Asset Management One

# 運 用 報 告 書（全体版）

## Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド

愛称 日本の矢

（旧ファンド名称：ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド）

第120期　<決算日　2026年１月６日>
第121期　<決算日　2026年３月６日>
第122期　<決算日　2026年５月７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、「Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド」は、2026年５月７日に第122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。

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/

### 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 | 2005年12月28日から無期限です。 | |
| 運用方針 | 安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざします。 | |
| 主要投資対象 | Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、インデックス２２５ マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券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。 |
| | インデックス２２５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、日経平均トータルリターン・インデックスに採用されている（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。<br>※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 |
| 運用方法 | 各マザーファンドへの投資に当たっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（以下、「基本リスクウェイト」といいます。）に基づき算出された資産構成比に従い、配分します。<br>基本リスクウェイトは、各資産の時価およびボラティリティをもとに、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社が定期的に計測します。計測の結果、原則として、基本リスクウェイトから信託財産におけるいずれかの資産のリスクウェイトが５％以上乖離した場合にはリバランスを行います。<br>実質組入外貨建資産については、為替ヘッジは行いません。 | |
| 組入制限 | Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド | マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。<br>株式への直接投資は行いません。<br>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 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。<br>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。<br>外貨建資産への投資には、制限を設けません。 |
| | インデックス２２５マザーファンド | 株式への投資割合には制限を設けません。 |
| | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>株式への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 毎決算時（原則として、奇数月の各６日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、原則として利子・配当等収益の範囲内で行います。また、毎年５月および11月の決算時には、原則として利子・配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。 | |

<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。

# Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド

## ■最近５作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期 | 基準価額 (分配落) | 基準価額 税込み分配金 | 基準価額 期中騰落率 | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 円 | 円 | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 第37作成期 | 108期(2024年１月９日) | 11,620 | 20 | 2.7 | 18.2 | 0.4 | 63.2 | － | 15.0 | 3,453 |
| | 109期(2024年３月６日) | 12,287 | 20 | 5.9 | 18.2 | 0.3 | 64.6 | － | 14.6 | 3,498 |
| | 110期(2024年５月７日) | 12,331 | 20 | 0.5 | 17.2 | 0.5 | 65.6 | － | 14.5 | 3,466 |
| 第38作成期 | 111期(2024年７月８日) | 13,013 | 20 | 5.7 | 19.5 | 0.5 | 63.5 | － | 15.6 | 3,601 |
| | 112期(2024年９月６日) | 12,136 | 20 | △6.6 | 18.3 | 0.6 | 62.8 | － | 16.2 | 3,317 |
| | 113期(2024年11月６日) | 12,750 | 20 | 5.2 | 19.0 | 0.7 | 62.1 | － | 16.5 | 3,470 |
| 第39作成期 | 114期(2025年１月６日) | 12,718 | 20 | △0.1 | 21.7 | 0.7 | 58.7 | － | 16.0 | 3,417 |
| | 115期(2025年３月６日) | 12,313 | 20 | △3.0 | 21.7 | 0.6 | 59.2 | － | 16.6 | 3,286 |
| | 116期(2025年５月７日) | 12,057 | 20 | △1.9 | 22.8 | 0.9 | 54.7 | － | 19.7 | 3,206 |
| 第40作成期 | 117期(2025年７月７日) | 12,525 | 20 | 4.0 | 24.0 | 0.7 | 53.4 | － | 19.9 | 3,310 |
| | 118期(2025年９月８日) | 13,156 | 20 | 5.2 | 23.6 | 0.7 | 53.3 | － | 20.3 | 3,428 |
| | 119期(2025年11月６日) | 13,981 | 20 | 6.4 | 24.7 | 0.6 | 52.5 | － | 19.9 | 3,605 |
| 第41作成期 | 120期(2026年１月６日) | 14,330 | 20 | 2.6 | 22.6 | 0.8 | 53.3 | － | 21.7 | 3,628 |
| | 121期(2026年３月６日) | 14,825 | 20 | 3.6 | 21.7 | 0.7 | 52.4 | － | 22.7 | 3,721 |
| | 122期(2026年５月７日) | 15,305 | 20 | 3.4 | 23.5 | 0.7 | 51.3 | － | 22.8 | 3,768 |

（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」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注３）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。
（注４）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。
（注５）当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。
（注６）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

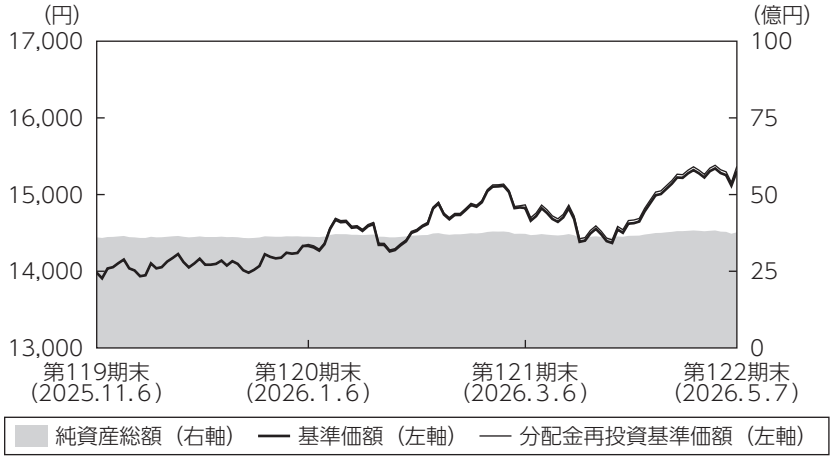
## ■過去６ヶ月間の基準価額の推移

| 決算期 | 年　月　日 | 基準価額 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 騰落率 | | | | | |
| 第120期 | (期　首)<br>2025年11月６日 | 円<br>13,981 | %<br>－ | %<br>24.7 | %<br>0.6 | %<br>52.5 | %<br>－ | %<br>19.9 |
| | 11　月　末 | 14,225 | 1.7 | 21.7 | 0.7 | 53.9 | － | 21.8 |
| | 12　月　末 | 14,238 | 1.8 | 21.8 | 0.8 | 53.9 | － | 21.8 |
| | (期　末)<br>2026年１月６日 | 14,350 | 2.6 | 22.6 | 0.8 | 53.3 | － | 21.7 |
| 第121期 | (期　首)<br>2026年１月６日 | 14,330 | － | 22.6 | 0.8 | 53.3 | － | 21.7 |
| | １　月　末 | 14,338 | 0.1 | 23.0 | 0.5 | 52.8 | － | 21.8 |
| | ２　月　末 | 15,107 | 5.4 | 23.4 | 0.6 | 51.6 | － | 22.5 |
| | (期　末)<br>2026年３月６日 | 14,845 | 3.6 | 21.7 | 0.7 | 52.4 | － | 22.7 |
| 第122期 | (期　首)<br>2026年３月６日 | 14,825 | － | 21.7 | 0.7 | 52.4 | － | 22.7 |
| | ３　月　末 | 14,368 | △3.1 | 20.6 | 0.8 | 54.0 | － | 22.3 |
| | ４　月　末 | 15,254 | 2.9 | 22.7 | 0.7 | 51.8 | － | 23.1 |
| | (期　末)<br>2026年５月７日 | 15,325 | 3.4 | 23.5 | 0.7 | 51.3 | － | 22.8 |

（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」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。
（注３）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。
（注４）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■第120期～第122期の運用経過（2025年11月７日から2026年５月７日まで）

### 基準価額等の推移




第120期首：　13,981円
第122期末：　15,305円
（既払分配金60円）
騰　落　率：　　9.9%
（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。
（注２）分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
（注３）分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
（注４）当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

高市政権の拡張的な財政政策と成長志向政策への期待が高まったことや好調な企業業績、世界的なＡＩ（人工知能）・半導体関連銘柄に対する期待の高まり等から国内株式市場が大きく上昇したこと、為替市場で多くの通貨に対して円安となったこと、米国の底堅い景況感等から米国を中心に多くの市場でリートが上昇したことがプラス寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド | 騰落率 |
|---|---|
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 3.7% |
| インデックス225 マザーファンド | 24.5% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 14.4% |

## 投資環境

外国債券市場では、米国債利回り、ドイツ国債の利回りはともに上昇しました。

米国国債はプライベートクレジットを巡る懸念に伴うリスク回避の動きや米雇用軟化懸念などから利回りは低下する局面もありましたが、米国によるイランへの軍事攻撃を受けたインフレ加速懸念から利回りは上昇しました。ドイツ債についても、米国によるイランへの軍事攻撃によるインフレ加速懸念から利回りは上昇しました。

国内株式市場は上昇しました。作成期初から作成期の半ばにかけては、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）の利下げ観測の高まりや、高市政権の拡張的な財政政策と成長志向政策への期待、衆院選での自民党の大勝、堅調な企業業績を支えに上昇基調で推移しました。作成期末にかけては、中東情勢の緊迫化や原油高の長期化への懸念から下落した後、米国とイランによる停戦協議やＡＩ（人工知能）・半導体関連銘柄の業績に対する期待の高まりを背景に反発しました。

外国リート市場は、豪州などが下落した一方、米国を中心に多くの市場が上昇しました。作成期前半、米国は利下げ観測を巡り一進一退の動きが続きました。作成期後半は豪州が利上げ懸念などから調整が続きましたが、米国は2026年２月に米長期金利の低下が好感され上昇しました。その後、中東情勢が悪化する中、米利下げ観測が大幅に後退したこともあり下落しましたが、４月に入ると米国とイランの和平交渉に対する期待などから上昇して、作成期末を迎えました。

為替市場では円は多くの主要通貨に対して下落する動きとなりました。ドル／円相場は、内外金利差が縮小したものの、日銀が追加利上げに慎重な姿勢を継続するとの見方等から円安ドル高の動きとなりました。その他主要通貨においても、日銀が追加利上げに慎重な姿勢を継続するとの見方等から多くの主要通貨に対して円安現地通貨高の動きとなりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

当ファンドでは、マザーファンドへの投資を通じ、外国債券、国内株式、外国リートの３資産に投資を行いました。各マザーファンドへの投資にあたっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（基本リスクウェイト：各々約33％）に基づき算出された資産構成比に従い分散投資を行いました。

【運用状況】

○各資産のリスク量

前作成期末

| | ファンドリスクウェイト | 基本リスクウェイト | 差 |
|---|---|---|---|
| 外国債券 | 32.1% | 33.3% | △1.3% |
| 国内株式 | 39.4% | 33.3% | 6.0% |
| 外国リート | 28.6% | 33.3% | △4.8% |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | 0.0% |

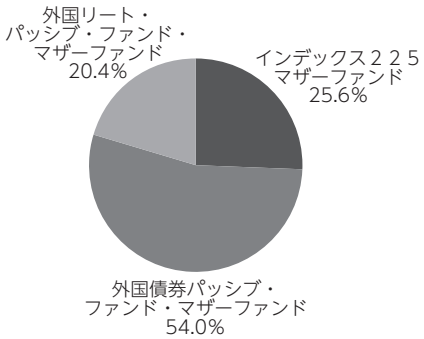
当作成期末

| | ファンドリスクウェイト | 基本リスクウェイト | 差 |
|---|---|---|---|
| 外国債券 | 28.9% | 33.3% | △4.5% |
| 国内株式 | 39.1% | 33.3% | 5.7% |
| 外国リート | 32.1% | 33.3% | △1.2% |
| 合計 | 100.0% | 100.0% | 0.0% |

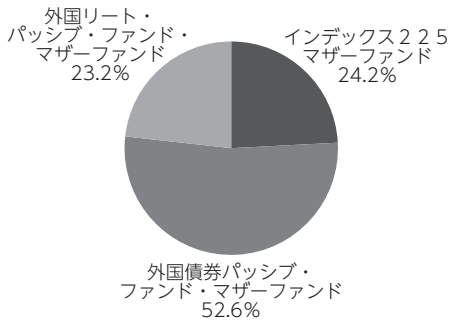
（注１）リスクウェイトはみずほ第一フィナンシャルテクノロジーが計測。
（注２）リスクウェイトの乖離につきましては、基本リスクウェイトへ近づけるオペレーションを実施します。

○マザーファンド組入比率

前作成期末




当作成期末




（注）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。

**●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。

**●インデックス２２５ マザーファンド**

ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ベンチマークに採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、ベンチマークとの連動性維持に努めました。なお、ベンチマーク採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

**●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド**

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

## 分配金

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した。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120期<br>2025年11月７日<br>～2026年１月６日 | 第121期<br>2026年１月７日<br>～2026年３月６日 | 第122期<br>2026年３月７日<br>～2026年５月７日 |
|---|---|---|---|
| 当期分配金（税引前） | 20円 | 20円 | 20円 |
| 対基準価額比率 | 0.14% | 0.13% | 0.13% |
| 当期の収益 | 20円 | 20円 | 20円 |
| 当期の収益以外 | －円 | －円 | －円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 4,384円 | 4,878円 | 5,359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

今後も各資産のリスク量が均等になるよう、各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率についても、高位を維持する方針です。

### ●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目指したパッシブ運用を行います。

### ●インデックス２２５ マザーファンド

今後の運用につきましても、財務リスク等を考慮しつつ、ベンチマークに採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行います。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

### ●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めざしてパッシブ運用を行います。

## ■１万口当たりの費用明細

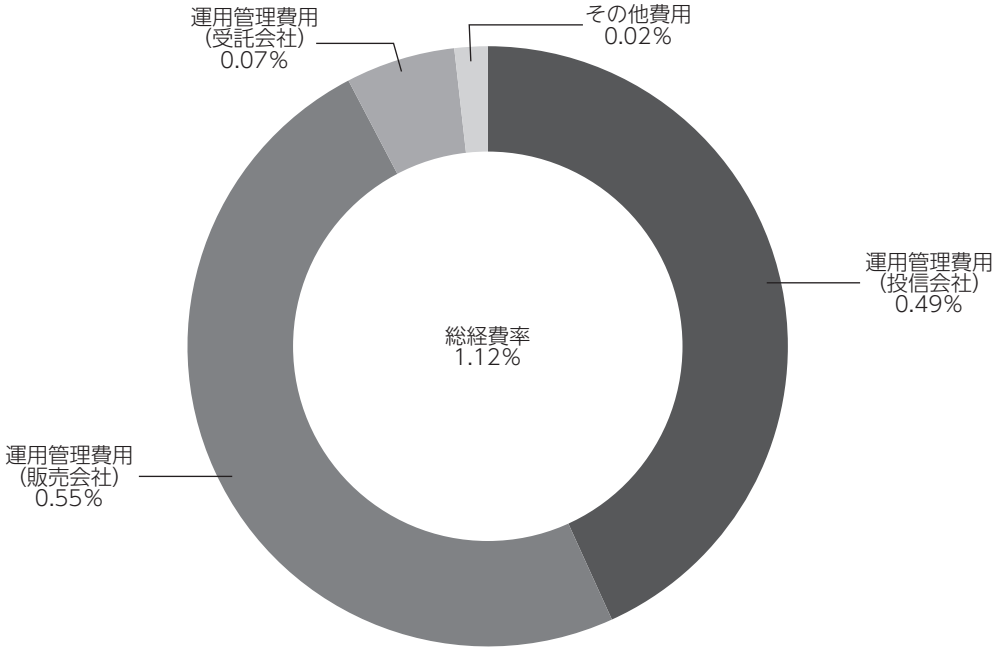
| 項目 | 第120期～第122期<br>(2025年11月７日<br>～2026年５月７日) | | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 金額 | 比率 | |
| (ａ) 信託報酬 | 80円 | 0.549% | (ａ) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は14,543円です。 |
| (投信会社) | (35) | (0.242) | 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 |
| (販売会社) | (40) | (0.275) | 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 |
| (受託会社) | ( 5) | (0.033) | 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (ｂ) 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | (ｂ) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>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) | (0.001) | |
| (ｃ) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (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<br>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) | (0.000) | |
| (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 | 0.010 | (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) | (0.007) | 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) | (0.001) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 82 | 0.562 | |

(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1.12％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（2025年11月７日から2026年５月７日まで）

| | 第 120 期 ～ 第 122 期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 12,538 | 33,057 | 20,603 | 55,000 |
| インデックス２２５マザーファンド | － | － | 41,012 | 192,000 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 26,225 | 60,294 | 10,171 | 25,000 |

## ■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 120 期 ～ 第 122 期 |
|---|---|
| | インデックス２２５マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 113,019,869千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 373,925,245千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.30 |

（注）(b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2025年11月７日から2026年５月７日まで）

**【Ｏｎｅパッシブ資産分散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

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 120 期 ～ 第 122 期 |
|---|---|
| 売買委託手数料総額 (A) | 61千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 3千円 |
| (B)／(A) | 4.9% |

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

**【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。

## 【インデックス２２５ 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 120 期 ～ 第 122 期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B／A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D／C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 79,562 | 238 | 0.3 | 33,456 | － | － |
| 株式先物取引 | 113,103 | 113,103 | 100.0 | 112,505 | 112,505 | 100.0 |

平均保有割合 0.2%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 第 120 期 ～ 第 122 期 | | |
|---|---|---|---|
| | 買付額 | 売付額 | 当作成期末保有額 |
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 29 | 11 | 170 |

(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 120 期 ～ 第 122 期 |
|---|---|
| | 買付額 |
| | 百万円 |
| 株式 | 57 |

## 【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です。

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

| | 第40作成期末 | 第41作成期末 | |
|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 737,129 | 729,064 | 1,966,212 |
| インデックス225マザーファンド | 203,594 | 162,581 | 904,278 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 320,487 | 336,540 | 869,251 |

## ■有価証券の貸付及び借入の状況

インデックス225 マザーファンド

| 区分 | 当期末 | |
|---|---|---|
| | 貸付 | 借入 |
| | 株 | 株 |
| 株式 | 5,485,600<br>(457,600) | －<br>(－) |

（注1）（ ）内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
（注2）当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、みずほ証券株式会社へ457,600株を貸付けています。

## ■投資信託財産の構成

2026年5月7日現在

| 項目 | 第41作成期末 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1,966,212 | 51.6 |
| インデックス225マザーファンド | 904,278 | 23.7 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 869,251 | 22.8 |
| コール・ローン等、その他 | 69,680 | 1.8 |
| 投資信託財産総額 | 3,809,423 | 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）期末の外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、311,307,285千円、98.3％です。
（注3）期末の外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、134,678,031千円、99.9％です。
（注4）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、2026年5月7日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝156.38円、1カナダ・ドル＝114.65円、1オーストラリア・ドル＝113.11円、1香港・ドル＝19.96円、1シンガポール・ドル＝123.29円、1ニュージーランド・ドル＝93.09円、1イギリス・ポンド＝212.55円、1イスラエル・シュケル＝53.736円、1デンマーク・クローネ＝24.57円、1ノルウェー・クローネ＝16.79円、1スウェーデン・クローナ＝16.89円、1メキシコ・ペソ＝9.065円、100韓国・ウォン＝10.784円、1オフショア・人民元＝22.952円、1マレーシア・リンギット＝39.912円、1ポーランド・ズロチ＝43.406円、1ユーロ＝183.64円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年１月６日)、　(2026年３月６日)、　(2026年５月７日)現在

| 項目 | 第 120 期 末 | 第 121 期 末 | 第 122 期 末 |
|---|---|---|---|
| **(A) 資産** | **3,673,667,618円** | **3,734,368,673円** | **3,809,423,484円** |
| コール・ローン等 | 44,719,245 | 49,114,514 | 33,680,614 |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 1,963,454,138 | 1,976,565,467 | 1,966,212,758 |
| インデックス225マザーファンド(評価額) | 835,177,015 | 824,654,437 | 904,278,681 |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 800,317,220 | 854,034,255 | 869,251,431 |
| 未収入金 | 30,000,000 | 30,000,000 | 36,000,000 |
| **(B) 負債** | **44,737,235** | **12,608,519** | **40,452,323** |
| 未払収益分配金 | 5,064,735 | 5,020,930 | 4,925,124 |
| 未払解約金 | 32,999,119 | 997,590 | 28,563,598 |
| 未払信託報酬 | 6,652,131 | 6,569,010 | 6,941,427 |
| その他未払費用 | 21,250 | 20,989 | 22,174 |
| **(C) 純資産総額(A－B)** | **3,628,930,383** | **3,721,760,154** | **3,768,971,161** |
| 元本 | 2,532,367,702 | 2,510,465,060 | 2,462,562,002 |
| 次期繰越損益金 | 1,096,562,681 | 1,211,295,094 | 1,306,409,159 |
| **(D) 受益権総口数** | **2,532,367,702口** | **2,510,465,060口** | **2,462,562,002口** |
| **１万口当たり基準価額(C／D)** | **14,330円** | **14,825円** | **15,305円** |

(注) 第119期末における元本額は2,579,173,502円、当作成期間（第120期～第122期）中における追加設定元本額は3,861,622円、同解約元本額は120,473,122円です。

## ■損益の状況

| 項目 | 第120期〔自 2025年11月7日 至 2026年1月6日〕 | 第121期〔自 2026年1月7日 至 2026年3月6日〕 | 第122期〔自 2026年3月7日 至 2026年5月7日〕 |
|---|---|---|---|
| **(A) 配当等収益** | **41,792円** | **54,627円** | **61,143円** |
| 受取利息 | 41,792 | 54,627 | 61,143 |
| **(B) 有価証券売買損益** | **100,086,248** | **135,733,037** | **130,057,154** |
| 売買益 | 101,837,801 | 136,311,722 | 141,929,090 |
| 売買損 | △1,751,553 | △578,685 | △11,871,936 |
| **(C) 信託報酬等** | **△6,673,381** | **△6,589,999** | **△6,963,601** |
| **(D) 当期損益金(A＋B＋C)** | **93,454,659** | **129,197,665** | **123,154,696** |
| **(E) 前期繰越損益金** | **1,000,135,798** | **1,078,534,007** | **1,179,369,758** |
| **(F) 追加信託差損益金** | **8,036,959** | **8,584,352** | **8,809,829** |
| (配当等相当額) | (21,730,233) | (22,121,328) | (22,091,824) |
| (売買損益相当額) | (△13,693,274) | (△13,536,976) | (△13,281,995) |
| **(G) 合計(D＋E＋F)** | **1,101,627,416** | **1,216,316,024** | **1,311,334,283** |
| **(H) 収益分配金** | **△5,064,735** | **△5,020,930** | **△4,925,124** |
| **次期繰越損益金(G＋H)** | **1,096,562,681** | **1,211,295,094** | **1,306,409,159** |
| 追加信託差損益金 | 8,036,959 | 8,584,352 | 8,809,829 |
| (配当等相当額) | (21,732,317) | (22,122,278) | (22,093,137) |
| (売買損益相当額) | (△13,695,358) | (△13,537,926) | (△13,283,308) |
| 分配準備積立金 | 1,088,525,722 | 1,202,710,742 | 1,297,599,330 |

(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120期 | 第121期 | 第122期 |
|---|---|---|---|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 15,717,387円 | 12,022,506円 | 20,571,251円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 77,737,272 | 117,175,159 | 102,583,445 |
| (c) 収益調整金 | 21,732,317 | 22,122,278 | 22,093,137 |
| (d) 分配準備積立金 | 1,000,135,798 | 1,078,534,007 | 1,179,369,758 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 1,115,322,774 | 1,229,853,950 | 1,324,617,591 |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額 | 4,404.27 | 4,898.91 | 5,379.02 |
| (g) 分配金 | 5,064,735 | 5,020,930 | 4,925,124 |
| (h) 1万口当たり分配金 | 20 | 20 | 20 |

## ■分配金のお知らせ

| 決　　算　　期 | 第　120　期 | 第　121　期 | 第　122　期 |
|---|---|---|---|
| １万口当たり分配金 | 20円 | 20円 | 20円 |

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

**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**

■ファンド名称を「ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド」から「Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド」に変更しました。

（2026年２月７日）

■有価証券の貸付の品貸料の一部を信託報酬として収受可能とするための規定を追加しました。

（2026年２月７日）

■旧投資対象マザーファンド「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」に相当する記載を削除しました。

（2026年２月７日）

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」、「インデックス２２５ マザーファンド」および「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、「一般社団法人投資信託協会」の名称変更に伴い、約款における記載を「一般社団法人資産運用業協会」に変更しました。

（2026年４月１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23期（決算日　2026年２月24日）**

