	17.7	13,983	寿スビリッツ	14.3	14.3	123,981								
三井松島ホールディングス	8.3	8.7	27,144				住友林業	5	5.1	23,001	カルピス	67.3	61.5	178,842								
I N P E X	800.9	707.9	989,644				日本基礎技術	118	102.7	249,522	森永乳業	27.4	24.5	114,415								
石油資源開発	23.5	22.2	92,463				バコーポレーション	12.7	7.2	3,837	六甲バター	11	9.9	13,246								
K&Oエナジーグループ	9.9	8.7	17,800				大和ハウス工業	20.7	13.5	5,535	ヤクルト本社	109.4	96.1	873,549								
							ライト工業	425.6	374.1	1,138,760	明治ホールディングス	97.6	83.4	561,282								
建設業 (1.9%)							積水ハウス	29	25.5	47,302	雪印メグミルク	35.6	32.6	57,636								
ヒノキグループ	4.5	-	-				日特建設	500	419.4	1,038,015	プリマハム	18.6	18.2	40,331								
ショーボンドホールディングス	28.5	26.1	139,896				北陸電気工事	9.8	12.9	11,868	日本ハム	56.5	52.6	192,253								
ミライト・ワン	64.4	66.5	101,146				ユアテック	9.8	9.3	6,463	林兼産業	3.8	3.7	1,731								
タマホーム	12.1	12.1	38,478				日本リーテック	26.5	29.9	22,155	丸大食品	14.8	13.5	19,642								
サンヨーホームズ	2.5	2.2	1,601				四電工	9.6	8.9	7,805	S F o o d s	13.3	14.9	43,001								
日本アーク	8.1	7.1	6,780				中電工	5.2	5.7	10,208	柿安本店	5.2	5.3	10,621								
ファーストコーポレーション	6.4	4.3	3,057				関電工	21.3	20.8	43,243	伊藤ハム株式会社ホールディングス	95.7	104.7	73,499								
ベステラ	4	3.7	3,300				きんでん	75.2	73.6	62,265	サッポロホールディングス	50.4	44.3	141,981								
Robot Home	33.3	32.7	5,460				東京エネシス	103.1	94.5	135,040	アピグループホールディングス	347.2	310.6	1,343,345								
キャンディル	3.8	2.7	1,358				トーエネック	15.5	13.3	11,903	キリンホールディングス	542.4	606.7	1,232,511								
ダイセキ環境ソリューション	3.9	3.4	3,233				住友電設	4.7	4.4	14,784	宝ホールディングス	100.4	91.8	94,921								
第一カッター興業	5.1	5.1	5,253				日本電設工業	11.5	12.8	29,964	オエノホールディングス	43	40.1	10,345								
安藤・間	99.1	110.9	93,377				エクスオグループ	25.4	22	32,956	養命酒造	5.1	4.4	8,030								
東急建設	58.5	54.6	35,271				新日本空調	69.8	61.5	140,958	ココロ ホテリアーズホールディングス	103.7	105.3	140,154								
コムシスホールディングス	64.4	64.8	156,556				九電工	12.2	7.4	14,097	サントリー食品インターナショナル	98.7	94.7	428,991								
ビアールホールディングス	27.1	30.5	10,339				三機工業	35.6	32.6	104,157	ダイドグループホールディングス	7.7	7.6	36,214								
飛鳥コンストラクショングループ	12.6	12.5	23,950				日揮ホールディングス	30.2	29.7	44,371	伊藤園	45	45.5	202,702								
東建コーポレーション	5.5	5.5	41,195				中外炉工業	141.9	132.4	220,048	キーコーヒー	14.8	15.1	31,257								
ソネット	2.3	2	1,890				ヤマト	4.7	4.4	7,700	ユニカフェ	5	4.1	3,673								
ヤマウラ	10.3	9.8	10,103				ヤマト	13.8	10.1	8,019	ジャパンフーズ	1.7	1.5	1,633								
オリエンタル白石	67.8	68.7	20,472				太平電業	10.4	8.4	28,350	日清オイリオグループ	18.7	19	60,135								
大成建設	133.2	133.2	571,428				高砂熱学工業	41.7	32.3	58,624	不二製油グループ本社	32	31.3	63,413								
大林組	460.9	478.7	463,860				三晃金属工業	1.7	1.4	5,222	かどや製油	1.1	1.2	4,266								
清水建設	431.8	402.5	283,360				朝日工業社	3.3	5.6	11,586	Jーオイルミルズ	14.2	13.7	21,166								
飛鳥建設	12.3	14.9	15,451				明星工業	29.9	23	18,009	キッコマン	106.3	89.1	592,515								
長谷工コーポレーション	137.3	138.2	203,706				大気社	22.6	16.1	55,062	味の素	325.9	329	1,349,229								
松井建設	18.4	12.6	7,421				ダイダ	10.3	8.9	19,366	ブルドックソース	6.4	5.4	10,022								
銭高組	1.7	1.5	4,072				日比谷総合設備	14.9	11.5	22,367	キュービー	77.6	72.2	159,345								
鹿島建設	337.9	296.9	450,694				フィル・カンパニー	2.8	2.4	2,712	ハウス食品グループ本社	55.3	41.3	110,931								
不動産トラ	9.8	9.3	14,322				テスホールディングス	8.5	14.4	16,300	カゴメ	56	62.7	193,429								
大末建設	5	4.3	4,940				インフロンティアホールディングス	196.5	140.2	142,162	焼津水産化学工業	1.1	5.6	5,073								
鉄建建設	10.3	9.6	17,212				東洋エンジニアリング	19.4	17.7	10,478	アリアケジャパン	5.5	11.8	52,451								
西松建設	28	22.7	75,818				レイズネクスト	22.6	19.4	24,851	ビエトロ	1.2	1.7	3,073								
三井住友建設	103.8	107.5	44,505				ニッポン	43.5	36.3	57,898	エバラ食品工業	2.5	3.3	10,362								
大豊建設	6.8	5.6	20,188				日清製粉グループ本社	167	124.3	193,783	やまみ	1.7	1.2	1,622								
佐田建設	10.2	7.7	4,150				日東富士製粉	1.6	2.2	9,515	ニチレイ	67.3	61.6	161,576								
ナカノフード建設	10.9	8.5	2,822				昭和産業	14.3	11.8	29,216	東洋水産	71	67.9	379,561								
奥村組	27.1	21.7	64,557				鳥越製粉	13.7	9.8	5,733	イトアンドホールディングス	5.7	5.8	13,415								
東鉄工業	21.5	18.5	48,451				中部飼料	16.7	18.7	19,167	大冷	2	1.7	3,226								
イチケン	3.5	2.7	4,881				フィード・ワン	20.2	19.7	13,297	ヨシムラ・フードホールディングス	7.9	8.6	7,765								
富士ピー・エス	5.9	6.1	2,751				東洋精糖	1.8	2.4	2,080	日清食品ホールディングス	57.9	47.3	530,706								
浅沼組	5.2	10.7	33,705				日本甜菜製糖	8.1	8	13,080	永谷園ホールディングス	6.9	6.7	13,527								
戸田建設	191.4	164.6	112,915				DME三井製糖ホールディングス	13.7	13.3	26,812	一正蒲鉾	6.2	5.2	3,655								
熊谷組	23.5	23.2	59,670				塩水港精糖	19.9	14.9	2,890	フジッコ	13.8	13.9	25,840								
北野建設	2.9	2.3	6,288								ロック・フィールド	16	15.1	23,435								
植木組	4.1	3.4	4,539																			

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
大成ラミック		千株	千円	ビービー・カストロール	千株	千円	中部鋼鉄	千株	千円		
クミアイ化学工業	4.6	4.3	12,409	富士石油	5.5	4.6	丸一鋼管	-	11.7	23,470	
日本農業	54.8	54.5	47,251	MORESCO	39.4	27.9	モリ工業	51.5	42.9	117,631	
アキレス	26.4	25.1	17,821	出光興産	5.1	4	大同特殊鋼	4.5	2.9	8,502	
有沢製作所	9.4	8.9	11,098	ENEOSホールディングス	163.3	152.1	日本高周波鋼業	23.8	17.7	86,199	
日東電工	21.5	22.4	31,270	コスモエネルギーホールディングス	2,210.8	2,473.4	日本冶金工業	4.2	4.2	1,365	
レック	89	99.4	840,924	ゴム製品 (0.7%)	42.6	54.1	山陽特殊製鋼	10.8	10.3	43,363	
三光合成	19.1	19.5	19,597	横浜ゴム	85	77.9	愛知製鋼	15	13.9	36,946	
さかもと	15.5	17.1	9,866	TOYO TIRE	77.5	78.6	日立金属	8.2	8.2	18,146	
藤森工業	22.9	18.1	3,620	ブリヂストン	423.6	437.2	日本金属	156.7	-	-	
前澤化成工業	13.2	10.8	34,290	住友ゴム工業	132.1	134.2	大平洋金属	3.6	2.8	2,492	
未来工業	9.5	8.8	11,968	藤倉コンポジット	11.9	8.7	新日本電工	8.9	10	19,390	
ウェアロックホールディングス	5.5	5	7,400	オカモト	11.9	8.7	栗本鐵工所	93.6	90	33,570	
J S P	5.6	3.7	2,260	フコク	8.8	7.6	虹 技	6.8	6.7	12,428	
エフピコ	8.7	9.6	15,273	ニッタ	6.6	7.2	日本鉄鋼管	2.3	1.7	1,705	
天馬	27	25.9	95,441	住友理工	15.3	13.9	三菱製鋼	1.6	1.4	1,324	
信越ポリマー	11.6	11.7	25,833	三ツ星ベルト	28.7	26.7	日亜鋼業	9.2	8.8	10,181	
東リ	26.4	25.4	33,451	バンドー化学	17.9	20	日本精練	19.5	13.3	3,511	
ニフコ	38.8	27.6	7,010	ガス・石炭 (0.7%)	24	21.8	エンビロ・ホールディングス	2.5	2	8,980	
パルカー	49.1	49.4	171,418	日東紡績	22	16.3	シンニッタン	4.8	8.7	6,177	
ユニ・チャーム	12	11.5	36,512	AGC	135.1	139.3	シンニッタン	18	13.7	3,356	
ショエイコーポレーション	283.4	285.2	1,438,834	日本板硝子	70.5	69.8	新東工業	3.8	2.7	6,679	
医薬品 (5.4%)	4	3.8	2,219	石塚硝子	2.5	1.9	非鉄金属 (0.7%)				
協和キリン	172.7	165.4	479,329	日本山村硝子	5.7	4.4	大紀アルミニウム工業所	22	20	26,440	
武田薬品工業	1,155.5	1,211.6	5,066,911	日本電気硝子	59.1	55.8	日本軽金属ホールディングス	36.7	38.1	54,292	
アステラス製薬	1,274.7	1,312.1	2,511,359	オハラ	5.9	6.5	三井金属鉱業	39.4	41	137,350	
住友ファーマ	90.9	101.5	88,000	住友大阪セメント	27.3	19.3	東邦亜鉛	8.1	8.4	17,673	
塩野義製薬	184.8	175	1,101,625	太平洋セメント	83.5	87.2	三菱マテリアル	95.9	9	201,348	
わかもと製薬	17.6	11.5	2,564	日本ヒューム	15.4	12.5	住友金属鉱山	185.8	163.4	825,170	
日本新薬	38.5	32.3	212,857	日本コンクリート工業	29.1	27.3	DOWAホールディングス	39.7	31.7	139,955	
中外製薬	460	428.6	1,468,383	三谷セキサン	6.9	5.8	古河機械金属	24.1	20.6	27,192	
科研製薬	23.1	23.4	83,772	アジアパイルホールディングス	23.3	21.8	エス・サイエンス	69	76.5	2,065	
エーザイ	176.1	166.6	1,265,660	東海カーボン	123.2	114.9	大前チタニウムテクノロジーズ	16.7	20.6	75,087	
ロート製薬	75.5	132.6	302,593	日本カーボン	7.6	7.8	東邦チタニウム	26.2	25.5	59,542	
小野薬品工業	337.6	264.2	747,025	東洋炭素	9.5	8.6	U A C J	22.2	19.7	46,610	
久光製薬	38.8	30.4	120,232	リタケカン/ニリミド	8.2	6.8	C Kサンエツ	3.2	2.6	10,881	
持田製薬	18.7	16.4	54,612	TOTO	105	90.4	古河電気工業	45.2	46.9	116,405	
参天製薬	274.1	257.6	255,281	日本硝子	159.3	162	住友電気工業	543.6	486.4	791,372	
扶桑薬品工業	5.2	4.3	8,286	日本特殊陶業	111.9	104.2	フジクラ	162	151.1	151,402	
日本ケミファ	1.2	1.2	2,053	ダントーホールディングス	9.5	8.7	昭和電線ホールディングス	12.6	15.8	29,008	
ツムラ	45.7	43.1	112,749	MARUWA	5.1	5.1	東京特殊電線	1.7	-	-	
日医工	45.6	-	-	品川リフラクトリーズ	3.5	3.8	タツタ電線	25.7	28.8	20,476	
キッセイ薬品工業	26.2	21.2	52,385	黒崎播磨	2.7	2.8	カナレ電気	2.8	2	2,620	
生化学工業	26	26.2	21,431	ヨソタイ	9.4	9.2	平河ヒューテック	8.2	8.2	10,651	
栄研化学	25.9	22.2	34,587	イソライト工業	6.6	-	リョービ	17.9	15	18,960	
日水製薬	5.9	-	-	東京薬業	19.4	11.6	アーレスティ	15.4	13.8	6,624	
鳥居薬品	8	7.3	22,995	ニッカトール	6.8	5.6	アサヒホールディングス	58.3	57.1	111,573	
J C R ファーマ	41.5	46.3	77,784	フジミンコーポレートッド	11.9	10.9	金属製品 (0.6%)				
東和薬品	21.1	21.1	42,263	クニミネ工業	4.9	3.6	稲葉製作所	8.3	8.3	11,561	
富士製薬工業	9.1	8.9	9,113	エーランドエーマテリアル	3.2	2.4	宮地エンジニアリンググループ	4.6	3.9	14,898	
ゼリア新薬工業	26.9	19	40,147	ニチアス	34.2	34.6	トーカロ	37.6	38.7	46,672	
第一三共	1,155.4	1,192.7	4,854,289	ニチハ	20.5	17.1	アルファ	4.8	4.5	4,257	
キョーリン製薬ホールディングス	29.6	29.7	49,509	鉄鋼 (0.8%)			S U M C O	223.9	268.1	537,540	
大幸薬品	22.3	24.8	9,597	日本製鉄	650.6	630.7	川田テクノロジーズ	3	3.3	11,104	
グアイト	9.4	9.6	24,268	神戸製鋼所	271.2	283.2	R S Technologies	4.7	9.4	37,553	
大塚ホールディングス	305.5	313.3	1,280,770	中山製鋼所	23.1	29	ジェイテックホールディングス	1.6	1.7	5,185	
大正製薬ホールディングス	35	30.4	160,816	合同製鐵	7.9	7	信和	9.1	6.8	5,535	
ペプチドリーム	77.1	66.4	134,592	J F Eホールディングス	392.6	376.4	東洋製鋼グループホールディングス	92.6	93.2	150,331	
あすか製薬ホールディングス	16.8	14	16,744	東京製鐵	49.6	39.6	ホッカンホールディングス	8.2	7.5	10,417	
サワグルホールディングス	32.2	31.3	122,696	共英製鋼	16.5	16.1	コロナ	8.6	7.8	7,020	
石油・石炭製品 (0.5%)				大和工業	28	23.2	横河ブリッジホールディングス	25	18.6	36,809	
日本コープス工業	123.8	123.5	10,744	東京製鐵	6.4	6.7	駒井ハルテック	2.9	2.1	3,225	
ニチレキ	18.9	16.3	22,249	大阪製鋼	7.9	6.6	高田機工	0.7	0.6	1,554	
ユシロ化学工業	7.9	7.1	5,836	淀川製鋼所	19.3	16.1	三和ホールディングス	137.1	129.6	172,886	
							文化シャッター	46.4	40.6	45,918	

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	
		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本電産	381.1	334.9	2,469,552	日本航空電子工業	33.7	28.3	64,184	K O A	22.3	20.6	38,460	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.6	9.9	4,959	T O A	16	15.7	12,183	市光工業	17.7	19.7	7,683	
ドレックス・セミコンダクター	7.5	6.5	17,927	マクセル	29.3	29.9	42,996	小糸製作所	80.7	164.2	363,703	
東光高岳	8.2	8.4	16,783	古野電気	17.4	18	16,740	ミツバ	27	25.6	13,568	
ダブル・スコープ	42.3	45.1	67,424	ユニデンホールディングス	3.3	-	-	S C R E E Nホールディングス	25.6	23.3	238,825	
ダイハチ	16.1	12.5	51,750	スマグコーポレーション	13.9	12.6	18,711	キヤノン電子	13.7	15.1	25,790	
ヤーマン	24	23.8	32,177	アイコム	5.5	5.4	13,635	キヤノン	730.5	749	2,182,586	
J V Cケンウッド	119.5	125.5	51,455	リオン	5.6	5.7	10,516	リコー	408.1	342.2	344,937	
ミマキンエンジニアリング	13.3	13.1	7,846	本多通信工業	11.9	-	-	象印マホービン	39.8	40.8	67,850	
イー P E X	6.9	7.6	8,952	横河電機	147.2	150.9	345,108	MUTOHホールディングス	1.2	1.7	2,748	
日新電機	34.7	33	56,100	新電元工業	5.6	5.3	17,940	東京エレクトロニクス	93.3	96.3	4,498,173	
大崎電気工業	26.8	32.5	17,095	アズビル	86.2	95.4	348,210	イノテック	8.7	9.1	12,212	
オムロン	122.4	126.3	954,322	東亜ディーケーケー	7.6	5.9	4,472	輸送用機器 (7.4%)				
日東工業	19.6	18.6	47,076	日本光電工業	60.9	63.1	207,599	トヨタ紡織	60	57.5	115,805	
I D E C	18.3	20.3	63,133	チノー	4.8	5.7	10,869	芦森工業	2.5	2.3	3,286	
正興電機製作所	4.6	4.6	4,650	共和電業	14.9	11.6	3,920	ユニプレス	21.9	24.5	19,159	
不二電機工業	3.4	2.5	2,720	日本電子材料	7.2	9	13,095	豊田自動織機	119.2	99.8	755,486	
ジエス・ユアサ コーポレーション	47.9	45.3	101,517	堀場製作所	27.3	30.3	184,830	モリタホールディングス	23.6	24	27,624	
サクサホールディングス	2.9	2.6	3,177	アドバンテスト	109.3	107.5	1,059,950	三機工業	20.2	20.9	13,773	
メルコホールディングス	3.3	3.7	12,265	小野測器	6.9	4.5	1,881	デンソー	323.7	281.6	2,070,886	
テクノメディカ	3.5	3.3	5,633	エスペース	12	10.9	22,345	東海理化電機製作所	38.8	38.6	56,394	
ダイヤモトエレクトロニクスホールディングス	4.1	4.5	6,187	キーエンス	133.2	136.5	8,336,055	川崎重工業	107.3	102.9	297,072	
日本電気	186.9	195	937,950	日置電機	7	7.1	51,830	名村造船所	43.7	31.2	12,261	
富士通	132.4	137.4	2,458,773	シスメックス	124.4	117.7	1,035,053	日本車輛製造	5.5	5.3	10,345	
沖電気工業	59.8	62.3	45,603	日本マイクロニクス	25.6	22.5	31,410	三菱ロジスネクスト	19.5	21.8	17,156	
岩崎通信機	6.3	5.4	4,109	メガチップス	13.8	11.2	32,872	近畿車輛	1.7	1.5	1,606	
電気興業	7.9	5.5	10,604	O B A R A GROUP	6.8	6.4	23,424	日産自動車	1,733.9	1,939.1	919,327	
サンケン電気	13.8	12.8	103,936	澤藤電機	1.8	1.4	1,601	いすゞ自動車	461.4	396.9	635,833	
ナカオ	2.2	2.1	2,375	厚田工業	7.5	5.5	4,719	トヨタ自動車	7,455.7	7,495.9	14,219,722	
アイホン	8.5	8.4	16,287	コーセル	16.3	16.4	18,220	日野自動車	183.6	175.8	98,448	
ルネサエレクトロニクス	796.7	899.7	1,274,425	イリソ電子工業	12.3	12.6	56,070	三菱自動車工業	544.1	532.6	272,158	
セイコーエプソン	182.4	183.6	343,332	オプテックスグループ	24	25.1	50,777	エフテック	10.3	8.3	4,482	
ワコム	114	109.2	72,072	千代田インテグレ	6.4	4.7	10,697	レップホールディングス	5.7	4.7	2,190	
アルバック	29.3	32.7	197,508	アイ・オー・データ機器	5.5	-	-	GMB	2.8	2.4	1,718	
アクセル	6.3	4.5	7,366	レーザータック	64.5	62.5	1,415,625	ファルテック	2.9	2.1	1,241	
E I Z O	11.5	10.1	36,562	スタンレー電気	102.8	97.1	271,006	武蔵精密工業	32.7	33.3	59,940	
ジャパンプディスプレイ	500	528.8	24,324	岩崎電機	5.4	4.4	12,742	日産車体	21.7	24.1	20,533	
日本信号	37.5	31.4	32,404	ウシオ電機	75.3	71.3	113,010	新明和工業	41.7	42.9	45,345	
京三製作所	31.6	29	11,832	岡谷電機産業	9.3	9.8	2,518	極東開発工業	27.3	24	34,536	
能美防災	19.5	18.7	32,126	ハリオス テクノ ホールディング	12.9	11.1	4,839	トビー工業	12.1	11.1	18,858	
ホーチキ	10.9	10.3	15,398	エノモト	4	3.1	5,809	ティラド	4.2	3.4	7,633	
星和電機	7.2	5.2	2,246	日本セラミック	13.8	13.9	37,349	曙ブレーキ工業	80.6	83.3	12,661	
エレコム	33.7	32.9	44,053	遠藤照明	6.9	5.4	3,963	タッチエス	25.7	21.6	26,157	
パソニック ホールディングス	1,568.1	1,628.6	1,882,661	古河電池	10.7	10.1	10,817	N O K	71.2	53	62,805	
シャープ	167.6	166	179,612	双信電機	6.4	5	1,880	フタバ産業	36.8	36.5	14,381	
アンリツ	94.6	97.1	120,306	山一電機	10.8	11.9	20,884	K Y B	15.4	13.1	47,684	
富士通ゼネラル	39.9	39.1	141,346	図研	9.5	11.9	38,020	大同メタル工業	28.5	26.6	13,273	
ソニーグループ	921.1	965.7	11,641,513	日本電子	30.8	34.2	135,261	プレス工業	73	60.8	26,691	
T D K	213	218.4	1,036,308	カシオ計算機	106.5	101.6	130,454	ミックニ	19.6	14	4,746	
帝國通信工業	6.7	6.2	9,163	ファナック	129.1	133.9	3,090,412	太平洋工業	30.8	31.3	34,868	
タムラ製作所	56.8	59.1	44,797	日本シイエムケイ	28.9	29	14,558	河西工業	17.7	16.1	2,495	
アルプスアルパイン	129.9	123.1	173,694	エンプラス	3.6	4	16,040	アイシン	107.7	105.4	382,075	
池上通信機	5	4	2,472	大真空	19.9	16.6	12,151	マツダ	461.4	451.5	480,396	
日本電波工業	13.3	16.5	23,859	ローム	65.8	63.1	663,181	今仙電機製作所	9.6	7.7	5,205	
鈴木	6.8	7.4	7,296	浜松ホトニクス	105.5	109.5	770,880	本田技研工業	1,157.5	1,109.7	3,617,622	
メイコー	12	15.1	44,016	三井ハイテック	14.6	14.1	100,815	スズキ	336.2	250.8	1,212,116	
日本トリム	2.9	3.1	9,008	新光電気工業	43.2	48.3	189,577	S U B A R U	421.2	432	932,904	
ローランド ディー・ジー	8.7	7.7	22,607	京セラ	206.9	212.1	1,380,771	安永	7.2	5.4	3,682	
フォスター電機	14.8	12.8	12,544	太陽誘電	71.3	66.5	303,240	ヤマハ発動機	191.9	214.5	709,995	
S M K	3.5	3.3	7,844	村田製作所	431.9	414	3,191,112	T B K	16.9	11.7	2,878	
ヨコオ	10.9	10.9	24,623	双葉電子工業	25.1	25.8	14,112	エクセディ	22.3	22.2	38,472	
ティアック	23.5	18.8	2,199	北陸電気工業	5.5	4.5	5,881	豊田合成	47.4	39.8	85,808	
ホシデン	35.4	33	53,460	ニチコン	46.3	27.9	37,497	愛三工業	23.1	22.6	19,119	
ヒロセ電機	22.8	22.8	382,356	日本ケミコン	14	13.5	26,392	盟和産業	1.7	1.5	1,401	

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
エイバックス	千株	千株	千円	東京エレクトロ	千株	千株	千円	丸文	千株	千株	千円
B I P R O G Y	24.9	23.2	41,156	デバイス	4.2	5.4	41,418	ハビネット	12.7	12.9	16,202
兼松エレクトロニクス	45.1	50.4	155,232	円谷フィリスホールディングス	12.6	12.4	30,938	3	12.1	12.3	25,202
都築電気	8	8.5	52,615	双日	159.9	153.3	393,214	橋本製業ホールディングス	3	5.8	6,165
TBSホールディングス	7.5	7.2	9,612	アルフレッサホールディングス	160.8	144.9	231,115	日本ライフライン	42.9	42.3	37,900
日本テレビホールディングス	87.7	70.2	104,668	横浜冷凍	41.4	39.4	41,921	タカショー	11	12.5	8,437
朝日放送グループホールディングス	120.4	121.3	124,453	神栄	2	1.8	1,519	I DOM	43.9	43.7	36,620
テレビ朝日ホールディングス	14.9	13	8,333	ラサ商事	8.2	5.8	7,215	進和	8.7	9.6	20,121
スカパーJSATホールディングス	34.7	33.3	43,523	アルコニック	15.4	19	26,125	エスケイジャパン	3.3	3.2	1,792
テレビ東京ホールディングス	122	121.3	57,738	神戸物産	112.5	111.8	418,691	ダイトロン	6.3	5.7	14,324
日本BS放送	10.6	9.8	18,708	ハイパー	2.3	2.5	1,140	シークス	20.6	20.5	29,417
ビジョン	5.3	4.4	3,977	あいホールディングス	20.6	23.1	49,919	田中商事	3.3	3.9	2,269
スマートパリュース	24.6	18.1	25,846	ディービーエックス	4.8	3.5	3,545	オーハシテックニカ	8.2	7.2	10,699
USEN-NEXT HOLDINGS	3.6	3	1,233	ダイワホールディングス	70.4	59	115,817	白銅	4.7	5.3	13,583
ワイヤレスゲート	13.8	12.3	28,228	マフニコホールディングス	34.5	35.4	121,953	ダイコー通産	1.7	1.4	1,496
コネクショ	5.5	5.5	1,380	ラクト・ジャパン	5	5.7	11,793	伊藤忠商事	1,012.8	890.1	3,610,245
日本通信	10.4	8.9	16,990	グリムス	6.6	6	15,276	丸紅	1,428.3	1,140.3	1,981,841
クロップス	119.8	126.2	27,637	バイタルエスケーホールディングス	25.2	21.1	17,576	高島	2.3	2.1	6,117
日本電信電話	2.9	2.1	2,297	八洲電機	11	11.8	12,779	長瀬産業	79.6	67.9	138,923
KDDI	1,509.2	1,754.4	6,766,720	メディアスホールディングス	8.5	9.2	6,559	蝶理	8.2	7.8	19,016
ソフトバンク	1,051.8	1,058	4,198,144	レスターホールディングス	13.8	13.8	30,898	豊田通商	145.3	126.5	712,195
光通信	2,185.1	2,199.3	3,366,028	ジュテックホールディングス	3.6	2.7	3,272	三共生興	19.6	20.7	10,577
エムティーアイ	16.6	16.1	301,392	大光	6.8	5.2	3,421	兼松	53.9	56	88,592
GMOインターネットグループ	14.2	12.5	6,337	OCHIホールディングス	3.6	2.9	3,726	ツカモトコーポレーション	1.8	1.9	2,637
ファイバーゲート	51.1	50.9	132,340	TOKAIホールディングス	70.4	71.3	61,104	三井物産	1,124.4	1,056.8	4,134,201
アドマテックインフォコムコミュニケーション	4.7	7.3	6,810	黒谷	4	3.7	2,205	日本紙パルパル商事	7.7	7.6	39,520
KADOKAWA	3.5	3.1	871	Cominix	1.8	2.4	1,824	カメイ	17.1	15.4	22,638
学研ホールディングス	78.7	72.3	181,545	三洋貿易	14.7	14.9	17,060	東都水産	0.6	0.6	3,150
ゼンリン	20.2	22.8	21,591	ビューティガレージ	2.5	2.3	8,257	OUGホールディングス	2.3	2	4,826
昭文社ホールディングス	23.4	23.3	20,154	ワイン・パートナーズ	10.9	10.5	10,510	スターゼン	10.9	11	23,111
アイネット	4.6	5.6	1,635	ミタチ産業	4	3.3	3,953	山善	60.9	38.9	40,883
松竹	11.7	10.8	2,203	明治ハウスホールディングス	46.5	51.9	127,777	椿本興業	2.3	2.1	8,652
東宝	7.6	8.4	10,810	ショッピング電機工業	4.7	5.5	6,226	住友商事	913.9	894.6	2,079,497
東映	9.5	7.8	86,112	デリカフーズホールディングス	6	5.2	2,667	内田洋行	6.3	6.4	30,176
エヌ・ティ・ティ・データ	85.2	85.7	406,218	スターティアホールディングス	3.4	2.5	2,460	三菱商事	1,085.1	903.1	4,145,229
ピー・シー・エー	4.7	3.8	64,562	コメダホールディングス	31.6	35.3	83,413	第一実業	6.7	5.1	24,709
ビジネスブレイン太田昭昭	384.2	429.6	853,185	ビーバンドットコム	2.4	1.7	895	キャノンマーケティングジャパン	35.9	33.4	101,870
DTS	8.6	7.8	9,640	アセンテック	4.9	4.7	2,641	西華産業	7.9	5.7	9,034
スワミア・エックスホールディングス	5.1	5.9	11,977	富士興産	3.8	2.9	3,436	佐藤商事	12.1	10.1	13,685
シーイーシー	27.7	29.1	90,792	協栄産業	1.7	1.1	1,900	菱洋エレフトロ	8.6	12.3	28,363
カプコン	67.1	68.8	422,432	フルサト・マルカホールディングス	14	14.3	47,118	東京産業	13.2	13.3	10,294
アイ・エス・ピー	15.4	19.2	30,163	ヤマエグループホールディングス	9.8	8.2	11,791	ユアサ商事	13.8	13	45,955
ジャストテック	136.1	136	569,160	小野建	14.3	13.4	20,167	神鋼商事	3.4	3.6	20,160
S C S K	6.8	7	8,379	南陽	2.3	2.5	5,010	トルク	6	6.6	1,379
NSW	8.6	8.4	10,315	佐島電機	9.1	8	11,360	阪和興業	28.9	25.9	107,226
アイネス	100	111.7	219,267	エコートレーディング	2.9	2.5	2,010	正栄食品工業	9.4	9.6	39,936
T K C	5.4	5.4	11,296	伯東	8.7	8.3	38,470	カナデン	12	11.7	12,905
富士ソフト	13.2	9.5	12,521	コンドーテック	11.6	11.1	11,155	菱電商事	11.6	11.6	20,648
NSD	24.4	24.6	89,175	中山福	7.6	6.6	2,204	岩谷産業	34.8	32.9	178,976
コナミグループ	15.4	15.5	114,545	ナガイレーベン	19.3	18.2	35,271	ナイス	5.1	3.5	4,669
龍井コンピュータホールディングス	46.5	48.8	112,972	三菱食品	14.2	13.4	43,885	ニチモウ	2.4	1.4	4,305
JBCホールディングス	52.4	58.6	359,218	松田産業	10.7	10.9	25,331	極東貿易	4.1	8.7	12,145
ミロク情報サービス	6.7	9.5	28,642	第一興商	27.5	27.9	109,507	アステナホールディングス	20.3	25	10,525
ソフトバンクグループ	9.8	9.9	19,899	メディカルホールディングス	156.2	149.7	257,633	三菱オプテ	35.6	39.8	53,968
卸売業 (6.0%)	12.7	12.5	22,950	S P K	6	6.4	9,702	稲畑産業	31.8	29.2	71,773
ハウスイ	865	791.6	4,961,748	秋原電気ホールディングス	5.4	5.5	13,975	G S I クレオス	6.9	8.5	13,472
高千穂交易	0.6	-	-	アズワン	21.1	21.2	128,260	明和産業	13.3	19.2	13,555
オルパルスタアホールディングス	5.9	4.5	10,696	スズデン	5.3	5.1	12,525	クワザールホールディングス	4.6	4.4	1,944
伊藤忠食品	1.7	2	3,256	尾家産業	3.2	3.1	2,920	ウキタ	31	26.5	30,713
エレマテック	3	2.7	13,351	シモジマ	9	9.9	9,969	東邦ホールディングス	46.5	35.9	73,846
J A L U X	11.7	13	22,919	ドウシシャ	13.8	15.3	27,524	サンゲツ	38.4	36.3	81,239
あらた	4.1	-	-	小津産業	2.5	2.9	4,584	ミツコグループホールディングス	21.3	18.6	21,483
トーメンデバイス	11.6	11	45,540	高速	8.8	7.5	14,392	シナホンホールディングス	5.4	4.6	16,353
	2.4	2.1	13,461	たけびし	5.6	5.6	8,954	伊藤忠エネクス	32.1	35.8	38,306
				リック	2.5	2.7	6,164	サンリオ	44.9	41	202,335