**（計算期間　2025年２月22日～2026年２月24日）**

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第23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ます。<br>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。<br>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） | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 19期（2022年２月21日） | 20,152 | 1.6 | 126,280.23 | 1.7 | 98.9 | － | 141,964 |
| 20期（2023年２月21日） | 20,182 | 0.1 | 126,494.96 | 0.2 | 99.0 | － | 186,822 |
| 21期（2024年２月21日） | 23,220 | 15.1 | 145,648.68 | 15.1 | 98.7 | － | 260,393 |
| 22期（2025年２月21日） | 23,694 | 2.0 | 148,397.46 | 1.9 | 98.2 | － | 270,905 |
| 23期（2026年２月24日） | 26,987 | 13.9 | 169,222.27 | 14.0 | 98.4 | － | 309,642 |

（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おりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、ＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はＦＴＳＥ　Ｆｉｘｅｄ　Ｉｎｃｏｍｅ　ＬＬＣに帰属します（以下同じ）。

（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

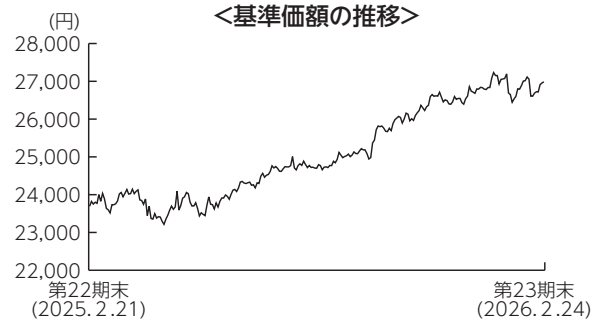
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年　月　日 | 基準価額 | | 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) | | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| (期　首) | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| 2025　年　2　月　21　日 | 23,694 | － | 148,397.46 | － | 98.2 | － |
| 2　月　末 | 23,771 | 0.3 | 149,193.47 | 0.5 | 98.4 | － |
| 3　月　末 | 24,026 | 1.4 | 150,538.31 | 1.4 | 98.6 | － |
| 4　月　末 | 23,612 | △0.3 | 148,044.63 | △0.2 | 98.4 | － |
| 5　月　末 | 23,745 | 0.2 | 148,747.39 | 0.2 | 97.9 | － |
| 6　月　末 | 24,331 | 2.7 | 152,505.94 | 2.8 | 98.4 | － |
| 7　月　末 | 24,769 | 4.5 | 155,605.61 | 4.9 | 98.5 | － |
| 8　月　末 | 24,717 | 4.3 | 154,883.59 | 4.4 | 98.6 | － |
| 9　月　末 | 25,185 | 6.3 | 157,987.18 | 6.5 | 98.6 | － |
| 10　月　末 | 26,158 | 10.4 | 163,996.33 | 10.5 | 98.4 | － |
| 11　月　末 | 26,711 | 12.7 | 167,515.28 | 12.9 | 98.3 | － |
| 12　月　末 | 26,840 | 13.3 | 168,271.00 | 13.4 | 98.7 | － |
| 2026　年　1　月　末 | 26,603 | 12.3 | 166,797.79 | 12.4 | 98.6 | － |
| (期　末) | | | | | | |
| 2026　年　2　月　24　日 | 26,987 | 13.9 | 169,222.27 | 14.0 | 98.4 | － |

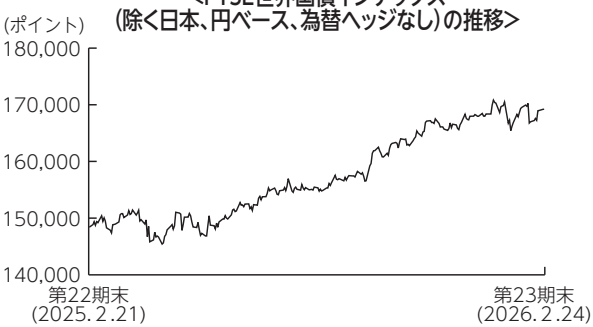
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2025年２月22日から2026年２月24日まで）

<基準価額の推移>




<FTSE世界国債インデックス
(除<日本、円ベース、為替ヘッジなし)の推移>




### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は26,987円となり、前期末比で13.9％上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、低下（価格は上昇）しました。米国国債は、底堅い雇用統計の発表を受けて、利回りが上昇する局面もありましたが、その後雇用統計が大幅下方修正され、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）の利下げを再開したことで利回りは低下しました。ドル円については、自民党総裁選での高市氏勝利を受けて、財政拡張が意識されたことなどから円安ドル高になりました。債券価格上昇と為替が円安に進んだことで基準価額は上昇しました。

### 投資環境

外国債券市場では、米国債利回りは低下、ドイツ債の利回りは上昇しました。

米国国債は、底堅い雇用統計の発表を受けて、利回りが上昇する局面もありましたが、その後雇用統計が大幅下方修正され、ＦＲＢ（米連邦準備理事会）の利下げを再開したことで利回りは低下しました。その後地政学リスクから安全資産が買われ、利回りは低下幅を拡大しました。ドイツ債については、フランス政局の不透明感などから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、トランプ大統領の大幅関税引き上げの発表を受け円高になる局面もありましたが、自民党総裁選での高市氏勝利を受けて、財政拡張が意識されたことなどから円安ドル高になりました。その後は日米当局によるレートチェックとみられる動きから、急速に円高ドル安が進行し円は下落幅を縮めました。ユーロ円も同様に自民党総裁選での高市氏勝利を受けて、財政拡張が意識されたことなどから円安ユーロ高になりました。

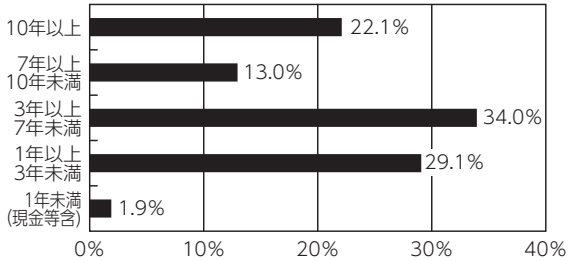
## ポートフォリオについて

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

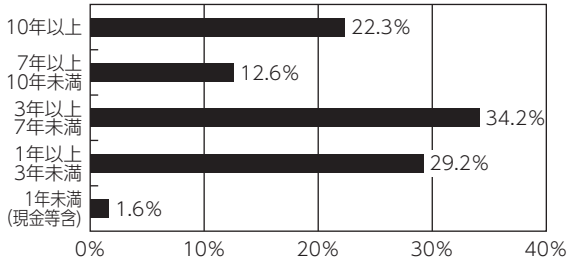
### 【運用状況】

### ○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 | 46.5% | 47.3% | △0.8% |
| | カナダ | 2.0% | 2.0% | △0.0% |
| | 計 | 48.5% | 49.3% | △0.8% |
| 中南米 | メキシコ | 0.8% | 0.8% | △0.0% |
| | 計 | 0.8% | 0.8% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 1.1% | 1.1% | △0.0% |
| | ベルギー | 1.5% | 1.6% | △0.0% |
| | フィンランド | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| | フランス | 7.1% | 7.2% | △0.1% |
| | ドイツ | 5.6% | 5.7% | △0.1% |
| | アイルランド | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| | イタリア | 6.6% | 6.7% | △0.1% |
| | オランダ | 1.2% | 1.2% | △0.0% |
| | ポルトガル | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| | スペイン | 4.3% | 4.4% | △0.1% |
| | ユーロ計 | 29.0% | 29.5% | △0.5% |
| | デンマーク | 0.2% | 0.2% | △0.0% |
| | スウェーデン | 0.2% | 0.2% | △0.0% |
| | 英国 | 5.1% | 5.1% | △0.1% |
| | ポーランド | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| | ノルウェー | 0.1% | 0.2% | △0.0% |
| | 計 | 35.1% | 35.7% | △0.6% |
| アジア・オセアニア | オーストラリア | 1.2% | 1.2% | △0.0% |
| | ニュージーランド | 0.3% | 0.3% | △0.0% |
| | 中国 | 11.2% | 11.4% | △0.2% |
| | シンガポール | 0.4% | 0.4% | △0.0% |
| | マレーシア | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| | 計 | 13.5% | 13.8% | △0.3% |
| 中近東 | イスラエル | 0.3% | 0.4% | △0.0% |
| | 計 | 0.3% | 0.4% | △0.0% |
| 現金など | | 1.8% | － | － |
| 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 | 44.7% | 45.3% | △0.5% |
| | カナダ | 2.1% | 2.1% | △0.0% |
| | 計 | 46.8% | 47.4% | △0.6% |
| 中南米 | メキシコ | 0.9% | 1.0% | △0.0% |
| | 計 | 0.9% | 1.0% | △0.0% |
| 欧州 | オーストリア | 1.1% | 1.1% | 0.0% |
| | ベルギー | 1.5% | 1.5% | △0.0% |
| | フィンランド | 0.5% | 0.5% | △0.0% |
| | フランス | 7.2% | 7.3% | △0.1% |
| | ドイツ | 5.6% | 5.7% | △0.1% |
| | アイルランド | 0.4% | 0.4% | △0.0% |
| | イタリア | 6.6% | 6.7% | △0.1% |
| | オランダ | 1.2% | 1.2% | △0.0% |
| | ポルトガル | 0.6% | 0.6% | △0.0% |
| | スペイン | 4.3% | 4.4% | △0.1% |
| | ユーロ計 | 29.1% | 29.6% | △0.5% |
| | デンマーク | 0.2% | 0.2% | △0.0% |
| | スウェーデン | 0.2% | 0.2% | △0.0% |
| | 英国 | 5.8% | 5.9% | △0.1% |
| | ポーランド | 0.7% | 0.7% | △0.0% |
| | ノルウェー | 0.2% | 0.2% | △0.0% |
| | 計 | 36.1% | 36.7% | △0.6% |
| アジア・オセアニア | オーストラリア | 1.3% | 1.3% | △0.0% |
| | ニュージーランド | 0.3% | 0.3% | △0.0% |
| | 中国 | 11.7% | 12.0% | △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 | 14.2% | 14.5% | △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 | | 1.6% | － | － |
| 合計 | | 100.0% | 100.0% | － |

（注１）当ファンドの組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。
（注２）世界国債インデックスとはＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本）です。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で14.0%上昇しました。

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

## 今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動することを目指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 | 4円 | 0.017% | (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) | (4) | (0.016) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (その他) | (0) | (0.001) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 4 | 0.017 | |
| 期中の平均基準価額は25,091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（2025年２月22日から2026年２月24日まで）

公社債

| | | | | 買付額 | 売付額 |
|---|---|---|---|---|---|
| 外国 | | アメリカ | 国債証券 | 千アメリカ・ドル<br>415,680 | 千アメリカ・ドル<br>390,371 |
| | | カナダ | 国債証券 | 千カナダ・ドル<br>28,418 | 千カナダ・ドル<br>22,099 |
| | | オーストラリア | 国債証券 | 千オーストラリア・ドル<br>15,216 | 千オーストラリア・ドル<br>12,201 |
| | | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポール・ドル<br>2,609 | 千シンガポール・ドル<br>2,836 |
| | | ニュージーランド | 国債証券 | 千ニュージーランド・ドル<br>3,592 | 千ニュージーランド・ドル<br>2,111 |
| | | イギリス | 国債証券 | 千イギリス・ポンド<br>38,878 | 千イギリス・ポンド<br>28,137 |
| | | イスラエル | 国債証券 | 千イスラエル・シュケル<br>9,547 | 千イスラエル・シュケル<br>8,374 |
| | | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーク・クローネ<br>7,429 | 千デンマーク・クローネ<br>8,117 |
| | | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェー・クローネ<br>12,264 | 千ノルウェー・クローネ<br>9,198 |
| | | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデン・クローナ<br>10,036 | 千スウェーデン・クローナ<br>11,064 |
| | | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>147,418 | 千メキシコ・ペソ<br>133,721 |
| | | 中国 | 国債証券 | 千オフショア・人民元<br>834,100 | 千オフショア・人民元<br>667,708 |
| | | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>12,217 | 千マレーシア・リンギット<br>12,219 |
| | | ポーランド | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>23,628 | 千ポーランド・ズロチ<br>15,127 |
| | ユーロ | アイルランド | 国債証券 | 千ユーロ<br>1,381 | 千ユーロ<br>1,817 |
| | | オランダ | 国債証券 | 7,108 | 7,685 |
| | | ベルギー | 国債証券 | 8,832 | 9,237 |
| | | フランス | 国債証券 | 50,100 | 51,342 |
| | | ドイツ | 国債証券 | 44,709 | 44,933 |
| | | ポルトガル | 国債証券 | 2,846 | 2,681 |
| | | スペイン | 国債証券 | 29,266 | 31,831 |
| | | イタリア | 国債証券 | 45,321 | 48,489 |
| | | フィンランド | 国債証券 | 2,750 | 2,328 |
| | | オーストリア | 国債証券 | 7,390 | 7,049 |

（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（2025年２月22日から2026年２月24日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

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BB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 |
| | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 940,557 | 894,562 | 138,531,990 | 44.7 | － | 19.1 | 17.3 | 8.3 |
| | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | | | | | |
| カナダ | 59,026 | 56,965 | 6,439,987 | 2.1 | － | 1.1 | 0.8 | 0.2 |
| | 千オーストラリア・ドル | 千オーストラリア・ドル | 千円 | | | | | |
| オーストラリア | 40,905 | 36,664 | 4,010,719 | 1.3 | － | 0.8 | 0.4 | 0.1 |
| | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円 | | | | | |
| シンガポール | 9,183 | 9,556 | 1,168,644 | 0.4 | － | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| | 千ニュージーランド・ドル | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | | | | | |
| ニュージーランド | 11,020 | 10,114 | 933,852 | 0.3 | － | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 | | | | | |
| イギリス | 100,852 | 85,421 | 17,854,040 | 5.8 | － | 4.0 | 1.3 | 0.5 |
| | 千イスラエル・シュケル | 千イスラエル・シュケル | 千円 | | | | | |
| イスラエル | 26,364 | 24,835 | 1,231,712 | 0.4 | － | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| | 千デンマーク・クローネ | 千デンマーク・クローネ | 千円 | | | | | |
| デンマーク | 27,439 | 25,499 | 623,200 | 0.2 | － | 0.1 | 0.0 | 0.0 |
| | 千ノルウェー・クローネ | 千ノルウェー・クローネ | 千円 | | | | | |
| ノルウェー | 34,576 | 32,158 | 520,646 | 0.2 | － | 0.1 | 0.1 | 0.0 |
| | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | | | | | |
| スウェーデン | 31,600 | 30,684 | 524,393 | 0.2 | － | 0.1 | 0.1 | － |
| | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | | | | | |
| メキシコ | 326,432 | 314,105 | 2,819,288 | 0.9 | － | 0.6 | 0.2 | 0.1 |
| | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 | 千円 | | | | | |
| 中国 | 1,541,820 | 1,612,178 | 36,241,290 | 11.7 | － | 5.0 | 5.1 | 1.5 |
| | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円 | | | | | |
| マレーシア | 37,751 | 39,453 | 1,571,393 | 0.5 | － | 0.4 | 0.1 | 0.0 |
| | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | | | | | |
| ポーランド | 51,685 | 51,399 | 2,223,868 | 0.7 | － | 0.2 | 0.4 | 0.1 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | | | | |
| アイルランド | 8,241 | 7,415 | 1,353,609 | 0.4 | － | 0.2 | 0.2 | 0.0 |
| オランダ | 22,397 | 20,287 | 3,703,529 | 1.2 | － | 0.8 | 0.3 | 0.1 |
| ベルギー | 28,511 | 25,563 | 4,666,666 | 1.5 | － | 1.0 | 0.4 | 0.1 |
| フランス | 133,840 | 121,707 | 22,217,679 | 7.2 | － | 4.1 | 2.4 | 0.6 |
| ドイツ | 102,787 | 95,524 | 17,438,083 | 5.6 | － | 2.8 | 1.8 | 1.0 |
| ポルトガル | 10,248 | 9,978 | 1,821,651 | 0.6 | － | 0.4 | 0.1 | 0.1 |
| スペイン | 75,493 | 72,961 | 13,319,135 | 4.3 | － | 2.5 | 1.3 | 0.5 |
| イタリア | 113,602 | 112,632 | 20,561,089 | 6.6 | － | 3.9 | 1.9 | 0.9 |
| フィンランド | 10,132 | 8,808 | 1,607,900 | 0.5 | － | 0.4 | 0.1 | 0.0 |
| オーストリア | 20,920 | 18,652 | 3,404,927 | 1.1 | － | 0.7 | 0.2 | 0.2 |
| | | | 千円 | | | | | |
| 合計 | － | － | 304,789,302 | 98.4 | － | 49.1 | 34.7 | 14.6 |

（注1）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注2）組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示

外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(アメリカ)** | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 1.75 01/31/29 | 国債証券 | 1.7500 | 6,400 | 6,099 | 944,549 | 2029/01/31 |
| US T N/B 4.375 01/31/32 | 国債証券 | 4.3750 | 4,548 | 4,712 | 729,737 | 2032/01/31 |
| US T N/B 0.75 01/31/28 | 国債証券 | 0.7500 | 5,678 | 5,395 | 835,605 | 2028/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/31/30 | 国債証券 | 3.5000 | 2,700 | 2,698 | 417,901 | 2030/01/31 |
| US T N/B 4.0 01/31/31 | 国債証券 | 4.0000 | 2,000 | 2,036 | 315,442 | 2031/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/31/28 | 国債証券 | 3.5000 | 5,680 | 5,686 | 880,618 | 2028/01/31 |
| US T N/B 4.0 01/31/29 | 国債証券 | 4.0000 | 1,949 | 1,978 | 306,461 | 2029/01/31 |
| US T N/B 4.25 01/15/28 | 国債証券 | 4.2500 | 5,500 | 5,580 | 864,173 | 2028/01/15 |
| US T N/B 4.25 01/31/30 | 国債証券 | 4.2500 | 3,000 | 3,080 | 477,002 | 2030/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/15/29 | 国債証券 | 3.5000 | 2,600 | 2,604 | 403,280 | 2029/01/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国債証券 | 3.1250 | 3,060 | 2,577 | 399,088 | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国債証券 | 3.1250 | 1,540 | 1,276 | 197,643 | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 3,170 | 2,268 | 351,362 | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39 | 国債証券 | 3.5000 | 700 | 649 | 100,652 | 2039/02/15 |
| US T N/B 5.375 02/15/31 | 国債証券 | 5.3750 | 5,860 | 6,333 | 980,786 | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36 | 国債証券 | 4.5000 | 2,102 | 2,195 | 339,947 | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41 | 国債証券 | 4.7500 | 2,230 | 2,313 | 358,341 | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国債証券 | 3.6250 | 1,630 | 1,433 | 222,032 | 2044/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/49 | 国債証券 | 3.0000 | 3,010 | 2,277 | 352,728 | 2049/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/52 | 国債証券 | 2.2500 | 1,000 | 625 | 96,823 | 2052/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国債証券 | 4.3750 | 500 | 512 | 79,370 | 2038/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/53 | 国債証券 | 3.6250 | 5,857 | 4,865 | 753,531 | 2053/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国債証券 | 4.6250 | 1,390 | 1,430 | 221,553 | 2040/02/15 |
| US T N/B 2.375 02/15/42 | 国債証券 | 2.3750 | 1,700 | 1,282 | 198,557 | 2042/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 3,068 | 1,769 | 274,042 | 2051/02/15 |
| US T N/B 4.25 02/15/54 | 国債証券 | 4.2500 | 4,200 | 3,892 | 602,799 | 2054/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45 | 国債証券 | 2.5000 | 1,200 | 873 | 135,192 | 2045/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/55 | 国債証券 | 4.6250 | 4,300 | 4,241 | 656,897 | 2055/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 6,826 | 5,277 | 817,333 | 2047/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 2,650 | 2,025 | 313,699 | 2048/02/15 |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 国債証券 | 2.6250 | 5,200 | 5,080 | 786,697 | 2029/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/28 | 国債証券 | 2.7500 | 4,540 | 4,480 | 693,919 | 2028/02/15 |
| US T N/B 4.0 02/15/34 | 国債証券 | 4.0000 | 7,500 | 7,562 | 1,171,113 | 2034/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/15/31 | 国債証券 | 1.1250 | 267 | 237 | 36,785 | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/35 | 国債証券 | 4.6250 | 8,200 | 8,608 | 1,333,121 | 2035/02/15 |
| US T N/B 4.25 02/28/31 | 国債証券 | 4.2500 | 2,334 | 2,403 | 372,237 | 2031/02/28 |
| US T N/B 3.875 02/15/43 | 国債証券 | 3.8750 | 2,000 | 1,839 | 284,833 | 2043/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/44 | 国債証券 | 4.5000 | 1,300 | 1,285 | 199,139 | 2044/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/41 | 国債証券 | 1.8750 | 3,100 | 2,219 | 343,772 | 2041/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/45 | 国債証券 | 4.7500 | 2,000 | 2,033 | 314,837 | 2045/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/50 | 国債証券 | 2.0000 | 2,800 | 1,692 | 262,163 | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/32 | 国債証券 | 1.8750 | 8,080 | 7,293 | 1,129,514 | 2032/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/33 | 国債証券 | 3.5000 | 8,250 | 8,103 | 1,254,837 | 2033/02/15 |
| US T N/B 1.5 02/15/30 | 国債証券 | 1.5000 | 4,330 | 4,010 | 621,091 | 2030/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/28/27 | 国債証券 | 1.8750 | 1,810 | 1,780 | 275,666 | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/29/28 | 国債証券 | 1.1250 | 6,000 | 5,732 | 887,765 | 2028/02/29 |
| US T N/B 1.875 02/28/29 | 国債証券 | 1.8750 | 3,700 | 3,534 | 547,298 | 2029/02/28 |
| US T N/B 4.125 02/29/32 | 国債証券 | 4.1250 | 3,000 | 3,068 | 475,151 | 2032/02/29 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(アメリカ)** | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 4.0 02/29/28 | 国債証券 | 4.0000 | 4,700 | 4,750 | 735,689 | 2028/02/29 |
| US T N/B 4.25 02/28/29 | 国債証券 | 4.2500 | 3,930 | 4,019 | 622,412 | 2029/02/28 |
| US T N/B 4.25 02/15/28 | 国債証券 | 4.2500 | 4,300 | 4,366 | 676,172 | 2028/02/15 |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 3,200 | 3,101 | 480,298 | 2027/03/31 |
| US T N/B 1.25 03/31/28 | 国債証券 | 1.2500 | 4,610 | 4,408 | 682,657 | 2028/03/31 |
| US T N/B 2.375 03/31/29 | 国債証券 | 2.3750 | 4,000 | 3,873 | 599,901 | 2029/03/31 |
| US T N/B 4.125 03/31/32 | 国債証券 | 4.1250 | 3,500 | 3,579 | 554,289 | 2032/03/31 |
| US T N/B 2.5 03/31/27 | 国債証券 | 2.5000 | 3,000 | 2,967 | 459,534 | 2027/03/31 |
| US T N/B 4.125 03/31/31 | 国債証券 | 4.1250 | 2,200 | 2,252 | 348,883 | 2031/03/31 |
| US T N/B 3.625 03/31/30 | 国債証券 | 3.6250 | 2,500 | 2,508 | 388,526 | 2030/03/31 |
| US T N/B 3.625 03/31/28 | 国債証券 | 3.6250 | 3,500 | 3,513 | 544,116 | 2028/03/31 |
| US T N/B 4.25 03/15/27 | 国債証券 | 4.2500 | 3,850 | 3,878 | 600,688 | 2027/03/15 |
| US T N/B 3.875 03/15/28 | 国債証券 | 3.8750 | 6,000 | 6,052 | 937,326 | 2028/03/15 |
| US T N/B 4.0 03/31/30 | 国債証券 | 4.0000 | 4,000 | 4,071 | 630,461 | 2030/03/31 |
| US T N/B 4.125 03/31/29 | 国債証券 | 4.1250 | 3,800 | 3,874 | 599,984 | 2029/03/31 |
| US T N/B 4.0 04/30/32 | 国債証券 | 4.0000 | 6,000 | 6,093 | 943,623 | 2032/04/30 |
| US T N/B 1.25 04/30/28 | 国債証券 | 1.2500 | 2,700 | 2,577 | 399,110 | 2028/04/30 |
| US T N/B 4.625 04/30/31 | 国債証券 | 4.6250 | 3,000 | 3,142 | 486,711 | 2031/04/30 |
| US T N/B 0.5 04/30/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,970 | 2,868 | 444,159 | 2027/04/30 |
| US T N/B 2.875 04/30/29 | 国債証券 | 2.8750 | 4,000 | 3,930 | 608,599 | 2029/04/30 |
| US T N/B 3.5 04/30/28 | 国債証券 | 3.5000 | 4,500 | 4,506 | 697,863 | 2028/04/30 |
| US T N/B 2.75 04/30/27 | 国債証券 | 2.7500 | 2,500 | 2,478 | 383,807 | 2027/04/30 |
| US T N/B 3.5 04/30/30 | 国債証券 | 3.5000 | 3,500 | 3,494 | 541,205 | 2030/04/30 |
| US T N/B 3.75 04/15/28 | 国債証券 | 3.7500 | 9,000 | 9,057 | 1,402,668 | 2028/04/15 |
| US T N/B 4.5 04/15/27 | 国債証券 | 4.5000 | 4,300 | 4,347 | 673,181 | 2027/04/15 |
| US T N/B 3.875 04/30/30 | 国債証券 | 3.8750 | 2,500 | 2,532 | 392,246 | 2030/04/30 |
| US T N/B 4.625 04/30/29 | 国債証券 | 4.6250 | 3,000 | 3,104 | 480,695 | 2029/04/30 |
| US T N/B 6.25 05/15/30 | 国債証券 | 6.2500 | 2,559 | 2,828 | 438,067 | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 3,430 | 3,409 | 527,932 | 2041/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/42 | 国債証券 | 3.0000 | 2,080 | 1,714 | 265,475 | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39 | 国債証券 | 4.2500 | 950 | 948 | 146,858 | 2039/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 2,890 | 2,299 | 356,025 | 2043/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/51 | 国債証券 | 2.3750 | 4,760 | 3,088 | 478,330 | 2051/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 1,290 | 1,018 | 157,653 | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47 | 国債証券 | 3.0000 | 1,620 | 1,248 | 193,417 | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/52 | 国債証券 | 2.8750 | 8,329 | 5,984 | 926,762 | 2052/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 384 | 273 | 42,418 | 2046/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 2,830 | 2,206 | 341,769 | 2048/05/15 |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 1,000 | 650 | 100,789 | 2040/05/15 |
| US T N/B 3.625 05/15/53 | 国債証券 | 3.6250 | 4,210 | 3,494 | 541,152 | 2053/05/15 |
| US T N/B 4.5 05/15/38 | 国債証券 | 4.5000 | 1,100 | 1,138 | 176,248 | 2038/05/15 |
| US T N/B 2.25 05/15/41 | 国債証券 | 2.2500 | 3,420 | 2,577 | 399,119 | 2041/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 4,060 | 4,012 | 621,339 | 2028/05/15 |
| US T N/B 4.625 05/15/54 | 国債証券 | 4.6250 | 4,600 | 4,536 | 702,477 | 2054/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 3,770 | 3,646 | 564,654 | 2029/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 3,830 | 3,778 | 585,166 | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37 | 国債証券 | 5.0000 | 800 | 868 | 134,437 | 2037/05/15 |
| US T N/B 4.75 05/15/55 | 国債証券 | 4.7500 | 4,000 | 4,026 | 623,577 | 2055/05/15 |
| US T N/B 1.25 05/15/50 | 国債証券 | 1.2500 | 4,380 | 2,167 | 335,592 | 2050/05/15 |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 6,340 | 5,743 | 889,383 | 2031/05/15 |
| US T N/B 4.625 05/31/31 | 国債証券 | 4.6250 | 2,000 | 2,095 | 324,534 | 2031/05/31 |

| 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 3.25 05/15/42 | 国債証券 | 3.2500 | 1,560 | 1,330 | 206,014 | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.625 05/15/44 | 国債証券 | 4.6250 | 2,000 | 2,006 | 310,784 | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.875 05/15/43 | 国債証券 | 3.8750 | 1,800 | 1,651 | 255,740 | 2043/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/45 | 国債証券 | 5.0000 | 1,000 | 1,048 | 162,345 | 2045/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | 2.8750 | 6,050 | 5,765 | 892,784 | 2032/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/33 | 国債証券 | 3.3750 | 8,700 | 8,459 | 1,309,994 | 2033/05/15 |
| US T N/B 0.5 05/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,980 | 2,870 | 444,555 | 2027/05/31 |
| US T N/B 4.25 05/15/35 | 国債証券 | 4.2500 | 8,000 | 8,163 | 1,264,238 | 2035/05/15 |
| US T N/B 1.25 05/31/28 | 国債証券 | 1.2500 | 4,140 | 3,945 | 610,942 | 2028/05/31 |
| US T N/B 0.625 05/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 5,350 | 4,743 | 734,582 | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/34 | 国債証券 | 4.3750 | 7,000 | 7,232 | 1,120,012 | 2034/05/15 |
| US T N/B 2.625 05/31/27 | 国債証券 | 2.6250 | 4,910 | 4,857 | 752,194 | 2027/05/31 |
| US T N/B 2.75 05/31/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,300 | 3,227 | 499,789 | 2029/05/31 |
| US T N/B 4.125 05/31/32 | 国債証券 | 4.1250 | 4,800 | 4,906 | 759,806 | 2032/05/31 |
| US T N/B 3.625 05/31/28 | 国債証券 | 3.6250 | 3,500 | 3,514 | 544,286 | 2028/05/31 |
| US T N/B 3.75 05/31/30 | 国債証券 | 3.7500 | 3,500 | 3,528 | 546,435 | 2030/05/31 |
| US T N/B 4.5 05/15/27 | 国債証券 | 4.5000 | 9,672 | 9,785 | 1,515,387 | 2027/05/15 |
| US T N/B 3.75 05/15/28 | 国債証券 | 3.7500 | 1,000 | 1,006 | 155,909 | 2028/05/15 |
| US T N/B 4.5 05/31/29 | 国債証券 | 4.5000 | 2,700 | 2,785 | 431,351 | 2029/05/31 |
| US T N/B 4.0 05/31/30 | 国債証券 | 4.0000 | 3,000 | 3,054 | 472,964 | 2030/05/31 |
| US T N/B 0.5 06/30/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,680 | 2,575 | 398,845 | 2027/06/30 |
| US T N/B 1.25 06/30/28 | 国債証券 | 1.2500 | 3,500 | 3,329 | 515,618 | 2028/06/30 |
| US T N/B 4.0 06/30/32 | 国債証券 | 4.0000 | 3,000 | 3,045 | 471,603 | 2032/06/30 |
| US T N/B 3.25 06/30/27 | 国債証券 | 3.2500 | 2,700 | 2,691 | 416,831 | 2027/06/30 |
| US T N/B 4.25 06/30/31 | 国債証券 | 4.2500 | 2,800 | 2,884 | 446,633 | 2031/06/30 |
| US T N/B 3.25 06/30/29 | 国債証券 | 3.2500 | 3,500 | 3,475 | 538,230 | 2029/06/30 |
| US T N/B 4.0 06/30/28 | 国債証券 | 4.0000 | 3,500 | 3,545 | 549,070 | 2028/06/30 |
| US T N/B 4.625 06/15/27 | 国債証券 | 4.6250 | 4,500 | 4,564 | 706,833 | 2027/06/15 |
| US T N/B 3.75 06/30/30 | 国債証券 | 3.7500 | 3,200 | 3,225 | 499,559 | 2030/06/30 |
| US T N/B 3.875 06/15/28 | 国債証券 | 3.8750 | 3,000 | 3,029 | 469,207 | 2028/06/15 |
| US T N/B 4.25 06/30/29 | 国債証券 | 4.2500 | 4,200 | 4,302 | 666,291 | 2029/06/30 |
| US T N/B 3.875 06/30/30 | 国債証券 | 3.8750 | 2,000 | 2,026 | 313,803 | 2030/06/30 |
| US T N/B 1.0 07/31/28 | 国債証券 | 1.0000 | 5,270 | 4,973 | 770,205 | 2028/07/31 |
| US T N/B 0.375 07/31/27 | 国債証券 | 0.3750 | 3,780 | 3,617 | 560,263 | 2027/07/31 |
| US T N/B 4.125 07/31/31 | 国債証券 | 4.1250 | 8,500 | 8,703 | 1,347,752 | 2031/07/31 |
| US T N/B 4.0 07/31/30 | 国債証券 | 4.0000 | 3,500 | 3,564 | 551,939 | 2030/07/31 |
| US T N/B 4.0 07/31/32 | 国債証券 | 4.0000 | 5,000 | 5,073 | 785,672 | 2032/07/31 |
| US T N/B 2.625 07/31/29 | 国債証券 | 2.6250 | 3,070 | 2,986 | 462,448 | 2029/07/31 |
| US T N/B 4.125 07/31/28 | 国債証券 | 4.1250 | 2,500 | 2,540 | 393,448 | 2028/07/31 |
| US T N/B 2.75 07/31/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,120 | 4,078 | 631,618 | 2027/07/31 |
| US T N/B 3.875 07/15/28 | 国債証券 | 3.8750 | 6,000 | 6,060 | 938,542 | 2028/07/15 |
| US T N/B 4.375 07/15/27 | 国債証券 | 4.3750 | 3,500 | 3,542 | 548,573 | 2027/07/15 |
| US T N/B 3.875 07/31/30 | 国債証券 | 3.8750 | 2,200 | 2,229 | 345,223 | 2030/07/31 |
| US T N/B 4.0 07/31/29 | 国債証券 | 4.0000 | 2,400 | 2,440 | 377,928 | 2029/07/31 |
| US T N/B 3.75 08/15/41 | 国債証券 | 3.7500 | 3,720 | 3,426 | 530,577 | 2041/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 1,600 | 1,512 | 234,245 | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 2,000 | 1,582 | 245,114 | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 1,590 | 1,291 | 200,011 | 2044/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 980 | 999 | 154,827 | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 1,470 | 1,299 | 201,207 | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/51 | 国債証券 | 2.0000 | 5,810 | 3,433 | 531,758 | 2051/08/15 |

| 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 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 1,470 | 1,132 | 175,321 | 2045/08/15 |
| US T N/B 4.75 08/15/55 | 国債証券 | 4.7500 | 6,100 | 6,144 | 951,509 | 2055/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 2,230 | 1,637 | 253,566 | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/49 | 国債証券 | 2.2500 | 2,940 | 1,897 | 293,821 | 2049/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/52 | 国債証券 | 3.0000 | 5,240 | 3,858 | 597,568 | 2052/08/15 |
| US T N/B 4.375 08/15/43 | 国債証券 | 4.3750 | 2,000 | 1,952 | 302,364 | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46 | 国債証券 | 2.2500 | 2,570 | 1,739 | 269,420 | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48 | 国債証券 | 3.0000 | 2,510 | 1,908 | 295,547 | 2048/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 4,240 | 4,166 | 645,192 | 2027/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 5,030 | 4,964 | 768,813 | 2028/08/15 |
| US T N/B 4.875 08/15/45 | 国債証券 | 4.8750 | 2,000 | 2,063 | 319,495 | 2045/08/15 |
| US T N/B 4.25 08/15/54 | 国債証券 | 4.2500 | 5,000 | 4,633 | 717,482 | 2054/08/15 |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | 3,460 | 3,253 | 503,813 | 2029/08/15 |
| US T N/B 4.25 08/15/35 | 国債証券 | 4.2500 | 9,500 | 9,685 | 1,499,903 | 2035/08/15 |
| US T N/B 3.375 08/15/42 | 国債証券 | 3.3750 | 2,920 | 2,525 | 391,092 | 2042/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 2,460 | 1,585 | 245,530 | 2040/08/15 |
| US T N/B 4.125 08/15/44 | 国債証券 | 4.1250 | 2,000 | 1,878 | 290,967 | 2044/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/32 | 国債証券 | 2.7500 | 6,340 | 5,977 | 925,665 | 2032/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/33 | 国債証券 | 3.8750 | 7,900 | 7,921 | 1,226,787 | 2033/08/15 |
| US T N/B 1.25 08/15/31 | 国債証券 | 1.2500 | 6,360 | 5,609 | 868,740 | 2031/08/15 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 3,836 | 3,375 | 522,664 | 2030/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/31/28 | 国債証券 | 1.1250 | 4,230 | 3,997 | 618,978 | 2028/08/31 |
| US T N/B 3.875 08/15/34 | 国債証券 | 3.8750 | 7,000 | 6,975 | 1,080,272 | 2034/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/31/32 | 国債証券 | 3.8750 | 6,500 | 6,546 | 1,013,805 | 2032/08/31 |
| US T N/B 0.5 08/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 3,060 | 2,927 | 453,324 | 2027/08/31 |
| US T N/B 3.75 08/31/31 | 国債証券 | 3.7500 | 2,000 | 2,009 | 311,250 | 2031/08/31 |
| US T N/B 3.125 08/31/29 | 国債証券 | 3.1250 | 3,110 | 3,073 | 475,895 | 2029/08/31 |
| US T N/B 4.125 08/31/30 | 国債証券 | 4.1250 | 4,000 | 4,093 | 633,849 | 2030/08/31 |
| US T N/B 3.125 08/31/27 | 国債証券 | 3.1250 | 4,540 | 4,517 | 699,521 | 2027/08/31 |
| US T N/B 4.375 08/31/28 | 国債証券 | 4.3750 | 3,500 | 3,578 | 554,141 | 2028/08/31 |
| US T N/B 3.625 08/15/28 | 国債証券 | 3.6250 | 4,500 | 4,521 | 700,136 | 2028/08/15 |
| US T N/B 3.75 08/15/27 | 国債証券 | 3.7500 | 7,200 | 7,228 | 1,119,434 | 2027/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/31/30 | 国債証券 | 3.6250 | 2,800 | 2,807 | 434,759 | 2030/08/31 |
| US T N/B 3.625 08/31/29 | 国債証券 | 3.6250 | 5,000 | 5,021 | 777,702 | 2029/08/31 |
| US T N/B 0.375 09/30/27 | 国債証券 | 0.3750 | 3,810 | 3,629 | 562,025 | 2027/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/30/30 | 国債証券 | 4.6250 | 3,000 | 3,133 | 485,295 | 2030/09/30 |
| US T N/B 1.25 09/30/28 | 国債証券 | 1.2500 | 1,413 | 1,336 | 207,025 | 2028/09/30 |
| US T N/B 3.625 09/30/31 | 国債証券 | 3.6250 | 2,500 | 2,496 | 386,545 | 2031/09/30 |
| US T N/B 3.875 09/30/32 | 国債証券 | 3.8750 | 2,000 | 2,013 | 311,837 | 2032/09/30 |
| US T N/B 4.125 09/30/27 | 国債証券 | 4.1250 | 4,000 | 4,040 | 625,767 | 2027/09/30 |
| US T N/B 3.875 09/30/29 | 国債証券 | 3.8750 | 1,950 | 1,974 | 305,828 | 2029/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/30/28 | 国債証券 | 4.6250 | 4,300 | 4,426 | 685,458 | 2028/09/30 |
| US T N/B 3.375 09/15/27 | 国債証券 | 3.3750 | 4,000 | 3,994 | 618,568 | 2027/09/15 |
| US T N/B 3.625 09/30/30 | 国債証券 | 3.6250 | 3,000 | 3,007 | 465,777 | 2030/09/30 |
| US T N/B 3.375 09/15/28 | 国債証券 | 3.3750 | 1,000 | 998 | 154,633 | 2028/09/15 |
| US T N/B 3.5 09/30/29 | 国債証券 | 3.5000 | 3,500 | 3,500 | 542,126 | 2029/09/30 |
| US T N/B 4.125 10/31/31 | 国債証券 | 4.1250 | 2,500 | 2,558 | 396,163 | 2031/10/31 |
| US T N/B 3.75 10/31/32 | 国債証券 | 3.7500 | 2,500 | 2,497 | 386,741 | 2032/10/31 |
| US T N/B 1.375 10/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 4,710 | 4,463 | 691,211 | 2028/10/31 |
| US T N/B 4.875 10/31/30 | 国債証券 | 4.8750 | 2,500 | 2,639 | 408,775 | 2030/10/31 |
| US T N/B 0.5 10/31/27 | 国債証券 | 0.5000 | 3,660 | 3,485 | 539,732 | 2027/10/31 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(アメリカ)** | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 4.875 10/31/28 | 国債証券 | 4.8750 | 4,000 | 4,145 | 641,967 | 2028/10/31 |
| US T N/B 4.0 10/31/29 | 国債証券 | 4.0000 | 2,800 | 2,847 | 440,975 | 2029/10/31 |
| US T N/B 4.125 10/31/27 | 国債証券 | 4.1250 | 3,340 | 3,376 | 522,849 | 2027/10/31 |
| US T N/B 3.875 10/15/27 | 国債証券 | 3.8750 | 4,000 | 4,026 | 623,505 | 2027/10/15 |
| US T N/B 3.625 10/31/30 | 国債証券 | 3.6250 | 6,700 | 6,715 | 1,040,014 | 2030/10/31 |
| US T N/B 3.5 10/15/28 | 国債証券 | 3.5000 | 3,000 | 3,004 | 465,269 | 2028/10/15 |
| US T N/B 4.125 10/31/29 | 国債証券 | 4.1250 | 4,000 | 4,085 | 632,651 | 2029/10/31 |
| US T N/B 5.25 11/15/28 | 国債証券 | 5.2500 | 562 | 588 | 91,100 | 2028/11/15 |
| US T N/B 6.125 11/15/27 | 国債証券 | 6.1250 | 3,200 | 3,342 | 517,580 | 2027/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/44 | 国債証券 | 3.0000 | 1,800 | 1,428 | 221,267 | 2044/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/42 | 国債証券 | 2.7500 | 2,056 | 1,618 | 250,659 | 2042/11/15 |
| US T N/B 4.75 11/15/53 | 国債証券 | 4.7500 | 4,100 | 4,124 | 638,745 | 2053/11/15 |
| US T N/B 4.5 11/15/54 | 国債証券 | 4.5000 | 4,500 | 4,348 | 673,350 | 2054/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 3,020 | 2,554 | 395,607 | 2041/11/15 |
| US T N/B 3.75 11/15/43 | 国債証券 | 3.7500 | 1,460 | 1,309 | 202,823 | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 2,250 | 1,646 | 255,024 | 2047/11/15 |
| US T N/B 1.625 11/15/50 | 国債証券 | 1.6250 | 5,832 | 3,162 | 489,778 | 2050/11/15 |
| US T N/B 1.875 11/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 4,370 | 2,492 | 385,978 | 2051/11/15 |
| US T N/B 4.0 11/15/52 | 国債証券 | 4.0000 | 4,760 | 4,233 | 655,645 | 2052/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/45 | 国債証券 | 3.0000 | 1,000 | 784 | 121,432 | 2045/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 1,580 | 1,198 | 185,640 | 2046/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 500 | 502 | 77,823 | 2039/11/15 |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 3,650 | 2,962 | 458,770 | 2048/11/15 |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 1,490 | 984 | 152,469 | 2049/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 4,180 | 4,145 | 642,030 | 2028/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/27 | 国債証券 | 2.2500 | 3,270 | 3,204 | 496,294 | 2027/11/15 |
| US T N/B 4.0 11/15/35 | 国債証券 | 4.0000 | 4,015 | 4,008 | 620,694 | 2035/11/15 |
| US T N/B 4.0 11/15/42 | 国債証券 | 4.0000 | 2,300 | 2,153 | 333,548 | 2042/11/15 |
| US T N/B 4.625 11/15/44 | 国債証券 | 4.6250 | 2,000 | 2,002 | 310,070 | 2044/11/15 |
| US T N/B 1.375 11/15/40 | 国債証券 | 1.3750 | 2,000 | 1,331 | 206,266 | 2040/11/15 |
| US T N/B 4.75 11/15/43 | 国債証券 | 4.7500 | 2,020 | 2,064 | 319,641 | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/41 | 国債証券 | 2.0000 | 2,850 | 2,039 | 315,859 | 2041/11/15 |
| US T N/B 4.625 11/15/45 | 国債証券 | 4.6250 | 700 | 698 | 108,190 | 2045/11/15 |
| US T N/B 4.625 11/15/55 | 国債証券 | 4.6250 | 1,700 | 1,678 | 259,909 | 2055/11/15 |
| US T N/B 4.125 11/15/32 | 国債証券 | 4.1250 | 4,000 | 4,083 | 632,421 | 2032/11/15 |
| US T N/B 1.75 11/15/29 | 国債証券 | 1.7500 | 4,250 | 3,995 | 618,665 | 2029/11/15 |
| US T N/B 4.5 11/15/33 | 国債証券 | 4.5000 | 1,100 | 1,147 | 177,678 | 2033/11/15 |
| US T N/B 1.375 11/15/31 | 国債証券 | 1.3750 | 1,000 | 882 | 136,591 | 2031/11/15 |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | 国債証券 | 0.8750 | 5,000 | 4,419 | 684,378 | 2030/11/15 |
| US T N/B 4.25 11/15/34 | 国債証券 | 4.2500 | 3,100 | 3,168 | 490,745 | 2034/11/15 |
| US T N/B 0.625 11/30/27 | 国債証券 | 0.6250 | 3,900 | 3,713 | 575,089 | 2027/11/30 |
| US T N/B 1.5 11/30/28 | 国債証券 | 1.5000 | 3,500 | 3,322 | 514,528 | 2028/11/30 |
| US T N/B 4.375 11/30/30 | 国債証券 | 4.3750 | 3,000 | 3,103 | 480,667 | 2030/11/30 |
| US T N/B 4.125 11/30/31 | 国債証券 | 4.1250 | 3,000 | 3,069 | 475,414 | 2031/11/30 |
| US T N/B 3.875 11/30/29 | 国債証券 | 3.8750 | 5,800 | 5,874 | 909,766 | 2029/11/30 |
| US T N/B 3.875 11/30/27 | 国債証券 | 3.8750 | 4,300 | 4,330 | 670,671 | 2027/11/30 |
| US T N/B 4.375 11/30/28 | 国債証券 | 4.3750 | 4,690 | 4,804 | 743,996 | 2028/11/30 |
| US T N/B 3.5 11/30/30 | 国債証券 | 3.5000 | 2,500 | 2,492 | 385,940 | 2030/11/30 |
| US T N/B 4.125 11/15/27 | 国債証券 | 4.1250 | 8,000 | 8,088 | 1,252,623 | 2027/11/15 |
| US T N/B 4.125 11/30/29 | 国債証券 | 4.1250 | 4,000 | 4,086 | 632,820 | 2029/11/30 |
| US T N/B 3.5 11/15/28 | 国債証券 | 3.5000 | 7,800 | 7,811 | 1,209,700 | 2028/11/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(アメリカ)** | | % | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円 | |
| US T N/B 4.5 12/31/31 | 国債証券 | 4.5000 | 2,000 | 2,085 | 322,967 | 2031/12/31 |
| US T N/B 3.75 12/31/30 | 国債証券 | 3.7500 | 2,600 | 2,618 | 405,561 | 2030/12/31 |
| US T N/B 1.375 12/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 4,600 | 4,344 | 672,856 | 2028/12/31 |
| US T N/B 3.875 12/31/29 | 国債証券 | 3.8750 | 2,800 | 2,836 | 439,231 | 2029/12/31 |
| US T N/B 0.625 12/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 4,020 | 3,819 | 591,458 | 2027/12/31 |
| US T N/B 3.625 12/31/30 | 国債証券 | 3.6250 | 3,700 | 3,707 | 574,145 | 2030/12/31 |
| US T N/B 3.875 12/31/27 | 国債証券 | 3.8750 | 4,600 | 4,635 | 717,837 | 2027/12/31 |
| US T N/B 3.75 12/31/28 | 国債証券 | 3.7500 | 4,000 | 4,033 | 624,618 | 2028/12/31 |
| US T N/B 4.0 12/15/27 | 国債証券 | 4.0000 | 4,400 | 4,442 | 687,891 | 2027/12/15 |
| US T N/B 4.375 12/31/29 | 国債証券 | 4.3750 | 3,800 | 3,917 | 606,650 | 2029/12/31 |
| US T N/B 3.5 12/15/28 | 国債証券 | 3.5000 | 1,500 | 1,502 | 232,662 | 2028/12/15 |
| 小計 | － | － | 940,557 | 894,562 | 138,531,990 | － |
| **(カナダ)** | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 3.0 03/01/32 | 国債証券 | 3.0000 | 900 | 906 | 102,480 | 2032/03/01 |
| CANADA 1.25 03/01/27 | 国債証券 | 1.2500 | 1,910 | 1,890 | 213,683 | 2027/03/01 |
| CANADA 3.5 03/01/34 | 国債証券 | 3.5000 | 1,450 | 1,496 | 169,234 | 2034/03/01 |
| CANADA 3.5 03/01/28 | 国債証券 | 3.5000 | 3,130 | 3,194 | 361,123 | 2028/03/01 |
| CANADA 4.0 03/01/29 | 国債証券 | 4.0000 | 1,700 | 1,770 | 200,099 | 2029/03/01 |
| CANADA 2.75 03/01/30 | 国債証券 | 2.7500 | 1,750 | 1,755 | 198,460 | 2030/03/01 |
| CANADA 2.75 05/01/27 | 国債証券 | 2.7500 | 1,400 | 1,407 | 159,065 | 2027/05/01 |
| CANADA 5.75 06/01/29 | 国債証券 | 5.7500 | 640 | 702 | 79,452 | 2029/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,010 | 1,190 | 134,628 | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37 | 国債証券 | 5.0000 | 1,650 | 1,916 | 216,676 | 2037/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41 | 国債証券 | 4.0000 | 197 | 210 | 23,742 | 2041/06/01 |
| CANADA 2.0 06/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 3,030 | 2,998 | 339,018 | 2028/06/01 |
| CANADA 1.0 06/01/27 | 国債証券 | 1.0000 | 1,150 | 1,131 | 127,885 | 2027/06/01 |
| CANADA 2.25 06/01/29 | 国債証券 | 2.2500 | 1,300 | 1,286 | 145,447 | 2029/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30 | 国債証券 | 1.2500 | 1,940 | 1,827 | 206,652 | 2030/06/01 |
| CANADA 2.75 06/01/33 | 国債証券 | 2.7500 | 500 | 492 | 55,659 | 2033/06/01 |
| CANADA 3.0 06/01/34 | 国債証券 | 3.0000 | 2,749 | 2,736 | 309,377 | 2034/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 3,070 | 2,875 | 325,028 | 2031/06/01 |
| CANADA 2.0 06/01/32 | 国債証券 | 2.0000 | 2,390 | 2,266 | 256,204 | 2032/06/01 |
| CANADA 3.25 06/01/35 | 国債証券 | 3.2500 | 1,950 | 1,966 | 222,368 | 2035/06/01 |
| CANADA 2.75 09/01/27 | 国債証券 | 2.7500 | 1,050 | 1,055 | 119,370 | 2027/09/01 |
| CANADA 3.25 09/01/28 | 国債証券 | 3.2500 | 500 | 509 | 57,552 | 2028/09/01 |
| CANADA 2.75 09/01/30 | 国債証券 | 2.7500 | 1,650 | 1,652 | 186,766 | 2030/09/01 |
| CANADA 3.5 09/01/29 | 国債証券 | 3.5000 | 1,300 | 1,338 | 151,290 | 2029/09/01 |
| CANADA 3.5 12/01/45 | 国債証券 | 3.5000 | 900 | 893 | 100,964 | 2045/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/48 | 国債証券 | 2.7500 | 500 | 432 | 48,868 | 2048/12/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51 | 国債証券 | 2.0000 | 1,760 | 1,270 | 143,627 | 2051/12/01 |
| CANADA 1.75 12/01/53 | 国債証券 | 1.7500 | 2,780 | 1,850 | 209,146 | 2053/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64 | 国債証券 | 2.7500 | 480 | 388 | 43,927 | 2064/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/55 | 国債証券 | 2.7500 | 1,450 | 1,206 | 136,448 | 2055/12/01 |
| CANADA 3.25 12/01/33 | 国債証券 | 3.2500 | 2,020 | 2,051 | 231,937 | 2033/12/01 |
| CANADA 3.25 12/01/35 | 国債証券 | 3.2500 | 2,110 | 2,121 | 239,852 | 2035/12/01 |
| CANADA 3.5 12/01/57 | 国債証券 | 3.5000 | 1,150 | 1,111 | 125,628 | 2057/12/01 |
| CANADA 0.5 12/01/30 | 国債証券 | 0.5000 | 3,550 | 3,196 | 361,382 | 2030/12/01 |
| CANADA 1.5 12/01/31 | 国債証券 | 1.5000 | 1,840 | 1,707 | 193,082 | 2031/12/01 |
| CANADA 2.5 12/01/32 | 国債証券 | 2.5000 | 400 | 388 | 43,976 | 2032/12/01 |
| CANADA 3.25 12/01/34 | 国債証券 | 3.2500 | 870 | 879 | 99,473 | 2034/12/01 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(カナダ)** | | % | 千カナダ・ドル | 千カナダ・ドル | 千円 | |
| CANADA 2.25 12/01/29 | 国債証券 | 2.2500 | 900 | 888 | 100,399 | 2029/12/01 |
| 小計 | － | － | 59,026 | 56,965 | 6,439,987 | － |
| **(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 | 1,090 | 790 | 86,506 | 2047/03/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 03/21/36 | 国債証券 | 4.2500 | 2,700 | 2,599 | 284,368 | 2036/03/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 1,240 | 1,248 | 136,534 | 2027/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 2,400 | 2,329 | 254,791 | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33 | 国債証券 | 4.5000 | 1,660 | 1,658 | 181,369 | 2033/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 880 | 802 | 87,819 | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,080 | 1,035 | 113,225 | 2028/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30 | 国債証券 | 2.5000 | 2,060 | 1,917 | 209,787 | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41 | 国債証券 | 2.7500 | 960 | 735 | 80,433 | 2041/05/21 |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32 | 国債証券 | 1.2500 | 2,950 | 2,441 | 267,066 | 2032/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34 | 国債証券 | 3.7500 | 1,940 | 1,826 | 199,772 | 2034/05/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 06/21/54 | 国債証券 | 4.7500 | 800 | 745 | 81,572 | 2054/06/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39 | 国債証券 | 3.2500 | 550 | 462 | 50,633 | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31 | 国債証券 | 1.5000 | 360 | 311 | 34,072 | 2031/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35 | 国債証券 | 2.7500 | 1,350 | 1,153 | 126,204 | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51 | 国債証券 | 1.7500 | 1,490 | 765 | 83,751 | 2051/06/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 06/21/34 | 国債証券 | 4.2500 | 1,950 | 1,901 | 207,969 | 2034/06/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 10/21/36 | 国債証券 | 4.2500 | 200 | 191 | 20,977 | 2036/10/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28 | 国債証券 | 2.7500 | 1,600 | 1,539 | 168,385 | 2028/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27 | 国債証券 | 2.7500 | 830 | 810 | 88,620 | 2027/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29 | 国債証券 | 2.7500 | 2,750 | 2,606 | 285,074 | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33 | 国債証券 | 3.0000 | 120 | 107 | 11,791 | 2033/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/32 | 国債証券 | 1.7500 | 3,828 | 3,222 | 352,482 | 2032/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31 | 国債証券 | 1.0000 | 1,500 | 1,243 | 136,029 | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 12/21/35 | 国債証券 | 4.2500 | 1,427 | 1,376 | 150,534 | 2035/12/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30 | 国債証券 | 1.0000 | 1,370 | 1,173 | 128,328 | 2030/12/21 |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34 | 国債証券 | 3.5000 | 1,820 | 1,669 | 182,615 | 2034/12/21 |
| 小計 | － | － | 40,905 | 36,664 | 4,010,719 | － |
| **(シンガポール)** | | % | 千シンガポール・ドル | 千シンガポール・ドル | 千円 | |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27 | 国債証券 | 3.5000 | 800 | 817 | 99,974 | 2027/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46 | 国債証券 | 2.7500 | 470 | 520 | 63,709 | 2046/03/01 |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50 | 国債証券 | 1.8750 | 710 | 681 | 83,352 | 2050/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 04/01/42 | 国債証券 | 2.7500 | 760 | 829 | 101,490 | 2042/04/01 |
| SINGAPORE 3.0 04/01/29 | 国債証券 | 3.0000 | 320 | 334 | 40,926 | 2029/04/01 |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28 | 国債証券 | 2.6250 | 240 | 246 | 30,119 | 2028/05/01 |
| SINGAPORE 3.375 05/01/34 | 国債証券 | 3.3750 | 550 | 613 | 75,027 | 2034/05/01 |
| SINGAPORE 3.25 06/01/54 | 国債証券 | 3.2500 | 160 | 196 | 24,083 | 2054/06/01 |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29 | 国債証券 | 2.8750 | 620 | 648 | 79,265 | 2029/07/01 |
| SINGAPORE 2.375 07/01/39 | 国債証券 | 2.3750 | 600 | 623 | 76,198 | 2039/07/01 |
| SINGAPORE 1.625 07/01/31 | 国債証券 | 1.6250 | 1,360 | 1,360 | 166,331 | 2031/07/01 |
| SINGAPORE 3.0 08/01/72 | 国債証券 | 3.0000 | 153 | 185 | 22,723 | 2072/08/01 |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 630 | 648 | 79,252 | 2036/08/01 |
| SINGAPORE 2.625 08/01/32 | 国債証券 | 2.6250 | 550 | 580 | 70,992 | 2032/08/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30 | 国債証券 | 2.8750 | 520 | 549 | 67,237 | 2030/09/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/27 | 国債証券 | 2.8750 | 200 | 204 | 25,022 | 2027/09/01 |
| SINGAPORE 1.875 10/01/51 | 国債証券 | 1.8750 | 540 | 514 | 62,932 | 2051/10/01 |
| 小計 | － | － | 9,183 | 9,556 | 1,168,644 | － |