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	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		
日本取引所グループ		千株	千円		千株	千円	MIRARTHホールディングス	株	株	株	株	株	株	株	株	株	株	株	株	株	株	株	
イー・ギランティ	367.1		377.7	739,158		67.7	24,304	61	67.7	24,304	博報堂DYホールディングス	千株	千株	千円	195.6	178.9	250,638	22.9	25.8	10,139	22.9	25.8	10,139
Aサックス	21.2		21.7	49,541		5.9	4,708	7.7	5.9	4,708	ぐるなび	22.9	25.8	10,139	17.6	19.2	7,468	17.6	19.2	7,468	17.6	19.2	7,468
NECキャピタルソリューション	8.5		5.5	3,366		72.7	125,111	72.7	69.7	125,111	タカミヤ	17.6	19.2	7,468	9.4	8.7	7,221	9.4	8.7	7,221	35.1	27.8	11,425
不動産業 (1.9%)	6.2		6.7	16,890		5.4	3,055	5.4	4.5	3,055	ジャパネットレキス株式会社	9.4	8.7	7,221	3.8	5.3	10,700	3.8	5.3	10,700	3.8	5.3	10,700
大東建託	47.2		49.2	615,492		5.6	5,275	5.6	5	5,275	ファンコミュニケーションズ	35.1	27.8	11,425	3.8	5.3	10,700	3.8	5.3	10,700	5.5	4.6	1,784
いちご	161.7		154.8	44,582		787.3	810.9	787.3	810.9	810.9	ライク	3.8	5.3	10,700	3.8	5.3	10,700	3.8	5.3	10,700	5.5	4.6	1,784
日本駐車場開発	158		160.1	41,305		20	31,710	20	22.3	31,710	ビジネス・ブレークスルー	5.5	4.6	1,784	39.7	40.3	29,419	39.7	40.3	29,419	39.7	40.3	29,419
スター・マイカ・ホールディングス	8		12.2	8,161		3.4	2.4	3.4	2.4	2.4	エスピーール	6.6	7.1	15,186	6.6	7.1	15,186	6.6	7.1	15,186	6.6	7.1	15,186
SREホールディングス	3.5		6.6	22,176		20	24.505	20	22.4	24,505	WD Bホールディングス	8.7	7.4	3,122	8.7	7.4	3,122	8.7	7.4	3,122	8.7	7.4	3,122
ADワークスグループ	30		30	4,380		14.6	14.1	14.6	14.1	13,930	ティア	1.4	1.4	1,590	1.4	1.4	1,590	1.4	1.4	1,590	1.4	1.4	1,590
ヒューリック	346.1		313.4	332,517		3.5	3.1	3.5	3.1	1,798	CDG	20.9	19.3	9,939	20.9	19.3	9,939	20.9	19.3	9,939	20.9	19.3	9,939
三菱建築設計	5.9		6.5	9,626		6	4.4	6	4.4	1,020	パリュエコマース	11.2	10.5	19,057	11.2	10.5	19,057	11.2	10.5	19,057	11.2	10.5	19,057
野村不動産ホールディングス	75		84	240,072		5	3.6	5	3.6	3,380	インフォマート	153.9	145.6	61,588	153.9	145.6	61,588	153.9	145.6	61,588	153.9	145.6	61,588
東急不動産ホールディングス	29.9		28.8	14,083		10.3	10.1	10.3	10.1	5,807	J Pホールディングス	35.7	40.3	13,500	35.7	40.3	13,500	35.7	40.3	13,500	35.7	40.3	13,500
S3交通グループホールディングス	23.4		21.4	43,270		55.3	47.6	55.3	47.6	309,400	エコパックホールディングス	26	22	2,024	26	22	2,024	26	22	2,024	26	22	2,024
サムティ	23.4		20.7	12,875							CLホールディングス	3	3.9	3,159	3	3.9	3,159	3	3.9	3,159	3	3.9	3,159
ダイヤ・ライフ	18.9		20.7	12,875							プラステック・インターナショナル	52.4	59	41,300	52.4	59	41,300	52.4	59	41,300	52.4	59	41,300
コーセーホールイー	4.6		3.7	2,730		6.6	6.3	6.6	6.3	4,958	アミュージュ	7.7	7.4	13,148	7.7	7.4	13,148	7.7	7.4	13,148	7.7	7.4	13,148
地主	9.2		10.2	18,645		8.3	8.5	8.3	8.5	30,132	ドリームインキュベータ	3.9	4.3	11,128	3.9	4.3	11,128	3.9	4.3	11,128	3.9	4.3	11,128
プレナスコポーレション	18.9		17.6	28,494		43	48	43	48	10,608	クワイフ	9.6	10.7	19,837	9.6	10.7	19,837	9.6	10.7	19,837	9.6	10.7	19,837
THEGグローバル社	9.1		7	1,526		32.1	31.9	32.1	31.9	78,952	TAC	8.6	6.8	1,373	8.6	6.8	1,373	8.6	6.8	1,373	8.6	6.8	1,373
ハウスコム	1.2		2	2,192		11.5	12.7	11.5	12.7	29,387	電通グループ	144.8	137.9	564,700	144.8	137.9	564,700	144.8	137.9	564,700	144.8	137.9	564,700
JPMC	7		6.8	6,834		230.5	240.8	230.5	240.8	323,153	テイワットギヴ・ニーズ	6.7	4.2	5,590	6.7	4.2	5,590	6.7	4.2	5,590	6.7	4.2	5,590
サンセイラジック	4.6		3.7	3,045		4.2	4.1	4.2	4.1	7,125	びあ	4.9	4.7	15,251	4.9	4.7	15,251	4.9	4.7	15,251	4.9	4.7	15,251
エストラスト	1.4		1.5	870		1.2	1	1.2	1	387	イオンファンタジー	5.4	6.1	18,007	5.4	6.1	18,007	5.4	6.1	18,007	5.4	6.1	18,007
フージャースホールディングス	18.8		20.6	16,274		20.3	20.6	20.3	20.6	50,923	シーティーエス	16	15.6	12,682	16	15.6	12,682	16	15.6	12,682	16	15.6	12,682
オープンハウスグループ	46.1		49.2	237,144		6.7	5.4	6.7	5.4	8,202	ネクシイズグループ	5	3.8	2,519	5	3.8	2,519	5	3.8	2,519	5	3.8	2,519
東急不動産ホールディングス	426.9		404.1	260,240		7.5	8.2	7.5	8.2	11,029	H. U. グループホールディングス	36.7	41.1	111,997	36.7	41.1	111,997	36.7	41.1	111,997	36.7	41.1	111,997
船井グループホールディングス	121		117.8	251,149		45.7	42	45.7	42	78,372	アルプス技研	12.6	12.2	25,729	12.6	12.2	25,729	12.6	12.2	25,729	12.6	12.2	25,729
イーグランド	2.5		1.9	2,810		37.5	42	37.5	42	38,304	ザニックス	24.4	22.7	5,198	24.4	22.7	5,198	24.4	22.7	5,198	24.4	22.7	5,198
ムゲンエーステート	9.4		7.9	3,950		3.6	3.1	3.6	3.1	3,081	ダイオーズ	3.5	-	-	3.5	-	-	3.5	-	-	3.5	-	-
ピーロット	9.9		8.3	4,490		15.3	17	15.3	17	34,765	日本空調サービス	15	15.4	10,918	15	15.4	10,918	15	15.4	10,918	15	15.4	10,918
ファーストブラザーズ	3.5		2.3	1,996		2.5	3.2	2.5	3.2	5,769	オリエンタルランド	166.1	148.5	3,203,887	166.1	148.5	3,203,887	166.1	148.5	3,203,887	166.1	148.5	3,203,887
And Doホールディングス	7.2		8	6,760		31	40.3	31	40.3	25,832	ダスキン	32.6	31.3	91,208	32.6	31.3	91,208	32.6	31.3	91,208	32.6	31.3	91,208
シーアールイー	4		6.1	6,453		47.8	53.4	47.8	53.4	184,497	朝光ネットワークジャパン	16.5	18.4	11,371	16.5	18.4	11,371	16.5	18.4	11,371	16.5	18.4	11,371
プロパティエージェント	1.7		1.5	1,875		5.1	3.8	5.1	3.8	2,116	フルッコホールディングス	6.8	6.1	11,376	6.8	6.1	11,376	6.8	6.1	11,376	6.8	6.1	11,376
ケイアイスター不動産	6.6		6.5	31,395		140.5	157.1	140.5	157.1	446,321	秀英予備校	3.6	3.1	1,354	3.6	3.1	1,354	3.6	3.1	1,354	3.6	3.1	1,354
アグレ都市デザイン	2.5		2.2	3,561		8.1	7.1	8.1	7.1	5,033	田谷	1.8	1.7	902	1.8	1.7	902	1.8	1.7	902	1.8	1.7	902
グッドコムアセット	6.4		12.5	10,062		44.1	38.4	44.1	38.4	8,332	ラウンドワン	39.2	117.3	56,538	39.2	117.3	56,538	39.2	117.3	56,538	39.2	117.3	56,538
ジェイ・エス・ピー	3		3.3	13,200		6.2	5.2	6.2	5.2	1,721	リゾートトラスト	64.4	55.4	128,417	64.4	55.4	128,417	64.4	55.4	128,417	64.4	55.4	128,417
ロードスターキャピタル	-		5.8	9,355		6.7	6.2	6.7	6.2	3,881	ピー・エム・エル	18.2	17.4	54,375	18.2	17.4	54,375	18.2	17.4	54,375	18.2	17.4	54,375
テンポインバージョン	4.1		3.7	4,380		5.6	6.4	5.6	6.4	8,857	りらいほコミュニケーションズ	21.3	23.2	33,732	21.3	23.2	33,732	21.3	23.2	33,732	21.3	23.2	33,732
グローバル・リンク・マネジメント	2.7		2.3	2,697		8	7.7	8	7.7	13,282	リソー教育	64.3	63.8	22,138	64.3	63.8	22,138	64.3	63.8	22,138	64.3	63.8	22,138
フェイスネットワーク	1.4		1.7	2,747		3.3	2.7	3.3	2.7	1,992	早稲田アカデミー	8	7.8	9,492	8	7.8	9,492	8	7.8	9,492	8	7.8	9,492
パーク24	77.8		104.7	225,733		2.9	2.6	2.9	2.6	5,686	ユー・エス・エス	15.3	144.3	313,131	15.3	144.3	313,131	15.3	144.3	313,131	15.3	144.3	313,131
パラカ	4		4.7	9,150		55.9	52.1	55.9	52.1	183,652	東京個別指導学院	17.3	16.7	9,034	17.3	16.7	9,034	17.3	16.7	9,034	17.3	16.7	9,034
宮越ホールディングス	5.5		6.2	5,542		103.1	104.7	103.1	104.7	224,162	サイバーエージェント	346.2	335.7	420,967	346.2	335.7	420,967	346.2	335.7	420,967	346.2	335.7	420,967
三井不動産	660.9		584.3	1,425,399		5	5.1	5	5.1	12,321	楽天グループ	721.4	649.5	437,763	721.4	649.5	437,763	721.4	649.5	437,763	721.4	649.5	437,763
三菱地所	952.8		811.2	1,364,438		9.1	9.1	9.1	9.1	7,462	クリク・アント・リバー社	7.5	8.3	18,907	7.5	8.3	18,907	7.5	8.3	18,907	7.5	8.3	18,907
平和不動産	24.9		21.8	76,845		2.5	2.2	2.5	2.2	1,216	モーニングスター	24.7	23	10,879	24.7	23	10,879	24.7	23	10,879	24.7	23	10,879
東京建物	143.1		128.1	203,038		9.8	9.8	9.8	9.8	9,045	テー・オー・ダリユー	24.8	27.2	7,996	24.8	27.2	7,996	24.8	27.2	7,996	24.8	27.2	7,996
京阪神ビルディング	22.6		16.9	20,989		24.7	24.6	24.7	24.6	98,154	山田コンサルティンググループ	7.5	7.1	8,228	7.5								

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額		株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
Gunosy		千株	千円		千株	千円	船場		千株	千円		千株	千円	燐ホールディングス		千株	千円		千株	千円
デザインワン・ジャパン	8.8	11.1	7,070		11.1	7,070	ジェロエシペーター・ビジネス・ホールディングス	1.7	1.5	1,051		1.5	1,051	スバル興業	6.3	6	11,550		6	11,550
イー・ガーディアン	3.6	3.7	706		3.7	706		44.5	50	90,600		50	90,600	東京テアトル	0.7	0.6	5,382		0.6	5,382
リブセンス	5.6	5.3	13,085		5.3	13,085	フルテック	2.2	1.7	1,849		1.7	1,849	タナバコンサルティンググループ	5.4	4.6	5,170		4.6	5,170
ジャパンマテリアル	8.7	5.8	1,954		5.8	1,954	グリーンズ	5.3	4.2	5,006		4.2	5,006	ナガワ	4.8	5	3,355		5	3,355
ベクトル	43.2	42.9	101,415		42.9	101,415	ツナググループ・ホールディングス	3.4	3.5	1,834		3.5	1,834	東京都競馬	10.7	11.8	45,607		11.8	45,607
ウチヤマホールディングス	19.7	22	27,346		22	27,346	GAMEWITH	4.3	3.7	1,232		3.7	1,232	常磐興産	5.4	4.3	5,293		4.3	5,293
チャーム・コア・コーポレーション	7.4	5.6	1,495		5.6	1,495	ソウルドアウト	3.5	-	-		-	-	カナモト	24.8	25.7	56,437		25.7	56,437
キャリアリンク	10.6	11.7	13,197		11.7	13,197	MS&Consulting	2.4	1.4	838		1.4	838	西尾レントオール	12.9	13	38,844		13	38,844
IBJ	5.1	5.2	13,639		5.2	13,639	ウェルビー	9.1	10.3	6,550		10.3	6,550	アゴラ ホスピタリティグループ	75.2	70.2	1,544		70.2	1,544
アサンテ	6.4	7	11,585		7	11,585	エル・ディー・エス	1.8	1.9	5,441		1.9	5,441	トランス・コスモス	17.9	17.4	57,594		17.4	57,594
バリューHR	5.6	12.3	20,688		12.3	20,688	日総工産	11	10.5	6,478		10.5	6,478	乃村工藝社	60.2	61.2	56,059		61.2	56,059
M&Aキャピタルパートナーズ	11.6	13	50,570		13	50,570	キュービネットホールディングス	6.6	6.6	9,840		6.6	9,840	藤田観光	6.2	6.2	20,925		6.2	20,925
ライドオンエクスプレスホールディングス	5.4	5.1	5,477		5.1	5,477	RPAホールディングス	19.7	19	6,213		19	6,213	KNT-CTホールディングス	8.7	8.4	14,338		8.4	14,338
ERIホールディングス	4	3.2	4,457		3.2	4,457	スプリックス	4	4.3	3,792		4.3	3,792	日本管財	15.1	14.8	37,000		14.8	37,000
アビスト	2.2	2	5,992		2	5,992	マネジメントソリューションズ	6.9	7.7	27,373		7.7	27,373	トーカイ	12.5	12.5	23,812		12.5	23,812
ジグマックス・ホールディングス	8.6	21.3	24,047		21.3	24,047	プロレド・パートナーズ	3	3.3	1,709		3.3	1,709	白洋舎	1.7	1.1	1,900		1.1	1,900
ウィルグループ	10.4	11.7	14,098		11.7	14,098	and factory	3.3	3.6	1,299		3.6	1,299	セコム	138.5	142.9	1,088,183		142.9	1,088,183
エスコロ・エージェンツ・ジャパン	18.9	13.5	2,038		13.5	2,038	テノ・ホールディングス	2	1.5	1,408		1.5	1,408	セントラル警備保障	6.8	7.5	19,110		7.5	19,110
メドピア	10.9	11	16,929		11	16,929	フロンティア・マネジメント	3.6	4.7	6,913		4.7	6,913	丹青社	28.7	27	19,089		27	19,089
レアジョブ	2.8	2.4	2,220		2.4	2,220	ピアラ	2.3	2	1,112		2	1,112	メイテック	17	55.9	136,507		55.9	136,507
リクルートホールディングス	1,083.7	1,039	4,509,260		1,039	4,509,260	コプロ・ホールディングス	2.9	2.1	2,520		2.1	2,520	応用地質	16	13.1	25,715		13.1	25,715
エラン	19.4	18.6	18,451		18.6	18,451	ギークス	2.6	1.8	1,760		1.8	1,760	船井総研ホールディングス	28.8	29.5	79,709		29.5	79,709
土木管理総合試験所	6.9	5.3	1,611		5.3	1,611	カーパスホールディングス	38.7	43.1	34,480		43.1	34,480	進学会ホールディングス	5.1	4.2	1,251		4.2	1,251
ネットマーケティング	6.9	-	-		-	-	フォーラムエンジニアリング	9.9	8.3	7,403		8.3	7,403	オオバ	10.2	7.9	5,609		7.9	5,609
日本郵政	1,834.3	1,839.2	2,094,848		1,839.2	2,094,848	FAST FITNESS JAPAN	2	4.7	5,654		4.7	5,654	いであ	3.9	2.8	4,396		2.8	4,396
ベルシスチーム24ホールディングス	20.1	18.8	28,294		18.8	28,294	ダイレクトマーケティングミックス	15.2	16.8	27,367		16.8	27,367	学究社	4.7	5.6	10,746		5.6	10,746
鎌倉新書	16	15.9	17,108		15.9	17,108	ポピンズ	3.4	2.1	4,321		2.1	4,321	ベネッセホールディングス	46.8	52.3	100,939		52.3	100,939
S MN	3.4	3.2	1,484		3.2	1,484	L I T A L I C O	11.5	10.9	29,299		10.9	29,299	イオンディライト	17.3	15.5	46,329		15.5	46,329
一蔵	2.3	1.5	693		1.5	693	アドバンテッジリス・マネジメント	7.2	5.7	2,650		5.7	2,650	ナック	7.4	6.5	6,253		6.5	6,253
グローバルキッズCOMPANY	2.7	1.9	1,520		1.9	1,520	リロググループ	76.9	78.1	167,212		78.1	167,212	ダイセキ	26	28.7	122,118		28.7	122,118
エアトリ	9	9.1	23,423		9.1	23,423	東祥	10.6	9.8	11,485		9.8	11,485	ステップ	5.3	5.8	10,300		5.8	10,300
アトラエ	9.8	11	14,190		11	14,190	ビーウィズ	-	2.7	3,958		2.7	3,958							
ストライク	5.3	6.9	27,841		6.9	27,841	TREホールディングス	19.4	29.5	41,860		29.5	41,860							
ソラスト	34.5	38.7	26,122		38.7	26,122	人・夢・技術グループ	5.6	6.3	8,782		6.3	8,782							
セラク	4.6	5	7,690		5	7,690	大栄環境	-	26.7	43,627		26.7	43,627							
インソース	13.7	34.8	50,251		34.8	50,251	エイチ・アイ・エス	31.3	36.7	75,785		36.7	75,785							
ベイカレント・コンサルティング	9.9	111	609,390		111	609,390	ラックランド	4.1	4.4	12,817		4.4	12,817							
Orchestra Holdings	2.8	3	5,925		3	5,925	共立メンテナンス	25	24	136,320		24	136,320							
アイモバイル	4	7.3	9,373		7.3	9,373	イチネンホールディングス	14.6	15	19,185		15	19,185							
キャリアインデックス	4.8	4.2	1,360		4.2	1,360	建設技術研究所	8.5	7.2	23,724		7.2	23,724							
MS - Japan	5.7	4.1	4,382		4.1	4,382	スペース	10.4	10	9,340		10	9,340							

	株数・金額	株数	金額
合計	1,161,644	159,799.8	389,230,950
銘柄数<比率>	2,174銘柄	2,161銘柄	<98.0%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 7,621		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年2月7日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 389,230,950		% 98.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,041,935		2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	397,272,885		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	397,272,885,824円
一 般 株 式	7,105,053,675
株 式 (評 価 額)	389,230,950,760
未 収 入 金	279,324,650
未 収 入 金	620,986,739
未 収 入 金	36,570,000
(B) 負 債	289,963,000
未 払 金	289,963,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	396,982,922,824
元 本	117,622,712,134
次 期 繰 越 損 益	279,360,210,690
(D) 受 取 金 総 額 (C / D)	117,622,712,134円
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	33,751円

(注1) 期首元本額	124,570,625,521円
追加設定元本額	128,363,975,255円
一部解約元本額	135,311,888,642円
(注2) 期末における元本の内訳	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOP1Xオープン	2,645,423,721円
MHAM日本株式インデックスファンド (ファンドラップ)	4,020,227,881円
One DC 国内株式インデックスファンド	24,845,344,460円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	4,943,887,105円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,060,345円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	14,320,221円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	40,143,190円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,541,745円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	24,853,218円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,002,416円
たわらノーロード TOP1X	1,674,620,773円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,460,942,246円
たわらノーロード バランス (堅実型)	52,176,853円
たわらノーロード バランス (標準型)	349,503,344円
たわらノーロード バランス (積極型)	550,702,894円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	2,858,868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)	171,426,417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)	431,690,813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)	329,347,990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)	441,937,258円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	413,659円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,761,301円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	32,921,123円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,228,726円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,768,526円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,601,320,487円
Oneグローバルバランス	9,945,679円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,069,194,980円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,604,894,445円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,977,108,233円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	337,230,087円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,073,452,202円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,128,991,784円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド エコリユージョン	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	305,935,932円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	356,000,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	576,024,312円
投資のソムリエ	6,962,375,127円
フルズコンロール	371,076,985円
投資のソムリエ<DC年金>	512,324,687円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	369,360,628円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	886,808,363円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	690,449,672円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,925,993,896円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	57,858,403円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	29,095,833円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,863,216円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	100,473,451円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	494,603,718円
リスクコンロール世界分散投資	556,231,620円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	276,065,472円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,963,704円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	31,180,825円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	19,176,919円
4資産分散投資・ドルクラス<DC年金>	373,583,154円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	4,139,504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]	70,190,490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]	71,566,262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]	23,234,424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]	43,811,639円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 [適格機関投資家限定]	69,167,191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]	173,752,833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	194,219,300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]	62,459,767円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型) 22-05	198,034,533円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産投) 22-10	500,445,393円
投資のソムリエ 私募 [適格機関投資家限定]	188,318,998円
AMOneマルチアセット・インカム戦略 [適格機関投資家限定]	27,824,141円
DIAMグローバル・バランス25VA [適格機関投資家限定]	29,351,203円
日本経済発展戦略ファンド(インカム重視) (毎月リターン) [適格機関投資家限定]	230,704,117円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (毎月リターン) [適格機関投資家限定]	119,336,352円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF) [適格機関投資家専用]	3,665,294円
しあわせの一步 私募 [適格機関投資家限定]	7,940,239円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	45,113,121円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	88,905,582円
DIAM国際分散バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	3,022,472円
DIAM国際分散バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	18,327,200円
DIAM国内重視バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	4,076,223円
DIAM国内重視バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	90,458円
DIAM世界バランスファンド40VA [適格機関投資家限定]	5,854,508円
DIAM世界バランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	26,240,499円
DIAMバランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	416,572,017円
DIAMバランスファンド37.5VA [適格機関投資家限定]	515,249,605円
DIAMバランスファンド50VA [適格機関投資家限定]	1,525,175,305円
DIAMグローバル・セット・バランスVA [適格機関投資家限定]	15,914,184円
DIAMグローバル・セット・バランスVA2 [適格機関投資家限定]	21,162,392円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA [適格機関投資家限定]	223,693,267円
DIAM世界アセットバランスファンドVA [適格機関投資家限定]	49,325,464円
DIAM世界バランスファンド55VA [適格機関投資家限定]	65,368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]	274,002,585円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA [適格機関投資家限定]	16,040,531円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA [適格機関投資家限定]	53,951,794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]	122,912,087円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA [適格機関投資家限定]	171,605,339円
DIAM世界バランス25VA [適格機関投資家限定]	31,023,888円
DIAM国内バランス30VA [適格機関投資家限定]	15,258,914円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	743,503,325円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	1,220,307,862円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(130) [適格機関投資家限定]	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
MHAMトピックスファンド	770,553,770円
MHAM TOP1XファンドVA [適格機関投資家専用]	50,331,323円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,300,674,671円
MHAM日本株式バッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,491,222,882円
期末元本合計	117,622,712,134円

(注3)

担保資産
代用として担保を提供している資産はありません。

■損益の状況

当期 自2022年2月8日 至2023年2月7日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	10,038,422,831円	
	受取配当金	10,036,451,031	
	受取利息	198,966	
	その他の収益	5,808,781	
	支払利息	△4,035,947	
(B)	有価証券売買損益	4,151,090,178	
	売却益	35,089,806,650	
	売却損	△30,938,716,472	
(C)	先物取引等取引損益	827,282,850	
	取引益	2,648,479,200	
	取引損	△1,821,196,350	
(D)	その他費用	△4	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	15,016,795,855	
(F)	前期繰越損益金	272,765,989,933	
(G)	解約差損益金	△292,592,755,843	
(H)	追加信託差損益金	284,170,180,745	
(I)	合計(E+F+G+H)	279,360,210,690	
	次期繰越損益金(I)	279,360,210,690	

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

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

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

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

■東京証券取引所の市場区分の再編に伴い、主要投資対象を「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更しました。

(2022年4月4日)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2023年2月15日）

（計算期間 2022年2月16日～2023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21期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年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	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			
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	ポイント 1,111,144.35	% 3.8	% 95.3	% 2.0	百万円 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
21期(2023年2月15日)	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4	856,221

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

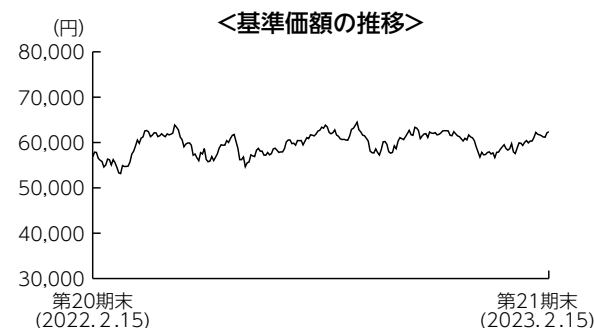
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2022年 2月 15日	56,820	% -	1,849,569.21	% -	% 93.1	% 1.8
2 月 末	56,351	△0.8	1,836,612.20	△0.7	95.5	2.0
3 月 末	62,337	9.7	2,031,374.00	9.8	95.6	2.1
4 月 末	59,665	5.0	1,943,470.47	5.1	95.3	2.2
5 月 末	59,498	4.7	1,941,169.72	5.0	94.5	3.1
6 月 末	58,103	2.3	1,895,744.26	2.5	95.7	1.9
7 月 末	60,392	6.3	1,967,771.49	6.4	95.2	2.3
8 月 末	60,806	7.0	1,982,292.26	7.2	94.6	3.1
9 月 末	57,818	1.8	1,883,547.10	1.8	95.3	2.5
10 月 末	63,361	11.5	2,066,941.46	11.8	95.8	1.8
11 月 末	61,492	8.2	2,007,747.19	8.6	95.4	2.4
12 月 末	57,722	1.6	1,884,347.09	1.9	95.2	2.6
2023年 1 月 末	59,911	5.4	1,957,032.55	5.8	95.5	2.2
(期 末) 2023年 2月 15日	62,397	9.8	2,036,206.59	10.1	95.5	2.4

(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（2022年2月16日から2023年2月15日まで）

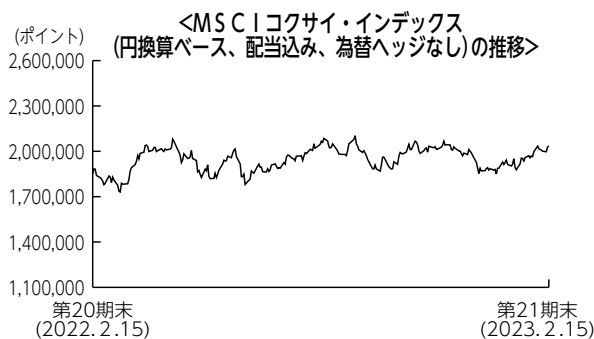


基準価額の推移

当期末の基準価額は62,397円となり、前期末比で9.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

インフレ高進に伴う大幅利上げと景気減速観測が嫌気され、米国やドイツなどの市場は下落しましたが、為替市場で円安が進んだことから当ファンドの基準価額は上昇しました。



投資環境

先進国株式市場は上昇、下落が混在する結果となりました。米国株式市場ではF R B（米連邦準備理事会）の大幅利上げに伴う景気減速懸念から下落基調となりました。2022年10月後半以降は利上げペースの緩和観測が広がり、持ち直しの動きとなりました。欧州株式市場ではロシアのウクライナ侵攻に伴うインフレ高進やE C B（欧州中央銀行）の利上げが嫌気され下落しましたが、中国のゼロコロナ政策緩和に伴う景気回復期待や欧州の景況感改善などが好感され反発しました。

為替市場では、円／米ドルレートは高騰する物価抑制のため金融引き締めを急ぐ米国と、金融緩和を維持する日本との政策の違いを背景に大幅に円安米ドル高が進みました。2022年10月後半以降は米国の物価上昇に鈍化傾向が見られたことから利上げペースの緩和観測が広がり、円高米ドル安方向に反転し円の下落幅を縮小しました。ユーロに対してはE C Bの利上げ継続が意識され円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

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

【運用状況】

○組入株式上位10業種

期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.8%
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

期末

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



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.1%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) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	2円 (1) (1) (0) (0)	0.003% (0.002) (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)	8 (8) (0) (0)	0.014 (0.014) (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)	13 (8) (5)	0.022 (0.014) (0.008)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	23	0.038	
期中の平均基準価額は59,696円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年2月16日から2023年2月15日まで)

(1) 株 式

		買		付		売		付	
		株 数	金 額	株 数	金 額	株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア	146,429.57 (28,880.34)	千アメリカ・ドル 1,573,779 (△280)	60,698.13	千アメリカ・ドル 623,093				
	メ	18,266.39 (2,003.25)	千カナダ・ドル 110,136 (-)	7,515.52	千カナダ・ドル 44,724				
	リ	37,539.52 (3,447.3)	千オーストラリア・ドル 83,816 (-)	20,631.98	千オーストラリア・ドル 32,045				
	カ	27,339.16 (-)	千香港・ドル 124,405 (-)	12,266	千香港・ドル 43,805				
	ナ	8,498.47 (-)	千シンガポール・ドル 8,393 (△7)	2,903	千シンガポール・ドル 2,867				
	ダ	1,951.75 (-)	千ニュージーランド・ドル 1,645 (-)	2,042.47	千ニュージーランド・ドル 1,342				
	グ	106,567.17 (3,741.03)	千イギリス・ポンド 76,417 (△770)	43,039.63	千イギリス・ポンド 39,087				
	ラ	4,723.42 (-)	千イスラエル・シケル 10,753 (-)	6.29	千イスラエル・シケル 430				

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ス イ ス	百株 9,648.21 (3,532.6)	千スイス・フラン 66,022 (△346)	百株 7,123.42	千スイス・フラン 27,291	
	デ ン マ ー ク	百株 2,131.07 (-)	千デンマーク・クローネ 118,134 (-)	百株 1,147.15	千デンマーク・クローネ 51,075	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 3,186.11 (-)	千ノルウェー・クローネ 58,164 (-)	百株 1,253.7	千ノルウェー・クローネ 18,394	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 17,412.61 (7,219.23)	千スウェーデン・クローナ 255,477 (-)	百株 11,724.99	千スウェーデン・クローナ 119,230	
	ユ ー ロ 圏	ア イ ル ラ ン ド	百株 3,308.28 (-)	千ユーロ 4,643 (-)	百株 140.45	千ユーロ 978
		オ ラ ン ダ	百株 8,803.64 (-)	千ユーロ 36,103 (△30)	百株 2,759.53	千ユーロ 14,396
		ベ ル ギ ー	百株 842.99 (29.18)	千ユーロ 5,404 (-)	百株 495.99	千ユーロ 1,930
		ル ク セ ン ブ ル グ	百株 285.39 (-)	千ユーロ 674 (-)	百株 320.77	千ユーロ 345
		フ ラ ン ス	百株 11,204.29 (1,127.33)	千ユーロ 63,276 (△54)	百株 5,503.82	千ユーロ 25,024
		ド イ ツ	百株 10,320.16 (-)	千ユーロ 50,341 (△418)	百株 4,164.74	千ユーロ 19,120
		ポ ル ト ガ ル	百株 719.53 (-)	千ユーロ 488 (-)	百株 -	千ユーロ -
		ス ペ イ ン	百株 18,213.25 (20,934.83)	千ユーロ 15,005 (△3)	百株 28,200.45	千ユーロ 6,356
		イ タ リ ア	百株 18,552.14 (-)	千ユーロ 10,406 (△5)	百株 8,292.23	千ユーロ 5,518
国	フ ィ ン ラ ン ド	百株 4,213.92 (-)	千ユーロ 6,141 (-)	百株 1,545.28	千ユーロ 2,284	
	オ ー ス ト リ ア	百株 322.73 (-)	千ユーロ 1,108 (-)	百株 363.32	千ユーロ 825	

(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) 投資信託受益証券、投資証券

	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
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8.155	1,306	3.108	468
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	6.545	538	2.815	209
	(-)	(-)	(-)	(-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	45.188	495	-	-
	(△136.345)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	37.979	4,878	15.018	1,932
	(20.182)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.166	1,077	1.59	318
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	9.282	1,317	6.451	918
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	4.367	2,935	1.67	1,084
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	13.615	715	6.431	318
	(△42.49)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INC	18.68	3,038	6.544	1,097
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3.231	895	1.018	291
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	19.763	1,425	8.106	565
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36.911	1,054	17.886	467
	(-)	(-)	(-)	(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.09	1,283	1.057	341
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	28.536	2,232	10.336	836
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	105.12	2,406	25.129	529
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	6.074	314	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.332	611	4.419	349
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	16.161	274	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	3.977	659	2.098	323
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	38.458	2,557	15.04	960
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	4.646	286	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	17.665	844	4.438	211
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.86	1,424	2.837	335
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	5.927	1,962	1.886	654
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	9.555	1,493	5.927	932
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	12.719	576	5.035	208
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
VORNADO REALTY TRUST	12.068	310	27.191	687
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	24.493	908	6.784	266
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.935	1,055	3.677	682
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	10.392	1,294	1.494	199
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	31.645	592	13.398	288
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	47.312	585	91.632	1,120
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	22.373	5,285	8.587	1,995
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	12.013	968	7.795	603
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42.371	1,237	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	42.177	1,528	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	21.439	759	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30.095	1,452	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	79.168	2,383	16.448	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	0.502	25	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.957	24	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	18.677	48	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GPT GROUP	11.931	59	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	15.847	66	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	62.787	503	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	90.284	1,752	33.867	600
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	173.934	349	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	280.096	821	112.275	305
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	93.116	5,933	30.3	1,996
	(-)	(-)	(-)	(-)
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	242.054	484	-	-
	(-)	(△1)	(-)	(-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	304.272	876	112.2	312
	(-)	(△16)	(-)	(-)

	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
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	487.1	838	497.5	896
	(-)	(△15)	(-)	(-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	-	-	6.265	7
	(6.265)	(7)	(-)	(-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	213.2	366	-	-
	(-)	(△2)	(-)	(-)
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	79.077	413	35.736	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	3.064	23	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	44.721	425	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW	27.206	846	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	0.282	30	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	8.18	172	-	-
	(-)	(△30)	(-)	(-)
COVIVIO	0.403	28	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	0.615	39	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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。

(3) 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 223,972	百万円 217,712	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	399,100,709千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	716,444,920千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.55

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2022年2月16日から2023年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引状況