| 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 | |
| **(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 4.5 04/15/27 | 国債証券 | 4.5000 | 700 | 714 | 65,958 | 2027/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33 | 国債証券 | 3.5000 | 1,080 | 1,042 | 96,214 | 2033/04/14 |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 510 | 433 | 40,025 | 2037/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29 | 国債証券 | 3.0000 | 750 | 741 | 68,501 | 2029/04/20 |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国債証券 | 2.7500 | 810 | 551 | 50,916 | 2051/05/15 |
| NEW ZEALAND 5.0 05/15/54 | 国債証券 | 5.0000 | 200 | 200 | 18,481 | 2054/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 400 | 270 | 24,994 | 2041/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31 | 国債証券 | 1.5000 | 1,960 | 1,745 | 161,141 | 2031/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.25 05/15/34 | 国債証券 | 4.2500 | 470 | 472 | 43,623 | 2034/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.25 05/15/36 | 国債証券 | 4.2500 | 730 | 722 | 66,713 | 2036/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.5 05/15/35 | 国債証券 | 4.5000 | 450 | 457 | 42,252 | 2035/05/15 |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32 | 国債証券 | 2.0000 | 1,410 | 1,258 | 116,180 | 2032/05/15 |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,050 | 986 | 91,065 | 2028/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.5 05/15/30 | 国債証券 | 4.5000 | 500 | 517 | 47,782 | 2030/05/15 |
| 小計 | － | － | 11,020 | 10,114 | 933,852 | － |
| **(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 | 1,660 | 1,323 | 276,637 | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45 | 国債証券 | 3.5000 | 1,450 | 1,187 | 248,130 | 2045/01/22 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60 | 国債証券 | 4.0000 | 1,300 | 1,074 | 224,639 | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 5.375 01/31/56 | 国債証券 | 5.3750 | 700 | 730 | 152,617 | 2056/01/31 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49 | 国債証券 | 1.7500 | 1,100 | 608 | 127,272 | 2049/01/22 |
| UK TREASURY 5.25 01/31/41 | 国債証券 | 5.2500 | 250 | 262 | 54,782 | 2041/01/31 |
| UK TREASURY 3.75 01/29/38 | 国債証券 | 3.7500 | 2,250 | 2,076 | 434,066 | 2038/01/29 |
| UK TREASURY 4.375 01/31/40 | 国債証券 | 4.3750 | 1,300 | 1,253 | 262,005 | 2040/01/31 |
| UK TREASURY 0.875 01/31/46 | 国債証券 | 0.8750 | 1,250 | 602 | 125,864 | 2046/01/31 |
| UK TREASURY 1.125 01/31/39 | 国債証券 | 1.1250 | 250 | 165 | 34,558 | 2039/01/31 |
| UK TREASURY 4.625 01/31/34 | 国債証券 | 4.6250 | 2,200 | 2,264 | 473,294 | 2034/01/31 |
| UK TREASURY 1.0 01/31/32 | 国債証券 | 1.0000 | 2,370 | 2,007 | 419,541 | 2032/01/31 |
| UK TREASURY 3.25 01/31/33 | 国債証券 | 3.2500 | 2,300 | 2,186 | 457,041 | 2033/01/31 |
| UK TREASURY 0.5 01/31/29 | 国債証券 | 0.5000 | 1,680 | 1,539 | 321,778 | 2029/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/28 | 国債証券 | 0.1250 | 2,190 | 2,059 | 430,491 | 2028/01/31 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36 | 国債証券 | 4.2500 | 2,561 | 2,528 | 528,428 | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 4.5 03/07/35 | 国債証券 | 4.5000 | 1,227 | 1,244 | 260,133 | 2035/03/07 |
| UK TREASURY 3.75 03/07/27 | 国債証券 | 3.7500 | 1,700 | 1,703 | 356,070 | 2027/03/07 |
| UK TREASURY 4.375 03/07/30 | 国債証券 | 4.3750 | 1,900 | 1,944 | 406,428 | 2030/03/07 |
| UK TREASURY 4.375 03/07/28 | 国債証券 | 4.3750 | 1,550 | 1,574 | 329,051 | 2028/03/07 |
| UK TREASURY 4.0 05/22/29 | 国債証券 | 4.0000 | 800 | 807 | 168,871 | 2029/05/22 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32 | 国債証券 | 4.2500 | 2,470 | 2,516 | 525,944 | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 4.5 06/07/28 | 国債証券 | 4.5000 | 1,850 | 1,886 | 394,362 | 2028/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47 | 国債証券 | 1.5000 | 1,200 | 645 | 134,888 | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/31/51 | 国債証券 | 1.2500 | 1,430 | 647 | 135,356 | 2051/07/31 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52 | 国債証券 | 3.7500 | 1,370 | 1,105 | 230,968 | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/31/53 | 国債証券 | 1.5000 | 1,410 | 662 | 138,417 | 2053/07/31 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57 | 国債証券 | 1.7500 | 1,562 | 747 | 156,257 | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65 | 国債証券 | 2.5000 | 350 | 198 | 41,434 | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68 | 国債証券 | 3.5000 | 880 | 645 | 134,826 | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 4.375 07/31/54 | 国債証券 | 4.3750 | 1,180 | 1,049 | 219,436 | 2054/07/31 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27 | 国債証券 | 1.2500 | 1,900 | 1,842 | 385,143 | 2027/07/22 |
| UK TREASURY 0.875 07/31/33 | 国債証券 | 0.8750 | 1,935 | 1,537 | 321,309 | 2033/07/31 |
| UK TREASURY 0.25 07/31/31 | 国債証券 | 0.2500 | 2,690 | 2,228 | 465,862 | 2031/07/31 |
| UK TREASURY 0.625 07/31/35 | 国債証券 | 0.6250 | 2,500 | 1,791 | 374,345 | 2035/07/31 |

| 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 | |
| **(イギリス)** | | % | 千イギリス・ポンド | 千イギリス・ポンド | 千円 | |
| UK TREASURY 4.25 07/31/34 | 国債証券 | 4.2500 | 2,180 | 2,181 | 455,975 | 2034/07/31 |
| UK TREASURY 4.125 07/22/29 | 国債証券 | 4.1250 | 2,100 | 2,130 | 445,227 | 2029/07/22 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,160 | 1,109 | 231,970 | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34 | 国債証券 | 4.5000 | 2,050 | 2,089 | 436,681 | 2034/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37 | 国債証券 | 1.7500 | 1,790 | 1,346 | 281,531 | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 10/22/53 | 国債証券 | 3.7500 | 1,800 | 1,437 | 300,410 | 2053/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券 | 1.6250 | 1,270 | 608 | 127,133 | 2054/10/22 |
| UK TREASURY 0.5 10/22/61 | 国債証券 | 0.5000 | 2,160 | 570 | 119,289 | 2061/10/22 |
| UK TREASURY 4.0 10/22/63 | 国債証券 | 4.0000 | 1,720 | 1,408 | 294,392 | 2063/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券 | 1.6250 | 830 | 341 | 71,299 | 2071/10/22 |
| UK TREASURY 1.125 10/22/73 | 国債証券 | 1.1250 | 1,336 | 435 | 91,003 | 2073/10/22 |
| UK TREASURY 1.25 10/22/41 | 国債証券 | 1.2500 | 2,350 | 1,437 | 300,401 | 2041/10/22 |
| UK TREASURY 0.625 10/22/50 | 国債証券 | 0.6250 | 1,340 | 507 | 106,023 | 2050/10/22 |
| UK TREASURY 4.75 10/22/43 | 国債証券 | 4.7500 | 1,350 | 1,318 | 275,545 | 2043/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券 | 1.6250 | 2,330 | 2,220 | 464,151 | 2028/10/22 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | 0.8750 | 2,030 | 1,843 | 385,239 | 2029/10/22 |
| UK TREASURY 4.0 10/22/31 | 国債証券 | 4.0000 | 2,200 | 2,209 | 461,867 | 2031/10/22 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/30 | 国債証券 | 0.3750 | 1,990 | 1,710 | 357,552 | 2030/10/22 |
| UK TREASURY 4.75 10/22/35 | 国債証券 | 4.7500 | 1,100 | 1,132 | 236,604 | 2035/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28 | 国債証券 | 6.0000 | 1,180 | 1,257 | 262,815 | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38 | 国債証券 | 4.7500 | 1,430 | 1,448 | 302,681 | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42 | 国債証券 | 4.5000 | 1,245 | 1,190 | 248,783 | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46 | 国債証券 | 4.2500 | 1,280 | 1,153 | 241,069 | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55 | 国債証券 | 4.2500 | 563 | 490 | 102,559 | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27 | 国債証券 | 4.2500 | 2,210 | 2,238 | 467,935 | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40 | 国債証券 | 4.2500 | 2,401 | 2,269 | 474,319 | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30 | 国債証券 | 4.7500 | 1,595 | 1,666 | 348,242 | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49 | 国債証券 | 4.2500 | 1,147 | 1,019 | 213,072 | 2049/12/07 |
| 小計 | － | － | 100,852 | 85,421 | 17,854,040 | － |
| **(イスラエル)** | | % | 千イスラエル・シュケル | 千イスラエル・シュケル | 千円 | |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42 | 国債証券 | 5.5000 | 1,874 | 2,204 | 109,337 | 2042/01/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 02/28/29 | 国債証券 | 3.7500 | 1,700 | 1,715 | 85,064 | 2029/02/28 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 国債証券 | 3.7500 | 1,810 | 1,708 | 84,745 | 2047/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 03/30/35 | 国債証券 | 4.0000 | 2,600 | 2,659 | 131,897 | 2035/03/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27 | 国債証券 | 2.0000 | 2,510 | 2,472 | 122,616 | 2027/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30 | 国債証券 | 1.0000 | 2,410 | 2,189 | 108,561 | 2030/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32 | 国債証券 | 1.3000 | 3,230 | 2,835 | 140,605 | 2032/04/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37 | 国債証券 | 1.5000 | 3,440 | 2,711 | 134,481 | 2037/05/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 07/31/28 | 国債証券 | 4.1000 | 400 | 406 | 20,142 | 2028/07/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 08/31/29 | 国債証券 | 4.6000 | 700 | 726 | 36,032 | 2029/08/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28 | 国債証券 | 2.2500 | 3,810 | 3,703 | 183,657 | 2028/09/28 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27 | 国債証券 | 3.7500 | 300 | 301 | 14,959 | 2027/09/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 11/29/52 | 国債証券 | 2.8000 | 1,580 | 1,201 | 59,610 | 2052/11/29 |
| 小計 | － | － | 26,364 | 24,835 | 1,231,712 | － |
| **(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 | 4,520 | 2,219 | 54,236 | 2052/11/15 |
| DENMARK 4.5 11/15/39 | 国債証券 | 4.5000 | 6,009 | 7,183 | 175,556 | 2039/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 2,850 | 2,791 | 68,212 | 2027/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 4,040 | 3,821 | 93,406 | 2029/11/15 |
| DENMARK 2.25 11/15/35 | 国債証券 | 2.2500 | 3,200 | 3,105 | 75,908 | 2035/11/15 |
| DENMARK 0.0 11/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 3,480 | 3,072 | 75,088 | 2031/11/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(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 2.25 11/15/33 | 国債証券 | 2.2500 | 3,340 | 3,305 | 80,789 | 2033/11/15 |
| 小計 | － | － | 27,439 | 25,499 | 623,200 | － |
| **(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 1.75 02/17/27 | 国債証券 | 1.7500 | 4,700 | 4,600 | 74,486 | 2027/02/17 |
| NORWAY 2.0 04/26/28 | 国債証券 | 2.0000 | 2,526 | 2,439 | 39,491 | 2028/04/26 |
| NORWAY 3.625 04/13/34 | 国債証券 | 3.6250 | 1,570 | 1,516 | 24,545 | 2034/04/13 |
| NORWAY 3.625 05/31/39 | 国債証券 | 3.6250 | 1,950 | 1,831 | 29,654 | 2039/05/31 |
| NORWAY 2.125 05/18/32 | 国債証券 | 2.1250 | 1,230 | 1,101 | 17,830 | 2032/05/18 |
| NORWAY 3.75 06/12/35 | 国債証券 | 3.7500 | 1,810 | 1,752 | 28,370 | 2035/06/12 |
| NORWAY 1.375 08/19/30 | 国債証券 | 1.3750 | 4,610 | 4,120 | 66,711 | 2030/08/19 |
| NORWAY 3.0 08/15/33 | 国債証券 | 3.0000 | 5,000 | 4,649 | 75,271 | 2033/08/15 |
| NORWAY 1.75 09/06/29 | 国債証券 | 1.7500 | 5,120 | 4,747 | 76,868 | 2029/09/06 |
| NORWAY 1.25 09/17/31 | 国債証券 | 1.2500 | 2,850 | 2,461 | 39,851 | 2031/09/17 |
| NORWAY 3.5 10/06/42 | 国債証券 | 3.5000 | 3,210 | 2,937 | 47,564 | 2042/10/06 |
| 小計 | － | － | 34,576 | 32,158 | 520,646 | － |
| **(スウェーデン)** | | % | 千スウェーデン・クローナ | 千スウェーデン・クローナ | 千円 | |
| SWEDEN 3.5 03/30/39 | 国債証券 | 3.5000 | 3,550 | 3,818 | 65,254 | 2039/03/30 |
| SWEDEN 0.75 05/12/28 | 国債証券 | 0.7500 | 4,090 | 3,990 | 68,193 | 2028/05/12 |
| SWEDEN 0.125 05/12/31 | 国債証券 | 0.1250 | 4,220 | 3,788 | 64,751 | 2031/05/12 |
| SWEDEN 2.25 05/11/35 | 国債証券 | 2.2500 | 1,100 | 1,069 | 18,273 | 2035/05/11 |
| SWEDEN 2.25 06/01/32 | 国債証券 | 2.2500 | 4,030 | 4,010 | 68,537 | 2032/06/01 |
| SWEDEN 2.5 10/15/36 | 国債証券 | 2.5000 | 3,300 | 3,239 | 55,360 | 2036/10/15 |
| SWEDEN 0.75 11/12/29 | 国債証券 | 0.7500 | 6,160 | 5,872 | 100,364 | 2029/11/12 |
| SWEDEN 1.75 11/11/33 | 国債証券 | 1.7500 | 5,150 | 4,895 | 83,657 | 2033/11/11 |
| 小計 | － | － | 31,600 | 30,684 | 524,393 | － |
| **(メキシコ)** | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| MEXICAN BONDS 02/28/30 | 国債証券 | 8.5000 | 4,000 | 4,066 | 36,500 | 2030/02/28 |
| MEXICAN BONDS 03/04/27 | 国債証券 | 5.5000 | 28,080 | 27,690 | 248,534 | 2027/03/04 |
| MEXICAN BONDS 03/01/29 | 国債証券 | 8.5000 | 41,823 | 42,763 | 383,824 | 2029/03/01 |
| MEXICAN BONDS 03/02/28 | 国債証券 | 8.5000 | 7,000 | 7,160 | 64,269 | 2028/03/02 |
| MEXICAN BONDS 04/15/32 | 国債証券 | 8.0000 | 4,000 | 3,905 | 35,050 | 2032/04/15 |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29 | 国債証券 | 8.5000 | 15,419 | 15,739 | 141,274 | 2029/05/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31 | 国債証券 | 7.7500 | 44,648 | 43,776 | 392,919 | 2031/05/29 |
| MEXICAN BONDS 05/24/35 | 国債証券 | 8.0000 | 20,500 | 19,466 | 174,723 | 2035/05/24 |
| MEXICAN BONDS 05/26/33 | 国債証券 | 7.5000 | 19,790 | 18,724 | 168,061 | 2033/05/26 |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27 | 国債証券 | 7.5000 | 19,146 | 19,268 | 172,943 | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS 07/31/53 | 国債証券 | 8.0000 | 38,290 | 33,395 | 299,744 | 2053/07/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42 | 国債証券 | 7.7500 | 29,993 | 26,035 | 233,683 | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47 | 国債証券 | 8.0000 | 8,461 | 7,428 | 66,679 | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38 | 国債証券 | 8.5000 | 12,442 | 11,876 | 106,595 | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36 | 国債証券 | 10.0000 | 12,805 | 13,864 | 124,440 | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34 | 国債証券 | 7.7500 | 20,035 | 18,944 | 170,041 | 2034/11/23 |
| 小計 | － | － | 326,432 | 314,105 | 2,819,288 | － |
| **(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 1.92 01/15/55 | 国債証券 | 1.9200 | 8,510 | 7,885 | 177,255 | 2055/01/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29 | 国債証券 | 2.3700 | 29,000 | 29,852 | 671,072 | 2029/01/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.43 01/25/30 | 国債証券 | 1.4300 | 46,000 | 45,932 | 1,032,542 | 2030/01/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34 | 国債証券 | 2.3500 | 26,000 | 27,263 | 612,876 | 2034/02/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.61 02/15/35 | 国債証券 | 1.6100 | 25,000 | 24,710 | 555,495 | 2035/02/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32 | 国債証券 | 2.7500 | 20,500 | 21,872 | 491,686 | 2032/02/17 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33 | 国債証券 | 2.8800 | 4,200 | 4,555 | 102,410 | 2033/02/25 |