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

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

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	444.06	11,415.95	113,817	15,113,762	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,727.2	2,180.54	23,388	3,105,755	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	654.52	795.05	2,090	277,555	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	42.71	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	873.09	1,124.58	15,295	2,031,077	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,223.07	2,016.32	17,330	2,301,286	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	464.19	584.05	22,071	2,930,841	ソフトウェア
CHUBB LTD	429.3	521.17	11,117	1,476,305	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	216.51	277.73	7,817	1,038,128	化学
ALLEGHANY CORP	12.56	—	—	—	保険
ALLSTATE CORP	305.8	329.39	4,448	590,660	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	674.78	837.7	16,837	2,235,887	コンプロマリット
AMGEN INC	552.91	666.76	16,070	2,134,056	バイオテクノロジー
HESS CORP	269.32	352.71	5,219	693,131	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	655.69	795.36	14,397	1,911,858	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	484.16	626.53	5,668	752,765	電力
AFLAC INC	624.14	726.73	5,029	667,893	保険
AMERICAN INTL GROUP	830.45	938.43	5,773	766,626	保険
AMERCO	9.29	—	—	—	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	518.67	633.36	11,561	1,535,232	半導体・半導体製造装置
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	696.42	864.52	5,635	748,378	建設関連製品
VALERO ENERGY CORP	422.88	484.9	6,773	899,462	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	83.94	108.31	2,970	394,482	ソフトウェア
APPLE INC	16,106.99	20,001.34	306,420	40,689,582	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	881.06	1,068.03	12,649	1,679,759	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	111.8	139.61	3,779	501,845	化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	544.75	694.12	5,676	753,784	食品
AMEREN CORP	254.36	316.21	2,694	357,750	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	62.95	99.36	1,253	166,468	電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	214.23	269.07	6,135	814,782	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	413.9	518.47	11,644	1,546,248	情報技術サービス
AUTOZONE INC	20.86	24.51	6,240	828,730	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	80.95	95.14	1,752	232,762	容器・包装
BALL CORP	315.98	402.23	2,289	304,075	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,292.71	1,619.51	50,332	6,683,686	各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	794.62	969.68	5,014	665,837	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	484.18	631.74	2,521	334,800	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	280.24	350.61	8,534	1,133,256	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	226.36	289.58	4,180	555,150	電気設備
VERIZON COMM INC	4,048.08	5,240.12	21,133	2,806,304	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	128.04	291.91	1,957	259,942	保険
BEST BUY CO INC	212.38	254.05	2,243	297,916	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	23.24	30.21	1,397	185,543	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	286.66	353.37	4,623	613,906	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	518.27	672.13	2,699	358,525	電力
BOEING CO	542.08	702.82	15,353	2,038,738	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	112.38	144.56	1,209	160,613	専門サービス
BORGWARNER INC	209.23	278	1,381	183,433	自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,387.96	1,753.52	8,290	1,100,914		ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	123.82	144.94	1,521	202,031		航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	107.92	195.29	2,189	290,678		娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	22.29	27.31	4,220	560,471		ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,157.51	2,659.49	19,214	2,551,535		医薬品
ONEOK INC	420.2	569.8	3,975	527,905		石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	74.44	97.09	1,276	169,524		保険
UNITED RENTALS INC	69.35	88.83	4,056	538,628		商社・流通業
SEMPRA ENERGY	310.48	385.67	6,049	803,277		総合公益事業
FEDEX CORP	247.48	309.91	6,590	875,199		航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	103.4	118.5	2,533	336,458		情報技術サービス
AMPHENOL CORP	581.23	743.44	6,001	796,977		電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	297.33	384.05	2,508	333,067		飲料
QUANTA SERVICES INC	-	175.6	2,707	359,562		建設・土木
SIRIUS XM HOLDINGS INC	971.36	1,017.65	473	62,837		メディア
CSX CORP	2,203.61	2,635.36	8,285	1,100,241		陸運・鉄道
COTERRA ENERGY INC	785.16	999.16	2,552	338,993		石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	203.34	269.78	1,376	182,774		食品
CONSTELLATION BRANDS INC	164.21	193.43	4,366	579,851		飲料
CARDINAL HEALTH INC	290.05	344.21	2,710	359,947		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARLISLE COS INC	-	61.19	1,572	208,847		建設関連製品
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	763.02	1,322.91	1,571	208,695		ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	532.89	658.5	16,091	2,136,737		機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	102.58	126.31	1,591	211,285		ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	115.3	-	-	-		ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	921.88	970.73	381	50,658		各種電気通信サービス
CERNER CORP	285.28	-	-	-		ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,913.79	3,650.43	52,274	6,941,485		銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	245.63	302.36	2,503	332,405		家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	144.65	198.78	2,500	332,008		保険
CINTAS CORP	89.31	111.73	4,950	657,366		商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	4,107.04	5,161.36	24,619	3,269,248		通信機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	-	693.71	1,415	188,012		金属・鉱業
CLOROX COMPANY	114.55	157.94	2,411	320,192		家庭用品
COCA-COLA CO/THE	4,005.62	5,108.54	30,441	4,042,365		飲料
COPART INC	203.22	540.11	3,741	496,884		商業サービス・用品
COGNEX CORP	162.62	204.32	1,130	150,119		電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	784.14	988.65	7,234	960,727		家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	265.14	345.46	6,262	831,551		ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	55.04	74.34	2,214	294,085		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NRG ENERGY, INC.	227.63	283.64	995	132,202		電力
COMCAST CORP-CL A	4,460.29	5,492.1	21,452	2,848,630		メディア
CONAGRA BRANDS INC	454.72	619.81	2,235	296,790		食品
CONSOLIDATED EDISON INC	340.89	438.55	3,995	530,521		総合公益事業
CMS ENERGY CORP	272.38	366.03	2,238	297,268		総合公益事業
COOPER COS INC	47.32	63.42	2,140	284,294		ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	169.84	252.81	1,305	173,392		飲料
CORNING INC	838.66	957.58	3,388	450,008		電子装置・機器・部品
WOLFSPEED INC	-	156.84	1,269	168,530		半導体・半導体製造装置
SEALED AIR CORP	133.82	176.1	895	118,862		容器・包装
HEICO CORP-CL A	74.77	94.63	1,295	172,014		航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CUMMINS INC	139.26	178.03	4,422	587,256		機械
DARLING INTERNATIONAL INC	—	200.32	1,369	181,867		食品
DR HORTON INC	327.87	406.02	4,026	534,678		家庭用耐久財
DANAHER CORP	625.65	861.23	22,068	2,930,430		ライフサイエンス・ツール/サービス
MOODY'S CORP	163.35	206.82	6,392	848,818		資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	512.62	629.06	4,240	563,095		情報技術サービス
TARGET CORP	474.94	577.14	9,878	1,311,819		複合小売り
DEERE & CO	286.89	362.03	14,818	1,967,715		機械
MORGAN STANLEY	1,330.94	1,604.05	16,130	2,141,946		資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	215.52	270.24	3,374	448,062		商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	412.01	500.52	3,842	510,310		専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,767.79	2,274.04	24,482	3,251,006		娯楽
DOLLAR TREE INC	231.67	281.49	4,136	549,247		複合小売り
DOVER CORP	141.72	178.42	2,777	368,890		機械
OMNICOM GROUP	203.13	265.7	2,475	328,760		メディア
DTE ENERGY CO	184.19	237.92	2,705	359,216		総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	753.03	964.73	9,596	1,274,275		電力
DARDEN RESTAURANTS INC	133.37	156.76	2,293	304,561		ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	628.16	676.67	3,302	438,492		インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	7,384.33	9,008.68	32,088	4,261,087		銀行
CITIGROUP INC	1,979.43	2,418.65	12,482	1,657,571		銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	133.26	167.9	1,483	197,002		化学
EATON CORP PLC	390.25	496.76	8,592	1,140,992		電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	268.13	343.37	6,836	907,772		ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	226.45	244.16	342	45,455		メディア
ECOLAB INC	252.97	325.5	5,155	684,654		化学
PERKINELMER INC	118.35	156.49	2,159	286,705		ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	275.61	348.38	3,910	519,283		娯楽
SALESFORCE INC	953.48	1,248.76	21,223	2,818,324		ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	33.72	803	106,640		保険
EMERSON ELECTRIC CO	583.88	738.89	6,353	843,709		電気設備
ATMOS ENERGY CORP	124.29	175.67	2,033	270,059		ガス
ENTERGY CORP	188.13	260.97	2,768	367,646		電力
EOG RESOURCES INC	567.51	734.98	9,784	1,299,322		石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	116.63	151.56	3,244	430,809		専門サービス
EQT CORP	—	409.96	1,274	169,195		石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	226.64	289.95	7,408	983,814		パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	163.66	199.74	2,259	300,007		航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	4,127.07	5,193.82	60,466	8,029,340		石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	121.83	155.34	1,998	265,353		化学
NEXTERA ENERGY INC	1,911.83	2,449.25	18,621	2,472,768		電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	38.74	47.16	2,027	269,169		資本市場
FAIR ISAAC CORP	28.1	29.62	2,067	274,563		ソフトウェア
ASSURANT INC	55.23	58.23	758	100,714		保険
FASTENAL CO	549.13	729.41	3,846	510,830		商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	666.81	843.62	3,137	416,618		銀行
M&T BANK CORP	121.75	207.66	3,335	442,912		銀行
FIRST HORIZON CORP	—	696.34	1,719	228,393		銀行
FISERV INC	576.52	760.76	8,825	1,171,948		情報技術サービス
FORD MOTOR CO	3,805.63	4,943.79	6,412	851,462		自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	276.05	379.16	1,202	159,655		資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
FREPORT-MCMORAN INC	1,425.79	1,801.8	7,744	1,028,343		金属・鉱業
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	11.92	15.87	1,219	161,930		銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	200.01	262.69	4,945	656,665		保険
DENTSPLY SIRONA INC	202.22	255.99	946	125,739		ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	231.98	287.25	6,666	885,206		航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	588.18	749.19	5,645	749,619		食品
GENUINE PARTS CO	136.11	173.74	3,068	407,455		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,218.49	1,563.88	13,399	1,779,296		バイオテクノロジー
GARTNER INC	88.55	95.64	3,272	434,607		情報技術サービス
MCKESSON CORP	150.01	179.8	6,577	873,490		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	2,433.72	3,102.42	71,265	9,463,370		半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	1,070.26	1,369.1	11,437	1,518,780		コングロマリット
VW GRAINGER INC	41.48	54.66	3,643	483,794		商社・流通業
NUANCE COMMUNICATIONS INC	309.23	-	-	-		ソフトウェア
HALLIBURTON CO	838.43	1,115.7	4,346	577,207		エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	386.22	497.39	5,185	688,554		飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	329.9	424.3	15,774	2,094,712		資本市場
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	193.75	243.2	5,176	687,453		航空宇宙・防衛
HASBRO INC	121.84	154.37	897	119,118		レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	143.58	174.31	1,551	205,958		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	35.96	51.85	907	120,455		航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	152.45	186.95	4,466	593,071		食品
HP INC	1,162.73	1,259.55	3,829	508,457		コンピュータ・周辺機器
F5 INC	55.57	69.24	1,019	135,368		通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	123.36	153.22	1,313	174,365		容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	352.9	437.15	1,370	182,042		通信機器
HOLOGIC INC	243.1	306.95	2,552	338,918		ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT INC	1,028.3	1,275.83	40,626	5,394,760		専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	198.15	228.8	2,487	330,377		バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	290.21	388.51	1,747	232,104		食品
CENTERPOINT ENERGY INC	611.05	787.91	2,307	306,346		総合公益事業
LENNIX INTERNATIONAL INC	34.21	36.02	952	126,450		建設関連製品
HUBBELL INC	-	69.03	1,694	224,964		電気設備
HUMANA INC	125.74	158.44	7,948	1,055,496		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	87.52	103.48	2,011	267,058		陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,419.2	1,814.91	2,785	369,937		銀行
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	143.44	176.03	5,088	675,725		バイオテクノロジー
IDEX CORP	73.32	90.65	2,042	271,263		機械
ILLINOIS TOOL WORKS	307.86	387.9	9,233	1,226,177		機械
INTUIT INC	266.2	335.01	14,136	1,877,174		ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	82.25	101.62	5,118	679,631		ヘルスケア機器・用品
TRANE TECHNOLOGIES PLC	230.51	292.93	5,439	722,261		建設関連製品
INTEL CORP	3,947.83	5,124.32	14,676	1,948,833		半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	239.91	319.79	3,070	407,790		化学
INTERNATIONAL PAPER CO	343.88	441.53	1,728	229,539		容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	369.48	456.79	1,716	227,949		メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	131.48	-	-	-		専門サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	77.48	95.06	1,583	210,248		情報技術サービス
INCYTE CORP	179.58	244.49	1,940	257,648		バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,569.27	3,270.95	53,002	7,038,198		医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	328	394.02	3,056	405,913		保険

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
KLA CORPORATION	147.87	177.34	7,134	947,446		半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	624.62	783.84	5,011	665,526		石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	265.78	329.41	2,213	293,948		食品
KEYCORP	916.12	1,189.55	2,293	304,547		銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	326.7	421.73	5,422	720,067		家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	147.89	188.14	13,718	1,821,643		資本市場
KROGER CO	684.81	827.75	3,611	479,567		食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	138.76	172.6	8,909	1,183,130		半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	44.17	58.9	2,600	345,272		電子装置・機器・部品
PACKAGING CORP OF AMERICA	105.55	110.29	1,573	208,887		容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	152.64	200.36	1,758	233,572		情報技術サービス
PLUG POWER INC	526.24	561.49	887	117,879		電気設備
LENNAR CORP	264.83	323.61	3,367	447,211		家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	791.98	1,006.41	34,978	4,644,832		医薬品
BATH & BODY WORKS INC	269.67	281.56	1,265	167,985		専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	170.02	179.37	622	82,602		保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	709.53	911.89	17,031	2,261,595		航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	292.04	371.89	5,691	755,761		ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	244.24	296.95	14,300	1,898,965		航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	223.94	235.3	1,453	193,034		保険
LOWE'S COS INC	674.34	774.78	16,561	2,199,227		専門小売り
DOMINION ENERGY INC	787.03	1,018.28	5,912	785,072		総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	387	404.01	1,783	236,804		ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	249.05	320.31	2,399	318,621		食品
MCDONALD'S CORPORATION	727.78	914.13	24,371	3,236,307		ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	233.63	425.05	15,508	2,059,357		資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	42.82	53.53	2,032	269,871		保険
MARKEL CORPORATION	14.47	16.74	2,256	299,616		保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	605.91	776.95	5,950	790,188		ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	495.58	621.47	10,378	1,378,167		保険
MASCO CORP	232.33	289.37	1,603	212,992		建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	58.93	77.36	2,755	365,911		建設資材
METLIFE INC	714.43	847.99	6,109	811,316		保険
MEDTRONIC PLC	1,313.85	1,660.79	13,850	1,839,272		ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	756.57	974.96	7,485	994,031		娯楽
CVS HEALTH CORP	1,287.35	1,636.16	14,483	1,923,235		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	2,465.91	3,156.72	34,326	4,558,172		医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	413.6	543.62	4,722	627,163		半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	92.82	114.55	2,793	370,952		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	6,957.86	8,819.04	240,027	31,873,293		ソフトウェア
MICRON TECH INC	1,090.85	1,356.54	8,420	1,118,097		半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	533.22	695.97	5,907	784,442		半導体・半導体製造装置
3M CO	566.66	693.96	7,925	1,052,455		コンプロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	59.63	63.11	739	98,176		家庭用耐久財
ENTEGRIS INC	136.39	177.09	1,507	200,213		半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	54.58	64.45	1,622	215,447		ライフサイエンス・ツール/サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	163.01	205.78	5,564	738,936		通信機器
ILLUMINA INC	142.46	198.33	4,221	560,514		ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	516.15	693.25	4,712	625,801		電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	97.13	117.16	1,205	160,119		バイオテクノロジー
NETAPP INC	212.2	282.65	1,914	254,174		コンピュータ・周辺機器

銘柄	期首(前期末)	当期		期末	業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEWELL BRANDS INC	404.89	419.84	625	83,068	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	774.43	992.87	4,667	619,794	金属・鉱業
NOVAVAX INC	78.86	-	-	-	バイオテクノロジー
NVR INC	3.38	4.05	2,073	275,348	家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	1,245.17	1,574.85	19,874	2,639,149	繊維・アパレル・贅沢品
NORDSON CORP	47.87	64.47	1,565	207,834	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	242.35	289.97	6,822	905,948	陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	328.72	430.42	3,395	450,899	電力
NISOURCE INC	420.35	532.7	1,434	190,495	総合公益事業
NORTHERN TRUST CORP	200.11	248.36	2,417	320,991	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	148.6	183.61	8,583	1,139,862	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	4,001.7	4,724.91	22,915	3,042,990	銀行
NUCOR CORP	282.85	316.6	5,422	719,999	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	231.2	285.54	4,248	564,164	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	430.6	466.54	5,381	714,614	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	902.66	1,147.44	7,612	1,010,813	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	95.78	116.3	4,171	553,942	陸運・鉄道
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	66.72	77.57	6,678	886,874	専門小売り
ORACLE CORP	1,632.21	1,992.12	17,747	2,356,729	ソフトウェア
PACCAR INC	359.38	648.01	4,743	629,880	機械
PTC INC	110.92	136.65	1,836	243,806	ソフトウェア
EXELON CORP	956.45	1,216.64	5,113	679,026	電力
PARKER HANNIFIN CORP	125.93	161.01	5,673	753,342	機械
PAYCHEX INC	313.87	405.19	4,616	613,056	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	73.03	96.51	3,199	424,861	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	734.82	887.37	2,532	336,297	電力
PEPSICO INC	1,349.24	1,714.95	30,143	4,002,778	飲料
PENTAIR PLC	163.39	198.04	1,116	148,319	機械
PFIZER INC	5,460.72	6,989.45	30,557	4,057,780	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	215.43	327.96	1,504	199,806	水道
CONOCOPHILLIPS	1,306.12	1,591.69	18,073	2,399,998	石油・ガス・消耗燃料
PG&E CORP	1,524.96	1,782.57	2,777	368,790	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	222.38	284.45	6,648	882,809	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,796.13	2,244.42	10,640	1,412,991	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	415.17	510.1	8,219	1,091,433	銀行
BROWN & BROWN INC	217.93	306.5	1,755	233,048	保険
GARMIN LTD	145.29	199.11	1,937	257,285	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	230.64	283.41	3,678	488,414	化学
IPG PHOTONICS CORP	33.53	-	-	-	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	429.9	551.82	27,768	3,687,403	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	218.51	277.07	3,349	444,816	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	124.93	145.36	2,101	279,092	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,369.3	2,967.79	41,335	5,488,924	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	569.36	731.78	10,191	1,353,329	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	490.59	601	3,675	488,098	総合公益事業
PULTE GROUP INC	238.14	290.5	1,640	217,874	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	283.31	336.53	3,909	519,183	情報技術サービス
QUALCOMM INC	1,096.16	1,401.58	18,548	2,463,056	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	197.29	234.37	2,677	355,537	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	179.82	233.86	1,532	203,467	バイオテクノロジー
REGENERON PHARMACEUTICALS	101.93	133.97	10,104	1,341,730	バイオテクノロジー

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
REPLIGN CORP	—	67.3	1,267	168,332		ライフサイエンス・ツール/サービス
RESMED INC	140.92	186.28	3,984	529,155		ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,379.88	1,766	8,676	1,152,133		銀行
SEAGEN INC	128.63	168.6	2,374	315,262		バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	370.32	458.51	3,039	403,549		保険
ROSS STORES INC	342.98	441.71	5,159	685,086		専門小売り
ROLLINS INC	191.56	259.2	923	122,669		商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	103.18	131.2	5,599	743,503		ソフトウェア
ROCKWELL AUTOMATION INC	111.67	146.33	4,289	569,663		電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	212.92	274.77	2,070	275,000		ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	128.97	164.67	1,467	194,830		化学
ACCENTURE PLC-CL A	618.55	788.43	22,452	2,981,417		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,364.94	1,686.45	11,073	1,470,414		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	124.53	132.32	3,195	424,299		保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	241.52	295.95	5,449	723,616		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	599.27	750.43	5,088	675,723		情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	39.84	49.56	12,246	1,626,215		ホテル・レストラン・レジャー
SCHLUMBERGER LTD	1,365.54	1,774.1	10,080	1,338,581		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,406.74	1,813.79	14,649	1,945,371		資本市場
POOL CORP	43.36	46.6	1,749	232,254		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	200.7	261.44	3,312	439,894		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	135.81	186.42	1,863	247,448		食品
SEI INVESTMENTS CO	102.94	144.77	904	120,111		資本市場
ELEVANCE HEALTH INC	238.09	299.28	14,709	1,953,209		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	149.22	191.04	3,006	399,194		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	257.42	319.21	2,936	389,883		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	243.75	304.76	7,068	938,680		化学
CENTENE CORP	563.86	700.8	5,142	682,868		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	56.17	73.3	2,277	302,488		銀行
SMITH (A.O.) CORP	140.37	148.56	1,002	133,119		建設関連製品
SNAP-ON INC	57.83	70.68	1,782	236,704		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	375.64	467.76	4,830	641,449		保険
ADVANCE AUTO PARTS	56.94	71.65	1,080	143,439		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	362.4	485.33	3,277	435,274		電力
SOUTHERN CO	1,035.27	1,360.27	9,066	1,203,900		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,291.44	1,653.26	8,071	1,071,776		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	132.2	197	699	92,892		旅客航空輸送業
AT&T INC	6,960.38	8,882.01	17,009	2,258,631		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,886.45	2,316.39	39,916	5,300,449		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	153.85	192.7	1,718	228,148		機械
STATE STREET CORP	351.58	461.98	4,323	574,078		資本市場
STARBUCKS CORP	1,144.57	1,428.19	15,421	2,047,833		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	219.29	229.37	2,901	385,294		金属・鉱業
STRYKER CORP	331.3	426.35	11,283	1,498,373		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	430.24	554.71	19,967	2,651,463		娯楽
GEN DIGITAL INC	552.31	730.86	1,549	205,747		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	158.87	203.18	1,236	164,147		陸運・鉄道
SYNOPSYS INC	147.52	187.79	7,059	937,467		ソフトウェア
SYSCO CORP	496.62	625.21	4,862	645,742		食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	346.96	446.32	10,760	1,428,864		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	44.66	55.32	1,356	180,166		ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	1,057.57	1,347.81	1,381	183,450		医薬品
TERADYNE INC	154.54	185.12	1,999	265,511		半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	895.92	1,137.01	20,050	2,662,444		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	206.83	258.24	1,926	255,781		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	382.78	487.95	27,885	3,702,897		ライフサイエンス・ツール/サービス
GLOBE LIFE INC	91.68	121.53	1,466	194,769		保険
DAVITA INC	64.97	68.13	564	74,990		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	109.61	136.9	3,258	432,640		専門小売り
BIO-TECHNE CORP	42.2	206.52	1,590	211,163		ライフサイエンス・ツール/サービス
TRIMBLE INC	260.37	286.76	1,594	211,756		電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	39.35	53	1,728	229,568		ソフトウェア
TYSON FOODS INC	277.88	356.84	2,172	288,525		食品
UGI CORP	184.69	241.6	953	126,563		ガス
MARATHON OIL CORP	-	840.59	2,283	303,165		石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	637.38	777.69	15,867	2,107,006		陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,472.36	1,830.61	18,556	2,464,169		航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	920.02	1,165.09	57,419	7,624,686		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	77.37	80.96	1,200	159,475		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VF CORP	356.87	378.87	1,046	138,956		繊維・アパレル・贅沢品
PARAMOUNT GLOBAL	570.34	786.63	1,765	234,505		メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	250.92	321.4	9,650	1,281,428		バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	126.76	164.52	3,053	405,429		建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	704.44	917.06	3,370	447,528		食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,502.63	1,878.96	27,336	3,630,078		食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	406.53	505.78	7,654	1,016,437		商業サービス・用品
WATERS CORP	57.5	75.11	2,548	338,432		ライフサイエンス・ツール/サービス
WEBSTER FINANCIAL CORP	204.18	222.85	1,228	163,142		銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	71.03	96.41	2,661	353,394		ライフサイエンス・ツール/サービス
JM SMUCKER CO/THE-NEW	99.44	126.79	1,864	247,563		食品
VAIL RESORTS INC	41.8	52.35	1,338	177,799		ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	293.01	407.23	1,777	235,987		コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	170.97	202.73	2,097	278,492		機械
WHIRLPOOL CORP	57.37	68.32	1,028	136,600		家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	159.24	188.33	2,293	304,526		半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	120.04	127.57	1,391	184,781		ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	110.34	415.96	2,438	323,789		資本市場
CME GROUP INC	348.92	443.42	8,264	1,097,496		資本市場
WILLIAMS COS INC	1,163.01	1,518.9	4,848	643,809		石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	287.85	315.04	1,808	240,211		販売
ALLIANT ENERGY CORP	238.72	339.66	1,810	240,356		電力
WEC ENERGY GROUP INC	305.23	383.18	3,513	466,592		総合公益事業
CARMAX INC	152.87	186.73	1,417	188,225		専門小売り
XILINX INC	253.18	-	-	-		半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,168.23	1,452.28	11,722	1,556,671		専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	56.09	67.3	2,145	284,868		電子装置・機器・部品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,087	1,560.49	749	99,464		不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	204	173.28	891	118,385		コングロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	108.82	150.92	3,394	450,734		バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	56.1	79.96	1,040	138,191		銀行
CBRE GROUP INC	323.38	410.89	3,652	485,056		不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	145.97	157.79	331	44,043		各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
REGIONS FINANCIAL CORP	974.23	1,172.22	2,795	371,246		銀行
DOMINO'S PIZZA INC	38.08	41.15	1,430	189,928		ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	40.44	53.87	2,804	372,377		半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	-	41.87	519	69,048		化学
T-MOBILE US INC	607.01	784.34	11,568	1,536,145		無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	367.69	429.72	2,473	328,451		ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	385.15	425.61	2,126	282,414		化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	39.59	48.71	1,734	230,319		資本市場
CELANESE CORP	109.17	138.41	1,689	224,376		化学
DEXCOM INC	93.5	487.1	5,774	766,805		ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	130.68	-	-	-		メディア
EXPEDIA GROUP INC	136.45	191.86	2,205	292,859		ホテル・レストラン・レジャー
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	202.05	240.27	2,055	272,887		化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	108.96	131.23	4,629	614,685		資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	360.34	783	103,977		各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	551.66	698.96	7,576	1,006,113		資本市場
LIVE NATION	153.12	204.44	1,596	211,968		娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	27.13	34.74	5,713	758,637		ホテル・レストラン・レジャー
TRANSDIGM GROUP INC	50.93	61.48	4,645	616,931		航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	858.46	1,074.66	39,758	5,279,480		情報技術サービス
WESTERN UNION CO	448.68	467.12	658	87,460		情報技術サービス
OWENS CORNING	97.4	132.27	1,367	181,630		建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	123.03	151.08	1,439	191,089		専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	-	178.61	1,125	149,444		商社・流通業
FIRST SOLAR INC	-	119.03	1,964	260,862		半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	-	-	-		ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	117.8	153	2,211	293,680		情報技術サービス
DELTA AIR LINES INC	147.23	215.92	844	112,107		旅客航空輸送業
INSULET CORP	64.81	88.34	2,590	343,943		ヘルスケア機器・用品
DISCOVER FINANCIAL	286.45	332.36	3,833	509,086		消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	318.46	387.62	5,143	683,034		電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	54.04	56.88	939	124,762		ヘルスケア機器・用品
LULULEMON ATHLETICA INC	114.58	145.47	4,653	617,910		繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	213.2	266.9	3,128	415,482		ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	43.13	57.15	6,471	859,304		インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	52.74	60.73	3,186	423,095		専門小売り
INVESCO LTD	369.04	385.3	732	97,211		資本市場
MSCI INC	79.74	98.07	5,509	731,642		資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,520.6	1,930.16	19,631	2,606,887		タバコ
VISA INC	1,644.41	2,035.26	46,686	6,199,544		情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	709.52	928.16	3,284	436,183		飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	173.37	228.09	3,405	452,231		水道
DISCOVERY INC-C	303.88	-	-	-		メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	618.96	631.37	8,121	1,078,512		石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	127.87	161.82	1,052	139,736		建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,960.57	2,578.77	4,721	626,998		石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	170.83	228.48	2,452	325,668		機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	261.91	333.42	3,338	443,323		化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.82	47.13	1,018	135,300		航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	156.99	208.98	2,227	295,764		ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	53.99	70.9	2,563	340,345		情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ZILLOW GROUP INC	76.58	—	—	—		不動産管理・開発
HCA HEALTHCARE INC	250.49	287.52	7,443	988,474		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	146.24	189.74	3,354	445,508		専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	61.52	77.92	1,174	155,918		医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	73.99	88.44	1,857	246,622		情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	169.47	224.34	3,036	403,238		銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	258.51	321.09	6,093	809,217		半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	136.87	163.43	1,550	205,885		専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	—	258.3	1,994	264,861		石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	52.16	69.11	981	130,397		自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	105.27	127.09	1,608	213,569		資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	215.54	310.59	1,939	257,605		情報技術サービス
DOLLAR GENERAL CORP	225.66	278.99	6,455	857,195		複合小売り
FORTINET INC	134.08	811.66	4,966	659,507		ソフトウェア
HORIZON PHARMA PLC	204.15	276.13	3,025	401,690		バイオテクノロジー
TESLA INC	819.66	3,319.53	69,461	9,223,748		自動車
GENERAC HOLDINGS INC	59.93	69.14	865	114,956		電気設備
ENPHASE ENERGY INC	122.17	170.46	3,551	471,608		半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,267.27	1,712.1	7,264	964,645		自動車
ALLY FINANCIAL INC	374.66	392.3	1,279	169,876		消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	96.61	2,367	314,332		資本市場
APTIV PLC	260.18	343.1	4,154	551,734		自動車部品
PHILLIPS 66	424.28	594.04	6,412	851,537		石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	86.28	—	—	—		ソフトウェア
META PLATFORMS INC	2,321.43	2,845.33	51,067	6,781,317		インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	185.72	225.14	5,112	678,856		ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	157.27	200.87	3,010	399,756		石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	192.63	253.33	11,687	1,551,967		ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	94.41	369.42	6,285	834,626		ソフトウェア
WORKDAY INC	186.02	255.47	4,842	642,992		ソフトウェア
ABBVIE INC	1,721.56	2,201.98	33,600	4,461,745		バイオテクノロジー
ZOETIS INC	460.53	587.56	10,100	1,341,199		医薬品
NEWS CORP/NEW-CL A	383.72	542.11	1,020	135,479		メディア
CDW CORP	129.43	164.65	3,426	454,965		電子装置・機器・部品
HOWMET AEROSPACE INC	404.34	475.9	2,047	271,863		航空宇宙・防衛
TWILIO INC	158.35	210.9	1,309	173,913		情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	77.32	—	—	—		ソフトウェア
SNAP INC	1,027.74	1,273.18	1,381	183,436		インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	418.52	532.3	2,657	352,855		メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	221.57	224.66	1,597	212,169		娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	83.24	88.45	310	41,225		メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	143.46	198.71	695	92,406		メディア
OKTA INC	116.92	178.28	1,377	182,951		情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	167.75	176.53	1,122	149,087		ソフトウェア
BAKER HUGHES CO	779.09	1,262.92	4,099	544,364		エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	181.67	1,803	239,478		食品
BROADCOM INC	398.94	502.59	30,271	4,019,752		半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	73.05	—	—	—		ソフトウェア
ARES MANAGEMENT CORP	—	195.34	1,639	217,707		資本市場
MONGODB INC	61.01	90.21	2,064	274,091		情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	68.61	84.53	1,944	258,157		専門小売り

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	404.49	613.21	790	104,960		医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	132.96	168.56	2,898	384,832		ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	829.81	—	—	—		インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	159.85	242.12	1,267	168,375		電気設備
EVERGY INC	223.98	282.26	1,711	227,324		電力
ALLEGION PLC	89.24	101.4	1,215	161,390		建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	133.6	183.14	1,420	188,595		ソフトウェア
STERIS PLC	96.49	125.24	2,440	324,030		ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	185.2	263.62	1,677	222,778		ソフトウェア
WIX.COM LTD	55.67	58.55	508	67,586		情報技術サービス
DROPBOX INC	281.7	304.79	731	97,135		ソフトウェア
KKR & CO INC	503.37	674.3	3,951	524,706		資本市場
FUTU HOLDINGS LTD ADR	47.58	50.5	241	32,107		資本市場
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	209	279.21	2,175	288,824		ソフトウェア
MODERNA INC	334.13	416.26	7,310	970,742		バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	266.16	344.09	5,208	691,635		ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	213.87	311.33	1,214	161,273		ホテル・レストラン・レジャー
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	571.24	—	—	—		娯楽
CIGNA CORP	331.11	382.14	11,439	1,519,083		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	277.83	327.7	1,410	187,246		コンピュータ・周辺機器
DOW INC	722.56	876.67	5,238	695,684		化学
OVINTIV INC	—	316.03	1,540	204,540		石油・ガス・消耗燃料
AMCOR PLC	1,618.22	1,887.89	2,152	285,789		容器・包装
PINTEREST INC	521.77	697.46	1,721	228,575		インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	254.18	—	—	—		レジャー用品
FOX CORP-A	346.81	365.01	1,305	173,327		メディア
FOX CORP-B	150.8	155.11	513	68,238		メディア
CLARIVATE ANALYTICS PLC	408.46	425.86	462	61,413		専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	182.31	257.23	2,991	397,286		ソフトウェア
CHEWY INC	90.68	96.48	462	61,354		インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	486.39	782.14	1,899	252,172		ライフサイエンス・ツール/サービス
LYFT INC	245.89	—	—	—		陸運・鉄道
DYNATRACE INC	194.17	254.29	1,128	149,824		ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	225.54	297.7	2,035	270,316		情報技術サービス
TRADEWEB MARKETS INC	98.86	138	1,027	136,466		資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	798.71	1,018.98	4,598	610,655		建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	422.26	528.55	4,457	591,879		機械
INMODE LTD	55.11	—	—	—		ヘルスケア機器・用品
UBER TECHNOLOGIES INC	1,191.09	1,815.6	6,396	849,372		陸運・鉄道
CORTEVA INC	717.05	905.9	5,632	747,990		化学
MATCH GROUP INC	253.22	352.59	1,588	210,879		インタラクティブ・メディアおよびサービス
FERGUSON PLC	—	257.02	3,789	503,173		商社・流通業
BILL.COM HOLDINGS INC	78.3	119.88	1,163	154,508		ソフトウェア
BLACKSTONE INC	665.78	880.26	8,518	1,131,141		資本市場
FIVERR INTERNATIONAL LTD	32.02	—	—	—		専門サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	53.22	1,155	153,398		ソフトウェア
CARLYLE GROUP INC	170.2	245.3	866	115,081		資本市場
10X GENOMICS INC	76.67	—	—	—		ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	183.67	291.79	2,494	331,207		ソフトウェア
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	209.24	256.89	1,861	247,178		コンピュータ・周辺機器
UPSTART HOLDINGS INC	20.8	—	—	—		消費者金融

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
INGERSOLL RAND INC	405.29	514.79	2,956	392,585		機械
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	—	441.35	3,204	425,544		ヘルスケア機器・用品
PAYCOM SOFTWARE INC	52.5	63.41	2,058	273,395		ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	177.12	383.42	747	99,232		自動車
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	—	92.67	196	26,087		海運業
ASANA INC	71.34	—	—	—		ソフトウェア
UNITY SOFTWARE INC	53.67	308.39	1,224	162,657		ソフトウェア
AON PLC	220.29	263.41	8,229	1,092,859		保険
SOFI TECHNOLOGIES INC	547.34	—	—	—		消費者金融
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	2,917.78	4,297	570,716		娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	7.36	1,419	188,484		石油・ガス・消耗燃料
BENTLEY SYSTEMS INC	160.02	225.66	924	122,708		ソフトウェア
COINBASE GLOBAL INC	39.76	130.94	772	102,638		資本市場
AFFIRM HOLDINGS INC	92.04	185.28	242	32,230		情報技術サービス
IAC INC	72.5	—	—	—		インタラクティブ・メディアおよびサービス
AIRBNB INC	227.11	471.77	5,702	757,206		ホテル・レストラン・レジャー
ZENDESK INC	119.15	—	—	—		ソフトウェア
CONSTELLATION ENERGY CORP	318.81	412.24	3,547	471,104		電力
ROYALTY PHARMA PLC	355.64	417.75	1,587	210,797		医薬品
ROBLOX CORP	—	450.19	1,605	213,237		娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	235.77	296.56	796	105,814		インタラクティブ・メディアおよびサービス
VIATRIS INC	1,248.58	1,508.26	1,781	236,532		医薬品
CAESARS ENTERTAINMENT INC	218.14	264.44	1,409	187,127		ホテル・レストラン・レジャー
DRAFTKINGS INC	334.59	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	126.87	1,064	141,296		石油・ガス・消耗燃料
HF SINCLAIR CORP	—	202.99	1,123	149,223		石油・ガス・消耗燃料
SNOWFLAKE INC	203.94	285.82	4,888	649,089		情報技術サービス
DOORDASH INC	109.22	295.75	1,822	241,958		インターネット販売・通信販売
OAK STREET HEALTH INC	91.44	—	—	—		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	218.59	293.67	4,154	551,643		通信機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	371.77	504.82	3,617	480,373		各種金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	1,532.71	2,028.24	1,870	248,322		ソフトウェア
IHS MARKIT LTD	367.14	—	—	—		専門サービス
FNF GROUP	254.51	310.04	1,351	179,460		保険
JACOBS SOLUTIONS INC	—	166.15	2,035	270,316		専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	794.17	1,079.89	5,098	676,984		半導体・半導体製造装置
APA CORP	—	409.46	1,738	230,918		石油・ガス・消耗燃料
ROBINHOOD MARKETS INC	198.72	—	—	—		資本市場
LUCID GROUP INC	421.36	449.1	463	61,603		自動車
U-HAUL HOLDING CO	—	119.81	689	91,559		陸運・鉄道
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	37.21	799	106,174		ソフトウェア
TOAST INC	—	326.2	819	108,766		情報技術サービス
GRAB HOLDINGS LTD	—	1,683.28	585	77,785		陸運・鉄道
CATALENT INC	174.39	205.64	1,446	192,104		医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	599.85	611.18	2,219	294,768		消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	435.54	633.78	2,748	364,916		銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	52.37	782	103,972		ソフトウェア
WAYFAIR INC	69.59	—	—	—		インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	174.12	222.09	4,113	546,297		電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	43.07	58.02	2,111	280,381		ソフトウェア
QORVO INC	111.07	141.44	1,505	199,894		半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	24.25	-	-	-	-	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	145.2	153.35	1,422	188,829		メディア
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	49.59	67.28	2,122	281,808		半導体・半導体製造装置
GODADDY INC	165.74	197.13	1,597	212,137		情報技術サービス
KORNIT DIGITAL LTD	49.78	-	-	-	-	機械
ETSY INC	117.13	156.14	2,088	277,314		インターネット販売・通信販売
TRANSUNION	189.9	257.08	1,753	232,784		専門サービス
ALCOA CORP	-	239.41	1,171	155,554		金属・鉱業
BLOCK INC	489.39	669.1	5,272	700,136		情報技術サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	506.8	602.66	4,607	611,888		化学
CARVANA CO	77.35	-	-	-	-	専門小売り
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	215.37	262.21	1,467	194,811		飲料
TELADOC HEALTH INC	147.9	-	-	-	-	ヘルスケア・テクノロジー
WESTROCK CO	262.97	342.86	1,131	150,243		容器・包装
KRAFT HEINZ CO	640.01	921.06	3,673	487,762		食品
NOVOCURE LTD	97.72	123.17	1,064	141,329		ヘルスケア機器・用品
FORTIVE CORP	329.64	426.08	2,940	390,509		機械
WASTE CONNECTIONS INC	261.86	310.39	4,180	555,106		商業サービス・用品
ALPHABET INC-CL A	293.14	7,443.29	70,473	9,358,118		インタラクティブ・メディアおよびサービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,231.01	1,563.84	2,586	343,473		コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	1,086.55	1,375.33	10,625	1,410,969		情報技術サービス
SEA LTD ADR	132.32	439.08	2,820	374,495		娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	343.46	449.24	1,477	196,144		各種金融サービス
SUNRUN INC	162.13	-	-	-	-	電気設備
ZILLOW GROUP INC-C	156.65	163.21	743	98,697		不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	280.94	6,916.6	65,673	8,720,733		インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	77.59	103.1	1,404	186,452		ソフトウェア
CABLE ONE INC	5.42	-	-	-	-	メディア
LINDE PLC	503.98	620.82	20,735	2,753,452		化学
ROKU INC	119.01	156.6	886	117,782		娯楽
AVALARA INC	78.24	-	-	-	-	ソフトウェア
CHARTER COMMUNICATIONS INC	124.76	140.85	5,635	748,382		メディア
VISTRA CORP	397.58	496.33	1,142	151,653		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>	309,096.71 608銘柄	423,708.49 601銘柄	4,451,014 -	591,050,171 <69.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES LTD	455.67	570.3	3,886	386,737		金属・鉱業
BARRICK GOLD CORP	1,736.87	2,148.35	5,108	508,425		金属・鉱業
BALLARD POWER SYSTEMS INC	212.72	-	-	-	-	電気設備
BANK OF MONTREAL	630.76	825.85	11,166	1,111,271		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	1,191.19	1,494.35	11,050	1,099,767		銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	326	409.67	4,133	411,413		銀行
BCE INC	72.75	76.97	470	46,841		各種電気通信サービス
BROOKFIELD CORP	1,379.3	1,771.31	8,638	859,721		資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	281.92	-	-	-	-	医薬品
SAPUTO INC	253.95	345.82	1,269	126,306		食品
BLACKBERRY LTD	466.71	-	-	-	-	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	622.22	923.11	910	90,581		総合公益事業
DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)	-	115.08	1,160	115,478		ソフトウェア
CGI INC	229.85	279.18	3,456	343,965		情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	153.58	210.58	1,314	130,813		容器・包装