| 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 | |
| **(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 1.45 02/25/28 | 国債証券 | 1.4500 | 79,000 | 79,199 | 1,780,390 | 2028/02/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50 | 国債証券 | 3.3900 | 16,100 | 19,329 | 434,522 | 2050/03/16 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29 | 国債証券 | 2.8000 | 11,000 | 11,494 | 258,396 | 2029/03/24 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.79 03/25/32 | 国債証券 | 1.7900 | 35,000 | 35,374 | 795,203 | 2032/03/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31 | 国債証券 | 2.2800 | 30,000 | 31,090 | 698,911 | 2031/03/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30 | 国債証券 | 2.8000 | 10,000 | 10,557 | 237,322 | 2030/03/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52 | 国債証券 | 3.3200 | 15,820 | 18,962 | 426,271 | 2052/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51 | 国債証券 | 3.7200 | 7,600 | 9,657 | 217,105 | 2051/04/12 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53 | 国債証券 | 3.1900 | 10,800 | 12,736 | 286,310 | 2053/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28 | 国債証券 | 2.6200 | 24,000 | 24,689 | 555,018 | 2028/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29 | 国債証券 | 2.0500 | 20,040 | 20,456 | 459,844 | 2029/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31 | 国債証券 | 3.0200 | 28,000 | 30,238 | 679,758 | 2031/05/27 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32 | 国債証券 | 2.7600 | 9,000 | 9,624 | 216,349 | 2032/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33 | 国債証券 | 2.6700 | 19,500 | 20,859 | 468,915 | 2033/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 | 国債証券 | 3.0100 | 22,000 | 22,884 | 514,431 | 2028/05/13 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29 | 国債証券 | 3.2900 | 25,000 | 26,680 | 599,780 | 2029/05/23 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.67 05/25/35 | 国債証券 | 1.6700 | 34,050 | 33,847 | 760,874 | 2035/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.65 05/15/35 | 国債証券 | 1.6500 | 12,000 | 11,892 | 267,342 | 2035/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.27 05/25/34 | 国債証券 | 2.2700 | 31,590 | 32,927 | 740,190 | 2034/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 | 国債証券 | 2.6800 | 7,600 | 7,966 | 179,092 | 2030/05/21 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.85 05/15/27 | 国債証券 | 1.8500 | 10,000 | 10,067 | 226,315 | 2027/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.46 05/25/28 | 国債証券 | 1.4600 | 57,000 | 57,175 | 1,285,288 | 2028/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 | 国債証券 | 2.8500 | 28,000 | 28,612 | 643,208 | 2027/06/04 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.12 06/25/31 | 国債証券 | 2.1200 | 17,410 | 17,913 | 402,694 | 2031/06/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29 | 国債証券 | 2.7500 | 7,000 | 7,317 | 164,489 | 2029/06/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30 | 国債証券 | 2.6200 | 31,000 | 32,521 | 731,082 | 2030/06/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49 | 国債証券 | 3.8600 | 16,300 | 20,875 | 469,276 | 2049/07/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28 | 国債証券 | 2.4000 | 34,650 | 35,540 | 798,935 | 2028/07/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 31,410 | 31,874 | 716,517 | 2027/07/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.55 07/25/30 | 国債証券 | 1.5500 | 10,000 | 10,026 | 225,386 | 2030/07/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.91 07/15/29 | 国債証券 | 1.9100 | 36,000 | 36,586 | 822,447 | 2029/07/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.83 08/25/35 | 国債証券 | 1.8300 | 21,000 | 21,099 | 474,302 | 2035/08/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32 | 国債証券 | 2.6900 | 16,000 | 17,012 | 382,436 | 2032/08/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33 | 国債証券 | 2.5200 | 25,000 | 26,495 | 595,605 | 2033/08/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27 | 国債証券 | 3.5900 | 5,000 | 5,186 | 116,590 | 2027/08/03 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.11 08/25/34 | 国債証券 | 2.1100 | 31,000 | 31,951 | 718,268 | 2034/08/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 08/15/28 | 国債証券 | 1.4200 | 9,000 | 9,013 | 202,610 | 2028/08/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.62 08/15/27 | 国債証券 | 1.6200 | 47,440 | 47,642 | 1,070,992 | 2027/08/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50 | 国債証券 | 3.8100 | 21,000 | 26,888 | 604,437 | 2050/09/14 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32 | 国債証券 | 2.6000 | 19,300 | 20,476 | 460,305 | 2032/09/01 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30 | 国債証券 | 2.6000 | 28,000 | 29,394 | 660,775 | 2030/09/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.87 09/15/31 | 国債証券 | 1.8700 | 21,000 | 21,326 | 479,417 | 2031/09/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.78 09/15/32 | 国債証券 | 1.7800 | 8,000 | 8,066 | 181,338 | 2032/09/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29 | 国債証券 | 2.6200 | 18,000 | 18,770 | 421,961 | 2029/09/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53 | 国債証券 | 3.0000 | 20,400 | 23,379 | 525,556 | 2053/10/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51 | 国債証券 | 3.5300 | 10,450 | 12,948 | 291,068 | 2051/10/18 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48 | 国債証券 | 4.0800 | 10,300 | 13,537 | 304,321 | 2048/10/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28 | 国債証券 | 2.9100 | 27,100 | 28,271 | 635,543 | 2028/10/14 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28 | 国債証券 | 2.5500 | 27,000 | 27,860 | 626,303 | 2028/10/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27 | 国債証券 | 2.4400 | 21,000 | 21,353 | 480,017 | 2027/10/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.63 10/25/30 | 国債証券 | 1.6300 | 8,000 | 8,027 | 180,450 | 2030/10/25 |

| 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 | |
| **(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 1.74 10/15/29 | 国債証券 | 1.7400 | 27,000 | 27,304 | 613,801 | 2029/10/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32 | 国債証券 | 2.8000 | 19,300 | 20,760 | 466,696 | 2032/11/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31 | 国債証券 | 2.8900 | 11,100 | 11,941 | 268,439 | 2031/11/18 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33 | 国債証券 | 2.6700 | 23,850 | 25,575 | 574,935 | 2033/11/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30 | 国債証券 | 3.2700 | 9,000 | 9,807 | 220,475 | 2030/11/19 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 11/22/28 | 国債証券 | 3.2500 | 37,000 | 39,093 | 878,819 | 2028/11/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 11/25/34 | 国債証券 | 2.0400 | 8,000 | 8,191 | 184,134 | 2034/11/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29 | 国債証券 | 3.1300 | 8,000 | 8,543 | 192,051 | 2029/11/21 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.42 11/15/27 | 国債証券 | 1.4200 | 47,000 | 47,084 | 1,058,454 | 2027/11/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.49 12/25/31 | 国債証券 | 1.4900 | 14,000 | 13,911 | 312,727 | 2031/12/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30 | 国債証券 | 2.5400 | 17,000 | 17,826 | 400,729 | 2030/12/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29 | 国債証券 | 2.7900 | 22,000 | 23,147 | 520,349 | 2029/12/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27 | 国債証券 | 3.2800 | 18,500 | 19,232 | 432,351 | 2027/12/03 |
| 小計 | － | － | 1,541,820 | 1,612,178 | 36,241,290 | － |
| **(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 4.457 03/31/53 | 国債証券 | 4.4570 | 1,720 | 1,845 | 73,487 | 2053/03/31 |
| MALAYSIA 4.736 03/15/46 | 国債証券 | 4.7360 | 800 | 883 | 35,208 | 2046/03/15 |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30 | 国債証券 | 4.4980 | 1,200 | 1,255 | 50,016 | 2030/04/15 |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33 | 国債証券 | 3.8440 | 1,660 | 1,697 | 67,626 | 2033/04/15 |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37 | 国債証券 | 4.7620 | 3,500 | 3,846 | 153,195 | 2037/04/07 |
| MALAYSIA 4.054 04/18/39 | 国債証券 | 4.0540 | 1,050 | 1,079 | 42,985 | 2039/04/18 |
| MALAYSIA 2.632 04/15/31 | 国債証券 | 2.6320 | 2,000 | 1,929 | 76,860 | 2031/04/15 |
| MALAYSIA 4.504 04/30/29 | 国債証券 | 4.5040 | 1,590 | 1,653 | 65,852 | 2029/04/30 |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27 | 国債証券 | 3.5020 | 1,250 | 1,258 | 50,129 | 2027/05/31 |
| MALAYSIA 3.757 05/22/40 | 国債証券 | 3.7570 | 1,400 | 1,392 | 55,466 | 2040/05/22 |
| MALAYSIA 4.254 05/31/35 | 国債証券 | 4.2540 | 900 | 950 | 37,837 | 2035/05/31 |
| MALAYSIA 4.18 05/16/44 | 国債証券 | 4.1800 | 700 | 721 | 28,724 | 2044/05/16 |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28 | 国債証券 | 3.7330 | 2,000 | 2,029 | 80,823 | 2028/06/15 |
| MALAYSIA 4.232 06/30/31 | 国債証券 | 4.2320 | 2,070 | 2,159 | 85,990 | 2031/06/30 |
| MALAYSIA 4.893 06/08/38 | 国債証券 | 4.8930 | 500 | 556 | 22,155 | 2038/06/08 |
| MALAYSIA 4.065 06/15/50 | 国債証券 | 4.0650 | 1,480 | 1,494 | 59,517 | 2050/06/15 |
| MALAYSIA 4.921 07/06/48 | 国債証券 | 4.9210 | 1,240 | 1,410 | 56,165 | 2048/07/06 |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34 | 国債証券 | 3.8280 | 2,270 | 2,318 | 92,356 | 2034/07/05 |
| MALAYSIA 3.582 07/15/32 | 国債証券 | 3.5820 | 3,100 | 3,125 | 124,498 | 2032/07/15 |
| MALAYSIA 3.476 07/02/35 | 国債証券 | 3.4760 | 900 | 897 | 35,733 | 2035/07/02 |
| MALAYSIA 3.885 08/15/29 | 国債証券 | 3.8850 | 1,100 | 1,125 | 44,831 | 2029/08/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43 | 国債証券 | 4.9350 | 1,600 | 1,824 | 72,660 | 2043/09/30 |
| MALAYSIA 4.696 10/15/42 | 国債証券 | 4.6960 | 1,160 | 1,283 | 51,120 | 2042/10/15 |
| MALAYSIA 3.899 11/16/27 | 国債証券 | 3.8990 | 661 | 670 | 26,724 | 2027/11/16 |
| MALAYSIA 4.642 11/07/33 | 国債証券 | 4.6420 | 1,900 | 2,044 | 81,425 | 2033/11/07 |
| 小計 | － | － | 37,751 | 39,453 | 1,571,393 | － |
| **(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 5.0 01/25/30 | 国債証券 | 5.0000 | 5,153 | 5,336 | 230,884 | 2030/01/25 |
| POLAND 4.5 01/25/31 | 国債証券 | 4.5000 | 2,200 | 2,225 | 96,300 | 2031/01/25 |
| POLAND 5.75 04/25/29 | 国債証券 | 5.7500 | 1,990 | 2,105 | 91,098 | 2029/04/25 |
| POLAND 2.75 04/25/28 | 国債証券 | 2.7500 | 4,760 | 4,693 | 203,085 | 2028/04/25 |
| POLAND 1.75 04/25/32 | 国債証券 | 1.7500 | 3,250 | 2,785 | 120,510 | 2032/04/25 |
| POLAND 3.75 05/25/27 | 国債証券 | 3.7500 | 1,420 | 1,429 | 61,867 | 2027/05/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27 | 国債証券 | 2.5000 | 5,060 | 5,009 | 216,726 | 2027/07/25 |
| POLAND 7.5 07/25/28 | 国債証券 | 7.5000 | 2,400 | 2,617 | 113,237 | 2028/07/25 |
| POLAND 4.5 07/25/30 | 国債証券 | 4.5000 | 3,300 | 3,349 | 144,936 | 2030/07/25 |

| 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 4.75 07/25/29 | 国債証券 | 4.7500 | 3,220 | 3,310 | 143,232 | 2029/07/25 |
| POLAND 2.75 10/25/29 | 国債証券 | 2.7500 | 2,000 | 1,923 | 83,228 | 2029/10/25 |
| POLAND 5.0 10/25/34 | 国債証券 | 5.0000 | 3,250 | 3,287 | 142,256 | 2034/10/25 |
| POLAND 6.0 10/25/33 | 国債証券 | 6.0000 | 4,862 | 5,271 | 228,057 | 2033/10/25 |
| POLAND 1.25 10/25/30 | 国債証券 | 1.2500 | 6,420 | 5,642 | 244,124 | 2030/10/25 |
| POLAND 5.0 10/25/35 | 国債証券 | 5.0000 | 2,400 | 2,411 | 104,321 | 2035/10/25 |
| 小計 | － | － | 51,685 | 51,399 | 2,223,868 | － |
| **(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 | 680 | 124,206 | 2045/02/18 |
| IRISH 1.35 03/18/31 | 国債証券 | 1.3500 | 540 | 514 | 93,970 | 2031/03/18 |
| IRISH 0.55 04/22/41 | 国債証券 | 0.5500 | 390 | 264 | 48,370 | 2041/04/22 |
| IRISH 1.5 05/15/50 | 国債証券 | 1.5000 | 550 | 371 | 67,896 | 2050/05/15 |
| IRISH 1.3 05/15/33 | 国債証券 | 1.3000 | 190 | 173 | 31,695 | 2033/05/15 |
| IRISH 2.4 05/15/30 | 国債証券 | 2.4000 | 970 | 973 | 177,701 | 2030/05/15 |
| IRISH 0.9 05/15/28 | 国債証券 | 0.9000 | 810 | 790 | 144,226 | 2028/05/15 |
| IRISH 1.1 05/15/29 | 国債証券 | 1.1000 | 730 | 705 | 128,811 | 2029/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37 | 国債証券 | 1.7000 | 780 | 682 | 124,612 | 2037/05/15 |
| IRISH 0.4 05/15/35 | 国債証券 | 0.4000 | 520 | 416 | 76,110 | 2035/05/15 |
| IRISH 0.2 05/15/27 | 国債証券 | 0.2000 | 420 | 411 | 75,032 | 2027/05/15 |
| IRISH 3.15 10/18/55 | 国債証券 | 3.1500 | 200 | 183 | 33,412 | 2055/10/18 |
| IRISH 3.0 10/18/43 | 国債証券 | 3.0000 | 280 | 268 | 48,940 | 2043/10/18 |
| IRISH 2.6 10/18/34 | 国債証券 | 2.6000 | 671 | 661 | 120,690 | 2034/10/18 |
| IRISH 0.2 10/18/30 | 国債証券 | 0.2000 | 350 | 317 | 57,930 | 2030/10/18 |
| 小計 | － | － | 8,241 | 7,415 | 1,353,609 | － |
| **(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 | 990 | 1,059 | 193,431 | 2042/01/15 |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 1,351 | 1,236 | 225,687 | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/52 | 国債証券 | 0.0000 | 1,646 | 691 | 126,264 | 2052/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28 | 国債証券 | 5.5000 | 490 | 521 | 95,156 | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37 | 国債証券 | 4.0000 | 1,820 | 2,003 | 365,797 | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 3.5 01/15/56 | 国債証券 | 3.5000 | 350 | 353 | 64,531 | 2056/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33 | 国債証券 | 2.5000 | 1,110 | 1,106 | 202,072 | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/38 | 国債証券 | 0.0000 | 240 | 168 | 30,725 | 2038/01/15 |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40 | 国債証券 | 0.5000 | 1,160 | 821 | 149,951 | 2040/01/15 |
| NETHERLANDS 2.0 01/15/54 | 国債証券 | 2.0000 | 790 | 590 | 107,803 | 2054/01/15 |
| NETHERLANDS 3.25 01/15/44 | 国債証券 | 3.2500 | 590 | 590 | 107,795 | 2044/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 1,240 | 1,166 | 212,947 | 2029/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/30 | 国債証券 | 2.5000 | 380 | 383 | 69,995 | 2030/01/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 国債証券 | 0.7500 | 630 | 610 | 111,500 | 2028/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 1,300 | 1,278 | 233,369 | 2027/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 1,160 | 1,087 | 198,450 | 2029/07/15 |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 1,200 | 1,086 | 198,264 | 2030/07/15 |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 1,300 | 1,142 | 208,629 | 2031/07/15 |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/33 | 国債証券 | 2.5000 | 250 | 248 | 45,308 | 2033/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/32 | 国債証券 | 0.5000 | 1,800 | 1,586 | 289,652 | 2032/07/15 |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/34 | 国債証券 | 2.5000 | 1,700 | 1,674 | 305,711 | 2034/07/15 |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/35 | 国債証券 | 2.5000 | 900 | 879 | 160,483 | 2035/07/15 |
| 小計 | － | － | 22,397 | 20,287 | 3,703,529 | － |
| **(ユーロ…ベルギー)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BELGIUM 5.5 03/28/28 | 国債証券 | 5.5000 | 1,600 | 1,710 | 312,160 | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41 | 国債証券 | 4.2500 | 880 | 943 | 172,292 | 2041/03/28 |