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		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
CAE INC	304.43	408.08	1,295	128,902		航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	346.76	542.64	2,110	210,019		石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	373.08	456.07	2,986	297,246		無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	436.21	1,145.14	7,152	711,821		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,152.17	1,407.03	11,305	1,125,121		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	58.89	61.24	1,003	99,890		複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	97.93	163.3	597	59,497		総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	691.09	732.33	11,682	1,162,605		陸運・鉄道
GILDAN ACTIVEWEAR INC	208.15	217.13	856	85,268		繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	258.68	332.17	1,583	157,585		ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	294.33	1,078	107,324		食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,185.75	2,199.14	1,216	121,028		金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	94.52	132.86	1,134	112,878		商業サービス・用品
FORTIS INC	452	604.84	3,334	331,847		電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	569.14	742.03	2,019	200,937		金属・鉱業
TELUS CORP	318.9	318.9	873	86,895		各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	252.5	342.08	1,228	122,251		保険
IMPERIAL OIL LTD	220.66	272.46	1,925	191,596		石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,964.79	2,517.28	13,356	1,329,257		石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	53.66	124.78	527	52,516		資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,892.5	2,338.61	6,106	607,680		保険
LOBLAW CO LTD	154.86	216	2,535	252,345		食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	788.73	1,012.1	6,476	644,534		食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	302.02	358.44	2,670	265,720		自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	570.83	758.84	5,172	514,742		保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23.2	27.99	2,441	242,970		保険
METRO INC	227.64	286.29	2,036	202,717		食品・生活必需品小売り
EMERA INC	238.36	369.98	2,004	199,529		電力
ONEX CORP	64.89	101.57	679	67,624		資本市場
PAN AMERICAN SILVER CORP	187.66	193.23	425	42,325		金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	564.39	655	2,335	232,451		保険
QUEBECOR INC-B	160.42	171.95	548	54,605		メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,394.86	1,719.47	23,874	2,376,024		銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	906.81	1,163.63	12,375	1,231,580		陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	426.01	598.77	2,357	234,663		メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,431.08	1,718.98	7,972	793,436		石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	643.1	687.62	616	61,383		金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	438.24	573.26	3,230	321,538		金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	167.4	199.79	3,309	329,343		専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	93.88	96.65	1,038	103,303		商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) CS	1,778.19	2,251.61	20,973	2,087,307		銀行
TC ENERGY CORP	949.79	1,237.53	6,982	694,862		石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	92.98	81.02	895	89,081		紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	78.86	98.39	1,655	164,756		食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	179.01	215.66	4,295	427,468		保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	470.07	585.39	3,372	335,624		金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	19.31	25.3	6,086	605,773		ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	186.23	231.63	4,204	418,390		金属・鉱業
TOURMALINE OIL CORP	323.64	392.98	2,467	245,567		石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	237.72	245.71	767	76,415		石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	144.97	156.65	473	47,127		石油・ガス・消耗燃料

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALTAGAS LTD	240.53	338.33	843	83,907	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	564.42	681.79	3,209	319,445	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	264.38	362.04	2,857	284,422	複合小売り
CENOVUS ENERGY INC W/I	1,344.22	1,677.15	4,454	443,312	石油・ガス・消耗燃料
ARC RESOURCES LTD	-	749.61	1,209	120,406	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	234.9	341.52	1,134	112,942	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	-	512.43	978	97,404	各種金融サービス
TMX GROUP LTD	47.97	70.4	962	95,760	資本市場
BRP INC	-	43.07	515	51,264	レジャー用品
IVANHOE MINES LTD	619.3	640.27	773	76,973	金属・鉱業
NUTRIEN LTD	555.64	661.77	6,795	676,243	化学
TFI INTERNATIONAL INC	89.99	93.99	1,602	159,511	陸運・鉄道
LIGHTSPEED COMMERCE INC	113.46	-	-	-	ソフトウェア
WSP GLOBAL INC	129.91	156.81	2,695	268,262	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	116.6	120.11	1,008	100,348	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	164.85	275.77	1,157	115,157	商業サービス・用品
NUVEI CORP	49.6	79.29	347	34,562	情報技術サービス
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	108.45	161.03	641	63,798	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	-	425.01	2,012	200,318	資本市場
AIR CANADA	179.4	188.14	427	42,540	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	264.43	353.84	3,141	312,666	ホテル・レストラン・レジャー
SHOPIFY INC	109.46	1,468.23	9,810	976,362	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	32.93	52.37	1,019	101,433	不動産管理・開発
CANOPY GROWTH CORP	186.34	-	-	-	医薬品
HYDRO ONE LTD	357.38	462.25	1,672	166,439	電力
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	86銘柄	309,487	30,800,200	
		86銘柄	-	<3.6%>	
(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	171.34	217.54	1,388	128,725	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	2,757.53	-	-	-	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	3,565.97	4,377.12	10,443	968,036	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,622.22	2,101.04	4,660	431,945	金属・鉱業
TELSTRA GROUP LTD	3,896.81	4,828.55	1,999	185,289	各種電気通信サービス
ASX LTD	189.26	236.64	1,638	151,894	資本市場
BHP GROUP LTD	3,064.96	6,313	30,125	2,792,345	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	318.28	993	92,044	石油・ガス・消耗燃料
COMPUTERSHARE LT	516.04	720.81	1,772	164,290	情報技術サービス
CSL LIMITED	464.24	601.03	18,496	1,714,458	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	58.28	61.34	749	69,461	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,937.86	3,796.33	5,295	490,875	運送インフラ
COCHLEAR LTD	58.75	78.36	1,638	151,858	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,463.6	2,132.29	1,505	139,535	電力
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,728.88	2,112.29	23,076	2,138,985	銀行
RIO TINTO LIMITED	359.15	459.36	5,581	517,323	金属・鉱業
APA GROUP	1,182.05	1,643	1,758	162,949	ガス
ARISTOCRAT LEISU	620.13	766.75	2,763	256,136	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	2,694.3	2,816.64	1,357	125,837	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	462.46	607.67	1,847	171,227	建設資材
IGO LTD	-	919.47	1,324	122,810	金属・鉱業
ORICA LTD	413.11	638.62	1,010	93,703	化学
LEND LEASE CORP LTD	621.16	1,071.81	841	77,986	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BLUESCOPE STEEL LTD	469.46	503.25	962	89,234	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	1,422.58	—	—	—	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	337.36	466.42	8,939	828,593	資本市場
SUNCORP GROUP LTD	1,202.9	1,541.62	1,950	180,759	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,188.61	3,928.66	12,418	1,151,070	銀行
NEWCREST MINING LTD	868.79	1,128.15	2,792	258,806	金属・鉱業
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,074.83	1,126.59	726	67,353	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,336.24	1,724.87	2,292	212,478	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	966.92	1,355.78	1,629	151,052	金属・鉱業
REECE LTD	303.19	315.58	520	48,205	商社・流通業
SANTOS LTD	3,333.93	4,173.58	2,967	275,049	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	406.13	527.74	1,513	140,291	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	247.11	259.85	742	68,788	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	2,145.97	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	1,094.81	1,397.2	6,804	630,696	複合小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	906.41	2,354.31	8,529	790,614	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,204.4	1,543.2	5,598	518,946	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	155.53	—	—	—	資本市場
SEEK LTD	361.4	384.05	935	86,751	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	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
AUSNET SERVICES	1,650.66	—	—	—	電力
MINERAL RESOURCES LTD	—	211.79	1,843	170,846	金属・鉱業
BRAMBLES LTD	1,300.28	1,709.29	2,034	188,536	商業サービス・用品
PILBARA MINERALS LTD	—	3,279.47	1,590	147,427	金属・鉱業
CROWN RESORTS LTD	328.61	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	1,502.3	—	—	—	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,381.66	2,228.49	744	68,990	陸運・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	759.03	792.33	1,135	105,241	飲料
XERO LTD	140.63	188.6	1,481	137,298	ソフトウェア
IDP EDUCATION LTD	228.52	237.81	746	69,147	各種消費者サービス
LOTTERY CORP LTD	—	2,912.7	1,453	134,719	ホテル・レストラン・レジャー
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	1,195.74	1,604.7	1,137	105,456	食品・生活必需品小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	3,743.53	9,639	893,493	銀行
MEDIBANK PVT LTD	2,831.54	2,985.76	913	84,685	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	4,093.17	5,966.94	2,768	256,627	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,227.26	1,716.84	3,095	286,918	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	136.04	148.23	837	77,600	ソフトウェア
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	66,920.43 55銘柄	87,275.27 52銘柄	209,012 —	19,373,402 <2.3%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	2,570	4,060	68,705	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS LTD	1,620	1,972.96	11,383	192,616	電力
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	535	933.14	4,105	69,470	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,164.4	1,518.91	51,217	866,602	資本市場
MTR CORP	1,375	1,924.41	7,986	135,128	陸運・鉄道
HANG SENG BANK LTD	758	950.96	11,934	201,932	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,204.5	1,709.72	4,829	81,722	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,460	1,513.2	6,605	111,758	電力
HONG KONG & CHINA GAS	11,754.56	15,364.06	11,861	200,689	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	2,000	2,609.04	13,984	236,616	ホテル・レストラン・レジャー
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,535	4,199.95	11,129	188,317	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	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,630.66	1,730.66	3,868	65,446	不動産管理・開発
SINO LAND CO	5,054	4,112	4,301	72,775	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,385	1,805.65	20,169	341,261	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC LTD A	495	530.2	3,528	59,701	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,320	1,801.56	19,312	326,771	機械
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,660	1,780	2,837	48,007	建設関連製品
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	2,172	-	-	-	専門小売り
AIA GROUP LTD	11,750.27	14,933.16	128,873	2,180,534	保険
HKT TRUST / HKT LTD	4,450	4,631.36	4,955	83,847	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	2,520	3,358	9,771	165,338	ホテル・レストラン・レジャー
SITC INTERNATIONAL CO LTD	1,330	1,400	2,405	40,695	海運業
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	2,016	4,324	73,167	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	1,517.5	1,961.35	8,551	144,691	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD	2,038	2,164	3,280	55,508	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,465	1,281	21,688	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,506	2,650	6,280	106,266	飲料
WH GROUP LTD	8,970	9,315	4,387	74,234	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,563.32	3,104.45	15,289	258,696	コンプロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,863.32	2,661.95	13,669	231,281	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	82,613.53 30銘柄	97,686.69 29銘柄	396,186 -	6,703,475 <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	1,095	1,442	524	52,483	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,766	2,248.1	7,881	788,105	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	394	320	32,028	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	-	155	441	44,186	コンプロマリット
SINGAPORE EXCHANGE LTD	674	998	916	91,607	資本市場
GENTING SINGAPORE LTD	7,242	7,611.93	776	77,633	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,349	1,849	1,307	130,711	コンプロマリット
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,209.53	3,981.98	5,164	516,411	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	8,084.22	9,433.3	2,358	235,808	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	1,580.5	1,627	955	95,495	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,113	1,399.66	4,235	423,494	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	436	301	30,124	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	421	438	811	81,109	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,814	2,585	1,028	102,872	食品
CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	2,952.15	3,065.9	1,180	118,025	不動産管理・開発
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	32,069.4 14銘柄	37,664.87 15銘柄	28,203 -	2,820,098 <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	1,643.41	1,401	117,837	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	494.49	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FISHER & PAYKEL	573.88	784.6	2,008	168,840	ヘルスケア機器・用品
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,629.43	2,190.38	1,160	97,585	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	628.34	397	33,433	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	1,241.62	1,321.57	708	59,544	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,659.02 6銘柄	6,568.3 5銘柄	5,677 -	477,242 <0.1%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	352.61	459.63	782	126,580	金属・鉱業
ASHTED GROUP	430.03	543.04	3,034	490,861	商社・流通業

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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
SEVERN TRENT PLC	294.58	293.97	821	132,861		水道
BARCLAYS PLC	16,512.19	20,224.17	3,787	612,744		銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	922.35	1,241.96	571	92,393		家庭用耐久財
BT GROUP PLC	8,502.62	9,041.98	1,250	202,281		各種電気通信サービス
BHP GROUP LTD	2,059.88	—	—	—		金属・鉱業
BUNZL PLC	355.08	385.93	1,168	189,094		商社・流通業
AVIVA PLC	3,815.43	3,486.83	1,544	249,865		保険
CRODA INTERNATIONAL	136.93	167.82	1,148	185,736		化学
DIAGEO PLC	2,277.84	2,829.74	9,960	1,611,240		飲料
SCHRODERS PLC	113.54	1,103.66	548	88,728		資本市場
DCC PLC	106.84	111.35	515	83,413		コンゴロマリット
NATIONAL GRID PLC	3,522.37	4,605.69	4,856	785,619		総合公益事業
KINGFISHER PLC	2,114.6	2,253.92	624	101,029		専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	3,096.99	3,796.23	3,285	531,423		航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,127.07	2,628.77	8,178	1,322,890		タバコ
HALMA PLC	342.01	510.66	1,133	183,381		電子装置・機器・部品
NEXT PLC	131.97	187.51	1,258	203,585		複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	896.52	1,078.89	2,181	352,881		タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	191.07	199.76	445	72,123		化学
ANGLO AMERICAN PLC	1,255.2	1,574.26	5,058	818,197		金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,721.99	2,209.35	4,190	677,779		ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	19,905.53	24,887.38	15,161	2,452,506		銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	5,733.2	7,381.79	1,880	304,131		保険
UNILEVER PLC	2,528.12	3,166.86	13,511	2,185,605		パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	677.14	905.69	954	154,342		水道
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	322.09	423.51	808	130,848		食品
PEARSON PLC	637.46	841.59	768	124,319		各種消費者サービス
PERSIMMON PLC	336.88	352.52	496	80,374		家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,544.6	3,339.71	4,286	693,387		保険
RIO TINTO PLC	1,091.55	1,408.39	8,475	1,371,027		金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	27,067.74	32,204.82	3,130	506,358		無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	692.96	886.53	5,088	823,145		家庭用品
RELX PLC	1,892.62	2,404.03	5,820	941,468		専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,934.06	3,121.14	1,561	252,538		商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	7,958.64	11,219.24	1,215	196,545		航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	5,723.46	6,704.64	2,044	330,785		銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	483.93	674.48	842	136,216		資本市場
SSE PLC	999.67	1,315.74	2,275	368,096		電力
BP PLC	19,568.09	23,470.86	13,146	2,126,501		石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	924.78	1,288.93	980	158,666		ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	354	516.95	916	148,177		コンゴロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	76.48	89.36	1,064	172,157		機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,427.25	3,198.02	2,307	373,292		銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	69,189.54	84,778.63	4,552	736,430		銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	3,467.94	5,698.63	679	109,971		家庭用耐久財
TESCO PLC	8,098.05	9,342.47	2,296	371,462		食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	1,019.75	1,247.51	2,047	331,250		資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	880.29	1,076.79	1,239	200,570		ヘルスケア機器・用品
GSK PLC	4,896.01	4,995.5	7,343	1,187,865		医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	317.95	414.94	3,177	514,010		資本市場
WPP PLC	1,134.03	1,427.85	1,406	227,458		メディア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	1,508.4	1,930.29	22,233	3,596,423	医薬品
WHITBREAD PLC	187.44	254.7	778	125,990	ホテル・レストラン・レジャー
INTERTEK GROUP PLC	161.39	233.09	1,030	166,767	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	387.64	522.29	1,256	203,187	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	162.86	217.52	1,210	195,775	ホテル・レストラン・レジャー
SAINSBURY (J) PLC	1,828.62	1,920.97	507	82,158	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	200.87	213.25	474	76,683	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	105.59	164.89	696	112,611	家庭用耐久財
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	180.34	184.55	323	52,287	医薬品
AVEVA GROUP PLC	104.08	-	-	-	ソフトウェア
ABRDN PLC	2,063.13	2,858.31	611	98,945	資本市場
EXPERIAN PLC	893.61	1,127.09	3,346	541,302	専門サービス
MONDI PLC	458.75	588.87	870	140,883	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	353.12	369.42	350	56,638	資本市場
OCADO GROUP PLC	449.09	697.66	432	69,991	食品・生活必需品小売り
INFORMA PLC	1,515.66	1,861.95	1,235	199,929	メディア
GLENCORE PLC	9,681.28	12,257.76	6,323	1,022,934	金属・鉱業
ENTAIN PLC	581.26	744.51	982	158,970	ホテル・レストラン・レジャー
COCA-COLA HBC AG	202.33	213.38	434	70,344	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	565.61	862.23	544	88,147	保険
FERGUSON PLC	216.07	-	-	-	商社・流通業
M&G PLC	2,591.17	2,704.01	541	87,611	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	2,354.9	2,521.8	449	72,733	専門小売り
HALEON PLC	-	6,227.66	2,043	330,523	パーソナル用品
SHELL PLC	7,503.11	9,059.72	23,197	3,752,413	石油・ガス・消耗燃料
AUTO TRADER GROUP PLC	1,046.24	1,108.33	670	108,466	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,701.29	4,872.07	689	111,517	コングロメリット
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	284,167.37 79銘柄	351,435.94 77銘柄	237,063 -	38,347,464 <4.5%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	1,077.44	1,467.03	4,442	167,607	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,436.45	1,803.43	5,345	201,686	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	-	2,877.73	1,576	59,501	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	21.98	36.62	2,123	80,125	航空宇宙・防衛
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	-	125.74	1,805	68,128	半導体・半導体製造装置
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,061.43	1,629.44	2,916	110,050	銀行
ICL GROUP LTD	680.48	1,030.67	2,754	103,948	化学
NICE LTD	61.29	76.4	5,898	222,541	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	167.84	174.4	1,993	75,212	銀行
AZRIELI GROUP	44.14	46.72	1,000	37,759	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,551.05 8銘柄	9,268.18 10銘柄	29,857 -	1,126,561 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,530.13	4,515.99	1,256	181,054	資本市場
LOGITECH INTL-REG	180.08	237.34	1,270	183,059	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	2,745.36	3,418.82	38,051	5,481,694	食品
CIE FINANCIER RICHEMONT	508.16	644.58	9,185	1,323,229	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	680.16	872.21	24,282	3,498,111	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	41.22	52.36	1,049	151,236	機械
SIKA INHABER	138.38	177.93	4,562	657,219	化学
SGS SA-REG	6.13	7.48	1,629	234,694	専門サービス

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
NOVARTIS AG-REG SHS	2,138.86	2,693.94	21,664	3,121,011	医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	42.59	56.75	862	124,184	保険	
BARRY CALLEBAUT AG	3.29	4.6	885	127,631	食品	
CLARIANT AG-REG	199.79	210.72	332	47,932	化学	
SWISSCOM AG-REG	24.19	34.31	1,954	281,536	各種電気通信サービス	
ABB LTD	1,605.91	1,945.38	6,052	871,862	電気設備	
ADECCO GROUP AG-REG	140.95	198.42	685	98,816	専門サービス	
GEBERIT AG	35.39	43.77	2,263	326,120	建設関連製品	
LONZA GROUP AG-REG	71.69	90.27	4,935	711,074	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDT & SPRUENGLI PART	1.1	1.37	1,397	201,309	食品	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.1	0.13	1,340	193,083	食品	
GIVAUDAN-REG	9.01	11.73	3,374	486,162	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	147.34	187.71	8,225	1,184,958	保険	
ROCHE HOLDING AG-BEARER	36.04	36.12	1,091	157,248	医薬品	
HOLCIM LTD	511.47	666.07	3,714	535,039	建設資材	
TEMENOS GROUP	67.53	70.82	495	71,355	ソフトウェア	
BACHEM HOLDING AG	5	46.73	417	60,217	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SONOVA HOLDING AG	52.1	69.84	1,601	230,702	ヘルスケア機器・用品	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	49.34	68.87	1,683	242,479	海運業	
STRAUMANN HOLDING AG	11.25	145.31	1,870	269,412	ヘルスケア機器・用品	
THE SWATCH GROUP AG-B	29.91	31.3	1,017	146,545	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	92.59	550	79,364	繊維・アパレル・贅沢品	
SCHINDLER NAMEN	14.94	27.2	521	75,155	機械	
SWISS LIFE HOLDING AG	30.53	39.78	2,183	314,501	保険	
BANQUE CANTONALE VAUD	-	49.03	412	59,366	銀行	
VIFOR PHARMA AG	52.56	-	-	-	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING	6.16	8.1	575	82,907	化学	
SWISS PRIME SITE AG	80.4	83.72	680	98,053	不動産管理・開発	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	21.76	28.52	2,655	382,509	資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	210.08	260.31	1,588	228,826	資本市場	
SWISS RE LTD	292.13	381.39	3,632	523,277	保険	
BKW AG	-	31.94	419	60,368	電力	
SIG GROUP AG	-	383.22	844	121,675	容器・包装	
ALCON INC	485.73	612.85	4,243	611,300	ヘルスケア機器・用品	
UBS GROUP AG	3,427.79	4,189.21	8,483	1,222,082	資本市場	
VAT GROUP AG	24.12	33.25	956	137,760	機械	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	16,704.59 41銘柄	22,761.98 43銘柄	174,900 -	25,196,133 <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	104.57	125.49	12,408	237,497	飲料	
A P MOLLER A/S	5.27	6.63	10,226	195,740	海運業	
AP MOLLER MAERSK A	3.41	3.59	5,463	104,580	海運業	
DANSKE BANK A/S	687.25	853.71	12,626	241,668	銀行	
GENMAB A/S	62.51	79.26	21,685	415,061	バイオテクノロジー	
NOVOZYMES-B SHS	191.32	238.59	8,259	158,096	化学	
ROCKWOOL AS	8.13	8.73	1,495	28,614	建設関連製品	
NOVO NORDISK A/S-B	1,640.82	2,063.49	205,110	3,925,822	医薬品	
GN STORE NORD A/S	104.48	-	-	-	ヘルスケア機器・用品	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	979.91	1,254.36	26,115	499,855	電気設備	
COLOPLAST-B	119.22	153.43	12,378	236,928	ヘルスケア機器・用品	
DSV A/S	198.61	238.42	30,505	583,881	航空貨物・物流サービス	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
DEMANT A/S	107.39	113.67	2,441	46,732	ヘルスケア機器・用品
TRYG A/S	357.84	448.87	7,085	135,614	保険
PANDORA A/S	92.65	124.73	7,902	151,261	繊維・アパレル・贅沢品
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	89.84	125.38	6,200	118,668	化学
AMBU A/S B	141.56	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
ORSTED A/S	192.05	232.4	14,545	278,408	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,086.83 18銘柄	6,070.75 16銘柄	384,453 —	7,358,435 <0.9%>
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	432.02	563.75	9,995	131,038	食品
NORSK HYDRO ASA	1,290.36	1,629.71	12,516	164,087	金属・鉱業
TELENOR ASA	674.35	859.54	9,897	129,757	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	75.37	—	—	—	メディア
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	111.85	4,637	60,795	航空宇宙・防衛
ORKLA ASA	694.4	1,160.68	8,059	105,663	食品
EQUINOR ASA	943.06	1,156.17	37,939	497,389	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	151.93	198.34	9,153	120,000	化学
AKER BP ASA	152.17	387.23	11,407	149,556	石油・ガス・消耗燃料
SALMAR ASA	—	72.48	3,254	42,664	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	294.84	257.21	4,740	62,146	保険
ADEVINTA ASA	222.65	243.82	2,156	28,272	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DNB BANK ASA	895.96	1,193.19	23,088	302,686	銀行
SCHIBSTED ASA	74.45	—	—	—	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,901.56 12銘柄	7,833.97 12銘柄	136,846 —	1,794,058 <0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	636.97	3,341.22	42,132	540,563	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	401.9	1,942.04	21,568	276,721	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,794.5	3,665.51	21,978	281,982	通信機器
GETINGE AB-B SHS	244.21	257.55	6,145	78,842	ヘルスケア機器・用品
INVESTOR AB-A SHS	557.33	584.37	12,184	156,322	各種金融サービス
LUNDBERGS B	73.82	78.59	3,887	49,870	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	322.28	465.94	9,290	119,201	機械
SANDVIK AB	1,143.71	1,333.5	28,736	368,694	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,664.38	1,958.37	24,469	313,947	銀行
SKANSKA AB-B SHS	319.68	439.37	8,424	108,091	建設・土木
SWEDBANK AB	893.78	1,122.96	22,863	293,338	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	543.82	702.11	10,675	136,967	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,340.2	1,844.99	19,510	250,323	銀行
VOLVO AB-A SHS	236.91	241.98	5,192	66,624	機械
VOLVO AB-B SHS	1,342.82	1,916.25	39,350	504,862	機械
HOLMEN AB-B SHS	—	101.42	4,404	56,511	紙製品・林産品
SWEDISH MATCH AB	1,583.29	—	—	—	タバコ
TELE2 AB-B SHS	460.83	644.16	6,022	77,273	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	142.73	152.92	4,388	56,308	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	119.4	213.25	6,096	78,222	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	252.19	269.07	3,426	43,959	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	483.54	760.85	7,048	90,432	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	1,694.19	2,263.92	46,150	592,104	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	662.7	822.87	10,511	134,860	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	1,010.25	1,246.12	31,738	407,207	建設関連製品

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TELIA CO AB	2,699.54	3,448.1	9,092	116,658	各種電気通信サービス
ORRON ENERGY AB	207.62	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BOLIDEN AB	240.47	362.6	15,936	204,462	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	279.3	353.13	12,197	156,488	機械
KINNEVIK AB-B	214.49	362.78	5,918	75,937	各種金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER	114.01	729.42	4,212	54,045	不動産管理・開発
INDUTRADE AB	—	391.78	9,242	118,576	機械
HUSQVARNA AB-B SHS	451.58	477.69	4,326	55,514	機械
NIBE INDUSTRIER AB	1,340.88	1,858.45	21,400	274,562	建設関連製品
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	—	183.8	4,466	57,303	バイオテクノロジー
HEXAGON AB-B SHS	1,852.43	2,481.63	29,531	378,887	電子装置・機器・部品
SAGAX AB	183.48	280.22	7,577	97,214	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	593.63	845.63	17,301	221,979	機械
EPIROC AB-B	389.43	412.05	7,293	93,572	機械
ESSITY AB-B	576.54	751.8	20,907	268,243	家庭用品
EQT AB	300.03	407.16	10,007	128,402	資本市場
EMBRACER GROUP AB	491.42	797.91	4,016	51,533	娯楽
VOLVO CAR AB	—	637.1	3,147	40,379	自動車
LIFCO AB	257.38	268.35	5,825	74,746	コンプロマリット
EVOLUTION AB	161.47	223.26	29,648	380,395	ホテル・レストラン・レジャー
NORDEA BANK ABP	3,102.72	4,203.56	52,779	677,166	銀行
INVESTMENT AB LATOUR	149.45	155.39	3,653	46,870	コンプロマリット
SINCH AB	562.99	—	—	—	ソフトウェア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	674,682	8,656,179	
			45銘柄	<1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	755.8	907.48	3,966	565,715	建設資材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	175.84	199.53	2,893	412,626	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY GROUP PLC-A	149.68	207.61	1,766	251,975	食品
KINGSPAN GROUP PLC	143.07	174.51	1,044	148,933	建設関連製品
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	242.28	324.22	1,192	170,025	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	1,345.37	1,329	189,650	銀行
AIB GROUP PLC	—	1,475.78	580	82,843	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	12,773	1,821,770	
			7銘柄	<0.2%>	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	575.35	733.77	8,510	1,213,733	航空宇宙・防衛
KONINKLIJKE DSM NV	168.59	222.01	2,630	375,207	化学
ING GROEP NV-CVA	3,804.32	4,707.18	6,145	876,498	銀行
ASM INTERNATIONAL NV	42.71	59.78	1,940	276,705	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	112.39	155.84	921	131,488	専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,063.9	1,258.84	3,459	493,364	食品・生活必需品小売り
HEINEKEN NV	245.94	320.26	2,921	416,651	飲料
AKZO NOBEL	187.17	226.27	1,565	223,248	化学
ASML HOLDING NV	403.14	506.05	31,430	4,482,655	半導体・半導体製造装置
AEGON NV	1,893.23	2,324.33	1,195	170,521	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	886.59	1,155.12	1,829	260,986	ヘルスケア機器・用品
WOLTERS KLUWER-CVA	266.29	320.47	3,280	467,795	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	650.99	869.19	3,963	565,337	半導体・半導体製造装置
QIAGEN N.V.	204.27	274.12	1,240	176,865	ライフサイエンス・ツール/サービス
KONINKLIJKE KPN NV	3,414.47	4,757.39	1,500	213,930	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEINEKEN HOLDING NV-A	106.67	108.53	831	118,565	飲料	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	553.04	577.75	593	84,664	飲料	
OCI NV	-	123.29	360	51,344	化学	
FERRARI NV	120.5	154.35	3,792	540,869	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV	1,061.55	1,246.04	1,885	268,875	機械	
PROSUS NV	906.79	1,025.26	7,618	1,086,580	インターネット販売・通信販売	
JDE PEET'S BV	73.08	143.85	395	56,336	食品	
EXOR NV	-	141.42	1,072	153,004	各種金融サービス	
EURONEXT NV	96.19	100.81	776	110,706	資本市場	
IMCD NV	53.59	68.23	1,031	147,132	商社・流通業	
NN GROUP NV	281.24	362.89	1,449	206,762	保険	
ARGENX SE	42.55	67.53	2,358	336,319	バイオテクノロジー	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	679.41	925.02	2,096	298,945	娯楽	
STELLANTIS NV	1,962.48	2,806.95	4,372	623,549	自動車	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	160.29	226.7	476	67,994	インターネット販売・通信販売	
ABN AMRO BANK NV	343.82	528.35	853	121,733	銀行	
EXOR NV	99.66	-	-	-	各種金融サービス	
ADYEN NV	19.2	25.93	3,550	506,348	情報技術サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,479.41 31銘柄	26,523.52 32銘柄	106,049 -	15,124,722 <1.8%>	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UMICORE	177.49	242.9	781	111,409	化学	
DIETEREN TRDG	-	27.36	498	71,056	販売	
KBC GROUPE	265.87	322.13	2,279	325,086	銀行	
SOFINA	13.82	22.81	531	75,733	各種金融サービス	
SOLVAY SA	69.31	90.7	979	139,704	化学	
AGEAS	170.55	181.36	792	113,058	保険	
UCB SA	127.78	167.32	1,299	185,321	医薬品	
COLRUYT NV	46.73	-	-	-	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	107.14	113.18	896	127,874	各種金融サービス	
PROXIMUS	137.39	-	-	-	各種電気通信サービス	
ELIA GROUP	28.62	40.78	530	75,666	電力	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	740.93	1,053.27	5,762	821,839	飲料	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,885.63 11銘柄	2,261.81 10銘柄	14,351 -	2,046,752 <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)	639.79	668.78	1,862	265,589	金属・鉱業	
EUROFINS SCIENTIFIC	139.43	178.24	1,203	171,588	ライフサイエンス・ツール/サービス	
TENARIS SA	529.85	558.55	904	129,010	エネルギー設備・サービス	
AROUNDTOWN SA	1,060.18	1,132.25	292	41,662	不動産管理・開発	
INPOST SA	203.95	-	-	-	航空貨物・物流サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,573.2 5銘柄	2,537.82 4銘柄	4,262 -	607,850 <0.1%>	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AIR LIQUIDE	465.78	653.17	9,434	1,345,532	化学	
AXA SA	1,895.06	2,280.92	6,436	918,010	保険	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	674.38	837.2	2,349	335,040	総合公益事業	
DASSAULT AVIATION SA	29.5	31.2	498	71,062	航空宇宙・防衛	
DANONE	632.31	791.5	4,010	571,981	食品	
SAFRAN SA	333.08	425.57	5,522	787,575	航空宇宙・防衛	
ACCOR SA	173.8	183.05	551	78,659	ホテル・レストラン・レジャー	