| 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 | |
| **(ユーロ…ベルギー)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BELGIUM 4.0 03/28/32 | 国債証券 | 4.0000 | 1,140 | 1,226 | 223,983 | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35 | 国債証券 | 5.0000 | 270 | 311 | 56,842 | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33 | 国債証券 | 1.2500 | 1,260 | 1,137 | 207,661 | 2033/04/22 |
| BELGIUM 2.75 04/22/39 | 国債証券 | 2.7500 | 320 | 295 | 53,987 | 2039/04/22 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45 | 国債証券 | 3.7500 | 640 | 632 | 115,432 | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47 | 国債証券 | 1.6000 | 920 | 612 | 111,730 | 2047/06/22 |
| BELGIUM 1.7 06/22/50 | 国債証券 | 1.7000 | 1,020 | 654 | 119,449 | 2050/06/22 |
| BELGIUM 1.4 06/22/53 | 国債証券 | 1.4000 | 1,540 | 861 | 157,354 | 2053/06/22 |
| BELGIUM 3.3 06/22/54 | 国債証券 | 3.3000 | 620 | 535 | 97,835 | 2054/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57 | 国債証券 | 2.2500 | 390 | 259 | 47,355 | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66 | 国債証券 | 2.1500 | 450 | 272 | 49,748 | 2066/06/22 |
| BELGIUM 0.65 06/22/71 | 国債証券 | 0.6500 | 470 | 146 | 26,805 | 2071/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31 | 国債証券 | 1.0000 | 1,440 | 1,330 | 242,820 | 2031/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28 | 国債証券 | 0.8000 | 940 | 907 | 165,745 | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.4 06/22/40 | 国債証券 | 0.4000 | 681 | 438 | 79,965 | 2040/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29 | 国債証券 | 0.9000 | 1,240 | 1,186 | 216,635 | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34 | 国債証券 | 3.0000 | 1,180 | 1,184 | 216,260 | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38 | 国債証券 | 1.9000 | 400 | 339 | 61,951 | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27 | 国債証券 | 0.8000 | 260 | 255 | 46,731 | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37 | 国債証券 | 1.4500 | 460 | 379 | 69,260 | 2037/06/22 |
| BELGIUM 3.45 06/22/43 | 国債証券 | 3.4500 | 640 | 615 | 112,325 | 2043/06/22 |
| BELGIUM 0.1 06/22/30 | 国債証券 | 0.1000 | 1,600 | 1,449 | 264,639 | 2030/06/22 |
| BELGIUM 3.45 06/22/42 | 国債証券 | 3.4500 | 560 | 542 | 98,943 | 2042/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/33 | 国債証券 | 3.0000 | 800 | 809 | 147,708 | 2033/06/22 |
| BELGIUM 3.4 06/22/36 | 国債証券 | 3.4000 | 700 | 711 | 129,834 | 2036/06/22 |
| BELGIUM 0.35 06/22/32 | 国債証券 | 0.3500 | 1,050 | 908 | 165,772 | 2032/06/22 |
| BELGIUM 3.1 06/22/35 | 国債証券 | 3.1000 | 600 | 600 | 109,565 | 2035/06/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/31 | 国債証券 | 0.0000 | 740 | 640 | 116,886 | 2031/10/22 |
| BELGIUM 2.85 10/22/34 | 国債証券 | 2.8500 | 1,320 | 1,304 | 238,094 | 2034/10/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/27 | 国債証券 | 0.0000 | 1,030 | 996 | 181,886 | 2027/10/22 |
| BELGIUM 2.6 10/22/30 | 国債証券 | 2.6000 | 500 | 502 | 91,808 | 2030/10/22 |
| BELGIUM 2.7 10/22/29 | 国債証券 | 2.7000 | 850 | 861 | 157,189 | 2029/10/22 |
| 小計 | － | － | 28,511 | 25,563 | 4,666,666 | － |
| **(ユーロ…フランス)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FRANCE OAT 2.7 02/25/31 | 国債証券 | 2.7000 | 4,200 | 4,219 | 770,266 | 2031/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/27 | 国債証券 | 0.0000 | 700 | 685 | 125,180 | 2027/02/25 |
| FRANCE OAT 0.75 02/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 5,680 | 5,525 | 1,008,624 | 2028/02/25 |
| FRANCE OAT 2.75 02/25/29 | 国債証券 | 2.7500 | 3,710 | 3,758 | 686,059 | 2029/02/25 |
| FRANCE OAT 2.75 02/25/30 | 国債証券 | 2.7500 | 4,300 | 4,348 | 793,818 | 2030/02/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41 | 国債証券 | 4.5000 | 1,190 | 1,298 | 236,960 | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55 | 国債証券 | 4.0000 | 1,530 | 1,476 | 269,469 | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60 | 国債証券 | 4.0000 | 2,060 | 1,960 | 357,818 | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29 | 国債証券 | 5.5000 | 3,500 | 3,836 | 700,329 | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 2,968 | 3,332 | 608,289 | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 996 | 906 | 165,426 | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48 | 国債証券 | 2.0000 | 1,950 | 1,366 | 249,474 | 2048/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/50 | 国債証券 | 1.5000 | 2,620 | 1,575 | 287,647 | 2050/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52 | 国債証券 | 0.7500 | 1,000 | 458 | 83,721 | 2052/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/53 | 国債証券 | 0.7500 | 1,156 | 514 | 93,911 | 2053/05/25 |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/54 | 国債証券 | 3.0000 | 1,550 | 1,240 | 226,448 | 2054/05/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/55 | 国債証券 | 3.2500 | 1,300 | 1,086 | 198,403 | 2055/05/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(ユーロ…フランス)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FRANCE OAT 3.75 05/25/56 | 国債証券 | 3.7500 | 1,600 | 1,462 | 267,006 | 2056/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66 | 国債証券 | 1.7500 | 2,240 | 1,171 | 213,944 | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72 | 国債証券 | 0.5000 | 1,790 | 481 | 87,979 | 2072/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30 | 国債証券 | 2.5000 | 3,650 | 3,654 | 667,114 | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 4,690 | 4,543 | 829,451 | 2028/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31 | 国債証券 | 1.5000 | 4,280 | 4,046 | 738,665 | 2031/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29 | 国債証券 | 0.5000 | 3,590 | 3,386 | 618,237 | 2029/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34 | 国債証券 | 1.2500 | 2,010 | 1,742 | 318,157 | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27 | 国債証券 | 1.0000 | 860 | 848 | 154,918 | 2027/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40 | 国債証券 | 0.5000 | 1,550 | 1,004 | 183,424 | 2040/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36 | 国債証券 | 1.2500 | 3,590 | 2,943 | 537,259 | 2036/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/38 | 国債証券 | 1.2500 | 3,700 | 2,859 | 521,976 | 2038/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/43 | 国債証券 | 2.5000 | 2,150 | 1,784 | 325,835 | 2043/05/25 |
| FRANCE OAT 3.6 05/25/42 | 国債証券 | 3.6000 | 1,300 | 1,266 | 231,168 | 2042/05/25 |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/33 | 国債証券 | 3.0000 | 3,400 | 3,412 | 622,962 | 2033/05/25 |
| FRANCE OAT 3.2 05/25/35 | 国債証券 | 3.2000 | 2,600 | 2,597 | 474,131 | 2035/05/25 |
| FRANCE OAT 0.0 05/25/32 | 国債証券 | 0.0000 | 3,590 | 3,021 | 551,611 | 2032/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39 | 国債証券 | 1.7500 | 3,050 | 2,455 | 448,278 | 2039/06/25 |
| FRANCE OAT 0.5 06/25/44 | 国債証券 | 0.5000 | 3,990 | 2,230 | 407,107 | 2044/06/25 |
| FRANCE OAT 3.0 06/25/49 | 国債証券 | 3.0000 | 500 | 419 | 76,657 | 2049/06/25 |
| FRANCE OAT 2.5 09/24/27 | 国債証券 | 2.5000 | 4,300 | 4,325 | 789,569 | 2027/09/24 |
| FRANCE OAT 2.4 09/24/28 | 国債証券 | 2.4000 | 1,500 | 1,505 | 274,906 | 2028/09/24 |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27 | 国債証券 | 2.7500 | 4,840 | 4,889 | 892,589 | 2027/10/25 |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38 | 国債証券 | 4.0000 | 1,340 | 1,402 | 256,003 | 2038/10/25 |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32 | 国債証券 | 5.7500 | 3,110 | 3,656 | 667,426 | 2032/10/25 |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 4,000 | 3,840 | 701,138 | 2028/11/25 |
| FRANCE OAT 3.5 11/25/35 | 国債証券 | 3.5000 | 600 | 610 | 111,501 | 2035/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31 | 国債証券 | 0.0000 | 1,870 | 1,603 | 292,755 | 2031/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30 | 国債証券 | 0.0000 | 3,980 | 3,531 | 644,631 | 2030/11/25 |
| FRANCE OAT 2.0 11/25/32 | 国債証券 | 2.0000 | 2,650 | 2,510 | 458,295 | 2032/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29 | 国債証券 | 0.0000 | 3,610 | 3,302 | 602,866 | 2029/11/25 |
| FRANCE OAT 3.5 11/25/33 | 国債証券 | 3.5000 | 4,300 | 4,441 | 810,778 | 2033/11/25 |
| FRANCE OAT 3.0 11/25/34 | 国債証券 | 3.0000 | 3,200 | 3,163 | 577,473 | 2034/11/25 |
| 小計 | － | － | 133,840 | 121,707 | 22,217,679 | － |
| **(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 | 2,140 | 2,279 | 416,104 | 2028/01/04 |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30 | 国債証券 | 6.2500 | 1,640 | 1,883 | 343,906 | 2030/01/04 |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 | 国債証券 | 5.5000 | 1,720 | 1,970 | 359,805 | 2031/01/04 |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37 | 国債証券 | 4.0000 | 1,230 | 1,368 | 249,899 | 2037/01/04 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 1,630 | 1,545 | 282,052 | 2029/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 2,120 | 2,058 | 375,864 | 2028/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 | 国債証券 | 0.2500 | 470 | 462 | 84,361 | 2027/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34 | 国債証券 | 2.2000 | 1,500 | 1,460 | 266,628 | 2034/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.9 02/15/36 | 国債証券 | 2.9000 | 2,352 | 2,389 | 436,205 | 2036/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 1,340 | 1,198 | 218,846 | 2031/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35 | 国債証券 | 2.5000 | 1,000 | 988 | 180,532 | 2035/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.5 02/15/35 | 国債証券 | 2.5000 | 2,300 | 2,276 | 415,552 | 2035/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 | 国債証券 | 2.3000 | 3,150 | 3,114 | 568,632 | 2033/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32 | 国債証券 | 0.0000 | 2,150 | 1,869 | 341,280 | 2032/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 2,020 | 1,853 | 338,384 | 2030/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33 | 国債証券 | 2.3000 | 1,927 | 1,906 | 347,974 | 2033/02/15 |

| 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 | |
| **(ユーロ…ドイツ)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| BUNDESOBL 2.2 04/13/28 | 国債証券 | 2.2000 | 2,200 | 2,207 | 402,943 | 2028/04/13 |
| BUNDESOBL 0.0 04/16/27 | 国債証券 | 0.0000 | 460 | 449 | 82,120 | 2027/04/16 |
| BUNDESOBL 2.1 04/12/29 | 国債証券 | 2.1000 | 1,300 | 1,299 | 237,139 | 2029/04/12 |
| BUNDESOBL 2.4 04/18/30 | 国債証券 | 2.4000 | 1,900 | 1,913 | 349,227 | 2030/04/18 |
| BUNDESOBL 2.1 04/12/29 | 国債証券 | 2.1000 | 1,200 | 1,199 | 218,957 | 2029/04/12 |
| DEUTSCHLAND 2.6 05/15/41 | 国債証券 | 2.6000 | 1,000 | 940 | 171,680 | 2041/05/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35 | 国債証券 | 0.0000 | 1,060 | 830 | 151,568 | 2035/05/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38 | 国債証券 | 1.0000 | 2,160 | 1,736 | 316,940 | 2038/05/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36 | 国債証券 | 0.0000 | 2,441 | 1,845 | 336,828 | 2036/05/15 |
| BUNDESSCHAT 1.7 06/10/27 | 国債証券 | 1.7000 | 1,457 | 1,451 | 264,924 | 2027/06/10 |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27 | 国債証券 | 6.5000 | 1,250 | 1,324 | 241,798 | 2027/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,055 | 1,120 | 204,511 | 2028/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,080 | 1,231 | 224,828 | 2039/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 1,480 | 1,502 | 274,194 | 2042/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44 | 国債証券 | 2.5000 | 2,320 | 2,095 | 382,443 | 2044/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 1,610 | 1,931 | 352,557 | 2040/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 1,320 | 1,534 | 280,180 | 2034/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46 | 国債証券 | 2.5000 | 2,240 | 1,988 | 363,075 | 2046/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52 | 国債証券 | 0.0000 | 1,927 | 796 | 145,342 | 2052/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53 | 国債証券 | 1.8000 | 2,367 | 1,703 | 310,992 | 2053/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 2,420 | 1,632 | 297,947 | 2048/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53 | 国債証券 | 1.8000 | 900 | 649 | 118,591 | 2053/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 3,110 | 3,043 | 555,612 | 2027/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54 | 国債証券 | 2.5000 | 1,860 | 1,563 | 285,416 | 2054/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.9 08/15/56 | 国債証券 | 2.9000 | 800 | 726 | 132,588 | 2056/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 57 | 54 | 9,963 | 2028/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/29 | 国債証券 | 0.0000 | 2,390 | 2,221 | 405,620 | 2029/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.6 08/15/35 | 国債証券 | 2.6000 | 602 | 598 | 109,186 | 2035/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 国債証券 | 0.0000 | 2,540 | 1,125 | 205,538 | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32 | 国債証券 | 1.7000 | 1,980 | 1,896 | 346,224 | 2032/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 50 | 44 | 8,050 | 2031/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50 | 国債証券 | 0.0000 | 1,140 | 507 | 92,665 | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33 | 国債証券 | 2.6000 | 500 | 502 | 91,748 | 2033/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 2,230 | 2,021 | 369,097 | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.6 08/15/34 | 国債証券 | 2.6000 | 1,100 | 1,099 | 200,722 | 2034/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 1,390 | 1,260 | 230,133 | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 2,100 | 1,853 | 338,413 | 2031/08/15 |
| BUNDESOBL 2.4 10/19/28 | 国債証券 | 2.4000 | 2,000 | 2,016 | 368,108 | 2028/10/19 |
| BUNDESOBL 1.3 10/15/27 | 国債証券 | 1.3000 | 2,580 | 2,551 | 465,769 | 2027/10/15 |
| BUNDESOBL 1.3 10/15/27 | 国債証券 | 1.3000 | 2,050 | 2,027 | 370,185 | 2027/10/15 |
| BUNDESOBL 2.2 10/10/30 | 国債証券 | 2.2000 | 800 | 797 | 145,603 | 2030/10/10 |
| BUNDESOBL 2.5 10/11/29 | 国債証券 | 2.5000 | 1,500 | 1,517 | 276,946 | 2029/10/11 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27 | 国債証券 | 0.0000 | 1,620 | 1,566 | 285,924 | 2027/11/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28 | 国債証券 | 0.0000 | 852 | 806 | 147,228 | 2028/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30 | 国債証券 | 2.4000 | 2,100 | 2,111 | 385,543 | 2030/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.5 11/15/32 | 国債証券 | 2.5000 | 1,600 | 1,603 | 292,763 | 2032/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29 | 国債証券 | 2.1000 | 1,700 | 1,695 | 309,462 | 2029/11/15 |
| BUNDESSCHAT 2.0 12/16/27 | 国債証券 | 2.0000 | 300 | 299 | 54,734 | 2027/12/16 |
| 小計 | － | － | 102,787 | 95,524 | 17,438,083 | － |
| **(ユーロ…ポルトガル)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| PORTUGUESE 4.1 02/15/45 | 国債証券 | 4.1000 | 400 | 426 | 77,941 | 2045/02/15 |

| 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 | |
| **(ユーロ…ポルトガル)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| PORTUGUESE 3.875 02/15/30 | 国債証券 | 3.8750 | 98 | 103 | 18,976 | 2030/02/15 |
| PORTUGUESE 4.1 04/15/37 | 国債証券 | 4.1000 | 2,300 | 2,512 | 458,685 | 2037/04/15 |
| PORTUGUESE 1.15 04/11/42 | 国債証券 | 1.1500 | 600 | 428 | 78,215 | 2042/04/11 |
| PORTUGUESE 1.0 04/12/52 | 国債証券 | 1.0000 | 400 | 218 | 39,969 | 2052/04/12 |
| PORTUGUESE 2.25 04/18/34 | 国債証券 | 2.2500 | 2,000 | 1,920 | 350,518 | 2034/04/18 |
| PORTUGUESE 4.125 04/14/27 | 国債証券 | 4.1250 | 900 | 921 | 168,199 | 2027/04/14 |
| PORTUGUESE 1.95 06/15/29 | 国債証券 | 1.9500 | 300 | 297 | 54,343 | 2029/06/15 |
| PORTUGUESE 3.375 06/15/40 | 国債証券 | 3.3750 | 400 | 399 | 72,914 | 2040/06/15 |
| PORTUGUESE 3.625 06/12/54 | 国債証券 | 3.6250 | 50 | 48 | 8,790 | 2054/06/12 |
| PORTUGUESE 0.3 10/17/31 | 国債証券 | 0.3000 | 900 | 798 | 145,709 | 2031/10/17 |
| PORTUGUESE 2.125 10/17/28 | 国債証券 | 2.1250 | 1,900 | 1,902 | 347,387 | 2028/10/17 |
| 小計 | － | － | 10,248 | 9,978 | 1,821,651 | － |
| **(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 | 1,960 | 2,170 | 396,206 | 2029/01/31 |
| SPAIN 4.2 01/31/37 | 国債証券 | 4.2000 | 1,360 | 1,484 | 270,951 | 2037/01/31 |
| SPAIN 3.5 01/31/41 | 国債証券 | 3.5000 | 800 | 796 | 145,458 | 2041/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/28 | 国債証券 | 0.0000 | 2,880 | 2,767 | 505,239 | 2028/01/31 |
| SPAIN 2.7 01/31/30 | 国債証券 | 2.7000 | 1,300 | 1,315 | 240,198 | 2030/01/31 |
| SPAIN 1.5 04/30/27 | 国債証券 | 1.5000 | 2,060 | 2,046 | 373,589 | 2027/04/30 |
| SPAIN 1.4 04/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 1,470 | 1,448 | 264,373 | 2028/04/30 |
| SPAIN 1.45 04/30/29 | 国債証券 | 1.4500 | 1,150 | 1,122 | 204,969 | 2029/04/30 |
| SPAIN 0.7 04/30/32 | 国債証券 | 0.7000 | 2,150 | 1,914 | 349,534 | 2032/04/30 |
| SPAIN 3.15 04/30/33 | 国債証券 | 3.1500 | 1,676 | 1,715 | 313,219 | 2033/04/30 |
| SPAIN 3.3 04/30/36 | 国債証券 | 3.3000 | 700 | 710 | 129,735 | 2036/04/30 |
| SPAIN 0.5 04/30/30 | 国債証券 | 0.5000 | 2,700 | 2,501 | 456,668 | 2030/04/30 |
| SPAIN 3.25 04/30/34 | 国債証券 | 3.2500 | 1,020 | 1,044 | 190,666 | 2034/04/30 |
| SPAIN 3.15 04/30/35 | 国債証券 | 3.1500 | 1,800 | 1,818 | 331,951 | 2035/04/30 |
| SPAIN 3.5 05/31/29 | 国債証券 | 3.5000 | 2,600 | 2,700 | 492,925 | 2029/05/31 |
| SPAIN 2.5 05/31/27 | 国債証券 | 2.5000 | 400 | 402 | 73,401 | 2027/05/31 |
| SPAIN 2.4 05/31/28 | 国債証券 | 2.4000 | 1,500 | 1,507 | 275,276 | 2028/05/31 |
| SPAIN 4.9 07/30/40 | 国債証券 | 4.9000 | 1,910 | 2,214 | 404,318 | 2040/07/30 |
| SPAIN 4.7 07/30/41 | 国債証券 | 4.7000 | 1,080 | 1,229 | 224,461 | 2041/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/66 | 国債証券 | 3.4500 | 1,120 | 996 | 181,974 | 2066/07/30 |
| SPAIN 1.95 07/30/30 | 国債証券 | 1.9500 | 1,070 | 1,050 | 191,729 | 2030/07/30 |
| SPAIN 5.75 07/30/32 | 国債証券 | 5.7500 | 2,135 | 2,522 | 460,422 | 2032/07/30 |
| SPAIN 2.35 07/30/33 | 国債証券 | 2.3500 | 2,070 | 2,006 | 366,277 | 2033/07/30 |
| SPAIN 3.45 07/30/43 | 国債証券 | 3.4500 | 1,440 | 1,404 | 256,319 | 2043/07/30 |
| SPAIN 1.4 07/30/28 | 国債証券 | 1.4000 | 1,470 | 1,442 | 263,410 | 2028/07/30 |
| SPAIN 1.85 07/30/35 | 国債証券 | 1.8500 | 2,091 | 1,890 | 345,154 | 2035/07/30 |
| SPAIN 0.85 07/30/37 | 国債証券 | 0.8500 | 1,600 | 1,233 | 225,190 | 2037/07/30 |
| SPAIN 3.9 07/30/39 | 国債証券 | 3.9000 | 260 | 273 | 49,894 | 2039/07/30 |
| SPAIN 1.0 07/30/42 | 国債証券 | 1.0000 | 1,640 | 1,117 | 203,939 | 2042/07/30 |
| SPAIN 0.8 07/30/27 | 国債証券 | 0.8000 | 2,400 | 2,355 | 430,071 | 2027/07/30 |
| SPAIN 3.1 07/30/31 | 国債証券 | 3.1000 | 2,000 | 2,054 | 375,001 | 2031/07/30 |
| SPAIN 0.8 07/30/29 | 国債証券 | 0.8000 | 1,700 | 1,613 | 294,632 | 2029/07/30 |
| SPAIN 5.15 10/31/28 | 国債証券 | 5.1500 | 1,660 | 1,786 | 326,063 | 2028/10/31 |
| SPAIN 5.15 10/31/44 | 国債証券 | 5.1500 | 1,110 | 1,332 | 243,249 | 2044/10/31 |
| SPAIN 2.9 10/31/46 | 国債証券 | 2.9000 | 1,600 | 1,409 | 257,245 | 2046/10/31 |
| SPAIN 2.7 10/31/48 | 国債証券 | 2.7000 | 1,160 | 969 | 177,055 | 2048/10/31 |
| SPAIN 1.9 10/31/52 | 国債証券 | 1.9000 | 470 | 316 | 57,700 | 2052/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/71 | 国債証券 | 1.4500 | 660 | 316 | 57,692 | 2071/10/31 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| **(ユーロ…スペイン)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| SPAIN 1.0 10/31/50 | 国債証券 | 1.0000 | 1,499 | 825 | 150,649 | 2050/10/31 |
| SPAIN 4.0 10/31/54 | 国債証券 | 4.0000 | 900 | 908 | 165,935 | 2054/10/31 |
| SPAIN 1.45 10/31/27 | 国債証券 | 1.4500 | 842 | 833 | 152,177 | 2027/10/31 |
| SPAIN 0.6 10/31/29 | 国債証券 | 0.6000 | 1,830 | 1,721 | 314,172 | 2029/10/31 |
| SPAIN 0.5 10/31/31 | 国債証券 | 0.5000 | 2,340 | 2,086 | 380,980 | 2031/10/31 |
| SPAIN 2.55 10/31/32 | 国債証券 | 2.5500 | 1,720 | 1,703 | 310,985 | 2032/10/31 |
| SPAIN 3.45 10/31/34 | 国債証券 | 3.4500 | 2,150 | 2,228 | 406,830 | 2034/10/31 |
| SPAIN 1.2 10/31/40 | 国債証券 | 1.2000 | 1,420 | 1,048 | 191,461 | 2040/10/31 |
| SPAIN 1.25 10/31/30 | 国債証券 | 1.2500 | 2,000 | 1,893 | 345,640 | 2030/10/31 |
| SPAIN 3.55 10/31/33 | 国債証券 | 3.5500 | 1,620 | 1,696 | 309,719 | 2033/10/31 |
| SPAIN 3.2 10/31/35 | 国債証券 | 3.2000 | 1,000 | 1,010 | 184,412 | 2035/10/31 |
| 小計 | － | － | 75,493 | 72,961 | 13,319,135 | － |
| **(ユーロ…イタリア)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ITALY BTPS 2.35 01/15/29 | 国債証券 | 2.3500 | 200 | 200 | 36,561 | 2029/01/15 |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券 | 5.7500 | 1,860 | 2,191 | 400,015 | 2033/02/01 |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37 | 国債証券 | 4.0000 | 1,240 | 1,314 | 239,875 | 2037/02/01 |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28 | 国債証券 | 2.0000 | 960 | 958 | 174,901 | 2028/02/01 |
| ITALY BTPS 3.85 02/01/35 | 国債証券 | 3.8500 | 1,000 | 1,052 | 192,115 | 2035/02/01 |
| ITALY BTPS 3.45 02/01/36 | 国債証券 | 3.4500 | 500 | 506 | 92,470 | 2036/02/01 |
| ITALY BTPS 3.5 02/15/31 | 国債証券 | 3.5000 | 1,400 | 1,456 | 265,895 | 2031/02/15 |
| ITALY BTPS 2.85 02/01/31 | 国債証券 | 2.8500 | 300 | 303 | 55,340 | 2031/02/01 |
| ITALY BTPS 0.45 02/15/29 | 国債証券 | 0.4500 | 1,900 | 1,800 | 328,635 | 2029/02/15 |
| ITALY BTPS 2.95 02/15/27 | 国債証券 | 2.9500 | 453 | 456 | 83,386 | 2027/02/15 |
| ITALY BTPS 4.1 02/01/29 | 国債証券 | 4.1000 | 800 | 840 | 153,458 | 2029/02/01 |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47 | 国債証券 | 2.7000 | 550 | 449 | 82,129 | 2047/03/01 |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 1,140 | 1,047 | 191,170 | 2048/03/01 |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67 | 国債証券 | 2.8000 | 500 | 367 | 67,004 | 2067/03/01 |
| ITALY BTPS 2.15 03/01/72 | 国債証券 | 2.1500 | 860 | 526 | 96,032 | 2072/03/01 |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 1,990 | 1,868 | 341,047 | 2032/03/01 |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40 | 国債証券 | 3.1000 | 1,560 | 1,468 | 268,100 | 2040/03/01 |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 2,020 | 2,051 | 374,532 | 2035/03/01 |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30 | 国債証券 | 3.5000 | 2,300 | 2,393 | 436,920 | 2030/03/01 |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 923 | 778 | 142,174 | 2036/03/01 |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41 | 国債証券 | 1.8000 | 1,150 | 895 | 163,495 | 2041/03/01 |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 国債証券 | 0.9500 | 2,986 | 2,318 | 423,156 | 2037/03/01 |
| ITALY BTPS 4.2 03/01/34 | 国債証券 | 4.2000 | 1,720 | 1,858 | 339,293 | 2034/03/01 |
| ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,460 | 1,405 | 256,528 | 2028/03/15 |
| ITALY BTPS 4.0 04/30/35 | 国債証券 | 4.0000 | 1,400 | 1,492 | 272,386 | 2035/04/30 |
| ITALY BTPS 1.5 04/30/45 | 国債証券 | 1.5000 | 1,210 | 817 | 149,296 | 2045/04/30 |
| ITALY BTPS 4.1 04/30/46 | 国債証券 | 4.1000 | 1,000 | 1,019 | 186,182 | 2046/04/30 |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 1,850 | 1,771 | 323,336 | 2030/04/01 |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31 | 国債証券 | 0.9000 | 1,510 | 1,386 | 253,144 | 2031/04/01 |
| ITALY BTPS 3.4 04/01/28 | 国債証券 | 3.4000 | 2,050 | 2,101 | 383,583 | 2028/04/01 |
| ITALY BTPS 1.1 04/01/27 | 国債証券 | 1.1000 | 1,900 | 1,880 | 343,230 | 2027/04/01 |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31 | 国債証券 | 6.0000 | 1,560 | 1,814 | 331,253 | 2031/05/01 |
| ITALY BTPS 4.4 05/01/33 | 国債証券 | 4.4000 | 1,800 | 1,970 | 359,641 | 2033/05/01 |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27 | 国債証券 | 2.2000 | 2,590 | 2,595 | 473,797 | 2027/06/01 |
| ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 国債証券 | 0.9500 | 900 | 804 | 146,929 | 2032/06/01 |
| ITALY BTPS 2.8 06/15/29 | 国債証券 | 2.8000 | 1,800 | 1,827 | 333,518 | 2029/06/15 |
| ITALY BTPS 3.7 06/15/30 | 国債証券 | 3.7000 | 1,700 | 1,782 | 325,324 | 2030/06/15 |
| ITALY BTPS 3.85 07/01/34 | 国債証券 | 3.8500 | 1,280 | 1,349 | 246,398 | 2034/07/01 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 種類 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…イタリア) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ITALY BTPS 3.45 07/15/31 | 国債証券 | 3.4500 | 1,600 | 1,660 | 303,208 | 2031/07/15 |
| ITALY BTPS 3.25 07/15/32 | 国債証券 | 3.2500 | 1,600 | 1,637 | 298,943 | 2032/07/15 |
| ITALY BTPS 2.95 07/01/30 | 国債証券 | 2.9500 | 1,200 | 1,220 | 222,849 | 2030/07/01 |
| ITALY BTPS 3.35 07/01/29 | 国債証券 | 3.3500 | 1,400 | 1,443 | 263,594 | 2029/07/01 |
| ITALY BTPS 3.45 07/15/27 | 国債証券 | 3.4500 | 1,200 | 1,221 | 223,046 | 2027/07/15 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34 | 国債証券 | 5.0000 | 860 | 980 | 179,034 | 2034/08/01 |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39 | 国債証券 | 5.0000 | 1,590 | 1,831 | 334,315 | 2039/08/01 |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 1,700 | 1,699 | 310,319 | 2027/08/01 |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29 | 国債証券 | 3.0000 | 1,710 | 1,747 | 318,946 | 2029/08/01 |
| ITALY BTPS 3.65 08/01/35 | 国債証券 | 3.6500 | 1,900 | 1,963 | 358,429 | 2035/08/01 |
| ITALY BTPS 0.6 08/01/31 | 国債証券 | 0.6000 | 1,520 | 1,361 | 248,574 | 2031/08/01 |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 国債証券 | 0.9500 | 1,350 | 1,262 | 230,423 | 2030/08/01 |
| ITALY BTPS 3.8 08/01/28 | 国債証券 | 3.8000 | 300 | 311 | 56,813 | 2028/08/01 |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 720 | 675 | 123,273 | 2038/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 1,460 | 1,629 | 297,493 | 2044/09/01 |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 1,380 | 1,241 | 226,567 | 2046/09/01 |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,480 | 1,570 | 286,782 | 2028/09/01 |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40 | 国債証券 | 5.0000 | 1,050 | 1,208 | 220,620 | 2040/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 1,180 | 882 | 161,147 | 2050/09/01 |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51 | 国債証券 | 1.7000 | 1,170 | 725 | 132,482 | 2051/09/01 |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 980 | 946 | 172,782 | 2033/09/01 |
| ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 国債証券 | 2.1500 | 1,060 | 722 | 131,969 | 2052/09/01 |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 750 | 679 | 123,960 | 2036/09/01 |
| ITALY BTPS 4.45 09/01/43 | 国債証券 | 4.4500 | 700 | 752 | 137,330 | 2043/09/01 |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 国債証券 | 0.9500 | 1,880 | 1,848 | 337,394 | 2027/09/15 |
| ITALY BTPS 4.5 10/01/53 | 国債証券 | 4.5000 | 1,270 | 1,337 | 244,125 | 2053/10/01 |
| ITALY BTPS 4.3 10/01/54 | 国債証券 | 4.3000 | 900 | 916 | 167,252 | 2054/10/01 |
| ITALY BTPS 4.0 10/30/31 | 国債証券 | 4.0000 | 1,400 | 1,496 | 273,102 | 2031/10/30 |
| ITALY BTPS 4.05 10/30/37 | 国債証券 | 4.0500 | 900 | 952 | 173,906 | 2037/10/30 |
| ITALY BTPS 4.15 10/01/39 | 国債証券 | 4.1500 | 1,260 | 1,330 | 242,893 | 2039/10/01 |
| ITALY BTPS 3.85 10/01/40 | 国債証券 | 3.8500 | 1,600 | 1,626 | 296,928 | 2040/10/01 |
| ITALY BTPS 3.6 10/01/35 | 国債証券 | 3.6000 | 2,000 | 2,056 | 375,395 | 2035/10/01 |
| ITALY BTPS 2.7 10/01/30 | 国債証券 | 2.7000 | 600 | 603 | 110,165 | 2030/10/01 |
| ITALY BTPS 2.7 10/15/27 | 国債証券 | 2.7000 | 1,500 | 1,513 | 276,344 | 2027/10/15 |
| ITALY BTPS 3.0 10/01/29 | 国債証券 | 3.0000 | 1,000 | 1,020 | 186,201 | 2029/10/01 |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27 | 国債証券 | 6.5000 | 2,010 | 2,154 | 393,344 | 2027/11/01 |
| ITALY BTPS 4.35 11/01/33 | 国債証券 | 4.3500 | 1,400 | 1,527 | 278,826 | 2033/11/01 |
| ITALY BTPS 4.0 11/15/30 | 国債証券 | 4.0000 | 1,000 | 1,062 | 193,959 | 2030/11/15 |
| ITALY BTPS 3.25 11/15/32 | 国債証券 | 3.2500 | 1,800 | 1,838 | 335,588 | 2032/11/15 |
| ITALY BTPS 3.15 11/15/31 | 国債証券 | 3.1500 | 1,400 | 1,430 | 261,141 | 2031/11/15 |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28 | 国債証券 | 2.8000 | 1,940 | 1,970 | 359,683 | 2028/12/01 |
| ITALY BTPS 0.95 12/01/31 | 国債証券 | 0.9500 | 2,000 | 1,811 | 330,768 | 2031/12/01 |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 国債証券 | 1.6500 | 940 | 901 | 164,573 | 2030/12/01 |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/32 | 国債証券 | 2.5000 | 800 | 782 | 142,797 | 2032/12/01 |
| ITALY BTPS 3.85 12/15/29 | 国債証券 | 3.8500 | 2,300 | 2,418 | 441,488 | 2029/12/15 |
| ITALY BTPS 2.65 12/01/27 | 国債証券 | 2.6500 | 1,520 | 1,533 | 280,028 | 2027/12/01 |
| 小計 | － | － | 113,602 | 112,632 | 20,561,089 | － |
| (ユーロ…フィンランド) | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FINLAND 0.125 04/15/52 | 国債証券 | 0.1250 | 660 | 268 | 48,966 | 2052/04/15 |
| FINLAND 0.75 04/15/31 | 国債証券 | 0.7500 | 700 | 642 | 117,208 | 2031/04/15 |
| FINLAND 1.375 04/15/47 | 国債証券 | 1.3750 | 280 | 187 | 34,271 | 2047/04/15 |