銘柄	期首(前期末)	当期			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BOUYGUES	202.22	291.23	898	128,177	建設・土木
BNP PARIBAS	1,099.14	1,390.23	8,950	1,276,491	銀行
THALES SA	104.48	128.86	1,642	234,227	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	155.19	198.39	3,669	523,304	情報技術サービス
EIFFAGE	84.77	117.84	1,213	173,021	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	253.45	294.05	2,203	314,278	メディア
FAURECIA	107.74	—	—	—	自動車部品
L'OREAL	245.54	301.22	11,679	1,665,773	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	270.69	344.54	27,924	3,982,658	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	708.07	1,148.08	586	83,588	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	162.26	869.08	2,559	364,965	自動車部品
PERNOD-RICARD	204.47	248.88	4,657	664,293	飲料
RENAULT SA	190.19	279.02	1,174	167,532	自動車
REMY COINTREAU	18.47	28.66	473	67,484	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	491.74	614.6	3,243	462,639	建設関連製品
SEB SA	24.39	25.96	252	35,987	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	788.64	1,004.09	2,661	379,631	銀行
VINCI S.A.	523.44	667.67	7,185	1,024,790	建設・土木
SODEXO	93.25	98.22	846	120,666	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	528.92	678.65	10,280	1,466,160	電気設備
VIVENDI SE	687.46	989.44	965	137,698	メディア
TOTALENERGIES SE	2,445.35	3,100.9	18,599	2,652,617	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	253.93	265.7	548	78,251	自動車部品
ORANGE	1,917.27	2,554.81	2,535	361,634	各種電気通信サービス
HERMES INTL	30.76	39.16	6,706	956,431	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	645.96	819	3,100	442,226	ソフトウェア
KERING	72.93	93.82	5,267	751,187	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	—	—	—	保険
CARREFOUR SA	611.89	755.72	1,240	176,976	食品・生活必需品小売り
SANOFI	1,108.56	1,424.61	12,552	1,790,200	医薬品
UBISOFT ENTERTAINMENT	71.51	110.32	219	31,310	娯楽
TELEPERFORMANCE	59.18	78.45	2,020	288,216	専門サービス
EURAZEO	30.08	56.73	366	52,226	各種金融サービス
ESSILORLUXOTTICA	278.64	356.82	6,115	872,248	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,149.26	1,437.2	1,661	237,031	銀行
ORPEA	49.32	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WENDEL	22.2	54.49	546	77,946	各種金融サービス
BIOMERIEUX	46.12	48.7	470	67,080	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	24.56	31.09	1,065	151,955	ライフサイエンス・ツール/サービス
ENGIE	1,774.63	2,217.51	2,935	418,729	総合公益事業
ALSTOM	285.33	370.07	995	141,976	機械
ELECTRICITE DE FRANCE	415.49	—	—	—	電力
IPSEN SA	36.46	38.73	408	58,219	医薬品
ARKEMA SA	60.09	63.92	583	83,231	化学
LEGRAND SA	259.78	327.83	2,858	407,611	電気設備
ADP	23.13	39.75	571	81,493	運送インフラ
BUREAU VERITAS SA	298.1	397.29	1,030	146,923	専門サービス
GETLINK	415.25	635.09	1,055	150,538	運送インフラ
EDENRED	248.65	310.91	1,593	227,208	情報技術サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	80.92	172.93	665	94,904	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDLINE SA	235.7	299.16	1,210	172,584	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AMUNDI SA	59.24	104.36	661	94,363	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,298.59 59銘柄	31,126.39 55銘柄	199,457 -	28,446,562 <3.3%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	184.33	219.74	3,050	435,052	繊維・アパレル・贅沢品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	329.21	415.77	4,063	579,570	自動車
COMMERZBANK AG	1,062.15	1,410.36	1,420	202,654	銀行
FRESENIUS SE & CO KGAA	388.3	489.48	1,385	197,561	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET	98.82	100.1	196	28,074	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	-	-	-	化学
HANNOVER RUECK SE	53.21	71.05	1,273	181,687	保険
GEA GROUP AG	164.92	174.9	720	102,795	機械
CONTINENTAL AG	97.95	129.21	883	125,973	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	959.37	1,247.72	5,118	729,950	航空貨物・物流サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	159.12	168.54	931	132,829	自動車
MERCK KGAA	123.64	162.3	3,051	435,167	医薬品
RWE AG	644.26	778.53	3,070	437,917	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SAP SE	1,015.97	1,300.68	14,294	2,038,677	ソフトウェア
E.ON SE	2,086.41	2,802.87	2,812	401,144	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	103.66	133.76	851	121,424	家庭用品
SIEMENS AG-REG	746.31	953.29	13,824	1,971,666	コングロマリット
PUMA AG	104.48	162.1	988	141,024	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	948.61	1,213.29	7,335	1,046,196	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	175	196.44	1,315	187,652	家庭用品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	827.56	995.29	7,114	1,014,646	自動車
BASF SE	895.92	1,164.08	5,943	847,703	化学
BEIERSDORF AG	103.42	129.4	1,461	208,449	パーソナル用品
HEIDELBERGCEMENT AG	140.32	208.09	1,308	186,554	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	188.36	238.55	890	127,072	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	401.57	509.4	11,214	1,599,403	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	702.48	723.42	697	99,439	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	135.09	176.12	5,722	816,091	保険
RHEINMETALL STAMM	-	55.96	1,324	188,910	航空宇宙・防衛
VOLKSWAGEN AG	31.53	33.15	556	79,404	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	179.03	222.69	2,899	413,515	自動車
NEMETSCHEK SE	48.41	98.78	507	72,355	ソフトウェア
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,132.85	2,537.16	2,930	418,008	資本市場
BMW VORZUG	69.57	78.21	703	100,277	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,241.17	4,033.92	8,273	1,179,976	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	26.86	28.47	1,251	178,535	ライフサイエンス・ツール/サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,266.18	1,590.23	5,699	812,846	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4.79	5.16	318	45,369	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG	35.01	48.66	649	92,612	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	75.33	81.39	328	46,907	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	196.7	238.84	4,088	583,164	資本市場
LANXESS AG	71.94	-	-	-	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	48.07	72.94	1,590	226,778	航空宇宙・防衛
SYMRISE AG	121.06	172.65	1,647	234,955	化学
BRENNTAG SE	163.1	179.34	1,267	180,781	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	233.4	246.87	496	70,769	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	983.85	1,054.74	292	41,713	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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LEG IMMOBILIEN SE	61.13	82.09	588	83,920	不動産管理・開発
KION GROUP AG	75.08	—	—	—	機械
VONOVIA SE	700.86	859.37	2,226	317,561	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	68.6	103.42	650	92,716	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	284.75	343.18	1,756	250,497	ヘルスケア機器・用品
DR ING HC F PORSCHE AG	—	151.74	1,732	247,142	自動車
SIEMENS ENERGY AG	357.61	590.14	1,121	159,914	電気設備
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	378.31	566.93	1,760	251,016	機械
ZALANDO SE	208.57	313.21	1,241	177,027	インターネット販売・通信販売
SCOUT24 SE	96.7	100.48	525	75,005	インタラクティブ・メディアおよびサービス
COVESTRO AG	191.58	275.58	1,147	163,658	化学
HELLOFRESH SE	169.9	178.56	387	55,287	食品・生活必需品小売り
UNIPER SE	104.27	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	166.45	225.64	947	135,159	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	149,853	21,372,171	
	<比率>	<比率>	—	<2.5%>	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	331.35	346.44	671	95,705	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,686.36	3,179.56	1,469	209,547	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	382.82	594.06	683	97,433	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	2,823	402,687	
	<比率>	<比率>	—	<0.0%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	5,945.92	7,795.92	8,380	1,195,243	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	212.06	—	—	—	電気設備
REPSOL SA	1,502.89	1,787.13	2,756	393,153	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	5,375.23	6,649.75	2,435	347,299	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	286.39	377.01	697	99,446	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	228.77	235.71	645	92,043	建設・土木
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	6,440.62	7,351.18	5,053	720,792	銀行
ACCIONA S.A.	—	26.42	490	69,896	電力
NATURGY ENERGY GROUP SA	162.89	176.77	464	66,279	ガス
BANCO SANTANDER SA	16,741.54	20,668.57	7,233	1,031,713	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	462.37	490.11	794	113,272	電力
INDITEX	1,042.55	1,363.21	3,856	550,017	専門小売り
ENAGAS	234.77	382.7	645	92,050	ガス
GRIFOLS SA	306.87	319.82	433	61,805	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	464.37	635.13	1,743	248,648	建設・土木
CAIXABANK	4,097.23	5,660.59	2,263	322,844	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	279.72	396.88	765	109,243	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMADEUS IT GROUP SA	467.67	547.12	3,228	460,378	情報技術サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	—	98.22	365	52,194	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AENA SME SA	70.76	99.89	1,405	200,516	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	487.6	695.72	2,678	382,010	各種電気通信サービス
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	46,338	6,608,848	
	<比率>	<比率>	—	<0.8%>	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	1,117.77	1,446.13	2,639	376,400	保険
INTESA SANPAOLO	15,981.58	20,509.73	5,131	731,859	銀行
UNICREDIT SPA	2,056.36	2,411.49	4,563	650,915	銀行
ENI SPA	2,418.13	3,151.96	4,673	666,476	石油・ガス・消耗燃料

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MEDIOBANCA SPA	574.42	867.92	903	128,857	銀行
ENEL SPA	7,880.51	10,193.43	5,484	782,137	電力
SNAM SPA	1,989.63	2,564.15	1,230	175,498	ガス
TELECOM ITALIA SPA	8,325.8	9,082.86	268	38,343	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	457.18	—	—	—	運送インフラ
TERNA SPA	1,671.4	1,660.64	1,225	174,740	電力
RECORDATI SPA	103.03	109.08	447	63,861	医薬品
AMPLIFON SPA	113.72	123	336	47,960	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA	218.22	307.28	1,139	162,456	電気設備
DIASORIN ITALIA SPA	22.23	24.29	286	40,912	ヘルスケア機器・用品
MONCLER SPA	228.55	250.14	1,418	202,277	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA	435.86	835.76	651	92,972	情報技術サービス
FINECOBANK SPA	652.74	751.8	1,250	178,309	銀行
POSTE ITALIANE SPA	557.49	588.89	600	85,583	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	232.81	418.79	440	62,833	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	45,037.43 19銘柄	55,297.34 18銘柄	32,691 4,662,399 <0.5%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KESKO OYJ-B	238.04	352.52	717	102,262	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ	486.12	509.56	480	68,531	機械
UPM-KYMMENE OYJ	559.82	677.58	2,362	336,971	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	555.48	749.6	1,040	148,334	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	499.85	583.96	2,647	377,528	保険
FORTUM OYJ	408.2	541.94	783	111,686	電力
NOKIA OYJ	5,106.9	6,795.69	2,964	422,862	通信機器
ELISA OYJ	136.42	202.42	1,074	153,237	各種電気通信サービス
NESTE OYJ	432.9	505.99	2,342	334,120	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	319.56	438.14	2,149	306,501	機械
ORION OYJ	81.06	135.59	632	90,269	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,824.35 11銘柄	11,492.99 11銘柄	17,194 2,452,304 <0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	170.07	172.58	811	115,682	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	69.16	73.2	570	81,325	電力
VOEST-ALPINE AG	98.75	105.93	351	50,157	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	315.46	456.86	1,634	233,133	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	195.72	—	—	—	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	849.16 5銘柄	808.57 4銘柄	3,367 480,299 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,063,294.07 1,228銘柄	1,372,550.07 1,212銘柄	— 817,729,794 <95.5%>	

(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) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率	
不動産ファンド (アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13.788	18.835	3,109	412,881		0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	14.801	18.531	1,340	178,009		0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	150.15	58.993	1,280	170,069		0.0	
PROLOGIS INC	72.03	115.173	14,711	1,953,479		0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13.356	16.932	3,049	404,891		0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	10.44	13.271	1,622	215,435		0.0	
EQUINIX INC	8.702	11.399	8,303	1,102,589		0.1	
DUKE REALTY TRUST	35.306	—	—	—		—	
CROWN CASTLE INC	42.028	54.164	7,530	1,000,036		0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6.132	8.345	1,993	264,655		0.0	
EQUITY RESIDENTIAL	34.397	46.054	3,053	405,458		0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49.946	68.971	1,789	237,575		0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	10.551	13.584	3,901	518,092		0.1	
WELLTOWER INC	40.744	58.944	4,465	592,908		0.1	
KIMCO REALTY	—	79.991	1,713	227,523		0.0	
IRON MOUNTAIN INC	28.44	34.514	1,835	243,775		0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16.573	20.486	1,468	195,048		0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	75.616	91.777	1,700	225,826		0.0	
MID AMERICA	11.699	13.578	2,320	308,082		0.0	
REALTY INCOME CORP	53.267	76.685	5,038	669,125		0.1	
REGENCY CENTERS CORP	14.665	19.311	1,269	168,603		0.0	
UDR INC	28.289	41.516	1,853	246,151		0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	31.871	40.894	5,128	681,015		0.1	
PUBLIC STORAGE	15.276	19.317	5,812	771,788		0.1	
SUN COMMUNITIES INC	11.066	14.694	2,335	310,087		0.0	
VENTAS INC	40.408	48.092	2,444	324,671		0.0	
VORNADO REALTY TRUST	15.123	—	—	—		—	
WEYERHAEUSER CO	72.184	89.893	2,945	391,171		0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	13.998	16.256	2,600	345,295		0.0	
DIGITAL REALTY TRUST INC	27.36	36.258	4,090	543,242		0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	54.08	72.327	875	116,212		0.0	
AGNC INVESTMENT CORP	44.32	—	—	—		—	
AMERICAN TOWER CORP	44.301	58.087	12,497	1,659,532		0.2	
WP CAREY INC	19.446	23.664	1,982	263,296		0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	42.371	870	115,623		0.0	
AMERICAN HOMES 4 RENT	—	42.177	1,443	191,711		0.0	
INVITATION HOMES INC	55.207	76.646	2,533	336,478		0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	—	30.095	1,600	212,563		0.0	
VICI PROPERTIES INC	57.882	120.602	4,122	547,383		0.1	
小計	□数 銘柄数<比率>	1,233.442 35銘柄<1.8%>	1,612.427 36銘柄<1.9%>	124,635 —	16,550,295 —	— 1.9	
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%	
CANADIAN APT PPTYS REIT	8.22	8.722	431	42,984		0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13.467	14.424	320	31,881		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	21.687 2銘柄<0.0%>	23.146 2銘柄<0.0%>	752 —	74,865 —	— 0.0	

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%	%	
MIRVAC GROUP	414.125	432.802	960	89,058	0.0	0.0	
GPT GROUP	207.292	219.223	1,008	93,470	0.0	0.0	
STOCKLAND	243.481	259.328	1,011	93,744	0.0	0.0	
DEXUS	101.202	163.989	1,393	129,201	0.0	0.0	
GOODMAN GROUP	158.185	214.602	4,268	395,641	0.0	0.0	
VICINITY CENTRES	371.711	545.645	1,096	101,657	0.0	0.0	
SCENTRE GROUP	479.376	647.197	1,922	178,166	0.0	0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	1,975.372 7銘柄<0.1%>	2,482.786 7銘柄<0.1%>	11,661 -	1,080,940 -	- 0.1	
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円	%	%	
LINK REIT	199.7	262.516	14,175	239,855	0.0	0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	199.7 1銘柄<0.0%>	262.516 1銘柄<0.0%>	14,175 -	239,855 -	- 0.0	
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	545.177	787.231	1,542	154,281	0.0	0.0	
CAPLAND ASCENDAS REIT	248.606	440.678	1,225	122,496	0.0	0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	484.5	474.1	787	78,692	0.0	0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	192.3	405.5	701	70,144	0.0	0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	1,470.583 4銘柄<0.0%>	2,107.509 4銘柄<0.0%>	4,256 -	425,615 -	- 0.0	
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%	%	
BRITISH LAND CO PLC	75.77	119.111	533	86,260	0.0	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	74.028	77.092	541	87,641	0.0	0.0	
SEGRO PLC	120.36	165.081	1,370	221,692	0.0	0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	270.158 3銘柄<0.1%>	361.284 3銘柄<0.0%>	2,445 -	395,594 -	- 0.0	
(ベルギー)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	%	
WAREHOUSES DE PAUW	-	27.206	806	115,006	0.0	0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	- 1銘柄<-%>	27.206 1銘柄<0.0%>	806 -	115,006 -	- 0.0	
(フランス)	千□	千□	千ユーロ	千円	%	%	
GECINA SA	4.763	5.045	556	79,362	0.0	0.0	
KLEPIERRE	17.099	25.279	607	86,707	0.0	0.0	
COVIVIO	4.663	5.066	323	46,168	0.0	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12.92	13.535	822	117,269	0.0	0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	39.445 4銘柄<0.0%>	48.925 4銘柄<0.0%>	2,310 -	329,508 -	- 0.0	
合計	□数 銘柄数<比率>	5,210.387 56銘柄<2.1%>	6,925.799 58銘柄<2.2%>	- -	19,211,682 -	- 2.2	

(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。

(3) 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	S & P 5 0 0 E M I N I F U T			百万円 14,918		百万円 -
	S & P / T S E 6 0 I X F U T			770		-
	S P I 2 0 0 F U T U R E S			767		-
国	FTSE 1 0 0 I N D E X F U T U R E			949		-
	D J E U R O S T O X X 5 0			3,157		-

(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

2023年2月15日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
株 式	千円	%		
	817,729,794	95.5		
投資信託受益証券、投資証券	19,211,682	2.2		
コール・ローン等、その他	19,565,080	2.3		
投資信託財産総額	856,506,557	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、856,083,494千円、100.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=132.79円、1カナダ・ドル=99.52円、1オーストラリア・ドル=92.69円、1香港・ドル=16.92円、1シンガポール・ドル=99.99円、1ニュージーランド・ドル=84.06円、1イギリス・ポンド=161.76円、1イスラエル・シケル=37.731円、1スイス・フラン=144.06円、1デンマーク・クローネ=19.14円、1ノルウェー・クローネ=13.11円、1スウェーデン・クローナ=12.83円、1ユーロ=142.62円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	858,116,339,350円
株 式 (評 価 額)	12,369,982,821
信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	817,729,794,487
資 信 託 受 益 証 券 (評 価 額)	1,506,555,624
収 入 配 当 金	17,705,126,582
入 委 託 証 拠	2,253,291,522
(B) 負 債	828,275,858
未 払 金	5,723,312,456
未 払 債 権	1,894,762,474
純 資 産	1,620,859,674
元 本	273,902,800
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	856,221,576,876
元 次 受 取 益 権 越 損 益	137,221,085,885
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	719,000,490,991
	137,221,085,885口
	62,397円

(注1) 期首元本額 113,101,593,550円
 追加設定元本額 64,603,879,550円
 一部解約元本額 40,484,387,215円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M 外国株式パッシブ・ファンド	3,359,545,916円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	1,537,466円
M I T O ラップ型ファンド (中立的型)	8,392,849円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	27,472,521円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	20,134,515円
グローバル8資産ラップファンド (中立的型)	14,285,405円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	21,312,714円
たわらノーロード 先進国株式	43,143,503,610円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	371,248,659円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,124,755,370円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	812,932,249円
たわらノーロード バランス (堅実型)	86,757,879円
たわらノーロード バランス (標準型)	734,327,287円
たわらノーロード バランス (積極型)	932,352,496円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,133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)	72,512,085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)	283,171,883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)	250,978,945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)	420,410,827円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	9,144円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	661,599円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	20,654,116円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,497,348円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	11,796,669円
たわらノーロード 全世界株式	612,427,800円
D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,311,292,707円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,776,530,848円
One グローバルバランス	5,702,978円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1安定型	154,579,488円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	796,155,072円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3成長型	1,045,740,545円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	93,160,102円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	255,168,934円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	248,526,364円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	629,832,963円
マネックス資産設計ファンド エコリノベーション	123,209,993円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	166,603,009円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	197,017,429円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	318,946,273円
投資のソムリエ	5,236,697,696円
クルーズコントロール	101,484,005円
投資のソムリエ<DC年金>	385,311,092円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	204,497,778円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	236,289,352円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	318,178,644円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,347,351,737円
ワールドアセットバランス (基本コース)	144,201,865円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	187,755,370円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	21,116,295円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	10,603,461円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,240,319円

投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	42,119,092円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,118,314円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	279,203,327円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,235,864円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	22,279,679円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	11,365,527円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	6,977,782円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	103,657,985円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	1,508,385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)	39,207,354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)	39,983,263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)	24,499,490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)	38,551,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド112021-04 (適格機関投資家限定)	98,803,834円
インカム重視マルチアセット運用ファンド112021-09 (適格機関投資家限定)	34,816,455円
MS C I コア・インデックス<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	381,034,312円
D I A M 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家専用)	40,471,840円
D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,108,533,199円
D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	201,337,819円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	1,060,739,400円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	140,711,864円
AM One マチアセット・インカム戦略ファンド (シグナル投資型) (適格機関投資家限定)	1,328,457円
D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	7,043,021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)	66,464,123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)	2,713,784円
しあわせの歩み・私募 (適格機関投資家限定)	3,660,019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)	25,277,114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)	49,829,008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)	1,710,694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)	15,007,497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)	1,142,119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)	33,882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)	3,280,399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)	22,060,605円
D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	154,952,415円
D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	252,239,956円
D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	852,113,757円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	43,996,613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)	35,704,735円
D I A M アジア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	248,901,994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)	9,152,563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)	164,151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)	102,331,680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)	8,974,317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)	30,241,885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)	45,713,631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)	95,203,048円
動的パッケージファンド<DC年金>	9,995,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
M H A M 外国株式インデックスファンド (ファンドラップ)	3,688,753,509円
M H A M 外国株式インデックスファンド	140,194,556円
M H A M 外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	6,728,106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)	1,261,770,351円
M H A M 外国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	1,390,845,054円
期末元本合計	137,221,085,885円

■損益の状況

当期 自2022年2月16日 至2023年2月15日

項	目	当 期
(A) 配	当 等 収 益	13,816,691,400円
受	取 配 当 金	13,694,195,113
受	取 利 息	30,845,985
そ	の 他 収 益	92,260,263
支	払 利 息	△609,961
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益	54,267,691,472
売	買 損 益	136,086,810,742
売	買 損	△81,819,119,270
(C) 先	物 取 引 等 取 引 損 益	102,052,001
取	引 益	5,493,726,731
取	引 損	△5,391,674,730
(D) そ	の 他 費 用	△165,932,544
(E) 当	期 損 益 金(A + B + C + D)	68,020,502,329
(F) 前	期 繰 越 損 益 金	529,540,902,616
(G) 解	約 差 損 益 金	△195,178,469,975
(H) 追	加 信 託 差 損 益 金	316,617,556,021
(I) 合	計(E + F + G + H)	719,000,490,991
次	期 繰 越 損 益 金(I)	719,000,490,991

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第20期 (決算日 2023年2月14日)

(計算期間 2022年2月15日～2023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20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入 比率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率				
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	百万円 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
20期 (2023年2月14日)	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	—	—	554,514

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません (以下同じ)。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

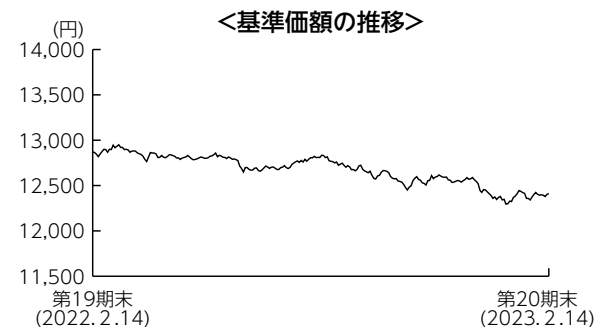
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比	債券先物率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2022年2月14日	円 12,872	% -	ポイント 381.31	% -	% 99.6	% -	% -
2月 末	12,900	0.2	382.13	0.2	99.8	-	-
3月 末	12,864	△0.1	381.04	△0.1	99.6	-	-
4月 末	12,832	△0.3	380.12	△0.3	99.2	-	-
5月 末	12,812	△0.5	379.54	△0.5	86.5	-	-
6月 末	12,694	△1.4	376.08	△1.4	99.6	-	-
7月 末	12,777	△0.7	378.55	△0.7	99.3	-	-
8月 末	12,747	△1.0	377.67	△1.0	99.4	-	-
9月 末	12,612	△2.0	373.60	△2.0	103.4	-	-
10月 末	12,598	△2.1	373.25	△2.1	99.4	-	-
11月 末	12,538	△2.6	371.33	△2.6	99.6	-	-
12月 末	12,374	△3.9	366.60	△3.9	99.6	-	-
2023年1月 末	12,341	△4.1	365.59	△4.1	99.4	-	-
(期末) 2023年2月14日	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月15日から2023年2月14日まで）

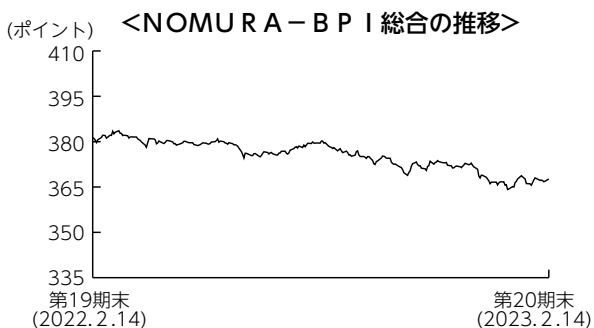


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,411円となり、前期末比で3.6%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初から2022年12月中旬にかけては、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢などを背景に基準価額は下落基調となりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行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基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2022年12月中旬にかけては、ウクライナ情勢を巡る不透明感などが意識された一方、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢が観測されたことなどを背景に、利回りは横ばいとなりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行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。

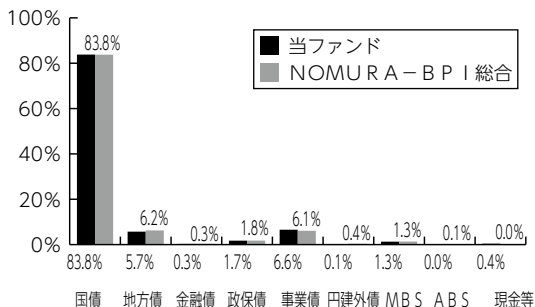
ポートフォリオについて

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。

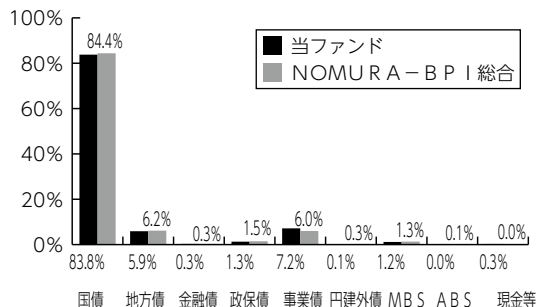
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

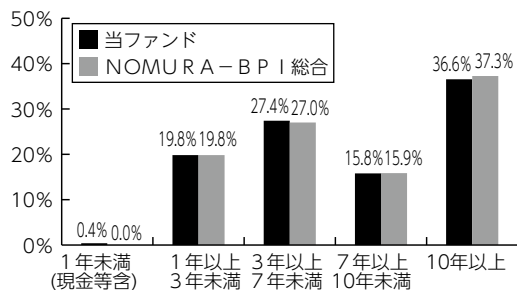


期末

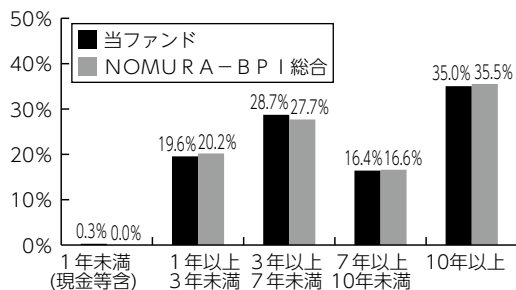


○残存年限別構成比

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3.6%下落しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は12,671円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年2月15日から2023年2月14日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	1,481,029,349	1,452,519,943 (-)
	地 方 債 証 券	6,447,190	4,140,237 (-)
	特 殊 債 券	7,637,720	3,833,526 (369,528)
	社 債 券	3,368,168	4,648,915 (-)

(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 (2022年2月15日から2023年2月14日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期			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 1,498,482	百万円 96,387	% 6.4	百万円 1,465,142	百万円 110,127	% 7.5
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

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

■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	469,265,000	464,530,535	83.8	—	52.3	20.8	10.7
地 方 債 証 券	32,839,330	32,767,927	5.9	4.9	3.9	1.4	0.5
特 殊 債 券	28,478,559	28,511,051	5.1	—	3.4	1.6	0.1
金 融 債 券	1,700,000	1,693,591	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 券	26,381,000	25,503,782	4.6	0.1	2.2	2.1	0.3
合 計	558,663,889	553,006,886	99.7	5.0	61.8	26.2	11.7

(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	
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,555,406	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	50,000	51,088	2024/03/20
4 3 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,720,000	3,724,166	2024/04/01
4 3 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	6,100,000	6,107,320	2024/05/01
4 3 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,850,000	3,854,966	2024/06/01
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	6,990,000	7,007,824	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	4,420,000	4,460,973	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	50,000	51,673	2024/06/20
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	40,000	41,230	2024/06/20
4 3 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,800,000	3,804,940	2024/07/01
4 3 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,300,000	1,301,703	2024/08/01
4 4 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,700,000	1,702,363	2024/09/01
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,810,000	2,818,064	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	4,610,000	4,652,688	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	460,000	476,008	2024/09/20
4 4 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,100,000	1,101,518	2024/10/01
4 4 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,500,000	1,502,175	2024/11/01
4 4 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,500,000	2,503,800	2024/12/01
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,930,000	2,939,463	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	3,000,000	3,031,830	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,900,000	1,913,148	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	380,000	394,557	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	41,606	2024/12/20
4 4 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,100,000	3,104,650	2025/01/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,100,000	3,110,354	2025/03/20

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	
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	5,430,000	5,482,236	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	180,000	188,136	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	70,000	72,871	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	41,724	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,900,000	5,920,060	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	5,980,000	6,043,089	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	250,000	261,400	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	50,000	52,397	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	90,000	94,526	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,650,000	2,658,930	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,073,926	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	400,000	421,080	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	147,742	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,900,000	2,909,889	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	4,420,000	4,460,222	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	70,000	74,222	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	170,000	179,769	2025/12/20
1 4 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	4,250,000	4,251,275	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,520,000	4,534,644	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	590,000	628,385	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	120,000	128,548	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	120,000	128,178	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	3,310,000	3,309,437	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,690,000	4,704,070	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	590,000	635,140	2026/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
89回 利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	10,731	2026/06/20
149回 利付国庫債券(5年)	0.0050	5,010,000	5,003,687	2026/09/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,570,000	5,581,975	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	470,000	506,439	2026/09/20
91回 利付国庫債券(20年)	2.3000	110,000	118,922	2026/09/20
150回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,720,000	4,708,200	2026/12/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	6,080,000	6,086,992	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,160,000	1,250,271	2026/12/20
151回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,200,000	4,182,864	2027/03/20
152回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,030,000	1,029,783	2027/03/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,690,000	4,689,015	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	370,000	398,638	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	670,000	724,584	2027/03/20
153回 利付国庫債券(5年)	0.0050	5,310,000	5,280,157	2027/06/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,130,000	5,122,202	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	601,535	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	130,207	2027/06/20
154回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,300,000	4,287,229	2027/09/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,970,000	4,955,239	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	721,406	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	174,156	2027/09/20
155回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,300,000	1,306,851	2027/12/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,250,000	4,231,640	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	818,947	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,860,000	5,826,012	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	913,415	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	255,433	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,020,000	4,981,597	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	557,115	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	177,432	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	120,824	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,260,000	4,220,083	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	705,126	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	553,640	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,510,000	4,459,442	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	662,784	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	754,266	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,200,000	4,144,770	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	383,379	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	487,220	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,630,000	3,575,876	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	513,755	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	821,881	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,500,000	4,424,625	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	127,494	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,370,000	1,525,508	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,720,000	3,649,282	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	410,000	457,646	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	404,240	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	113,955	2030/02/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,750,000	3,676,200	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	597,214	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,070,000	1,198,303	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,952,629	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	618,336	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	516,746	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	670,000	727,084	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,200,000	5,060,744	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	640,000	708,665	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	626,965	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	236,836	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,620,000	4,482,185	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,050,000	1,179,916	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	669,696	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,360,000	5,189,230	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	680,634	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	570,368	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	599,713	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,899,698	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	370,000	411,810	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,400,000	5,211,270	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	1,007,897	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	232,188	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,330,000	4,176,198	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	830,000	914,352	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,030,000	1,143,403	2031/12/20
366回 利付国庫債券(10年)	0.2000	2,780,000	2,707,469	2032/03/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	1,000,422	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,840,000	2,028,452	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	360,000	393,746	2032/03/20
367回 利付国庫債券(10年)	0.2000	3,000,000	2,959,290	2032/06/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,880,000	2,075,783	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,020,000	1,107,577	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	900,000	985,716	2032/06/20
368回 利付国庫債券(10年)	0.2000	3,750,000	3,742,950	2032/09/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,450,000	1,601,235	2032/09/20
369回 利付国庫債券(10年)	0.5000	1,400,000	1,400,000	2032/12/20
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,060,000	1,170,547	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,530,000	1,703,808	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,730,000	1,893,692	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,450,000	1,573,409	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	276,240	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,850,000	3,149,136	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	263,446	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,340,000	2,584,810	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	170,340	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,890,000	3,161,688	2033/12/20
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	400,720	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,060,000	2,230,732	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	309,501	2034/06/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)					
149回	利付国庫債券(20年)	1.5000	2,640,000	2,855,925	2034/06/20
160回	利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	286,020	2034/09/20
150回	利付国庫債券(20年)	1.4000	2,700,000	2,888,730	2034/09/20
17回	利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	318,978	2034/12/20
151回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,660,000	2,782,626	2034/12/20
18回	利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	468,468	2035/03/20
152回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,548,994	2035/03/20
19回	利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	328,101	2035/06/20
153回	利付国庫債券(20年)	1.3000	2,700,000	2,848,446	2035/06/20
20回	利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	394,864	2035/09/20
154回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,530,000	2,635,222	2035/09/20
21回	利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	363,732	2035/12/20
155回	利付国庫債券(20年)	1.0000	2,680,000	2,721,808	2035/12/20
22回	利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	347,594	2036/03/20
156回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,240,000	2,103,897	2036/03/20
23回	利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	419,706	2036/06/20
157回	利付国庫債券(20年)	0.2000	2,060,000	1,875,918	2036/06/20
24回	利付国庫債券(30年)	2.5000	470,000	564,159	2036/09/20
158回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,480,000	2,344,220	2036/09/20
25回	利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	388,063	2036/12/20
159回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,460,000	2,350,333	2036/12/20
26回	利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	737,211	2037/03/20
160回	利付国庫債券(20年)	0.7000	2,380,000	2,297,485	2037/03/20
161回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,410,000	2,287,644	2037/06/20
27回	利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	746,039	2037/09/20
162回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,170,000	2,051,604	2037/09/20
163回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,240,000	2,110,528	2037/12/20
28回	利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	926,902	2038/03/20
164回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,540,000	2,348,839	2038/03/20
165回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,130,000	1,960,941	2038/06/20
29回	利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,022,419	2038/09/20
166回	利付国庫債券(20年)	0.7000	1,680,000	1,588,423	2038/09/20
167回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,850,000	1,688,828	2038/12/20
30回	利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,032,829	2039/03/20
168回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,890,000	1,690,642	2039/03/20
169回	利付国庫債券(20年)	0.3000	2,060,000	1,804,209	2039/06/20
31回	利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	834,062	2039/09/20
170回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,700,000	1,482,111	2039/09/20
171回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,940,000	1,683,551	2039/12/20
32回	利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,137,451	2040/03/20
172回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,480,000	1,301,008	2040/03/20
173回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,220,000	1,942,722	2040/06/20
33回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,326,768	2040/09/20
174回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,170,000	1,890,330	2040/09/20
175回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,330,000	2,058,508	2040/12/20
34回	利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,385,568	2041/03/20
176回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	1,848,525	2041/03/20
177回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,050,000	1,764,968	2041/06/20
35回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,640,047	2041/09/20
178回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,400,000	2,099,904	2041/09/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)					
179回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,150,000	1,875,466	2041/12/20
36回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,540,222	2042/03/20
180回	利付国庫債券(20年)	0.8000	1,740,000	1,602,035	2042/03/20
181回	利付国庫債券(20年)	0.9000	2,000,000	1,872,000	2042/06/20
37回	利付国庫債券(30年)	1.9000	1,660,000	1,837,055	2042/09/20
182回	利付国庫債券(20年)	1.1000	1,980,000	1,916,659	2042/09/20
183回	利付国庫債券(20年)	1.4000	800,000	814,544	2042/12/20
38回	利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,685,532	2043/03/20
39回	利付国庫債券(30年)	1.9000	1,300,000	1,435,876	2043/06/20
40回	利付国庫債券(30年)	1.8000	1,130,000	1,227,637	2043/09/20
41回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,270,000	1,356,639	2043/12/20
42回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,420,000	1,515,267	2044/03/20
43回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,350,000	1,440,207	2044/06/20
44回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,500,000	1,598,460	2044/09/20
45回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,570,000	1,612,437	2044/12/20
46回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,714,071	2045/03/20
47回	利付国庫債券(30年)	1.6000	1,560,000	1,629,732	2045/06/20
48回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,480,000	1,487,651	2045/09/20
49回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,490,000	1,495,170	2045/12/20
50回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,460,000	1,290,245	2046/03/20
51回	利付国庫債券(30年)	0.3000	1,390,000	1,087,508	2046/06/20
52回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,430,000	1,171,599	2046/09/20
53回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,460,000	1,221,713	2046/12/20
54回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,269,257	2047/03/20
55回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,120,000	977,580	2047/06/20
56回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,360,000	1,183,635	2047/09/20
57回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,430,000	1,242,083	2047/12/20
1回	利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	132,266	2048/03/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,540,000	1,333,747	2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,220,000	1,027,569	2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	1,300,000	1,147,250	2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	954,145	2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	730,497	2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,120,000	886,692	2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,410,000	1,081,399	2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,030,000	786,930	2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	950,000	724,356	2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	626,691	2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	990,000	751,974	2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,570,000	1,257,020	2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,470,000	1,175,103	2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,530,000	1,256,283	2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	836,971	2051/03/20
70回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,410,000	1,155,100	2051/03/20
71回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,400,000	1,145,368	2051/06/20
72回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,490,000	1,222,112	2051/09/20
73回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,490,000	1,220,518	2051/12/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	710,000	798,054	2052/03/20
74回	利付国庫債券(30年)	1.0000	1,520,000	1,349,668	2052/03/20
75回	利付国庫債券(30年)	1.3000	1,620,000	1,550,809	2052/06/20

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 6回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,520,000	1,488,840 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	600,000	614,268 2052/12/20
6 回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	1,040,000	1,139,236 2053/03/20
7 回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	1,210,000	1,266,676 2054/03/20
8 回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	1,190,000	1,156,703 2055/03/20
9 回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,950,000	1,386,723 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,970,000	1,649,421 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,380,000	1,113,135 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,440,000	1,034,971 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	2,070,000	1,483,010 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	2,050,000	1,566,979 2061/03/20
1 5回	利付国庫債券 (40年)	1.0000	1,540,000	1,280,818 2062/03/20
小	計	-	469,265,000	464,530,535 -
(地方債証券)		%	千円	千円
2 0 8回	神奈川県公募債	0.5510	300,000	302,097 2024/06/20
2 6年度4回	札幌市公募債 10年	0.5400	100,000	100,684 2024/06/20
1 回	兵庫県公募債 (12年)	1.1000	300,000	304,362 2024/06/26
2 6年度4回	神戸市公募債	0.6060	100,000	100,808 2024/07/18
2 6年度5回	埼玉県公募債	0.6110	400,000	403,328 2024/07/29
4 8 8回	名古屋市公募債 10年	0.5980	450,000	454,014 2024/09/20
2 6年度1回	相模原市公募債	0.5290	100,000	100,782 2024/09/20
2 6年度1回	長崎県公募債	0.5540	100,000	100,827 2024/09/30
2 6年度1回	静岡県公募債	0.5150	100,000	100,835 2024/11/25
2 6年度1回	京都府公募債	0.4760	350,000	352,779 2024/12/19
2 6年度1回	三重県公募債	0.4560	100,000	100,755 2024/12/25
2 6年度1回	浜松市公募債	0.3350	100,000	100,545 2025/01/23
1 4 2回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	502,825 2025/01/24
2 6年度3回	広島市公募債	0.4290	100,000	100,754 2025/02/25
2 6年度17回	兵庫県公募債	0.4600	200,000	201,636 2025/02/26
5回	東京都公募債 20年	2.1100	100,000	104,277 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募債	0.5340	100,000	100,987 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	403,400 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	606,564 2025/05/23
2 7年度4回	千葉県公募債	0.6020	200,000	202,546 2025/07/25
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	505,765 2025/07/25
7 回	東京都公募債 20年	2.1600	100,000	105,371 2025/09/19
1 回	静岡県公募債 20年	2.1800	100,000	105,410 2025/09/19
1 5 0回	共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	303,279 2025/09/25
2 7年度15回	愛知県公募債 10年	0.4710	100,000	101,029 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,038 2025/12/25
2 7年度9回	千葉県公募債	0.0950	100,000	99,922 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,827 2026/04/24
9回	東京都公募債 20年	2.4400	200,000	215,374 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,564 2026/06/25
1 6 0回	共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	498,370 2026/07/24
1 回	兵庫県公募債 15年	1.6600	200,000	210,406 2026/07/29
2 8年度6回	北海道公募債	0.0700	100,000	99,665 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募債	0.0450	100,000	99,589 2026/09/18
1 0回	東京都公募債 20年	2.3300	300,000	323,247 2026/09/18
4回	京都市公募債 20年	2.5100	100,000	108,373 2026/09/18

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
4 1 3回	大阪府公募債 10年	0.0210	100,000	99,389 2026/10/28
1 9 0回	大阪府公募債 5年	0.0010	300,000	297,654 2026/12/25
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	499,510 2027/01/25
令和3年度3回	仙台市公募債 5年	0.0010	300,000	297,540 2027/01/28
2 8年度8回	福岡県公募債	0.2400	100,000	100,079 2027/02/24
1 6 9回	共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	499,270 2027/04/23
4 1 9回	大阪府公募債 10年	0.1960	100,000	99,775 2027/04/27
2回	静岡県公募債 15年	1.4060	100,000	104,939 2027/06/25
5回	兵庫県公募債 12年	0.6870	100,000	101,854 2027/07/07
1 7 3回	共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,836 2027/08/25
2 9年度4回	大阪府公募債	0.1500	200,000	198,728 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,340 2027/09/24
2 4年度1回	福岡県公募債 15年	1.3290	100,000	104,808 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,547 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,495 2028/02/25
2 9年度6回	広島市公募債	0.2300	300,000	298,347 2028/02/25
2 9年度13回	京都府公募債	0.2000	109,330	108,536 2028/03/16
5回	兵庫県公募債 15年	1.3100	300,000	314,676 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募債	0.2200	110,000	109,105 2028/06/20
4回	静岡県公募債 15年	1.3380	100,000	105,053 2028/06/23
3 0年度8回	北海道公募債	0.2490	400,000	396,400 2028/08/31
3 0年度7回	神戸市公募債 30年	0.2540	300,000	297,438 2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募債	0.1850	200,000	197,536 2028/09/20
7回	静岡県公募債 20年	2.3200	300,000	331,548 2028/09/21
3 0年度3回	広島県公募債	0.2540	100,000	99,144 2028/09/25
3 0年度3回	堺市公募債	0.1950	100,000	98,576 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募債	0.1350	200,000	196,578 2028/12/20
2 0 2回	福岡県公募債	2.0500	100,000	109,208 2028/12/20
6回	大阪府公募債 20年	2.2100	200,000	220,240 2028/12/20
1 7回	横浜市公募債 20年	2.0700	100,000	109,322 2028/12/20
6回	北九州市公募債 20年	2.0300	100,000	109,031 2028/12/20
3 0年度6回	福岡県公募債	0.2000	200,000	197,318 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,714 2028/12/25
3 0年度14回	北海道公募債	0.1950	400,000	394,280 2028/12/28
1 8回	東京都公募債 20年	2.2200	100,000	110,361 2029/03/19
3 0年度19回	愛知県公募債	0.1150	200,000	195,720 2029/03/28
3 0年度3回	岡山県公募債 10年	0.1500	200,000	196,134 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	293,058 2029/05/25
6回	川崎市公募債 20年	2.2100	200,000	221,006 2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募債	0.0290	200,000	194,264 2029/06/21
9回	兵庫県公募債 15年	1.0200	100,000	103,236 2029/07/13
1 1回	神奈川県公募債 20年	2.0800	100,000	109,884 2029/07/20
1 9 6回	共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	486,175 2029/07/25
7 9 6回	東京都公募債	0.0400	200,000	193,754 2029/09/20
令和元年度9回	静岡県公募債	0.0500	200,000	193,944 2029/09/20
令和元年度3回	横浜市公募債	0.0500	400,000	387,512 2029/10/16
令和元年度16回	兵庫県公募債	0.0500	200,000	193,738 2029/10/23
2 1回	東京都公募債 20年	2.1900	100,000	110,892 2029/12/20
1 7回	さいたま市公募債	0.1100	200,000	194,190 2029/12/25
令和元年度第8回	埼玉県公募債	0.1350	200,000	194,434 2030/01/30

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		
21年度2回 福岡県公債券 20年	2.2300	100,000	111,371	2030/02/22	
2030回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	96,840	2030/02/25	
802回 東京都公債券 20年	0.1300	400,000	388,276	2030/03/19	
511回 名古屋市長公債券 10年	0.0750	200,000	193,306	2030/03/27	
令和2年度1回 京都府公債券 20年	0.1350	400,000	388,048	2030/04/12	
令和2年2回 大阪市公債券 20年	0.1310	300,000	290,415	2030/05/22	
9回 埼玉県公債券 20年	2.1500	100,000	111,028	2030/05/24	
8回 静岡県公債券 15年	0.8280	200,000	203,408	2030/06/07	
令和2年度10回 静岡県公債券 20年	0.1350	100,000	96,268	2030/09/20	
令和2年5回 福岡県公債券 20年	0.1350	100,000	96,142	2030/10/23	
36回2号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	240,335	2030/10/28	
令和2年度1回 福島県公債券 20年	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27	
令和2年度1回 高知県公債券 20年	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27	
22年度14回 愛知県公債券 20年	2.0870	300,000	331,965	2030/12/13	
9回 京都市公債券 20年	2.1430	200,000	222,170	2030/12/17	
813回 東京都公債券 20年	0.1790	300,000	288,789	2030/12/20	
16回 神奈川公債券 20年	2.0900	300,000	332,343	2031/01/24	
464回 大阪府公債券 10年	0.0720	200,000	190,528	2031/01/28	
令和2年度19回 北海道公債券 20年	0.1450	100,000	95,702	2031/02/26	
令和2年度14回 京都府公債券 20年	0.2140	200,000	192,564	2031/03/12	
令和2年7回 広島県公債券 20年	0.2140	200,000	192,474	2031/03/19	
251回 神奈川公債券 10年	0.1990	200,000	192,242	2031/03/20	
令和2年度14回 静岡県公債券 20年	0.1400	200,000	191,338	2031/03/20	
令和3年度1回 長野県公債券 10年	0.1900	200,000	192,040	2031/04/16	
令和3年度2回 兵庫県公債券 20年	0.1750	100,000	95,856	2031/04/25	
467回 大阪府公債券 10年	0.1640	200,000	191,388	2031/04/28	
469回 大阪府公債券 10年	0.1280	200,000	190,590	2031/06/27	
11回 九州市公債券 20年	2.0190	300,000	331,587	2031/07/18	
令和3年5回 千葉県公債券 20年	0.1050	200,000	189,864	2031/09/25	
472回 大阪府公債券 10年	0.1000	200,000	189,618	2031/09/29	
474回 大阪府公債券 10年	0.1190	300,000	284,616	2031/11/28	
19回 神奈川公債券 20年	1.8180	100,000	109,234	2032/01/30	
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	479,015	2032/02/25	
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	476,525	2032/03/25	
258回 神奈川公債券 10年	0.2900	300,000	286,713	2032/06/18	
24年度2回 福岡県公債券 (20年)	1.6350	300,000	323,976	2032/08/16	
10回 大阪府公債券 20年	1.7200	200,000	218,262	2032/09/24	
24年度12回 神戸市長公債券 20年	1.7110	200,000	216,916	2032/12/17	
14回 千葉県公債券 20年	1.1370	100,000	102,557	2033/04/15	
13回 埼玉県公債券 20年	1.5990	100,000	107,254	2033/05/20	
1回 東京都公債券 30年	2.2100	200,000	226,936	2033/06/20	
14回 埼玉県公債券 20年	1.5460	300,000	320,910	2034/05/08	
26年度4回 愛知県公債券 20年	1.5420	200,000	213,880	2034/05/15	
29回 横浜市公債券 20年	1.5280	100,000	106,759	2034/05/26	
16回 名古屋市長公債券 20年	1.5200	100,000	106,642	2034/06/09	
5回 群馬県公債券 20年	1.5290	100,000	106,745	2034/06/16	
17回 九州市公債券 20年	1.5290	100,000	106,477	2034/06/20	
31回 東京都公債券 20年	1.2380	200,000	206,890	2034/09/20	
15回 埼玉県公債券 20年	1.1660	100,000	102,444	2035/02/16	
2回 横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	117,335	2035/03/20	

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		
18回 千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	102,000	2035/04/13	
17回 名古屋市公債券 20年	1.2030	100,000	102,676	2035/05/28	
13回 大阪府公債券 20年	1.2030	100,000	102,213	2035/09/28	
14回 大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	93,260	2036/09/29	
21回 千葉県公債券 20年	0.4240	100,000	91,920	2036/10/15	
3回 神奈川公債券 30年	2.6200	100,000	119,692	2037/03/19	
29年度2回 広島市長公債券 20年	0.6160	200,000	186,502	2037/08/18	
29年度5回 札幌市長公債券 20年	0.5970	300,000	278,595	2037/09/18	
30年度2回 仙台市長公債券 20年	0.7290	100,000	93,237	2038/10/18	
30年度7回 福岡市長公債券 20年	0.7010	200,000	185,616	2038/10/19	
2019年度5回 福岡市長公債券 20年	0.2860	100,000	85,565	2039/07/29	
2回 兵庫県公債券 30年	2.3600	100,000	115,928	2040/03/19	
22年度8回 福岡市長公債券 20年	2.2800	100,000	114,581	2040/09/20	
令和2年2回 広島県公債券 20年	0.4640	100,000	86,483	2040/09/21	
23年度7回 札幌市長公債券 30年	2.0970	100,000	111,561	2041/09/20	
5回 川崎市長公債券 30年	2.0970	100,000	111,758	2042/03/20	
24年度12回 愛知県公債券 30年	2.1200	100,000	112,081	2042/09/19	
14回 東京都公債券 30年	2.0500	100,000	110,745	2043/06/19	
27年度8回 愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	152,100	2045/06/20	
27年度2回 広島県公債券 30年	0.7110	100,000	84,226	2046/03/22	
6回 埼玉県公債券 30年	0.9570	200,000	176,576	2046/12/20	
令和元年度7回 愛知県公債券 30年	0.3690	300,000	219,747	2049/06/18	
令和元年3回 福岡市長公債券 30年	0.4320	200,000	149,236	2049/06/18	
令和元年度1回 鳥取県公債券 30年	0.2900	200,000	179,728	2049/09/17	
5回 京都市公債券 30年定時償還	0.2900	200,000	178,096	2049/09/17	
12回 埼玉県公債券 30年	0.4740	300,000	225,567	2049/12/20	
令和3年度6回 神戸市長公債券 30年	0.7130	200,000	158,462	2051/06/20	
小計	-	32,839,330	32,767,927	-	
(特殊債券)	%	千円	千円		
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	100,856	2024/05/31	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	201,760	2024/06/28	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	302,556	2024/09/13	
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	100,695	2024/09/20	
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	100,810	2024/11/27	
21回 政保中部国際空港債	0.4500	100,000	100,893	2025/03/17	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	504,500	2025/03/31	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,790	2025/04/25	
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	417,968	2025/06/20	
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,197	2025/06/20	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,001	2025/08/29	
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,780	2025/09/19	
85回 日本高速道路債券	0.0700	300,000	298,959	2025/10/21	
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,007	2025/11/20	
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	105,523	2025/12/19	
61回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	104,787	2025/12/19	
F538回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	498,430	2025/12/25	
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,825	2026/03/13	
33回 政保日本政策投資銀行債	0.0200	300,000	299,490	2026/03/16	
87回 中日本高速道路債	0.0600	400,000	397,488	2026/03/18	
11回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	107,368	2026/03/20	

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)		%	千円	千円
271回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	299,439
187回	住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,731
83回	地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	399,108
80回	住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	104,878
321回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165
325回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165
79回	政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	314,238
91回	政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,753
300回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	99,783
F147回	地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	208,092
78回	日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	298,890
309回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	797,992
96回	地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,570
72回	東日本高速道路社債	0.1200	200,000	197,442
98回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,715
222回	住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,405
103回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	99,450
124回	住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	104,912
77回	東日本高速道路社債	0.1100	300,000	294,948
230回	住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	297,546
113回	政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	99,189
9回	新関西国際空港社債	1.2310	200,000	207,186
1回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	217,836
93回	都市再生債券	1.1020	100,000	103,257
1回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	331,575
2回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	332,127
12回	新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,952
39回	住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	219,880
97回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	110,813
78回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	101,051
109回	都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,616
15回	日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	217,810
121回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	545,880
13回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	110,778
90回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	191,122
75回	住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	386,540
7回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	109,804
153回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	110,088
19回	地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	218,006
156回	日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	381,724
23回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	108,206
115回	住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	109,974
15回	国際協力機構債	1.7240	100,000	109,201
24回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	217,854
188回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	105,581
28回	日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	592,695
124回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	106,286
36回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	106,670
39回	地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	524,325
42回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	300,312

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	償還年月日
(特殊債券)		%	千円	千円
239回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	308,823
159回	住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	101,042
155回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	102,964
44回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	206,116
250回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	104,095
第262回	政保道路債	1.1090	500,000	509,045
172回	高速道路機構債	0.2880	200,000	179,758
286回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,470
59回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,733
319回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	188,402
26回	高速道路機構債	2.6700	200,000	237,358
2回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2700	29,481	29,564
337回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,927
233回	住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	91,085
F174回	地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	327,294
210回	高速道路機構債	0.6770	100,000	91,875
50回	高速道路機構債	0.5000	300,000	265,596
77回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	250,305
125回	日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	425,180
288回	政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	303,009
116回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	107,738
40回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	44,416	45,090
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	10,028	10,056
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,395	48,533
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	28,716	28,785
4回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	9,766	9,791
148回	住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	267,802
27回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	16,224	16,963
9回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	101,085	106,357
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	153,752	160,563
159回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	99,702
38回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	21,513	22,364
1回	高速道路機構債	2.9900	300,000	374,067
260回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	197,772
169回	高速道路機構債	1.2000	100,000	91,630
268回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	96,646
49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	18,489	19,253
52回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	21,674	22,467
53回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	22,728	23,550
19回	高速道路機構債	2.7500	150,000	180,889
60回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	27,955	28,894
64回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	68,544	70,293
36回	高速道路機構債	2.8400	300,000	367,482
76回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	31,310	32,207
82回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	37,252	37,929
84回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	37,866	38,564
86回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,647	42,347
90回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	43,218	43,641
398回	政保道路債	0.4220	300,000	225,969
93回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	48,571	48,186

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	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	0.5170	300,000	222,036	2050/04/28
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	54,967	54,920	2050/05/10
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	77,436	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	155,190	2050/06/20
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	56,873	57,164	2050/08/10
418回 高速道路機構債	0.6300	200,000	157,672	2051/08/31
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	159,878	2051/10/31
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	213,474	206,557	2051/11/10
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,432	70,469	2052/02/10
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	72,120	70,253	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,281	70,341	2052/04/10
124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	225,873	218,581	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	226,248	218,802	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	153,450	148,271	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	230,445	222,139	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	229,833	221,568	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	397,340	384,211	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	79,465	76,755	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	81,727	78,041	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	262,260	248,724	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	102,090	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	350,088	333,234	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	269,238	256,449	2055/09/10
164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,114	263,056	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	838,701	795,759	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	149,016	2061/02/28
小 計	-	28,478,559	28,511,051	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,075	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	99,912	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,144	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	298,761	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	298,617	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	298,308	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	198,774	2026/08/27
小 計	-	1,700,000	1,693,591	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	100,870	2024/04/25
2回 BPCE SA円債社債(ソシヤルボンド)	0.3670	100,000	99,582	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	100,989	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	100,732	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,874	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	103,370	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	100,756	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	201,138	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,729	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	200,536	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	201,488	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	201,280	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	264,048	2024/12/25

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	
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,834	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,001	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,306	2025/06/11
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,249	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	312,741	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	101,459	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	208,004	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,624	2025/07/09
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	209,534	2025/09/19
27回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,188	2025/12/19
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,478	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,834	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	199,008	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,497	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,414	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	296,892	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	197,168	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,227	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,694	2026/06/03
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,250	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,038	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	98,180	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,437	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	297,714	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,476	2026/06/19
61回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	496,025	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,771	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	128,152	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	102,035	2026/06/25
90回 中日本高速道路債券	0.0500	200,000	198,360	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	296,802	2026/07/27
3回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	295,548	2026/09/04
91回 中日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/17
62回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,183	2026/09/18
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,106	2026/10/16
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,035	2026/10/23
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	299,208	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	199,682	2027/02/16
12回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	106,194	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	107,729	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	297,735	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	297,435	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,384	2027/05/07
3回 東レ社債	0.3750	300,000	298,701	2027/07/16
30回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	108,120	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,858	2027/09/24
25回 フランス銀行総合銀行(BF CMI)円債社債(2017)	0.5100	300,000	292,086	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,105	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	195,324	2027/10/25

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	98,587	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	297,567	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,483	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,612	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,710	2028/06/06
5 回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	98,283	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	109,267	2029/03/21
2 3 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	97,601	2029/04/12
1 4 回 プリヂストーン社債	0.3750	300,000	295,032	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,734	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	385,108	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	389,616	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	190,862	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	289,911	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	192,826	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	109,292	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	194,078	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	96,955	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	96,435	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	192,592	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	382,644	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	95,100	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	291,630	2030/07/16
3 1 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	192,492	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	192,698	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	389,456	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,766	2030/09/27
1 7 回 デイセル社債	0.5000	300,000	291,198	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	287,298	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	218,502	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	191,796	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	181,328	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	94,712	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	279,612	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	286,257	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	279,180	2031/09/19

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 3 6 回 東北電力社債	0.2900	300,000	277,605	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	470,495	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	186,218	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	188,732	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	282,738	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	189,720	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	295,416	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	94,311	2036/06/02
2 3 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	185,404	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	180,940	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	89,875	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,153	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	92,653	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	176,628	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	88,572	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	184,228	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	89,806	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,393	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,241	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	169,598	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	81,752	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	83,714	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,538	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,014	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	81,836	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	94,254	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	87,052	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	77,848	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	153,760	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	206,034	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	75,020	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	74,006	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	74,560	2060/12/17
小 計	-	26,381,000	25,503,782	-
合 計	-	558,663,889	553,006,886	-

■投資信託財産の構成

2023年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
コーポレートローン等、その他	553,006,886	99.7
投資信託財産総額	1,668,486	0.3
	554,675,373	100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	554,675,373,305円		
コ ー ー ン 等	617,814,346		
公 社 債(評価額)	553,006,886,952		
未 収 利 息	696,325,613		
前 払 金	354,346,394		
(B) 負 債	160,658,000		
未 払 解 約 金	160,658,000		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	554,514,715,305		
元 本	446,785,885,792		
次 期 繰 越 損 益	107,728,829,513		
(D) 受 益 権 総 口 数	446,785,885,792口		
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,411円		
(注1) 期首元本額	429,840,166,151円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,242,098,929円
追加設定元本額	1,193,021,056,559円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	33,649,224円
一部解約元本額	1,176,075,336,918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)	1,918,361,466円
(注2) 期末における元本の内訳		インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	1,966,575,557円
DIAM国内債券バッシブ・ファンド	25,377,106,533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)	1,522,865,115円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	57,586,017円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	1,201,586,453円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	103,700,225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)	1,897,755,847円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	66,758,277円	インカム重視マルチアセット運用ファンド1 2021-04 (適格機関投資家限定)	4,911,402,998円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	754,422,213円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	1,872,779,890円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	180,875,125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)	1,712,159,046円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	51,325,733円	マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	1,920,698,394円
たわらノーロード 国内債券	17,498,683,959円	DIAM国内債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	9,123,052,184円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,806,010,006円	Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,647,924,770円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,251,955,017円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	2,161,052,848円
たわらノーロード バランス (標準型)	2,226,167,410円	AMOne マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	572,870,714円
たわらノーロード バランス (積極型)	289,053,050円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	262,362,220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)	128,198,441円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1 1 (適格機関投資家限定)	5,397,074,453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)	1,726,237,986円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1 1 1 (適格機関投資家限定)	5,408,411,752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)	1,815,055,749円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド1V (適格機関投資家限定)	5,364,968,629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)	501,958,943円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	3,271,484,674円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,448,954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)	41,605,092円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	27,062,997円	AMOneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,052,664,270円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	18,479,351円	しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	74,795,895円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	155,346,253円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	146,999,752円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,911,502円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	96,492,643円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	62,284円	DIAM国際分散(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	19,332,957円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,797,948,481円	DIAM国際分散(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	72,848,637円
Oneグローバルバランス	26,722,380円	DIAM国内重視(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	27,734,823円
DIAM/バランス・ファンド<DC年金>1 安定型	9,748,438,004円	DIAM国内重視(バランスファンド)50VA (適格機関投資家限定)	327,700円
DIAM/バランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	13,721,614,185円	DIAM世界(バランスファンド)50VA (適格機関投資家限定)	23,873,600円
DIAM/バランス・ファンド<DC年金>3 成長型	5,826,988,427円	DIAM世界(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	107,055,264円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,358,619,228円	DIAM/バランスファンド*37.5VA (適格機関投資家限定)	3,016,439,998円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,427,324,525円	DIAM/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,100,621,220円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	411,372,305円	DIAM/グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	4,138,221,952円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	97,387,528円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	64,082,448円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	3,564,928,239円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	143,932,786円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	13,441,521円	DIAM アクア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,815,004,927円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	4,632,204,263円	DIAM アセット(バランスファンド)VA (適格機関投資家向け)	133,615,087円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,967,220,079円	DIAM世界(バランスファンド)55VA (適格機関投資家限定)	532,578円
DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	377,779,353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)	1,989,249,669円
投資のソムリエ	80,243,319,715円	DIAM世界アセット(バランスファンド)40VA (適格機関投資家限定)	43,566,296円
グループコントロール	973,146,033円	DIAM世界アセット(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	293,969,678円
投資のソムリエ<DC年金>	5,911,038,890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)	445,411,075円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,610,654,070円	DIAM世界アセット(バランスファンド)4VA (適格機関投資家限定)	771,111,794円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,317,826,922円	DIAM世界(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	250,595,165円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,499,330,383円	DIAM国内(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	95,877,638円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	27,485,903,692円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	905,339,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	470,764,235円	動的パッケージファンド<DC年金>	366,377,124円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	236,380,237円	コア資産形成ファンド	245,142,281円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	45,753,552円	MHAM日本債券インデックスファンド (ファンドラップ)	46,520,562,169円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,970,386,655円	MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	47,766,276,797円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,435,483,967円	MHAM日本債券バッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,297,060,099円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,471,865,998円	MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,689,593,873円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,499,704,588円	期末元本合計	446,785,885,792円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	663,974,989円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	253,415,299円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	155,546,201円		

■損益の状況

当期 自2022年2月15日 至2023年2月14日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,860,461,249	円
	受取利息	3,866,858,522	
	支払利息	△6,397,273	
(B)	有価証券売買損益	△31,051,006,500	
	売却益	919,953,577	
	売却損	△31,970,960,077	
(C)	その他費用	△20	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△27,190,545,271	
(E)	前期繰越損益金	123,463,010,360	
(F)	解約差損益金	△306,962,982,017	
(G)	追加信託差損益金	318,419,346,441	
(H)	計(D+E+F+G)	107,728,829,513	
	次期繰越損益金(H)	107,728,829,513	

(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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15日)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2023年2月21日）

（計算期間 2022年2月22日～2023年2月21日）

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

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率	債券先物率	純資産額
	期	中	期	中			
	騰	落	騰	落	比	比	総
	率	率	率	率			
16期 (2019年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
17期 (2020年2月21日)	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
18期 (2021年2月22日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
19期 (2022年2月21日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
20期 (2023年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

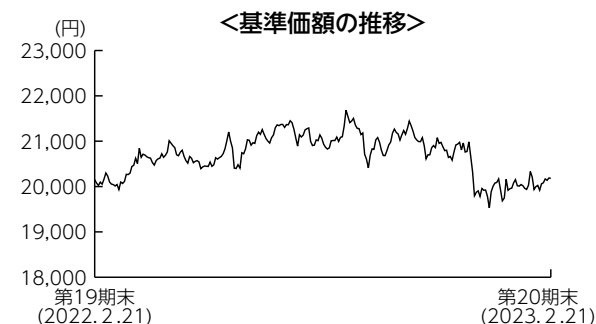
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022 年 2 月 21 日	円 20,152	% -	ポイント 126,280.23	% -	% 98.9	% -
2 月 末	20,052	△0.5	125,907.80	△0.3	98.8	-
3 月 末	20,713	2.8	129,775.21	2.8	98.3	-
4 月 末	20,758	3.0	129,955.37	2.9	99.0	-
5 月 末	20,634	2.4	129,451.47	2.5	98.7	-
6 月 末	21,122	4.8	132,579.22	5.0	99.0	-
7 月 末	21,267	5.5	133,117.57	5.4	98.9	-
8 月 末	21,015	4.3	131,430.25	4.1	98.7	-
9 月 末	20,830	3.4	130,076.63	3.0	99.0	-
10 月 末	21,443	6.4	134,355.57	6.4	99.0	-
11 月 末	20,802	3.2	130,450.40	3.3	98.7	-
12 月 末	19,782	△1.8	123,946.23	△1.8	98.6	-
2023 年 1 月 末	20,018	△0.7	125,559.33	△0.6	98.8	-
(期 末) 2023 年 2 月 21 日	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

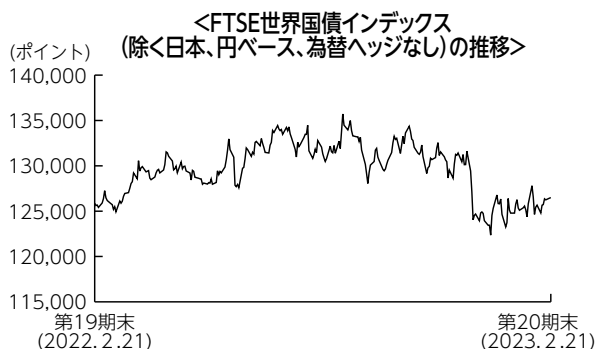


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,182円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

FOMC（米連邦公開市場委員会）による複数回の利上げやインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもFOMCによる複数回の利上げと日銀の金融緩和策を堅持する姿勢から、日米金利差拡大が意識されて円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも大きく為替が円安に動いたことから、基準価額は若干上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、インフレ率が加速する中でFOMCの複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やECB（欧州中央銀行）の複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、FOMCにおいて複数回の利上げを実施しましたが、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

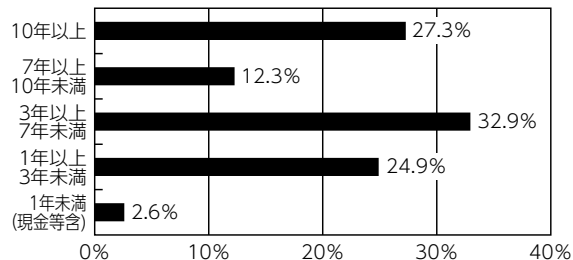
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

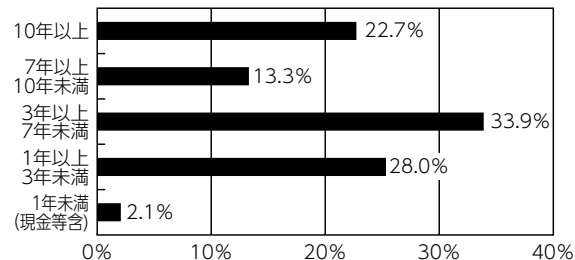
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

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

期末

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

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で0.2%上昇しました。

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

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.016%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(3)	(0.015)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は20,688円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■売買及び取引の状況 (2022年2月22日から2023年2月21日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 536,386	千アメリカ・ドル 350,573	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 26,736	千カナダ・ドル 16,227	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,961	千オーストラリア・ドル 11,123	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 4,947	千シンガポール・ドル 3,149	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 4,867	千ニュージーランド・ドル -	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 42,306	千イギリス・ポンド 23,277	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 9,417	千イスラエル・シケル 7,354	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 15,932	千デンマーク・クローネ 12,094	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 16,915	千ノルウェー・クローネ 14,888	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 13,712	千スウェーデン・クローナ 12,914	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 111,333	千メキシコ・ペソ 63,692	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 369,093	千オフショア・人民元 18,682	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,418	千マレーシア・リンギット 8,762	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,489	千ポーランド・ズロチ 7,291	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 5,238	千ユーロ 3,823
		オランダ	国債証券	15,082	10,731
		ベルギー	国債証券	17,985	11,988
		フランス	国債証券	79,108	52,916
		ドイツ	国債証券	67,768	45,631
		スペイン	国債証券	46,170	31,229
		イタリア	国債証券	74,616	52,932
		フィンランド	国債証券	4,741	3,163
	オーストラリア	国債証券	12,167	8,398	

(注) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

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

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クロネ	千ノルウェー・クロネ	千円	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,650	2,260	29,686	2031/09/17
小計	—	—	29,010	27,010	354,646	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クロナ	千スウェーデン・クロナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,420	3,860	50,146	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	2,890	2,632	34,192	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,120	6,057	78,681	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	5,420	4,469	58,060	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	2,654	34,482	2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	6,210	5,833	75,777	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,010	2,685	34,885	2029/11/12
小計	—	—	29,770	28,193	366,227	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	29,842	26,541	194,062	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	10,580	9,121	66,691	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	9,180	8,225	60,143	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	20,159	19,594	143,272	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,648	28,407	207,710	2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	5,790	5,244	38,343	2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,746	23,052	168,555	2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	6,290	5,645	41,276	2053/07/31
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	22,070	21,098	154,263	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	17,277	15,096	110,380	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	16,161	14,508	106,083	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,807	108,271	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,931	43,367	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	4,835	4,411	32,257	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	15,902	15,707	114,846	2024/12/05
小計	—	—	234,607	217,394	1,589,526	—
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	20,000	19,779	387,117	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	34,500	34,380	672,902	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	5,100	5,167	101,145	2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	10,997	215,235	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	12,000	12,005	234,970	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	14,320	14,442	282,676	2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	2,100	2,255	44,148	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	30,100	29,875	584,732	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	1,000	1,013	19,830	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	3,000	2,969	58,114	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,600	6,522	127,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,452	165,436	2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	7,500	7,549	147,767	2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	20,000	19,904	389,565	2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	450	460	9,015	2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	国債証券	2.1800	4,200	4,193	82,076	2024/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,256	396,471	2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	13,000	12,764	249,819	2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	30,000	29,770	582,671	2025/08/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	26,600	26,675	522,102	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	国債証券	3.5900	5,000	5,236	102,489	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	7,300	7,120	139,358	2032/09/01

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

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

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

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

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

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

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

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

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

■投資信託財産の構成

2023年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 185,001,333	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,186,068	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	188,187,402	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、186,640,391千円、99.2%です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月21日)現在

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

(注1) 期首元本額 70,448,298,510円
 追加設定元本額 63,457,547,851円
 一部解約元本額 41,337,416,276円

(注2) 期末における元本の内訳

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

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	259,574,682円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	265,741,005円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	128,786,227円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	162,358,218円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	256,453,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定)	618,270,983円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	198,620,020円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	231,445,712円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	208,546,866円
D I A M海替フルレンジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,554,465,372円
D I A M外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,585,064,790円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,555,775,823円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,282,640,293円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,242,436円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	49,166,703円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	442,107,851円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	362,944,405円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	238,451,787円
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,931,845円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,911,489円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,822,125円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	49,876円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	14,713,798円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	43,966,666円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,620,938,828円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,399,685,001円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,546,932,927円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	65,747,358円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	124,222,256円
D I A Mアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,489,912,024円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	300,752,649円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	163,842円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	305,817,896円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	273,773,162円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	379,947,236円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	46,662,175円
動的パッケージファンド<DC年金>	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
M H A M外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	756,300,586円
M H A M外国債券インデックスファンド<海替ヘッジあり> (ファンドラップ)	514,130,947円
M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	7,052,612,220円
M H A M外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,364,933,377円
期末元本合計	92,568,430,085円