| 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 | |
| **(ユーロ…フィンランド)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| FINLAND 2.75 04/15/38 | 国債証券 | 2.7500 | 370 | 353 | 64,519 | 2038/04/15 |
| FINLAND 2.95 04/15/55 | 国債証券 | 2.9500 | 91 | 77 | 14,191 | 2055/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/43 | 国債証券 | 0.5000 | 380 | 233 | 42,675 | 2043/04/15 |
| FINLAND 0.125 04/15/36 | 国債証券 | 0.1250 | 816 | 609 | 111,193 | 2036/04/15 |
| FINLAND 3.2 04/15/45 | 国債証券 | 3.2000 | 200 | 190 | 34,772 | 2045/04/15 |
| FINLAND 2.875 04/15/29 | 国債証券 | 2.8750 | 400 | 407 | 74,403 | 2029/04/15 |
| FINLAND 2.75 07/04/28 | 国債証券 | 2.7500 | 320 | 325 | 59,339 | 2028/07/04 |
| FINLAND 2.625 07/04/42 | 国債証券 | 2.6250 | 400 | 359 | 65,680 | 2042/07/04 |
| FINLAND 0.5 09/15/29 | 国債証券 | 0.5000 | 715 | 671 | 122,653 | 2029/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/28 | 国債証券 | 0.5000 | 650 | 623 | 113,828 | 2028/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/27 | 国債証券 | 0.5000 | 400 | 390 | 71,302 | 2027/09/15 |
| FINLAND 0.25 09/15/40 | 国債証券 | 0.2500 | 290 | 186 | 34,029 | 2040/09/15 |
| FINLAND 3.0 09/15/33 | 国債証券 | 3.0000 | 1,100 | 1,118 | 204,196 | 2033/09/15 |
| FINLAND 1.5 09/15/32 | 国債証券 | 1.5000 | 750 | 698 | 127,513 | 2032/09/15 |
| FINLAND 0.125 09/15/31 | 国債証券 | 0.1250 | 1,100 | 963 | 175,935 | 2031/09/15 |
| FINLAND 3.0 09/15/35 | 国債証券 | 3.0000 | 400 | 401 | 73,209 | 2035/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/30 | 国債証券 | 0.0000 | 110 | 98 | 18,010 | 2030/09/15 |
| 小計 | － | － | 10,132 | 8,808 | 1,607,900 | － |
| **(ユーロ…オーストリア)** | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| AUSTRIA 3.8 01/26/62 | 国債証券 | 3.8000 | 480 | 489 | 89,351 | 2062/01/26 |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47 | 国債証券 | 1.5000 | 650 | 453 | 82,696 | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29 | 国債証券 | 0.5000 | 1,520 | 1,445 | 263,871 | 2029/02/20 |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,355 | 1,320 | 241,090 | 2028/02/20 |
| AUSTRIA 2.9 02/20/34 | 国債証券 | 2.9000 | 450 | 453 | 82,747 | 2034/02/20 |
| AUSTRIA 3.2 02/20/36 | 国債証券 | 3.2000 | 600 | 609 | 111,183 | 2036/02/20 |
| AUSTRIA 2.95 02/20/35 | 国債証券 | 2.9500 | 200 | 200 | 36,590 | 2035/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/31 | 国債証券 | 0.0000 | 1,360 | 1,204 | 219,815 | 2031/02/20 |
| AUSTRIA 2.9 02/20/33 | 国債証券 | 2.9000 | 1,150 | 1,164 | 212,626 | 2033/02/20 |
| AUSTRIA 0.9 02/20/32 | 国債証券 | 0.9000 | 1,400 | 1,269 | 231,827 | 2032/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/30 | 国債証券 | 0.0000 | 1,280 | 1,166 | 213,022 | 2030/02/20 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 国債証券 | 4.1500 | 1,010 | 1,112 | 203,122 | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51 | 国債証券 | 0.7500 | 590 | 311 | 56,935 | 2051/03/20 |
| AUSTRIA 0.7 04/20/71 | 国債証券 | 0.7000 | 360 | 130 | 23,820 | 2071/04/20 |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27 | 国債証券 | 0.5000 | 390 | 383 | 69,977 | 2027/04/20 |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34 | 国債証券 | 2.4000 | 1,260 | 1,222 | 223,204 | 2034/05/23 |
| AUSTRIA 1.85 05/23/49 | 国債証券 | 1.8500 | 460 | 334 | 61,071 | 2049/05/23 |
| AUSTRIA 2.9 05/23/29 | 国債証券 | 2.9000 | 400 | 408 | 74,557 | 2029/05/23 |
| AUSTRIA 0.85 06/30/20 | 国債証券 | 0.8500 | 310 | 96 | 17,672 | 2120/06/30 |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 | 550 | 525 | 95,942 | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 | 1,115 | 1,178 | 215,163 | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 3.2 07/15/39 | 国債証券 | 3.2000 | 700 | 694 | 126,801 | 2039/07/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17 | 国債証券 | 2.1000 | 390 | 233 | 42,583 | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 2.8 09/20/32 | 国債証券 | 2.8000 | 500 | 503 | 91,996 | 2032/09/20 |
| AUSTRIA 3.15 10/20/53 | 国債証券 | 3.1500 | 420 | 381 | 69,642 | 2053/10/20 |
| AUSTRIA 0.25 10/20/36 | 国債証券 | 0.2500 | 1,060 | 791 | 144,430 | 2036/10/20 |
| AUSTRIA 0.0 10/20/40 | 国債証券 | 0.0000 | 770 | 473 | 86,432 | 2040/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86 | 国債証券 | 1.5000 | 190 | 91 | 16,749 | 2086/11/02 |
| 小計 | － | － | 20,920 | 18,652 | 3,404,927 | － |
| 合計 | － | － | － | － | 304,789,302 | － |

## ■投資信託財産の構成

2026年２月24日現在

| 項目 | 当期末 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 304,789,302 | 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 5,253,773 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 310,043,076 | 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、308,819,613千円、99.6％です。
（注３）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2026年２月24日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝154.86円、１カナダ・ドル＝113.05円、１オーストラリア・ドル＝109.39円、１シンガポール・ドル＝122.29円、１ニュージーランド・ドル＝92.33円、１イギリス・ポンド＝209.01円、１イスラエル・シュケル＝49.593円、１デンマーク・クローネ＝24.44円、１ノルウェー・クローネ＝16.19円、１スウェーデン・クローナ＝17.09円、１メキシコ・ペソ＝8.975円、１オフショア・人民元＝22.479円、１マレーシア・リンギット＝39.828円、１ポーランド・ズロチ＝43.266円、１ユーロ＝182.55円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2026年２月24日)現在

| 項目 | 当期末 |
|---|---|
| **(A) 資産** | **311,220,164,433円** |
| コール・ローン等 | 2,435,595,393 |
| 公社債(評価額) | 304,789,302,340 |
| 未収入金 | 1,178,136,730 |
| 未収利息 | 2,609,823,580 |
| 前払費用 | 207,306,390 |
| **(B) 負債** | **1,577,197,430** |
| 未払金 | 1,554,844,430 |
| 未払解約金 | 22,353,000 |
| **(C) 純資産総額(A－B)** | **309,642,967,003** |
| 元本 | 114,738,216,739 |
| 次期繰越損益金 | 194,904,750,264 |
| **(D) 受益権総口数** | **114,738,216,739口** |
| **１万口当たり基準価額(C／D)** | **26,987円** |

(注１) 期首元本額 114,336,381,954円
追加設定元本額 42,071,866,157円
一部解約元本額 41,670,031,372円

(注２) 期末における元本の内訳

| | |
|---|---|
| ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド | 9,046,169,190円 |
| たわらノーロード 先進国債券 | 26,631,990,027円 |
| たわらノーロード バランス（８資産均等型） | 5,492,161,022円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型） | 76,204,405円 |
| たわらノーロード バランス（標準型） | 554,674,152円 |
| たわらノーロード バランス（積極型） | 162,031,872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） | 16,906,619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） | 929,187,090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） | 1,737,373,824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） | 941,800,283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） | 623,786,001円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（保守型） | 1,765,781円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定型） | 12,405,475円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型） | 146,923,029円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（成長型） | 40,922,803円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（積極型） | 29,274,840円 |
| マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型） | 54,857,394円 |
| マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型） | 12,725,900円 |
| マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型） | 447,717円 |
| ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞ | 6,909,874,885円 |
| Ｏｎｅ ＤＣ 先進国債券インデックスファンド | 4,020,402,297円 |
| Ｏｎｅグローバルバランス | 209,706,897円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型 | 772,521,481円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型 | 2,608,980,983円 |
| ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型 | 3,504,958,590円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣバランス30インデックスファンド | 360,518,765円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣバランス50インデックスファンド | 840,298,768円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣバランス70インデックスファンド | 917,683,100円 |
| マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞ | 22,221,019円 |
| マネックス資産設計ファンド＜育成型＞ | 940,871,130円 |
| マネックス資産設計ファンド　エボリューション | 33,205,553円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10） | 156,797,134円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20） | 176,543,663円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30） | 324,428,213円 |
| クルーズコントロール | 391,119,377円 |
| ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞ | 225,130,824円 |
| ４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞ | 1,389,110,084円 |
| ４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 1,123,327,142円 |
| ９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞ | 174,341,663円 |
| ４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞ | 1,020,799,067円 |
| Ｏｎｅグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞ | 3,981,950円 |
| Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞ | 28,919,129円 |
| Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド | 729,064,021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） | 302,919,829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） | 323,434,226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） | 316,845,344円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドＩＩ2021－04（適格機関投資家限定） | 839,900,055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） | 709,327,344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） | 362,251,956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） | 583,994,066円 |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024－01（適格機関投資家限定） | 883,100,081円 |
| ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け） | 4,897,266,931円 |
| ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け） | 1,322,652,730円 |
| 外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定） | 4,209,924,082円 |
| ＤＩＡＭワールドバランス25ＶＡ（適格機関投資家限定） | 31,227,279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） | 572,574,574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） | 155,988,926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） | 180,239,164円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定） | 9,229,665円 |
| ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定） | 16,660,545円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家限定） | 5,075,429円 |
| ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定） | 52,637円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家限定） | 692,158,406円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド37.5ＶＡ（適格機関投資家限定） | 982,194,365円 |
| ＤＩＡＭバランスファンド50ＶＡ（適格機関投資家限定） | 1,984,375,768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） | 35,159,501円 |
| ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定） | 76,754,747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） | 584,137,376円 |
| ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け） | 117,620,285円 |
| ＤＩＡＭ世界バランスファンド55ＶＡ（適格機関投資家限定） | 148,101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） | 104,346,029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） | 97,905,737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） | 118,914,941円 |
| ＤＩＡＭ世界バランス25ＶＡ（適格機関投資家限定） | 22,672,127円 |
| 動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞ | 59,600,973円 |
| コア資産形成ファンド | 20,800,921円 |
| たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジなし）＜ラップ専用＞ | 2,415,896,596円 |
| たわらノーロード　外国債券（為替ヘッジあり）＜ラップ専用＞ | 6,856,119,578円 |
| ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］ | 5,789,966,672円 |
| ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］ | 5,660,366,594円 |
| 期末元本合計 | 114,738,216,739円 |

## ■損益の状況

当期　自2025年２月22日　至2026年２月24日

| 項目 | 当期 |
|---|---|
| **(A) 配当等収益** | **9,255,540,404円** |
| 受取利息 | 9,255,534,429 |
| その他収益金 | 5,975 |
| **(B) 有価証券売買損益** | **30,892,894,661** |
| 売買益 | 33,191,805,865 |
| 売買損 | △2,298,911,204 |
| **(C) その他費用** | **△50,448,676** |
| **(D) 当期損益金(A＋B＋C)** | **40,097,986,389** |
| **(E) 前期繰越損益金** | **156,569,573,912** |
| **(F) 解約差損益金** | **△63,411,720,880** |
| **(G) 追加信託差損益金** | **61,648,910,843** |
| **(H) 合計(D＋E＋F＋G)** | **194,904,750,264** |
| **次期繰越損益金(H)** | **194,904,750,264** |

（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**

■投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

（2025年４月１日）

# インデックス225 マザーファンド

## 運用報告書

**第20期（決算日　2026年２月20日）**

**（計算期間　2025年２月21日～2026年２月20日）**

インデックス225 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 | 原則、無期限です。 |
| 運用方針 | 日経平均トータルリターン・インデックスの動きに連動する投資成果をめざした運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、原則として、日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄の中から200銘柄以上に同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行います。 |
| 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 | | 日経平均トータルリターン・インデックス（ベンチマーク） | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 16期(2022年２月21日) | 21,886 | △9.3 | 45,218.42 | △9.3 | 98.3 | 1.6 | 127,373 |
| 17期(2023年２月20日) | 22,882 | 4.6 | 47,299.71 | 4.6 | 97.4 | 2.6 | 130,473 |
| 18期(2024年２月20日) | 32,557 | 42.3 | 67,302.68 | 42.3 | 98.4 | 1.5 | 184,913 |
| 19期(2025年２月20日) | 33,354 | 2.4 | 69,055.80 | 2.6 | 97.8 | 2.2 | 230,938 |
| 20期(2026年２月20日) | 49,922 | 49.7 | 103,441.65 | 49.8 | 98.4 | 1.6 | 397,330 |

（注１）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注２）「日経平均株価」および「日経平均トータルリターン・インデックス」（以下、「日経平均株価」といいます。）に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は株式会社日本経済新聞社に帰属します。株式会社日本経済新聞社は「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、当ファンドについて、株式会社日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません（以下同じ）。

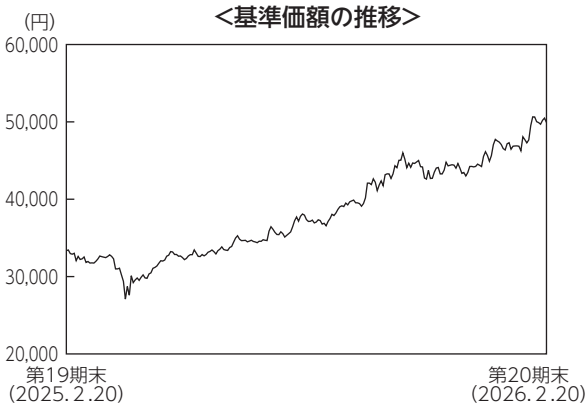
（注３）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

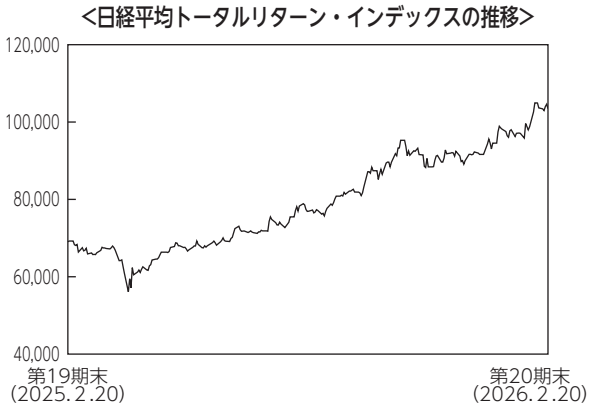
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年　月　日 | 基準価額 | | 日経平均トータルリターン・インデックス | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | |
| (期　首)<br>2025年 2月20日 | 円<br>33,354 | %<br>－ | 69,055.80 | %<br>－ | %<br>97.8 | %<br>2.2 |
| 2　月　末 | 32,061 | △3.9 | 66,381.33 | △3.9 | 97.9 | 2.1 |
| 3　月　末 | 30,989 | △7.1 | 64,164.99 | △7.1 | 96.0 | 3.9 |
| 4　月　末 | 31,363 | △6.0 | 64,938.64 | △6.0 | 97.7 | 2.3 |
| 5　月　末 | 33,039 | △0.9 | 68,397.62 | △1.0 | 97.6 | 2.3 |
| 6　月　末 | 35,277 | 5.8 | 73,063.18 | 5.8 | 98.4 | 1.5 |
| 7　月　末 | 35,787 | 7.3 | 74,118.65 | 7.3 | 98.2 | 1.7 |
| 8　月　末 | 37,243 | 11.7 | 77,138.62 | 11.7 | 98.1 | 1.9 |
| 9　月　末 | 39,433 | 18.2 | 81,678.01 | 18.3 | 97.8 | 2.2 |
| 10　月　末 | 45,998 | 37.9 | 95,279.92 | 38.0 | 97.3 | 2.7 |
| 11　月　末 | 44,106 | 32.2 | 91,370.38 | 32.3 | 98.0 | 2.0 |
| 12　月　末 | 44,226 | 32.6 | 91,630.43 | 32.7 | 97.7 | 2.2 |
| 2026年 1　月　末 | 46,852 | 40.5 | 97,065.30 | 40.6 | 98.4 | 1.6 |
| (期　末)<br>2026年 2月20日 | 49,922 | 49.7 | 103,441.65 | 49.8 | 98.4 | 1.6 |

（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（2025年２月21日から2026年２月20日まで）




### 基準価額の推移

当ファンドの基準価額は49,922円（１万口あたり）となり、前期末比で49.7％上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

国内株式市場は、2025年４月、米国トランプ新政権の関税引き上げによる輸出関連製造業への懸念が高まり、大きく下落しましたが、その直後、中国以外の相互関税上乗せ分の適用猶予が発表されたことが好感されて上昇に転じました。10月には、自民党総裁選で積極財政を掲げる高市候補が勝利したことが好感されて一段高となりました。年明け１月には、高市首相が衆議院を解散、総選挙後の政策実行加速への期待が高まったことから、上昇基調を強めました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果を目標に運用を行いました。ベンチマークに採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、採用銘柄の入替などにも適宜対応しました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、連動性維持に努めました。

### ベンチマークとの差異について

日経平均トータルリターン・インデックスは前期末比で49.8％上昇しました。当ファンドの騰落率は日経平均トータルリターン・インデックス比で△0.1％程度と概ね連動したパフォーマンスとなりました。

### 今後の運用方針

今後の運用につきましては、ベンチマークである日経平均トータルリターン・インデックスに採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、採用銘柄の入替などにも適宜対応するとともに、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