■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月21日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

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17期 (決算日 2023年6月6日)

(計算期間 2022年6月7日~2023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17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証R E I T指数		投資証券 組入比率	不動産 投信先 物比率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	(配当込み) ベンチマーク	期中 騰落率			
13期(2019年6月6日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
14期(2020年6月8日)	20,819	14.5	3,880.89	14.6	97.4	2.0	33,154
15期(2021年6月7日)	19,706	△5.3	3,696.98	△4.7	97.4	2.2	41,885
16期(2022年6月6日)	24,869	26.2	4,660.79	26.1	97.6	2.2	88,531
17期(2023年6月6日)	24,389	△1.9	4,567.99	△2.0	97.6	2.3	199,921
	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2	200,500

(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商標または商標は、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商標または商標に関するすべての権利はJ P Xが有しています。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません(以下同じ)。

(注3) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

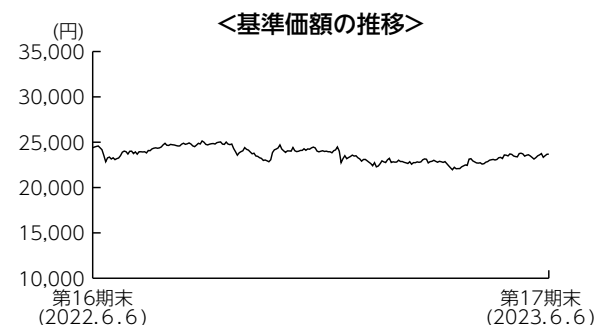
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東 証 R E I T 指 数		投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み) (ベ ン チ マ ー ク)	騰 落 率		
(期 首) 2022 年 6 月 6 日	円 24,389	% -	ポ イ ン ト 4,567.99	% -	% 97.6	% 2.3
6 月 末	23,959	△1.8	4,487.40	△1.8	97.6	2.4
7 月 末	24,713	1.3	4,628.79	1.3	97.6	2.3
8 月 末	25,003	2.5	4,683.62	2.5	97.6	2.2
9 月 末	23,964	△1.7	4,488.86	△1.7	97.4	2.5
10 月 末	24,369	△0.1	4,564.72	△0.1	97.4	2.3
11 月 末	24,373	△0.1	4,565.38	△0.1	97.8	2.2
12 月 末	23,509	△3.6	4,403.82	△3.6	97.6	2.3
2023 年 1 月 末	22,762	△6.7	4,263.06	△6.7	97.8	2.2
2 月 末	23,116	△5.2	4,331.37	△5.2	97.9	2.1
3 月 末	22,445	△8.0	4,204.73	△8.0	97.6	2.3
4 月 末	23,595	△3.3	4,420.34	△3.2	97.8	2.1
5 月 末	23,748	△2.6	4,448.91	△2.6	97.9	2.1
(期 末) 2023 年 6 月 6 日	23,686	△2.9	4,437.30	△2.9	97.8	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年6月7日から2023年6月6日まで）

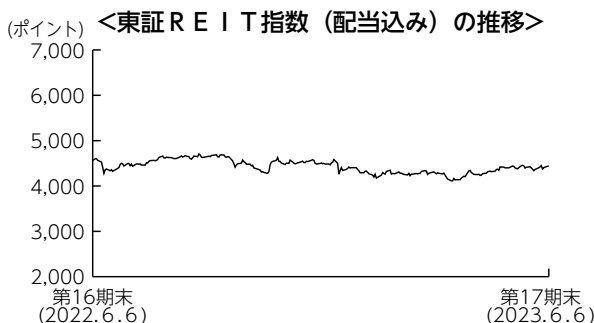


基準価額の推移

当期末の基準価額は23,686円となり、前期末比で2.9%下落しました。

基準価額の主な変動要因

米国の金融引き締め加速懸念や日銀による長期金利の許容変動幅拡大などにより東証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。期の前半は米国の金融引き締めペースを巡る思惑などから不安定な相場展開となりました。後半は日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことや米国の銀行破綻等による金融システム不安などが相場の下落要因となりましたが、期末にかけては日銀による追加政策修正への警戒感や米国の利上げ観測が後退し、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2.9%下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション) (投資証券)	0円 (0) (0)	0.001% (0.001) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は23,630円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年6月7日から2023年6月6日まで)

(1) 投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート投資法人	2.446 (-)	283,598 (-)	2.216 (-)	257,405 (-)
サンケイリアルエステート投資法人	3.866 (-)	352,134 (-)	3.493 (-)	317,841 (-)
S O S I L A物流リート投資法人	5.863 (-)	817,652 (-)	4.818 (-)	676,465 (-)
東海道リート投資法人	3.155 (-)	382,649 (-)	1.42 (-)	166,089 (-)
日本アコモデーションファンド投資法人	4.108 (-)	2,608,591 (-)	3.774 (-)	2,386,905 (-)
森ヒルズリート投資法人	13.988 (-)	2,164,435 (-)	12.853 (-)	1,953,913 (-)
産業ファンド投資法人	19.547 (-)	3,155,155 (-)	16.212 (-)	2,579,137 (-)
アドバンス・レジデンス投資法人	11.888 (-)	4,058,437 (-)	10.922 (-)	3,707,214 (-)
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8.925 (-)	1,889,757 (-)	7.904 (-)	1,647,056 (-)
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6.202 (-)	2,550,773 (-)	5.78 (-)	2,337,835 (-)
G L P投資法人	43.091 (-)	6,649,002 (-)	37.508 (-)	5,829,268 (-)
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5.825 (-)	1,843,548 (-)	5.135 (-)	1,642,415 (-)
日本プロロジスリート投資法人	20.572 (-)	6,454,889 (-)	17.09 (-)	5,347,590 (-)
星野リゾート・リート投資法人	2.191 (-)	1,509,542 (-)	1.894 (-)	1,279,408 (-)
Oneリート投資法人	2.089 (-)	520,643 (-)	1.905 (-)	477,606 (-)
イオンリート投資法人	14.23 (-)	2,174,340 (-)	13.613 (-)	2,058,639 (-)
ヒューリックリート投資法人	11.164 (-)	1,806,029 (-)	10.213 (-)	1,620,993 (-)

	買		付		売		付	
	□	数	金	額	□	数	金	額
		千□		千円		千□		千円
日本リート投資法人		4.109		1,439,715		3.51		1,222,524
		(-)		(-)		(-)		(-)
積水ハウス・リート投資法人		35.816		2,783,839		33.45		2,587,705
		(-)		(-)		(-)		(-)
トーセイ・リート投資法人		2.838		382,704		2.397		316,989
		(-)		(-)		(-)		(-)
ケネディクス商業リート投資法人		5.673		1,478,817		4.631		1,199,302
		(-)		(-)		(-)		(-)
ヘルスケア&メディカル投資法人		2.957		519,642		2.691		454,549
		(-)		(-)		(-)		(-)
サムティ・レジデンシャル投資法人		3.604		434,109		2.767		329,919
		(-)		(-)		(-)		(-)
野村不動産マスターファンド投資法人		38.457		6,248,196		35.334		5,628,241
		(-)		(-)		(-)		(-)
いちごホテルリート投資法人		1.97		205,309		1.81		184,359
		(-)		(-)		(-)		(-)
ラサールロジポート投資法人		14.561		2,344,829		13.379		2,163,123
		(-)		(-)		(-)		(-)
スターアジア不動産投資法人		18.174		1,036,955		13.194		740,952
		(-)		(-)		(-)		(-)
マリモ地方創生リート投資法人		2.233		293,864		1.46		189,773
		(-)		(-)		(-)		(-)
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4.717		2,314,991		4.316		2,114,375
		(-)		(-)		(-)		(-)
大江戸温泉リート投資法人		1.917		127,795		1.761		114,887
		(-)		(-)		(-)		(-)
投資法人みらい		14.501		684,775		13.265		622,025
		(-)		(-)		(-)		(-)
森トラスト・ホテルリート投資法人		2.037		270,595		1.606		206,963
	(△4.547)	(-)	(△605,985)	(-)	(-)	(-)	(-)	(-)
三菱地所物流リート投資法人		4.793		2,069,388		3.531		1,511,139
		(-)		(-)		(-)		(-)
CREロジスティクスファンド投資法人		5.366		1,012,098		4.23		817,373
		(-)		(-)		(-)		(-)
ザイマックス・リート投資法人		1.934		231,896		1.763		207,929
		(-)		(-)		(-)		(-)
タカラレーベン不動産投資法人		5.999		605,375		4.193		417,993
		(-)		(-)		(-)		(-)
アドバンス・ロジスティクス投資法人		5.756		819,073		4.529		647,371
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本ビルファンド投資法人		13.885		8,689,760		12.745		7,856,097
		(-)		(-)		(-)		(-)
ジャパンリアルエステイト投資法人		12.396		7,315,592		10.959		6,406,081
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本都市ファンド投資法人		60.003		6,249,714		55.131		5,682,475
		(-)		(-)		(-)		(-)
オリックス不動産投資法人		23.695		4,374,650		21.771		3,935,320
		(-)		(-)		(-)		(-)
日本プライムリアルティ投資法人		8.141		3,095,395		7.471		2,804,919
		(-)		(-)		(-)		(-)
NTT都市開発リート投資法人		11.474		1,627,364		10.498		1,477,795
		(-)		(-)		(-)		(-)
東急リアル・エステート投資法人		7.976		1,572,545		7.328		1,415,154
		(-)		(-)		(-)		(-)
グローバル・ワン不動産投資法人		9.294		1,008,519		7.692		825,667
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ユナイテッド・アーバン投資法人	26.549 (-)	3,953,038 (-)	24.639 (-)	3,596,230 (-)
森トラストリート投資法人	12.178 (22,21648)	1,313,130 (605,985)	12.48448 (-)	1,221,207 (-)
インヴィンシブル投資法人	52.339 (-)	2,518,208 (-)	48.088 (-)	2,296,723 (-)
フロンティア不動産投資法人	4.732 (-)	2,417,417 (-)	4.015 (-)	2,027,849 (-)
平和不動産リート投資法人	8.152 (-)	1,238,187 (-)	7.07 (-)	1,069,645 (-)
日本ロジスティクスファンド投資法人	8.02 (-)	2,503,490 (-)	7.369 (-)	2,271,758 (-)
福岡リート投資法人	6.15 (-)	1,033,114 (-)	5.65 (-)	931,445 (-)
ケネディクス・オフィス投資法人	5.664 (4,946)	2,289,568 (-)	5.268 (-)	2,323,567 (-)
いちごオフィスリート投資法人	9.748 (-)	853,933 (-)	8.957 (-)	771,258 (-)
大和証券オフィス投資法人	2.427 (-)	1,593,944 (-)	2.302 (-)	1,485,390 (-)
阪急阪神リート投資法人	5.37 (-)	797,151 (-)	4.933 (-)	723,099 (-)
スターツプロシード投資法人	2.282 (-)	540,786 (-)	1.806 (-)	429,891 (-)
大和ハウスリート投資法人	18.014 (-)	5,317,512 (-)	16.455 (-)	4,839,564 (-)
ジャパン・ホテル・リート投資法人	40.847 (-)	3,025,354 (-)	34.904 (-)	2,481,629 (-)
大和証券リビング投資法人	16.924 (-)	1,948,306 (-)	14.981 (-)	1,710,910 (-)
ジャパンエクセレント投資法人	10.914 (-)	1,386,912 (-)	10.028 (-)	1,261,550 (-)

(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 18,032	百万円 18,204	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等（2022年6月7日から2023年6月6日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
投 資 証 券	百万円 131,188	百万円 34,238	% 26.1	百万円 115,808	百万円 9,371	% 8.1
不動産投信指数先物取引	18,032	8,688	48.2	18,204	4,241	23.3
金 銭 信 託	0.406	0.406	100.0	0.406	0.406	100.0

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
投 資 証 券	百万円 7,433

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	2,071千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	771千円
(B) / (A)	37.3%

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

■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			3.532		3.762	441,282	0.2
サンケイリアルエステート投資法人			5.556		5.929	510,486	0.3
S O S I L A 物流リート投資法人			8.161		9.206	1,242,810	0.6
東海道リート投資法人			1.343		3.078	368,744	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人			6.057		6.391	4,224,451	2.1
森ヒルズリート投資法人			20.628		21.763	3,244,863	1.6
産業ファンド投資法人			24.904		28.239	4,408,107	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人			17.539		18.505	6,615,537	3.3
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人			12.552		13.573	2,840,828	1.4
アクティビア・プロパティーズ投資法人			9.349		9.771	3,962,140	2.0
G L P 投資法人			56.814		62.397	9,247,235	4.6
コンフォリア・レジデンシャル投資法人			8.16		8.85	3,022,275	1.5
日本プロロジスリート投資法人			28.7		32.182	9,944,238	5.0
星野リゾート・リート投資法人			2.94		3.237	2,184,975	1.1
One リート投資法人			3.044		3.228	773,428	0.4
イオンリート投資法人			20.63		21.247	3,320,906	1.7
ヒューリックリート投資法人			16.365		17.316	2,765,365	1.4
日本リート投資法人			5.413		6.012	2,005,002	1.0
積水ハウス・リート投資法人			53.248		55.614	4,504,734	2.2
トーセイ・リート投資法人			3.665		4.106	538,296	0.3
ケネディクス商業リート投資法人			7.004		8.046	2,030,005	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人			4.297		4.563	746,050	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人			3.974		4.811	557,594	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人			56.727		59.85	9,839,340	4.9
いちごホテルリート投資法人			2.906		3.066	306,293	0.2
ラサールロジポート投資法人			21.475		22.657	3,715,748	1.9
スターアジア不動産投資法人			18.128		23.108	1,356,439	0.7
マリモ地方創生リート投資法人			2.054		2.827	377,969	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人			6.91		7.311	3,651,844	1.8
大江戸温泉リート投資法人			2.831		2.987	195,051	0.1
投資法人みらい			21.249		22.485	1,035,434	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人			4.116		-	-	-
三菱地所物流リート投資法人			5.096		6.358	2,714,866	1.4
C R E ロジスティクスファンド投資法人			6.794		7.93	1,516,216	0.8
ザイマックス・リート投資法人			2.831		3.002	332,621	0.2
タカラレーベン不動産投資法人			6.918		8.724	826,162	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人			6.84		8.067	1,114,859	0.6

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	%	
日本ビルファンド投資法人	20.451	21.591	12,090,960	6.0	
ジャパンリアルエステイト投資法人	17.542	18.979	10,077,849	5.0	
日本都市ファンド投資法人	88.509	93.381	9,170,014	4.6	
オリックス不動産投資法人	34.952	36.876	6,619,242	3.3	
日本プライムリアルティ投資法人	11.987	12.657	4,436,278	2.2	
N T T 都市開発リート投資法人	16.815	17.791	2,353,749	1.2	
東急リアル・エステート投資法人	11.761	12.409	2,363,914	1.2	
グローバル・ワン不動産投資法人	12.018	13.62	1,461,426	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人	39.49	41.4	6,110,640	3.0	
森トラストリート投資法人	12.537	34.447	2,431,958	1.2	
インヴィンシブル投資法人	77.209	81.46	4,773,556	2.4	
フロンティア不動産投資法人	6.15	6.867	3,354,529	1.7	
平和不動産リート投資法人	11.958	13.04	2,023,808	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	11.828	12.479	4,036,956	2.0	
福岡リート投資法人	9.072	9.572	1,544,920	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人	5.427	10.769	3,322,236	1.7	
いちごオフィスリート投資法人	14.374	15.165	1,373,949	0.7	
大和証券オフィス投資法人	3.709	3.834	2,277,396	1.1	
阪急阪神リート投資法人	7.923	8.36	1,220,560	0.6	
スターツプロシード投資法人	2.732	3.208	743,614	0.4	
大和ハウスリート投資法人	26.339	27.898	8,196,432	4.1	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	53.741	59.684	4,607,604	2.3	
大和証券リビング投資法人	23.703	25.646	2,895,433	1.4	
ジャパンエクセレント投資法人	16.092	16.978	2,045,849	1.0	
合 計	□ 数 ・ 金 額	1,025.069	1,128.309	196,015,084	-
	銘 柄 数 < 比 率 >	61銘柄 < 97.6% >	60銘柄 < 97.8% >	-	97.8

(注1) < >内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

(注3) インヴィンシブル投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、スターツプロシード投資法人、トーセイ・リート投資法人、福岡リート投資法人、日本都市ファンド投資法人、森トラストリート投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、イオンリート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、投資法人みらい、CREロジスティクスファンド投資法人、大和証券リビング投資法人、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、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、ジャパンリアルエステイト投資法人、Oneリート投資法人につきましては、委託会社の利害関係人（みずほ銀行、みずほ信託銀行、みずほ証券、みずほリートマネジメント）が運用会社または一般事務受託会社となっています。（当該投資法人の直近の資産運用報告書より記載）

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	東 証 R E I T	百万円 4,383		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年6月6日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
投 資 証 券	千円 196,015,084		% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,050,590		2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	201,065,675		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月6日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	201,065,675,835円
コ ー ル ・ 口 ー ン 等	3,315,269,486
投 資 証 券(評価額)	196,015,084,850
未 収 入 金	365,658,895
未 収 配 当 金	1,275,504,874
差 入 委 託 証 拠 金	94,157,730
(B) 負 債	564,883,025
未 払 金	51,945,706
未 払 解 約 金	512,937,319
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	200,500,792,810
元 本	84,649,761,469
次 期 繰 越 損 益 金	115,851,031,341
(D) 受 益 権 総 口 数	84,649,761,469口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	23,686円

(注1) 期首元本額 81,973,373,034円
 追加設定元本額 57,914,110,381円
 一部解約元本額 55,237,721,946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)	236,896円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	1,070,098円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	2,794,505円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	3,280,530円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	2,494,276円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	2,607,089円
たわらノーロード 国内リート	5,669,747,226円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,107,613,678円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,409,625,816円
たわらノーロード バランス (堅実型)	41,133,949円
たわらノーロード バランス (標準型)	801,212,486円
たわらノーロード バランス (積極型)	889,719,642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)	230,708,597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)	557,228,467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)	373,374,712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)	424,568,977円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	2,576,131円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	46,569,948円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,007,008円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,774,791円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	12,819,640円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	473,699,700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 D C 8資産バランスファンド (新興国10)	143,513,616円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	211,185,463円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	394,778,673円
投資のソムリエ	8,362,909,666円
投資のソムリエ<DC年金>	666,581,590円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	162,621,843円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	649,975,211円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,538,132,409円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	42,151,167円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	20,782,609円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	4,700,816円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	125,275,722円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	121,839,567円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,874,973円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	49,724,250円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	22,871,627円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	14,066,729円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	3,323,065円

One グローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	43,418,572円
J リートインデックスファンド (D C)	67,255,589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)	694,470,884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)	309,507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)	159,755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)	30,130,099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)	130,110円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建日本政府保証償活用型) (適格機関投資家限定)	188,600,781円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定)	79,681,678円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型・シグナルヘッジ付き) 21-03 (適格機関投資家限定)	66,237,972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)	387,982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)	465,704円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-05 (適格機関投資家限定)	33,968,236円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-07 (適格機関投資家限定)	58,420,541円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-08 (適格機関投資家限定)	41,811,325円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	79,204,348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)	198,008円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-09 (適格機関投資家限定)	41,563,452円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-12 (適格機関投資家限定)	59,063,740円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日本資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家限定)	3,724,997円
D I A M J - R E I T インデックスファンド (適格機関投資家向け)	3,470,360,133円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	226,204,320円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,931,359円
日本資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	435,975,434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)	394,647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) (適格機関投資家限定)	3,419,398円
日本資産配分戦略ファンド (T I P S 活用型) (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家限定)	136,151,078円
D I A M グローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,084,557,096円
M H A M J - R E I T インデックスファンド<DC年金>	7,772,942,184円
M H A M J - R E I T インデックスファンド (毎月決算型)	36,562,726,908円
M H A M J - R E I T インデックスファンド (年1回決算型)	2,663,434,070円
M H A M J - R E I T インデックスファンド (ファンドラップ)	3,992,981,440円
期末元本合計	84,649,761,469円

■損益の状況

当期 自2022年6月7日 至2023年6月6日

項	目	当	期
(A)	配当等収当益	7,616,435,397円	
	受取配当金	7,618,410,769	
	その取利	60,047	
	の他収益	1,037	
	支払利	△2,036,456	
(B)	有価証券売買損益	△14,437,084,878	
	売買益	3,000,792,575	
	売買損	△17,437,877,453	
(C)	先物取引等取引損益	△138,373,770	
	取引益	263,426,640	
	取引損	△401,800,410	
(D)	その他費用	△1	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	△6,959,023,252	
(F)	前期繰越損益金	117,948,373,616	
(G)	解約差損益金	△74,084,393,742	
(H)	追加信託差損益金	78,946,074,719	
(I)	計(E+F+G+H)	115,851,031,341	
	次期繰越損益金(I)	115,851,031,341	

(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。

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16期（決算日 2023年6月22日）

（対象期間 2022年6月23日～2023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	2007年4月11日から無期限です。
運用方針	S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	円	騰落率	ポイント	騰落率		
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	百万円 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
16期(2023年6月22日)	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4	81,199

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

（注2）S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

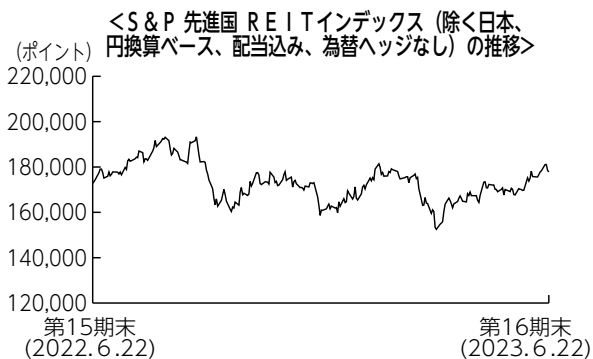
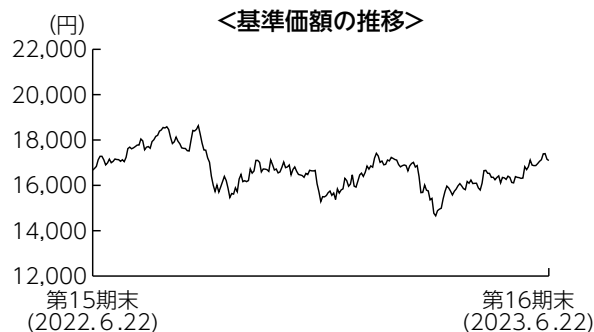
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	期 騰 落	中 率	
(期 首) 2022年 6 月 22 日	円 16,673	% -	ポイント 172,787.99	% -	% 99.3
6 月 末	17,127	2.7	177,552.22	2.8	102.6
7 月 末	18,045	8.2	187,036.58	8.2	99.6
8 月 末	17,654	5.9	183,143.17	6.0	99.4
9 月 末	15,704	△5.8	162,709.12	△5.8	99.2
10 月 末	17,102	2.6	177,452.85	2.7	100.8
11 月 末	16,704	0.2	173,502.90	0.4	99.7
12 月 末	15,662	△6.1	162,761.28	△5.8	99.2
2023年 1 月 末	16,716	0.3	173,922.95	0.7	99.6
2 月 末	16,899	1.4	175,688.04	1.7	99.6
3 月 末	15,731	△5.6	163,587.88	△5.3	99.2
4 月 末	16,096	△3.5	167,414.44	△3.1	99.6
5 月 末	16,341	△2.0	170,042.31	△1.6	99.7
(期 末) 2023年 6 月 22 日	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2022年6月23日から2023年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は17,096円となり、前期末比で2.5%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が続くことへの警戒感などから欧州リート市場が軒並み下落しマイナスの影響となったものの、利上げサイクルが終盤に近付いていると見られる米国リート市場やオーストラリアリート市場は上昇しプラスの寄与となりました。為替市場で日銀が金融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もプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

米国リート市場は小幅に上昇しました。期前半はインフレ指標を受け大きく変動しましたが、2022年10月以降はインフレ鈍化を好感して反発しました。その後は米地銀破綻に端を発した金融システム不安から下落し、期末にかけては持ち直しました。欧州リート市場はECB（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことや、英国の経済対策への懸念に伴う金利急騰などを背景に下落しました。オーストラリアリート市場は利上げサイクルの終了が近いとの見方から上昇しました。

為替市場では日銀の金融緩和解除に対する思惑が広がったものの、各国との金融政策の方向性の違いから多くの通貨に対して円安となりました。米ドルはFRB（米連邦準備理事会）の金融引き締めを受け米ドル高が進みましたが、インフレの鈍化から長期金利が低下すると米ドル安基調となりました。年明け以降はFRBのタカ派姿勢を受けて再び米ドル高が進み、期を通じては米ドル高円安となりました。ユーロはECBのタカ派姿勢からユーロ高円安が進みました。

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2.9%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマークを0.4%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)	3円 (1) (3)	0.019% (0.003) (0.015)	(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)	7 (1) (7)	0.044 (0.003) (0.041)	(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)	9 (9) (1)	0.057 (0.053) (0.004)	(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	20	0.120	
期中の平均基準価額は16,690円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年6月23日から2023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		72.842		10,247		47.748		6,445
		(-)		(-)		(-)		(-)
ALEXANDER'S INC.		0.624		139		0.264		54
		(-)		(-)		(-)		(-)
BOSTON PROPERTIES INC		63.931		4,438		44.28		2,798
		(-)		(-)		(-)		(-)
CEDAR REALTY TRUST INC		1.301		37		5.082		48
		(-)		(-)		(-)		(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		102.766		2,940		70.287		2,033
		(-)		(-)		(-)		(-)
APARTMENT INVNT & MGMT CO-A		51.797		379		36.542		285
		(-)		(-)		(-)		(-)
AGREE REALTY CORP		44.258		3,103		25.648		1,784
		(-)		(-)		(-)		(-)
BRT APARTMENTS CORP		4.203		84		2.264		44
		(-)		(-)		(-)		(-)
SL GREEN		23.666		851		15.316		485
		(-)		(-)		(-)		(-)
EPR PROPERTIES		31.674		1,304		20.836		836
		(-)		(-)		(-)		(-)
PROLOGIS INC		400.494		47,797		268.34		31,801
		(54.791)		(-)		(-)		(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC		64.999		11,537		44.2		7,890
		(-)		(-)		(-)		(-)

	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
LXP INDUSTRIAL TRUST	124.7	1,290	80.461	801
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	48.34	5,629	33.306	3,804
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	29.001	442	20.686	297
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	41.915	27,961	27.945	18,739
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	78.81	3,474	50.82	2,205
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROWTH INC	6.122	115	2.34	47
	(3.716)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	65.41	1,625	43.182	989
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12.216	214	7.882	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	73.922	957	47.074	581
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	55.173	674	17.982	164
	(△19.409)	(△112)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	34.61	1,968	38.193	2,076
	(△115.35)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	-	3.185	29
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29.746	6,859	21.108	4,823
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	156.299	10,070	108.88	6,976
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	35.705	3,589	24.358	2,354
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	59.533	3,002	40.803	2,066
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	244.285	5,866	166.041	3,815
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	45.749	1,106	31.471	722
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11.251	309	-	-
	(△56.675)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49.569	1,361	33.628	844
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	59.525	518	37.697	312
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	226.642	16,445	143.012	10,271
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	20.618	3,302	13.156	2,105
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	273.196	5,567	187.177	3,644
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	46.442	1,875	31.673	1,166
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LTC PROPERTIES INC	15.961	584	9.01	332
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57.263	53	36.971	59
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	65.34	430	36.173	216
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	139.638	7,171	97.875	4,971
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	92.234	986	61.366	611
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	77.159	5,190	52.414	3,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	34.535	507	17.036	235
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	310.15	5,243	212.64	3,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	52.713	8,400	36.012	5,622
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.425	90	5.022	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	18.158	1,010	12.793	706
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	5.745	373	4.164	261
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.41	122	2.887	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	-	1.938	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	19.02	622	12.038	403
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	1.353	253	7.546	1,375
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	32.419	321	16.968	152
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	304.999	19,566	187.637	11,896
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	68.99	4,227	47.956	2,842
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	136.309	5,749	90.309	3,756
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	47.5	1,204	31.57	774
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	4.099	175	3.246	126
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	148.93	16,599	103.043	10,919
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	37.442	4,429	25.406	3,055
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	72.478	21,903	48.383	14,330
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
SUN COMMUNITIES INC	57.042	8,238	38.506	5,446
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER FACTORY OUTLET	44.377	783	29.5	507
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	25.296	415	12.756	198
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13.936	225	8.241	109
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5.398	275	3.028	138
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	184.117	8,456	127.952	5,784
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	70.609	1,550	47.773	950
	(-)	(-)	(-)	(-)
ELME COMMUNITIES	35.978	682	21.081	385
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	11.032	714	54.098	3,541
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	97.304	1,972	64.964	1,284
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	61.89	10,151	42.661	7,030
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20.374	48	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80.037	820	53.08	530
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	99.36	4,394	68.127	3,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	132.225	14,163	88.89	9,413
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	84.648	725	57.491	471
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	265.438	3,028	183.617	1,932
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	84.385	1,351	62.359	929
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	51.408	755	32.857	465
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	42.678	431	22.065	203
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43.526	323	24.375	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	32.065	1,944	22.438	1,353
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	21.165	546	14.359	321
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	65.667	736	45.748	494
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	120	3,404	81.325	2,315
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	50.231	767	35.352	523
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	18.849	284	11.357	157
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	9.39	115	3.736	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	98.795	1,266	65.472	811
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	8.935	85	5.719	48
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	47.682	491	33.367	342
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	81.108	2,657	55.526	1,783
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	99.36	7,882	62.628	4,890
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	29.287	551	17.433	316
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	15.157	286	8.777	148
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	161.973	3,387	119.299	2,452
	(56.675)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24.236	2,100	16.11	1,376
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27.571	338	18.027	211
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	65.011	2,599	42.843	1,698
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	105.527	1,617	66.519	1,007
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	91.388	5,257	52.165	3,019
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	140.037	4,581	90.657	2,927
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	96.164	1,713	63.082	1,090
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12.725	1,165	8.239	700
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	36.942	720	26.894	492
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	52.881	359	25.969	163
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	271.124	8,879	198.6	6,606
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	389	195	224.6	111
	(-)	(△6)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	43.312	309	28.056	185
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	14.515	289	10.977	220
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
SAFEHOLD INC	6.458	197	4.015	115
	(△7.428)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	64.005	1,512	37.703	884
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	12.441	94	7.363	43
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	121.811	6,131	76.249	3,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132.258	2,856	88.148	1,844
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12.663	59	10.153	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	217.8	112	60	32
	(-)	(△5)	(-)	(-)
POSTAL REALTY TRUST INC	1.889	29	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6.172	106	2.105	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	28.479	690	19.868	455
	(-)	(-)	(-)	(-)
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	-	-	4.068	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	2.56	66	1.39	37
	(△9.507)	(△247)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	22.818	288	9.008	96
	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	14.622	127	12.785	100
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	28.876	241	17.489	128
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	25.528	485	12.169	227
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	41.764	794	27.189	521
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	1.891	120	2.1	136
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	49.566	1,612	31.798	998
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK HOMES TRUST INC	-	-	-	-
	(1.188)	(16)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	68.664	2,600	49.503	1,856
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	83.494	1,486	51.751	897
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAR HOLDINGS	-	-	-	-
	(5.322)	(112)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10.61	268	6.315	162
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	89.7	61	49.3	34
	(-)	(△2)	(-)	(-)

	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
STORE CAPITAL CORP	62.982 (-)	1,904 (-)	140.748 (-)	4,486 (-)
PARAMOUNT GROUP INC	64.095 (-)	370 (-)	40.652 (-)	225 (-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26.797 (-)	267 (-)	18.197 (-)	161 (-)
URBAN EDGE PROPERTIES	50.559 (-)	753 (-)	32.044 (-)	463 (-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	31.428 (-)	499 (-)	18.136 (-)	273 (-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	41.788 (-)	604 (-)	27.269 (-)	382 (-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8.434 (-)	423 (-)	5.313 (-)	242 (-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	35.545 (-)	1,534 (-)	24.383 (-)	1,022 (-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9.548 (-)	350 (-)	6.217 (-)	218 (-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91.151 (-)	1,455 (-)	60.79 (-)	926 (-)
GLOBAL NET LEASE INC	35.909 (-)	486 (-)	18.858 (-)	242 (-)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14.638 (-)	179 (-)	- (-)	- (-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	842.4 (-)	290 (△2)	529.7 (-)	175 (-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	94.933 (-)	1,248 (-)	71.108 (-)	907 (-)
VICI PROPERTIES INC	462.717 (-)	14,884 (-)	307.756 (-)	9,914 (-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	39.174 (-)	1,041 (-)	23.16 (-)	618 (-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	32.342 (-)	877 (-)	22.51 (-)	599 (-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	42.562 (-)	1,959 (-)	31.627 (-)	1,453 (-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51.894 (-)	642 (-)	36.568 (-)	442 (-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	48.237 (-)	777 (-)	33.91 (-)	533 (-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	69.863 (-)	1,443 (-)	50.288 (-)	1,011 (-)
ALLIED PROPERTIES REIT	27.336 (-)	776 (-)	17.809 (-)	483 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10.822 (-)	166 (-)	10.502 (-)	158 (-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.441 (-)	391 (-)	5.249 (-)	284 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.677 (-)	167 (-)	10.602 (-)	91 (-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	22.644 (-)	350 (-)	14.744 (-)	221 (-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	29.499 (-)	388 (-)	19.784 (-)	253 (-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54.186 (-)	541 (-)	31.563 (-)	313 (-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2.247 (-)	40 (-)	- (-)	- (-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	57.905 (-)	759 (-)	37.374 (-)	489 (-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	24.603 (-)	465 (-)	52.136 (-)	521 (-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14.218 (-)	1,121 (-)	10.069 (-)	802 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10.425 (-)	64 (-)	5.794 (-)	32 (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	78.323 (-)	1,106 (-)	55.181 (-)	772 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.878 (-)	172 (-)	7.797 (-)	109 (-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23.52 (-)	374 (-)	15.579 (-)	242 (-)
PLAZA RETAIL REIT	- (-)	- (-)	16.376 (-)	65 (-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.76 (-)	27 (-)	- (-)	- (-)
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.769 (-)	102 (-)	- (-)	- (-)
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13.322 (-)	276 (-)	5.218 (-)	101 (-)
SLATE GROCERY REIT	15.919 (-)	226 (-)	11.822 (-)	161 (-)
NEXUS INDUSTRIAL REIT	17.694 (-)	173 (-)	10.697 (-)	97 (-)
PRIMARIS REIT	18.413 (-)	256 (-)	10.359 (-)	137 (-)
SLATE OFFICE REIT	8.835 (-)	41 (-)	6.752 (-)	29 (-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3.521 (-)	41 (-)	2.665 (-)	34 (-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21.082 (-)	361 (-)	14.043 (-)	238 (-)
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	197.973 (-)	776 (-)	133.395 (-)	513 (-)
MIRVAC GROUP	1,853.463 (-)	3,976 (-)	1,294.797 (-)	2,746 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
CROMWELL PROPERTY GROUP	529.883 (-)	353 (-)	364.294 (-)	233 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	221.455 (-)	867 (-)	149.106 (-)	572 (-)
GPT GROUP	860.435 (-)	3,779 (-)	598.664 (-)	2,541 (-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	255.065 (-)	452 (-)	142.322 (-)	245 (-)
ABACUS PROPERTY GROUP	161.194 (-)	433 (-)	92.044 (-)	241 (-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	120.864 (-)	394 (-)	58.558 (-)	180 (-)
STOCKLAND	1,111.398 (-)	4,244 (-)	776.907 (-)	2,914 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	147.838 (-)	606 (-)	95.082 (-)	372 (-)
DEXUS	486.473 (-)	4,002 (-)	339.622 (-)	2,713 (-)
GOODMAN GROUP	793.35 (-)	14,901 (-)	547.239 (-)	10,238 (-)
VICINITY CENTRES	1,719.112 (-)	3,382 (-)	1,153.673 (-)	2,222 (-)
CHARTER HALL GROUP	196.126 (-)	2,421 (-)	128.874 (-)	1,545 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	121.253 (-)	390 (-)	92.022 (-)	288 (-)
REGION RE LTD	526.897 (-)	1,374 (-)	352.981 (-)	872 (-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	211.007 (-)	655 (-)	133.287 (-)	402 (-)
ARENA REIT	134.203 (-)	526 (-)	72.751 (-)	280 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	310.383 (-)	1,360 (-)	197.223 (-)	849 (-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	71.755 (-)	207 (-)	44.504 (-)	122 (-)
NATIONAL STORAGE REIT	542.744 (-)	1,322 (-)	333.186 (-)	813 (-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62.468 (-)	209 (-)	42.272 (-)	138 (-)
GDI PROPERTY GROUP	180.531 (-)	140 (-)	137.075 (-)	100 (-)
RURAL FUNDS GROUP	138.817 (-)	318 (-)	91.137 (-)	196 (-)
IRONGATE GROUP	32.043 (-)	60 (-)	213.237 (-)	405 (-)
SCENTRE GROUP	2,407.532 (-)	6,824 (-)	1,674.489 (-)	4,670 (-)
HMC CAPITAL LTD	98.428 (-)	441 (-)	43.001 (-)	175 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	615.8 (-)	776 (-)	345.471 (-)	422 (-)
HEALTHCO REIT	130.128 (-)	184 (-)	18.996 (-)	33 (-)
CENTURIA OFFICE REIT	185.682 (-)	290 (-)	102.641 (-)	149 (-)
WAYPOINT REIT LTD	281.739 (-)	741 (-)	194.093 (-)	492 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT DUMMY	156.3 (-)	8,084 (-)	- (-)	- (-)
LINK REIT	1,035.3 (-)	56,476 (13)	694.9 (-)	36,819 (-)
PROSPERITY REIT	527 (-)	1,131 (-)	342 (-)	666 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,068 (-)	2,420 (-)	765 (-)	1,519 (-)
CHAMPION REIT	611 (-)	2,011 (-)	347 (-)	1,144 (-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338 (-)	1,111 (-)	235 (-)	761 (-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	629 (-)	3,979 (-)	387 (-)	2,469 (-)
LINK REIT-RTS	- (225.244)	- (△13)	225.244 (-)	900 (-)
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	2,344.8 (-)	4,700 (△2)	1,672.1 (-)	3,283 (-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,543.1 (-)	4,297 (△50)	1,075.5 (-)	2,989 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	980.7 (-)	1,428 (△7)	643.9 (-)	945 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,486.3 (-)	2,469 (△51)	1,003.1 (-)	1,660 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	531.2 (-)	292 (-)	328.7 (-)	174 (-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	908.2 (-)	935 (△15)	500.5 (-)	509 (-)
KEPPEL REIT	838.6 (-)	799 (-)	546.8 (-)	510 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	478 (-)	1,058 (-)	323.9 (-)	720 (-)
ESR LOGOS REIT	2,856.3 (-)	1,013 (△7)	1,512.7 (-)	522 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	346.6 (-)	419 (△1)	229.2 (-)	274 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	456.5 (-)	513 (△23)	246.2 (-)	265 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	544.5 (-)	143 (△6)	334.1 (-)	87 (-)

	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	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		151.3		201		86.5		116
		(-)		(△7)		(-)		(-)
PARKWAY LIFE REIT		166.2		693		110.4		448
		(-)		(△5)		(-)		(-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		907.6		2,161		592.6		1,405
		(-)		(△0.82883)		(-)		(-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL		1,014.3		1,776		648.6		1,135
		(-)		(△6)		(-)		(-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST		-		-		124.4		148
		(-)		(△0.67549)		(-)		(-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		451.3		278		273.7		164
		(-)		(-)		(-)		(-)
PARAGON REIT		481.5		447		300.7		279
		(-)		(-)		(-)		(-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		149.5		112		84.1		61
		(-)		(-)		(-)		(-)
OUÉ COMMERCIAL REIT		930.2		320		679		227
		(-)		(△2)		(-)		(-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT		763.4		547		489.2		358
		(-)		(-)		(-)		(-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		319.9		197		197.1		115
		(-)		(△9)		(-)		(-)
IREIT GLOBAL		-		-		168.6		85
		(-)		(△2)		(-)		(-)
KEPPEL DC REIT		584.4		1,133		393.5		771
		(-)		(△12)		(-)		(-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST		1,328.8		1,677		918.7		1,178
		(-)		(△20)		(-)		(-)
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		509.611		653		290.797		368
		(-)		(-)		(-)		(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		222.906		551		155.612		378
		(-)		(-)		(-)		(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST		516.012		1,075		357.07		742
		(-)		(-)		(-)		(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD		721.983		671		478.656		436
		(-)		(-)		(-)		(-)
ARGOSY PROPERTY LTD		275.903		319		189.331		218
		(-)		(-)		(-)		(-)
STRIDE STAPLED GROUP		370.694		604		137.344		194
		(-)		(-)		(-)		(-)
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		434.208		1,815		305.397		1,197
		(-)		(-)		(-)		(-)
DERWENT LONDON PLC		52.718		1,297		37.483		873
		(-)		(-)		(-)		(-)
BIG YELLOW GROUP PLC		75.861		922		50.084		583
		(-)		(-)		(-)		(-)
HAMMERSON PLC		1,508.537		373		706.246		164
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付		売 付	
	□ 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
LAND SECURITIES GROUP PLC	366.408	2,381	257.226	1,562
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	53.606	271	34.927	163
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	187.678	1,831	132.727	1,245
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	554.181	643	361.233	411
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	78.702	337	35.621	141
(△131.131)	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGREO PLC	570.257	4,819	390.076	3,137
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	104.225	571	67.641	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	1,245.215	695	829.528	441
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	167.963	108	99.031	56
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	173.703	84	78.272	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
HELICAL PLC	48.089	132	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	216.96	173	148.03	117
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	352.394	212	212.48	119
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	97.634	973	65.858	626
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	451.633	887	310.201	579
	(-)	(-)	(-)	(-)
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	307.731	287	195.694	173
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	615.951	748	440.359	520
(440.075)	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSE REIT PLC	287.7	370	103.341	108
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	120.548	99	85.737	68
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	274.289	177	163.453	100
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRS REIT PLC/THE	196.87	179	128.075	113
	(-)	(-)	(-)	(-)
CLS HOLDINGS PLC	83.611	125	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	89.136	70	41.253	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	508.013	518	336.62	324
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	819.933	1,267	551.355	789
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 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
CUSTODIAN REIT PLC	193.557	180	132.181	119
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME REIT PLC	174.692	185	74.149	71
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	240.146	209	150.055	130
	(-)	(-)	(-)	(-)
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	165.764	116	61.787	37
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK REIT PLC	89.174	87	68.854	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	1,111.121	1,377	620.948	719
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	167.475	101	137.217	79
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	330.767	504	109.087	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	119.991	120	70.745	67
	(-)	(-)	(-)	(-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シケル	千□	千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	69.118	1,166	43.431	746
	(-)	(-)	(-)	(-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	80.834	689	52.096	426
	(-)	(-)	(-)	(-)
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314.331	606	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	34.658	146,210	24.14	102,277
	(-)	(-)	(-)	(-)
KOREA ASSET IN TRUST CO LTD	20.195	69,188	20.195	65,850
	(-)	(-)	(-)	(-)
E KOCREF CR-REIT CO LTD	17.156	94,585	6.021	33,257
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	15.023	104,263	4.736	37,583
	(-)	(-)	(-)	(-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	14.759	70,762	7.437	33,005
	(-)	(-)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD	59.659	244,534	43.308	178,793
	(-)	(-)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	28.054	146,125	18.676	92,921
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	5.728	29,587	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
JR REIT XXVII	60.111	268,849	38.919	171,125
	(-)	(19)	(-)	(-)
SK REITS CO LTD	33.006	168,861	18.906	94,584
	(-)	(△768)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	-	-	5.465	1,066
	(5.465)	(-)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	70.841	295,417	40.489	169,257
	(-)	(△2,206)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
D&D PLATFORM REIT CO LTD	24.986	98,366	13.214	52,217
	(-)	(△417)	(-)	(-)
SK REITS CO LTD-RTS	-	-	4.739	222
	(4.739)	(△3)	(-)	(-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	17.936	70,562	8.211	34,740
	(-)	(△542)	(-)	(-)
JR GLOBAL REIT-RTS	-	-	10.483	-
	(10.483)	(△19)	(-)	(-)
ユーロ (シンガポール)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	152.8	266	91.5	159
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	176.964	204	104.581	114
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
VASTNED RETAIL	7.516	163	4.729	95
	(-)	(-)	(-)	(-)
WERELDHAVE NV	15.224	207	10.227	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
NSI NV	8.003	194	5.165	115
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.992	424	11.788	259
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	1.948	92	9.279	438
	(-)	(-)	(-)	(-)
COFINIMMO SA	12.196	1,096	7.486	650
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	3.74	243	1.986	122
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9.762	206	4.114	85
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	74.256	2,085	48.101	1,309
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	6.113	482	3.163	247
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	19.056	1,553	12.573	982
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	17.34	265	10.177	154
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	-	-	10.525	6
	(10.525)	(-)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	9.298	287	6.001	189
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	24.441	2,397	16.79	1,571
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	13.296	585	8.653	380
	(-)	(△11)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
ALTAREA	1.833	234	0.998	121
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	87.765	1,895	61.026	1,303
	(-)	(-)	(-)	(-)
COVIVIO	19.493	1,111	13.199	721
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	34.454	319	16.738	148
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	25.9	367	12.842	177
	(-)	(△30)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	82	3.061	137
	(49.493)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48.794	2,559	35.157	1,783
	(△49.493)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	23.841	178	14.982	112
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4.046	42	3.777	26
	(-)	(△25)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	129.781	785	78.618	448
	(-)	(△17)	(-)	(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19.613	95	12.25	59
	(-)	(△11)	(-)	(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	144.464	1,266	98.211	817
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (イタリア)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	12.141	39	5.946	16
	(-)	(-)	(-)	(-)
COIMA RES SPA	-	-	7.596	75
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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 (2022年6月23日から2023年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引状況

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

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	期首(前期末)		当期		期末	
		□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率
不動産ファンド (アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		227.5	391.9	121	17,247		0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0		0.0
PRIME US REIT		159.8	317.6	65	9,243		0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		104.2	144.6	67	9,648		0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		526.3	839	144	20,487		0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		45,455	70,549	7,986	1,133,893		1.4
ALEXANDER'S INC.		0.661	1.021	186	26,411		0.0
BOSTON PROPERTIES INC		44.04	63.691	3,450	489,907		0.6
CEDAR REALTY TRUST INC		3.781	—	—	—		—
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		72.072	104.551	3,213	456,277		0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		50.727	65.982	533	75,689		0.1
AGREE REALTY CORP		23.151	41.761	2,722	386,499		0.5
BRT APARTMENTS CORP		4.22	6.159	121	17,304		0.0
SL GREEN		19.707	28.057	729	103,564		0.1
EPR PROPERTIES		23.004	33.842	1,501	213,225		0.3
PROLOGIS INC		227.981	414.926	50,077	7,109,491		8.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC		43.06	63.859	12,093	1,716,930		2.1
LXP INDUSTRIAL TRUST		86.864	131.103	1,301	184,824		0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		32.805	47.839	5,307	753,539		0.9
VERIS RESIDENTIAL INC		26.897	35.212	588	83,584		0.1
EQUINIX INC		28.058	42.028	32,277	4,582,437		5.6
NNN REIT INC		54.298	82.288	3,437	487,974		0.6
CTO REALTY GROUTH INC		1.858	9.356	155	22,075		0.0
COUSINS PROPERTIES INC		45.843	68.071	1,463	207,776		0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		9.712	14.046	288	40,919		0.1
SITE CENTERS CORP		54.965	81.813	1,053	149,601		0.2
SAFEHOLD INC		—	17.782	412	58,619		0.1
DUKE REALTY TRUST		118.933	—	—	—		—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		15.107	11.922	42	6,008		0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		20.121	28.759	6,691	950,012		1.2
EQUITY RESIDENTIAL		105.387	152.806	10,010	1,421,165		1.8
FEDERAL REALTY INVS TRUST		21.871	33.218	3,068	435,613		0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		40.254	58.984	3,090	438,711		0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		166.168	244.412	4,856	689,472		0.8
EQUITY COMMONWEALTH		34.761	49.039	1,017	144,462		0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		45.424	—	—	—		—
HIGHWOODS PROPERTIES INC		32.282	48.223	1,075	152,670		0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST		55.097	76.925	661	93,920		0.1
WELLTOWER INC		139.809	223.439	17,649	2,505,691		3.1
EAST GROUP		12.57	20.032	3,458	490,949		0.6
KIMCO REALTY		191.008	277.027	5,291	751,193		0.9

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	%
KILROY REALTY CORP	32.424	47.193	1,417	201,267	0.2
LTC PROPERTIES INC	11.949	18.9	627	89,137	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80.9	101.192	197	28,014	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	52.781	81.948	358	50,957	0.1
IRON MOUNTAIN INC	89.485	131.248	7,290	1,035,078	1.3
THE MACERICH COMPANY	65.088	95.956	1,048	148,898	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53.477	78.222	5,310	753,930	0.9
ACADIA REALTY TRUST	26.852	44.351	624	88,654	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	221.191	318.701	5,303	752,893	0.9
MID AMERICA	35.548	52.249	7,926	1,125,353	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.122	13.525	80	11,367	0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	14.064	19.429	1,029	146,219	0.2
CENTERSPACE	5.041	6.622	404	57,441	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.609	8.132	170	24,267	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1.938	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	13.2	20.182	675	95,928	0.1
PS BUSINESS PARKS	6.193	—	—	—	—
RPT REALTY	25.143	40.594	397	56,421	0.1
REALTY INCOME CORP	185.275	302.637	18,040	2,561,165	3.2
REGENCY CENTERS CORP	47.683	68.717	4,098	581,833	0.7
UDR INC	92.65	138.65	5,885	835,591	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	34.498	50.428	1,202	170,676	0.2
SAUL CENTERS INC	4.594	5.447	195	27,723	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	101.12	147.007	16,278	2,310,999	2.8
LIFE STORAGE INC	25.982	38.018	4,956	703,715	0.9
PUBLIC STORAGE	47.03	71.125	20,466	2,905,690	3.6
SUN COMMUNITIES INC	37.453	55.989	7,392	1,049,474	1.3
TANGER FACTORY OUTLET	31.61	46.487	989	140,508	0.2
UMH PROPERTIES INC	13.569	26.109	419	59,529	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11.025	16.72	204	29,054	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3.781	6.151	289	41,147	0.1
VENTAS INC	123.095	179.26	8,059	1,144,211	1.4
VORNADO REALTY TRUST	49.038	71.874	1,113	158,059	0.2
ELME COMMUNITIES	25.835	40.732	645	91,656	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	43.066	—	—	—	—
KITE REALTY GROUP TRUST	67.449	99.789	2,096	297,649	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	41.354	60.583	8,845	1,255,827	1.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33.176	53.55	75	10,719	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67.157	94.114	922	130,941	0.2
CUBESMART	69.12	100.353	4,521	641,975	0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	87.671	131.006	13,669	1,940,611	2.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	64.291	91.448	717	101,915	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	184.696	266.517	2,379	337,888	0.4
DOUGLAS EMMETT INC	54.064	76.09	955	135,679	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	37.066	55.617	738	104,858	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
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	37.982	58.595	407	57,815	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31.732	50.883	317	45,004	0.1
TERRENO REALTY CORP	23.266	32.893	1,914	271,736	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16.216	23.022	439	62,427	0.1
RLJ LODGING TRUST	50.885	70.804	705	100,218	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	82.511	121.186	3,868	549,176	0.7
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40.287	55.166	707	100,405	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	16.172	23.664	185	26,339	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	17.214	22.868	213	30,258	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70.265	103.588	1,215	172,505	0.2
WHITESTONE REIT	16.382	19.598	188	26,710	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	46.744	61.059	290	41,175	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	54.404	79.986	2,847	404,259	0.5
WP CAREY INC	59.552	96.284	6,571	932,939	1.1
ALEXANDER & BALDWIN INC	21.978	33.832	617	87,657	0.1
GLADSTONE LAND CORP	9.216	15.596	254	36,090	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	70.549	169.898	3,166	449,604	0.6
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16.978	25.104	2,331	331,061	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	20.128	29.672	353	50,171	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41.363	63.531	2,480	352,121	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	67.816	106.824	1,481	210,349	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	50.822	90.045	4,775	678,046	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT	91.409	140.789	4,917	698,174	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	68.065	101.147	1,826	259,338	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	8.362	12.848	951	135,069	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	33.048	43.096	643	91,346	0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	36.884	63.796	421	59,776	0.1
INVITATION HOMES INC	187.961	260.485	8,903	1,264,012	1.6
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47.245	62.501	434	61,669	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13.541	17.079	384	54,555	0.1
SAFEHOLD INC	4.985	—	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	40.391	66.693	1,589	225,632	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	21.803	26.881	76	10,876	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	72.71	118.272	5,761	817,893	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	92.007	136.117	2,902	411,998	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20.173	22.683	88	12,591	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC	5.42	7.309	106	15,129	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.685	6.752	108	15,471	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20.754	29.365	661	93,843	0.1
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST	4.068	—	—	—	—
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	8.337	—	—	—	—
FARMLAND PARTNERS INC	9.907	23.717	278	39,563	0.0
CITY OFFICE REIT INC	15.394	17.231	92	13,063	0.0
ORION OFFICE REIT INC	16.725	28.112	183	26,061	0.0
NETSTREIT CORP	14.759	28.118	504	71,694	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	率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
CARETRUST REIT INC	29.882	44.457	864	122,759		0.2
INDUS REALTY TRUST INC	2.312	2.103	140	19,952		0.0
PHILLIPS EDISON & CO INC	34.925	52.693	1,732	245,894		0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	1.188	18	2,653		0.0
APARTMENT INCOME REIT CORP	48.505	67.666	2,419	343,433		0.4
BROADSTONE NET LEASE INC	52.141	83.884	1,312	186,376		0.2
STAR HOLDINGS	—	5.322	73	10,494		0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7.54	11.835	267	37,922		0.0
STORE CAPITAL CORP	77.766	—	—	—		—
PARAMOUNT GROUP INC	55.259	78.702	346	49,162		0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17.822	26.422	248	35,260		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	33.994	52.509	779	110,702		0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	29.19	42.482	610	86,728		0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	35.217	49.736	606	86,073		0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6.895	10.016	454	64,585		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	25.232	36.394	1,270	180,426		0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.99	10.321	340	48,397		0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	65.286	95.647	1,409	200,154		0.2
GLOBAL NET LEASE INC	31.417	48.468	490	69,566		0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE	—	14.638	167	23,794		0.0
CLIPPER REALTY INC	5.086	5.086	27	3,891		0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	72.797	96.622	1,214	172,428		0.2
VICI PROPERTIES INC	296.576	451.537	14,060	1,996,220		2.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	23.62	39.634	1,011	143,653		0.2
小 計	□ 数	□ 数	金額	金額		—
銘 柄 数<比 率>	7,979.351	11,681.835	440,278	62,506.354		—
	151銘柄<76.0%>	145銘柄<77.0%>	—	—		77.0
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	21.535	31.367	756	81,683		0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT	26.099	37.034	1,789	193,120		0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	42.878	58.204	593	64,070		0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	32.504	46.831	675	72,929		0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	46.43	66.005	1,258	135,769		0.2
ALLIED PROPERTIES REIT	19.099	28.626	612	66,111		0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	8.213	8.533	109	11,833		0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.546	9.738	589	63,570		0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	17.493	24.568	168	18,161		0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV	16.748	24.648	339	36,681		0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22.588	32.303	405	43,751		0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	33.05	55.673	380	41,096		0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	6.458	8.705	139	15,049		0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT	4.643	4.643	15	1,653		0.0
DREAM INDUSTRIAL REIT	36.406	56.937	757	81,723		0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.423	15.423	47	5,076		0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	27.533	—	—	—		—
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	9.835	13.984	1,046	112,929		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
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	16.803	21.434	51	5,505		0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	48.913	72.055	955	103,112		0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	5.26	9.341	134	14,465		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.147	25.088	362	39,069		0.0
PLAZA RETAIL REIT	16.376	—	—	—		—
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	10.116	17.876	50	5,459		0.0
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	15.769	82	8,934		0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	8.104	132	14,343		0.0
SLATE GROCERY REIT	7.969	12.066	154	16,706		0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	7.458	14.455	119	12,869		0.0
PRIMARIS REIT	13.944	21.998	274	29,627		0.0
SLATE OFFICE REIT	15.735	17.818	36	3,922		0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	7.481	8.337	93	10,094		0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	17.944	24.983	430	46,481		0.1
小 計	□ 数 ・ 金 額	579.627	792.546	12,563	1,355,806	—
	銘 柄 数<比 率>	30銘柄<1.9%>	30銘柄<1.7%>	—	—	1.7
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%
BWP TRUST	144.478	209.056	773	74,651		0.1
MIRVAC GROUP	1,217.477	1,776.143	4,138	399,398		0.5
CROMWELL PROPERTY GROUP	466.932	632.521	338	32,658		0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT	157.855	230.204	849	81,980		0.1
GPT GROUP	591.472	853.243	3,617	349,149		0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	189.484	302.227	513	49,585		0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	126.389	195.539	527	50,952		0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	98.14	160.446	482	46,608		0.1
STOCKLAND	737.402	1,071.893	4,544	438,621		0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	109.543	162.299	655	63,280		0.1
DEXUS	332.461	479.312	3,925	378,856		0.5
GOODMAN GROUP	523.576	769.687	15,755	1,520,562		1.9
VICINITY CENTRES	1,193.493	1,758.932	3,350	323,382		0.4
CHARTER HALL GROUP	145.638	212.89	2,356	227,444		0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	96.915	126.146	370	35,792		0.0
REGION RE LTD	341.231	515.147	1,200	115,840		0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	162.422	240.142	756	73,004		0.1
ARENA REIT	103.753	165.205	642	62,021		0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	186.309	299.469	1,260	121,676		0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	63.933	91.184	245	23,672		0.0
NATIONAL STORAGE REIT	329.249	538.807	1,287	124,280		0.2
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	65.661	85.857	285	27,509		0.0
GDI PROPERTY GROUP	178.986	222.442	151	14,598		0.0
RURAL FUNDS GROUP	126.29	173.97	300	28,962		0.0
IRONGATE GROUP	181.194	—	—	—		—
SCENTRE GROUP	1,606.393	2,339.436	6,269	605,087		0.7
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	140.343	140.343	95	9,210		0.0
HMC CAPITAL LTD	53.607	109.034	541	52,298		0.1

銘柄	期首(前期末)		当期		末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	439,583	709,912	841	81,188	0.1	
HEALTHCO REIT	71,487	182,619	257	24,850	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	127.89	210,931	302	29,212	0.0	
WAYPOINT REIT LTD	212,662	300,308	837	80,861	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	10,522,248 32銘柄<6.4%>	15,265,344 31銘柄<6.8%>	57,477 -	5,547,201 -	- 6.8
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円	%	
LINK REIT	648.62	1,145.32	51,825	940,636	1.2	
PROSPERITY REIT	353	538	914	16,599	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	682	985	1,654	30,034	0.0	
CHAMPION REIT	632.07	896.07	2,455	44,562	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	342	445	1,303	23,664	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	436	678	3,823	69,404	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3,093.69 6銘柄<1.6%>	4,687.39 6銘柄<1.4%>	61,978 -	1,124,903 -	- 1.4
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,573,909	2,246,609	4,448	471,162	0.6	
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,037.96	1,505.56	4,140	438,539	0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	668.49	1,005.29	1,306	138,424	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	985.82	1,469.02	2,482	262,961	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	412.4	614.9	310	32,890	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	588.116	995.816	1,095	116,024	0.1	
KEPPEL REIT	598.9	890.7	792	83,965	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	326.6	480.7	1,076	114,051	0.1	
ESR LOGOS REIT	1,558.24	2,901.84	972	102,966	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	277.1	394.5	477	50,560	0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST	338.18	548.48	553	58,675	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	327.7	538.1	139	14,818	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	163,795	228,595	278	29,539	0.0	
PARKWAY LIFE REIT	117.4	173.2	654	69,345	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	597.62	912.62	2,053	217,495	0.3	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	673.1	1,038.8	1,734	183,749	0.2	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	124.4	-	-	-	-	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	303.8	481.4	291	30,848	0.0	
PARAGON REIT	313	493.8	469	49,688	0.1	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	112.4	112.4	35	3,809	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	194.5	259.9	184	19,545	0.0	
OUE COMMERCIAL REIT	787,955	1,039,155	348	36,872	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	573	847.2	563	59,674	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	103.9	226.7	137	14,527	0.0	
IREIT GLOBAL	168.6	-	-	-	-	
KEPPEL DC REIT	403.5	594.4	1,230	130,324	0.2	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	894,764	1,304,864	1,657	175,528	0.2	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	14,225,149 27銘柄<3.5%>	21,304,549 25銘柄<3.6%>	27,435 -	2,905,990 -	- 3.6

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(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	391.694	610.508	775	68,331		0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	142.269	209.563	490	43,216		0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	317.48	476.422	1,026	90,482		0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	467.188	710.515	646	56,982		0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	289.87	376.442	419	36,991		0.0
STRIDE STAPLED GROUP	—	233.35	324	28,585		0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	1,608.501 5銘柄<0.4%>	2,616.8 6銘柄<0.4%>	3,683 —	324,588 —	— 0.4
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%
BRITISH LAND CO PLC	288.115	416.926	1,372	248,755		0.3
DERWENT LONDON PLC	34.55	49.785	1,037	188,040		0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	53.044	78.821	848	153,855		0.2
HAMMERSON PLC	1,047.969	1,850.26	475	86,182		0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	230.251	339.433	1,940	351,764		0.4
WORKSPACE GROUP PLC	41.816	60.495	294	53,373		0.1
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	0	0		0.0
UNITE GROUP PLC	123.179	178.13	1,595	289,105		0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	407.879	600.827	581	105,409		0.1
SHAFTESBURY PLC	88.05	—	—	—		—
SEGRO PLC	370.318	550.499	4,037	731,731		0.9
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	77.506	114.09	495	89,823		0.1
ASSURA PLC	903.196	1,318.883	610	110,672		0.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	115.909	184.841	91	16,649		0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT HELICAL PLC	160.85 —	256.281 48.089	113 129	20,483 23,532		0.0 0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	179.543	248.473	187	34,000		0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	256.076	395.99	205	37,319		0.0
SAFESTORE HOLDINGS LTD	64.657	96.433	829	150,306		0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	300.333	441.765	753	136,591		0.2
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU	239.019	351.056	252	45,810		0.1
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	259.531	875.198	1,054	191,138		0.2
WAREHOUSE REIT PLC	—	184.359	151	27,499		0.0
NEWRIVER REIT PLC	113.346	148.157	128	23,200		0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	182.937	293.773	233	42,328		0.1
PRS REIT PLC/THE	181.169	249.964	197	35,835		0.0
CLS HOLDINGS PLC	—	83.611	112	20,396		0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	105.686	153.569	78	14,250		0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	381.587	552.98	416	75,567		0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	575.519	844.097	1,109	201,021		0.2
CUSTODIAN REIT PLC	128.872	190.248	165	29,963		0.0
HOME REIT PLC	186.078	286.621	108	19,739		0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	197.945	288.036	252	45,730		0.1
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO P	—	103.977	63	11,419		0.0
AEW UK REIT PLC	58.66	78.98	78	14,314		0.0
LXI REIT PLC	277.287	767.46	681	123,515		0.2

銘柄	期首(前期末)	当期			末	
		口数	口数	外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
REGIONAL REIT LTD	150.233	180.491	84	15,309	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	-	221.68	264	47,971	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	136.07	185.316	168	30,463	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	8,148.22 34銘柄<5.5%>	13,500.634 38銘柄<4.7%>	21,204 -	3,843,073 -	- 4.7
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シェケル	千円	%	
REIT 1 LTD	61.727	87.414	1,429	56,044	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	63.623	92.361	730	28,662	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	-	314.331	539	21,139	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	125.35 2銘柄<0.1%>	494.106 3銘柄<0.1%>	2,699 -	105,846 -	- 0.1
(韓国)	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%	
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	28.835	39.353	169,021	18,643	0.0	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	-	11.135	59,572	6,570	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19.52	29.807	181,822	20,055	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11.032	18.354	86,080	9,494	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	39.603	55.954	217,101	23,946	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11.152	20.53	111,683	12,318	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	4.123	9.851	36,005	3,971	0.0	
JR REIT XXVII	45.194	66.386	301,060	33,206	0.0	
SK REITS CO LTD	17.691	31.791	164,041	18,093	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	43.616	73.968	308,076	33,980	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	14.329	26.101	86,394	9,529	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	11.162	20.887	75,610	8,339	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	246.257 11銘柄<0.3%>	404.117 12銘柄<0.2%>	1,796,470 -	198,150 -	- 0.2
(ユーロ…シンガポール)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CROMWELL REIT EUR	101.34	162.64	256	40,087	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	101.34 1銘柄<0.1%>	162.64 1銘柄<0.0%>	256 -	40,087 -	- 0.0
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	125.78	198.163	191	29,800	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	125.78 1銘柄<0.0%>	198.163 1銘柄<0.0%>	191 -	29,800 -	- 0.0
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	5.188	7.975	157	24,633	0.0	
WERELDHAVE NV	13.152	18.149	250	39,014	0.0	
NSI NV	5.696	8.534	168	26,359	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11.992	19.196	390	60,849	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	36.028 4銘柄<0.2%>	53.854 4銘柄<0.2%>	967 -	150,857 -	- 0.2
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
BEFIMMO	7.331	-	-	-	-	
COFINIMMO SA	9.07	13.78	979	152,842	0.2	
RETAIL ESTATES	3.376	5.13	324	50,577	0.1	

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(ユーロ…ベルギー)	千□		千□	千ユー□	千円	%
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6.965		12.613	188	29,357	0.0
WAREHOUSES DE PAUW	43.839		69.994	1,777	277,344	0.3
MONTEA SCA	3.06		6.01	441	68,816	0.1
AEDIFICA	11.176		17.659	1,079	168,456	0.2
CARE PROPERTY INVEST NV	8.849		16.012	199	31,123	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	6.95		10.247	293	45,797	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	100.616 9銘柄<1.3%>	151.445 8銘柄<1.0%>	5,284 -	824,315 -	- 1.0
(ユーロ…フランス)	千□		千□	千ユー□	千円	%
GECINA SA	16.786		24.437	2,360	368,255	0.5
ICADE	9.819		14.462	568	88,753	0.1
ALTAREA	1.248		2.083	213	33,339	0.0
KLEPIERRE	60.076		86.815	1,924	300,251	0.4
COVIVIO	14.518		20.812	918	143,308	0.2
MERCIALYS	17.947		35.663	291	45,453	0.1
CARMILA SA	13.198		26.256	364	56,933	0.1
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-		48.183	2,236	348,918	0.4
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	35.856		-	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	169.448 8銘柄<1.7%>	258.711 8銘柄<1.7%>	8,879 -	1,385,213 -	- 1.7
(ユーロ…ドイツ)	千□		千□	千ユー□	千円	%
HAMBORNER REIT AG	23.534		32.393	217	33,857	0.0
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3.67		3.939	20	3,133	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	27.204 2銘柄<0.1%>	36.332 2銘柄<0.0%>	237 -	36,991 -	- 0.0
(ユーロ…スペイン)	千□		千□	千ユー□	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	82.605		133.768	742	115,816	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	18.955		26.318	144	22,539	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	102.599		148.852	1,155	180,194	0.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	204.159 3銘柄<0.4%>	308.938 3銘柄<0.4%>	2,041 -	318,550 -	- 0.4
(ユーロ…イタリア)	千□		千□	千ユー□	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	14.36		20.555	51	8,064	0.0
COIMA RES SPA	7.596		-	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	21.956 2銘柄<0.0%>	20.555 1銘柄<0.0%>	51 -	8,064 -	- 0.0
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	47,314.924 328銘柄<99.3%>	71,937.959 324銘柄<99.4%>	- -	80,705,796 -	- 99.4

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

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

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

■投資信託財産の構成

2023年6月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券、投資証券	80,705,796 千円	99.0 %
コール・ローン等、その他	810,337	1.0
投資信託財産総額	81,516,134	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、81,117,389千円、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、2023年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=141.97円、1カナダ・ドル=107.92円、1オーストラリア・ドル=96.51円、1香港・ドル=18.15円、1シンガポール・ドル=105.92円、1ニュージーランド・ドル=88.13円、1イギリス・ポンド=181.24円、1イスラエル・シケル=39.213円、100韓国・ウォン=11.03円、1ユーロ=156.00円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	81,532,357,135円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	493,052,220
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	8,619,311,186
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	72,086,485,439
未 収 入 金	18,624,711
未 収 配 当 金	314,883,579
(B) 負 債	333,262,325
未 払 金	211,605,325
未 払 解 約 金	121,657,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	81,199,094,810
元 本	47,496,039,171
次 期 繰 越 損 益 金	33,703,055,639
(D) 受 益 権 総 口 数	47,496,039,171口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	17,096円

(注1) 期首元本額 33,589,773,063円
 追加設定元本額 48,627,104,040円
 一部解約元本額 34,720,837,932円

(注2) 期末における元本の内訳
 D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) 2,361,712,742円
 D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ) 35,315,437円
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 3,799,837円
 M I T O ラップ型ファンド (中立型) 16,993,360円
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 42,801,843円
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 53,631,948円
 グローバル8資産ラップファンド (中立型) 39,861,110円
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 42,915,263円
 たわらノーロード 先進国リート 15,013,942,860円
 たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> 1,566,109,485円
 たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> 331,123,558円
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 3,467,723,278円
 たわらノーロード バランス (堅実型) 28,608,263円
 たわらノーロード バランス (標準型) 563,881,175円
 たわらノーロード バランス (積極型) 1,170,685,116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) 48,387,380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) 499,698,074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) 506,479,071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) 890,805,367円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 623,293円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 33,617,966円
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 6,202,351円
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 25,151,182円
 O n e D C先進国リートインデックスファンド 1,662,663,729円
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 18,491,200円
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 690,947,972円
 マネックス資産設計ファンド エポリューション 57,534,103円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) 214,120,117円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) 312,458,906円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) 567,875,975円

投資のソムリエ 9,045,210,186円
 投資のソムリエ<DC年金> 720,615,046円
 D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 240,510,446円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 670,367,293円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,618,196,372円
 ワールドアセットバランス (基本コース) 347,351,219円
 ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 1,009,390,261円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 42,415,971円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 20,915,842円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 4,844,141円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 100,031,740円
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 176,001,936円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 50,035,961円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 23,020,391円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 14,147,630円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) 3,342,049円
 O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け> 86,386,655円
 D I A M/パッシブ資産分散ファンド 284,697,856円
 D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金> 328,891,728円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) 217,802円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) 647,540円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) 125,270円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) 285,547円
 インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04 (適格機関投資家限定) 711,941円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) 506,310円
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 244,380,951円
 A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定) 1,243,561円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) 572,716円
 リスクコントロール世界8資産バランスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用) 3,700,623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) 54,518,708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) 184,149,001円
 D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) 944,444,517円
 期末元本合計 47,496,039,171円

■損益の状況

当期 自2022年6月23日 至2023年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,018,423,361円	
	受取配当金	3,005,881,073	
	受取利息	11,524,314	
	その他の収益	1,180,907	
	支払利息	△162,933	
(B)	有価証券売買損益	△1,857,706,305	
	売買益	7,975,013,780	
	売買損	△9,832,720,085	
(C)	その他の費用	△39,826,167	
(D)	当期損益金(A+B+C)	1,120,890,889	
(E)	前期繰越損益金	22,413,304,632	
(F)	解約差損益金	△21,875,935,842	
(G)	追加信託差損益金	32,044,795,960	
(H)	計(D+E+F+G)	33,703,055,639	
	次期繰越損益金(H)	33,703,055,639	

(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。