## ■１万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| (a) 売買委託手数料 | 0円 | 0.001% | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| 合計 | 0 | 0.001 | |
| 期中の平均基準価額は38,286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（2025年２月21日から2026年２月20日まで）

(1) 株　式

| | | 買付 株数 | 買付 金額 | 売付 株数 | 売付 金額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 国内 | 上場 | 25,620.4<br>(10,184.8) | 103,893,092<br>(−) | 15,574.6 | 58,446,242 |

（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 新規買付額 | 買建 決済額 | 売建 新規売付額 | 売建 決済額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | 株式先物取引 | 163,243 | 164,340 | − | − |

（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 | 162,339,334千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 278,584,243千円 |
| (c) 売買高比率 (a)／(b) | 0.58 |

（注）(b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2025年２月21日から2026年２月20日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 | 当期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B／A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D／C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 103,893 | 3,856 | 3.7 | 58,446 | 4,793 | 8.2 |
| 株式先物取引 | 163,243 | 163,243 | 100.0 | 164,340 | 164,340 | 100.0 |

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 当期 | | |
|---|---|---|---|
| | 買付額 | 売付額 | 当期末保有額 |
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 36 | 17 | 165 |

(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 |
| | 百万円 |
| 株式 | 53 |

(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） | 2,512千円 |
| うち利害関係人への支払額（B） | 2,475千円 |
| （B）／（A） | 98.6% |

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

## ■組入資産の明細

(1) 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) 株数 | 当期末 株数 | 当期末 評価額 |
|---|---|---|---|
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| **水産・農林業（0.1%）** | | | |
| ニッスイ | 192 | 230 | 338,445 |
| **鉱業（0.1%）** | | | |
| ＩＮＰＥＸ | 76.8 | 92 | 338,284 |
| **建設業（1.9%）** | | | |
| コムシスホールディングス | 192 | 230 | 1,271,440 |
| 大成建設 | 38.4 | 46 | 864,570 |
| 大林組 | 192 | 230 | 955,190 |
| 清水建設 | 192 | 230 | 793,960 |
| 長谷工コーポレーション | 38.4 | 46 | 150,558 |
| 鹿島建設 | 96 | 115 | 814,775 |
| 大和ハウス工業 | 192 | 230 | 1,268,450 |
| 積水ハウス | 192 | 230 | 863,190 |
| 日揮ホールディングス | 192 | 230 | 548,780 |
| **食料品（2.4%）** | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 192 | 230 | 489,325 |
| 明治ホールディングス | 76.8 | 92 | 354,936 |
| 日本ハム | 96 | 115 | 794,190 |
| サッポロホールディングス | 38.4 | 230 | 398,935 |
| アサヒグループホールディングス | 576 | 690 | 1,178,865 |
| キリンホールディングス | 192 | 230 | 606,855 |
| キッコーマン | 960 | 1,150 | 1,705,450 |
| 味の素 | 192 | 460 | 2,116,920 |
| ニチレイ | 96 | 230 | 478,170 |
| 日本たばこ産業 | 192 | 230 | 1,355,390 |
| **繊維製品（0.1%）** | | | |
| 帝人 | 38.4 | 46 | 75,555 |
| 東レ | 192 | 230 | 294,170 |
| **パルプ・紙（0.1%）** | | | |
| 王子ホールディングス | 192 | 230 | 223,468 |
| **化学（4.8%）** | | | |
| クラレ | 192 | 230 | 412,275 |
| 旭化成 | 192 | 230 | 400,200 |
| レゾナック・ホールディングス | 19.2 | 23 | 258,060 |
| 住友化学 | 192 | 230 | 130,640 |
| 日産化学 | 192 | 230 | 1,517,310 |
| 東ソー | 96 | 115 | 303,600 |
| トクヤマ | 38.4 | 46 | 191,774 |
| デンカ | 38.4 | 46 | 150,144 |
| 信越化学工業 | 960 | 1,150 | 6,612,500 |
| 三井化学 | 38.4 | 92 | 212,842 |
| 三菱ケミカルグループ | 96 | 115 | 128,512 |
| ＵＢＥ | 19.2 | 23 | 64,446 |
| 花王 | 192 | 230 | 1,500,520 |
| 富士フイルムホールディングス | 576 | 690 | 2,070,000 |
| 資生堂 | 192 | 230 | 707,020 |
| 日東電工 | 960 | 1,150 | 4,167,600 |
| **医薬品（5.2%）** | | | |
| 協和キリン | 192 | 230 | 639,055 |
| 武田薬品工業 | 192 | 230 | 1,331,700 |
| アステラス製薬 | 960 | 1,150 | 2,847,975 |
| 住友ファーマ | 192 | 230 | 569,365 |
| 塩野義製薬 | 576 | 690 | 2,515,050 |
| 中外製薬 | 576 | 690 | 6,851,700 |
| エーザイ | 192 | 230 | 1,176,220 |
| 第一三共 | 576 | 690 | 2,013,765 |
| 大塚ホールディングス | 192 | 230 | 2,442,600 |
| **石油・石炭製品（0.3%）** | | | |
| 出光興産 | 384 | 460 | 651,590 |
| ＥＮＥＯＳホールディングス | 192 | 230 | 334,880 |
| **ゴム製品（0.7%）** | | | |
| 横浜ゴム | 96 | 115 | 917,930 |
| ブリヂストン | 192 | 460 | 1,665,200 |
| **ガラス・土石製品（0.7%）** | | | |
| ＡＧＣ | 38.4 | 46 | 289,524 |
| 日本電気硝子 | 57.6 | 69 | 426,420 |
| 太平洋セメント | 19.2 | 23 | 106,881 |
| 東海カーボン | 192 | 230 | 239,660 |
| ＴＯＴＯ | 96 | 115 | 712,425 |
| 日本碍子 | 192 | 230 | 993,830 |
| **鉄鋼（0.0%）** | | | |
| 日本製鉄 | 19.2 | 115 | 77,498 |
| 神戸製鋼所 | 19.2 | 23 | 52,601 |
| ＪＦＥホールディングス | 19.2 | 23 | 51,738 |
| **非鉄金属（2.7%）** | | | |
| 三井金属 | 19.2 | 23 | 719,670 |
| 三菱マテリアル | 19.2 | 23 | 120,451 |
| 住友金属鉱山 | 96 | 115 | 1,151,150 |
| ＤＯＷＡホールディングス | 38.4 | 46 | 466,440 |
| 古河電気工業 | 19.2 | 23 | 536,705 |
| 住友電気工業 | 192 | 230 | 2,242,040 |
| フジクラ | 192 | 230 | 5,267,000 |
| **金属製品（0.0%）** | | | |
| ＳＵＭＣＯ | 19.2 | 23 | 37,122 |
| **機械（4.9%）** | | | |
| 日本製鋼所 | 38.4 | 46 | 460,920 |
| オークマ | 76.8 | 92 | 415,380 |
| アマダ | 192 | 230 | 578,220 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ディスコ | 38.4 | 46 | 3,406,760 |
| ＳＭＣ | 19.2 | 23 | 1,676,240 |
| 小松製作所 | 192 | 230 | 1,734,430 |
| 住友重機械工業 | 38.4 | 46 | 264,684 |
| 日立建機 | 192 | 230 | 1,506,270 |
| クボタ | 192 | 230 | 700,580 |
| 荏原製作所 | 192 | 230 | 1,296,740 |
| ダイキン工業 | 192 | 230 | 4,537,900 |
| 日本精工 | 192 | 230 | 304,175 |
| ＮＴＮ | 192 | 230 | 94,714 |
| ジェイテクト | 192 | 230 | 470,580 |
| カナデビア | 38.4 | 46 | 49,680 |
| 三菱重工業 | 192 | 230 | 1,141,950 |
| ＩＨＩ | 19.2 | 161 | 705,824 |
| **電気機器（33.4%）** | | | |
| イビデン | － | 460 | 4,212,220 |
| コニカミノルタ | 192 | 230 | 136,045 |
| ミネベアミツミ | 192 | 230 | 761,300 |
| 日立製作所 | 192 | 230 | 1,133,900 |
| 三菱電機 | 192 | 230 | 1,345,500 |
| 富士電機 | 38.4 | 46 | 578,450 |
| 安川電機 | 192 | 230 | 1,195,540 |
| ソシオネクスト | 192 | 230 | 447,695 |
| ニデック | 307.2 | － | － |
| オムロン | 192 | 230 | 1,188,870 |
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 38.4 | 46 | 239,568 |
| 日本電気 | 19.2 | 115 | 450,340 |
| 富士通 | 192 | 230 | 834,900 |
| ルネサスエレクトロニクス | 192 | 230 | 668,840 |
| セイコーエプソン | 384 | 460 | 953,810 |
| パナソニック　ホールディングス | 192 | 230 | 577,415 |
| シャープ | 192 | 230 | 149,730 |
| ソニーグループ | 960 | 1,150 | 3,836,400 |
| ＴＤＫ | 2,880 | 3,450 | 8,211,000 |
| アルプスアルパイン | 192 | 230 | 536,015 |
| 横河電機 | 192 | 230 | 1,241,540 |
| アドバンテスト | 1,536 | 1,840 | 46,874,000 |
| キーエンス | 19.2 | 23 | 1,412,890 |
| レーザーテック | 76.8 | 92 | 2,818,880 |
| カシオ計算機 | 192 | 230 | 369,035 |
| ファナック | 960 | 1,150 | 7,384,150 |
| ローム | － | 230 | 609,500 |
| 京セラ | 1,536 | 1,840 | 4,887,960 |
| 太陽誘電 | 192 | 230 | 1,065,820 |
| 村田製作所 | 460.8 | 552 | 2,028,600 |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 76.8 | 92 | 2,022,160 |
| キヤノン | 288 | 345 | 1,616,325 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| リコー | 192 | 230 | 333,270 |
| 東京エレクトロン | 576 | 690 | 30,332,400 |
| **輸送用機器（3.3%）** | | | |
| デンソー | 768 | 920 | 2,037,800 |
| 川崎重工業 | 19.2 | 23 | 412,045 |
| 日産自動車 | 192 | 230 | 102,350 |
| いすゞ自動車 | 96 | 115 | 316,825 |
| トヨタ自動車 | 960 | 1,150 | 4,180,250 |
| 日野自動車 | 192 | 230 | 102,120 |
| 三菱自動車工業 | 19.2 | 23 | 9,998 |
| マツダ | 38.4 | 46 | 61,732 |
| 本田技研工業 | 1,152 | 1,380 | 2,129,340 |
| スズキ | 768 | 920 | 2,110,480 |
| ＳＵＢＡＲＵ | 192 | 230 | 694,830 |
| ヤマハ発動機 | 576 | 690 | 850,770 |
| **精密機器（2.2%）** | | | |
| テルモ | 1,536 | 1,840 | 3,610,080 |
| ニコン | 192 | 230 | 451,720 |
| オリンパス | 768 | 920 | 1,361,600 |
| ＨＯＹＡ | 96 | 115 | 3,167,675 |
| シチズン時計 | 192 | － | － |
| **その他製品（1.7%）** | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 576 | 690 | 2,780,700 |
| ＴＯＰＰＡＮホールディングス | 96 | 115 | 529,690 |
| 大日本印刷 | 192 | 230 | 711,160 |
| ヤマハ | 576 | 690 | 824,895 |
| 任天堂 | 192 | 230 | 1,975,010 |
| **電気・ガス業（0.2%）** | | | |
| 東京電力ホールディングス | 19.2 | 23 | 16,175 |
| 中部電力 | 19.2 | 23 | 59,190 |
| 関西電力 | 19.2 | 23 | 61,686 |
| 東京瓦斯 | 38.4 | 46 | 348,450 |
| 大阪瓦斯 | 38.4 | 46 | 293,848 |
| **陸運業（0.7%）** | | | |
| 東武鉄道 | 38.4 | 46 | 140,668 |
| 東急 | 96 | 115 | 222,007 |
| 小田急電鉄 | 96 | 115 | 200,560 |
| 京王電鉄 | 38.4 | 46 | 189,612 |
| 京成電鉄 | 288 | 345 | 459,195 |
| 東日本旅客鉄道 | 57.6 | 69 | 263,166 |
| 西日本旅客鉄道 | 38.4 | 46 | 150,834 |
| 東海旅客鉄道 | 96 | 115 | 531,645 |
| ヤマトホールディングス | 192 | 230 | 426,190 |
| ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス | 57.6 | 69 | 253,230 |
| **海運業（0.3%）** | | | |
| 日本郵船 | 57.6 | 69 | 359,835 |
| 商船三井 | 57.6 | 69 | 375,429 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 川崎汽船 | 172.8 | 207 | 497,938 |
| **空運業（0.2%）** | | | |
| 日本航空 | 192 | 230 | 702,190 |
| ＡＮＡホールディングス | 19.2 | 23 | 75,992 |
| **倉庫・運輸関連業（－%）** | | | |
| 三菱倉庫 | 480 | － | － |
| **情報・通信業（10.6%）** | | | |
| ディー・エヌ・エー | 57.6 | 69 | 183,850 |
| ネクソン | 384 | 460 | 1,479,360 |
| ＳＨＩＦＴ | － | 230 | 151,133 |
| 野村総合研究所 | 192 | 230 | 881,590 |
| メルカリ | 192 | 230 | 824,550 |
| ＬＩＮＥヤフー | 76.8 | 92 | 34,435 |
| トレンドマイクロ | 192 | 230 | 1,308,240 |
| ＮＴＴ | 1,920 | 2,300 | 347,300 |
| ＫＤＤＩ | 1,152 | 2,760 | 7,220,160 |
| ソフトバンク | 1,920 | 2,300 | 483,000 |
| 東宝 | 19.2 | 23 | 178,135 |
| ＮＴＴデータグループ | 960 | － | － |
| コナミグループ | 192 | 230 | 4,322,850 |
| ソフトバンクグループ | 1,152 | 5,520 | 23,896,080 |
| **卸売業（4.1%）** | | | |
| 双日 | 19.2 | 23 | 155,618 |
| 伊藤忠商事 | 192 | 1,150 | 2,521,375 |
| 丸紅 | 192 | 230 | 1,313,300 |
| 豊田通商 | 576 | 690 | 4,647,150 |
| 三井物産 | 384 | 460 | 2,532,300 |
| 住友商事 | 192 | 230 | 1,467,860 |
| 三菱商事 | 576 | 690 | 3,443,790 |
| **小売業（11.9%）** | | | |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 96 | 115 | 300,035 |
| ＺＯＺＯ | 192 | 690 | 745,545 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 192 | 230 | 686,435 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 576 | 690 | 1,511,790 |
| 良品計画 | 192 | 460 | 1,665,200 |
| 高島屋 | 192 | 230 | 528,310 |
| 丸井グループ | 192 | 230 | 719,900 |
| イオン | 192 | 690 | 1,583,550 |
| ニトリホールディングス | 96 | 575 | 1,861,275 |
| ファーストリテイリング | 518.4 | 552 | 36,961,920 |
| **銀行業（0.9%）** | | | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 192 | 230 | 717,370 |
| 横浜フィナンシャルグループ | 192 | 230 | 390,655 |
| あおぞら銀行 | 19.2 | 23 | 66,182 |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 192 | 230 | 676,660 |
| りそなホールディングス | 19.2 | 23 | 45,551 |
| 三井住友トラストグループ | 38.4 | 46 | 252,264 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 57.6 | 69 | 411,447 |
| 千葉銀行 | 192 | 230 | 548,205 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 38.4 | 46 | 313,122 |
| みずほフィナンシャルグループ | 19.2 | 23 | 165,025 |
| **証券、商品先物取引業（0.2%）** | | | |
| 大和証券グループ本社 | 192 | 230 | 366,275 |
| 野村ホールディングス | 192 | 230 | 323,035 |
| **保険業（1.1%）** | | | |
| ＳＯＭＰＯホールディングス | 115.2 | 138 | 814,752 |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 172.8 | 207 | 894,240 |
| 第一生命ホールディングス | 19.2 | 92 | 143,704 |
| 東京海上ホールディングス | 288 | 345 | 2,233,875 |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 38.4 | 46 | 184,552 |
| **その他金融業（0.8%）** | | | |
| クレディセゾン | 192 | 230 | 1,067,890 |
| オリックス | 192 | 230 | 1,244,300 |
| 日本取引所グループ | 384 | 460 | 863,420 |
| **不動産業（1.5%）** | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 192 | 230 | 357,420 |
| 三井不動産 | 576 | 690 | 1,439,340 |
| 三菱地所 | 192 | 230 | 1,170,470 |
| 東京建物 | 96 | 115 | 476,675 |
| 住友不動産 | 192 | 460 | 2,320,240 |
| **サービス業（2.9%）** | | | |
| エムスリー | 460.8 | 552 | 882,096 |
| 電通グループ | 192 | 230 | 651,130 |
| オリエンタルランド | 192 | 230 | 623,415 |
| サイバーエージェント | 153.6 | 184 | 240,856 |
| 楽天グループ | 192 | 230 | 189,152 |
| リクルートホールディングス | 576 | 690 | 4,335,960 |
| 日本郵政 | 192 | 230 | 462,760 |
| ベイカレント | － | 230 | 1,030,400 |
| セコム | 384 | 460 | 2,753,100 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 合計　株数・金額 | 60,614.4 | 80,845 | 391,015,104 |
| 合計　銘柄数＜比率＞ | 225銘柄 | 225銘柄 | <98.4%> |

（注１）銘柄欄の（　）内は、期末の国内株式評価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 |
| 国内 | 日経平均 | 百万円<br>6,195 | 百万円<br>－ |

## ■投資信託財産の構成

2026年２月20日現在

| 項目 | 当期末 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 391,015,104 | 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 6,574,634 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 397,589,738 | 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

(2026年２月20日)現在

| 項目 | 当期末 |
|---|---|
| **(A) 資産** | **397,575,093,607円** |
| コール・ローン等 | 5,817,281,241 |
| 株式(評価額) | 391,015,104,100 |
| 未収入金 | 111,191,390 |
| 未収配当金 | 408,324,000 |
| 差入委託証拠金 | 223,192,876 |
| **(B) 負債** | **244,337,000** |
| 未払解約金 | 244,337,000 |
| **(C) 純資産総額(A－B)** | **397,330,756,607** |
| 元本 | 79,589,746,637 |
| 次期繰越損益金 | 317,741,009,970 |
| **(D) 受益権総口数** | **79,589,746,637口** |
| **１万口当たり基準価額(C／D)** | **49,922円** |

(注１) 期首元本額 69,238,565,169円
追加設定元本額 23,448,224,271円
一部解約元本額 13,097,042,803円

(注２) 期末における元本の内訳

| | |
|---|---|
| (適格機関投資家私募) インデックス２２５ (３ヵ月決算型) | 959,828,034円 |
| (適格機関投資家私募) インデックス２２５ | 627,910,240円 |
| マルチアセット・アロケーション戦略ファンド (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募) | 102,767,776円 |
| マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII (為替バリアブルヘッジ型) (適格機関投資家限定) | 20,939,543円 |
| たわらノーロード　日経２２５ | 71,372,755,897円 |
| Ｏｎｅパッシブ資産分散ファンド | 174,942,095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) | 29,831,095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) | 29,784,920円 |
| ＤＩＡＭ日経２２５インデックスファンドＶＡ | 437,088,834円 |
| 国内株式パッシブ・ファンド－日経２２５型－ (適格機関投資家向け) | 1,540,467,924円 |
| ＤＩＡＭ日経２２５型パッシブ・ファンド (適格機関投資家向け) | 944,057,555円 |
| ＭＨＡＭ日経２２５インデックスファンド [適格機関投資家限定] | 3,279,041,463円 |
| ＭＨＡＭインデックス２２５ [適格機関投資家限定] | 70,331,261円 |
| 期末元本合計 | 79,589,746,637円 |

## ■損益の状況

当期　自2025年２月21日　至2026年２月20日

| 項目 | 当期 |
|---|---|
| **(A) 配当等収益** | **5,053,180,477円** |
| 受取配当金 | 5,024,166,680 |
| 受取利息 | 28,794,706 |
| その他収益金 | 219,091 |
| **(B) 有価証券売買損益** | **119,720,357,106** |
| 売買益 | 131,422,468,739 |
| 売買損 | △11,702,111,633 |
| **(C) 先物取引等取引損益** | **2,299,840,010** |
| 取引益 | 3,977,529,260 |
| 取引損 | △1,677,689,250 |
| **(D) 当期損益金(A＋B＋C)** | **127,073,377,593** |
| **(E) 前期繰越損益金** | **161,700,348,330** |
| **(F) 解約差損益金** | **△37,202,562,682** |
| **(G) 追加信託差損益金** | **66,169,846,729** |
| **(H) 合計(D＋E＋F＋G)** | **317,741,009,970** |
| **次期繰越損益金(H)** | **317,741,009,970** |

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

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

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

## 《お知らせ》

**約款変更のお知らせ**

■投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

（2025年４月１日）

# 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

**第18期（決算日　2025年６月23日）**

**（対象期間　2024年６月25日～2025年６月23日）**

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

**当ファンドの仕組みは次の通りです。**

| | |
|---|---|
| 信託期間 | 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。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。<br>株式への直接投資は行いません。 |

**■最近５期の運用実績**

| 決算期 | 基準価額 | | Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴ インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）(ベンチマーク) | | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 | 不動産投信指数先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 14期(2021年６月22日) | 15,336 | 40.4 | 157,949.66 | 42.0 | 99.4 | － | 78,959 |
| 15期(2022年６月22日) | 16,673 | 8.7 | 172,787.99 | 9.4 | 99.3 | － | 56,003 |
| 16期(2023年６月22日) | 17,096 | 2.5 | 177,832.19 | 2.9 | 99.4 | － | 81,199 |
| 17期(2024年６月24日) | 20,700 | 21.1 | 216,675.29 | 21.8 | 99.0 | 1.0 | 87,881 |
| 18期(2025年６月23日) | 20,948 | 1.2 | 221,013.22 | 2.0 | 98.9 | 1.2 | 96,756 |

（注１）不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

（注４）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

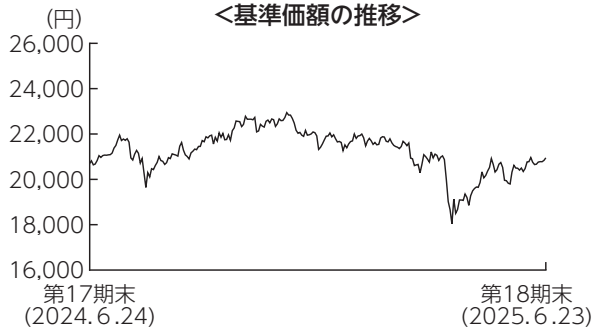
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年　月　日 | 基準価額 | | S&P先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) | | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 | 不動産投信指数先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | (ベンチマーク) | 期中騰落率 | | |
| (期　首)<br>2024年6月24日 | 円<br>20,700 | %<br>－ | ポイント<br>216,675.29 | %<br>－ | %<br>99.0 | %<br>1.0 |
| 6月末 | 20,830 | 0.6 | 218,253.22 | 0.7 | 98.9 | 1.0 |
| 7月末 | 21,150 | 2.2 | 221,602.20 | 2.3 | 99.1 | 0.9 |
| 8月末 | 21,025 | 1.6 | 220,652.86 | 1.8 | 98.8 | 1.2 |
| 9月末 | 21,559 | 4.1 | 226,444.42 | 4.5 | 98.7 | 1.4 |
| 10月末 | 22,730 | 9.8 | 238,875.51 | 10.2 | 99.1 | 0.9 |
| 11月末 | 22,684 | 9.6 | 238,269.11 | 10.0 | 99.3 | 0.7 |
| 12月末 | 21,875 | 5.7 | 229,955.43 | 6.1 | 98.7 | 1.9 |
| 2025年1月末 | 21,689 | 4.8 | 228,353.39 | 5.4 | 98.8 | 1.2 |
| 2月末 | 21,447 | 3.6 | 225,764.10 | 4.2 | 99.3 | 0.8 |
| 3月末 | 20,834 | 0.6 | 219,233.72 | 1.2 | 98.9 | 1.1 |
| 4月末 | 19,647 | △5.1 | 206,876.00 | △4.5 | 99.2 | 1.4 |
| 5月末 | 20,498 | △1.0 | 216,010.17 | △0.3 | 99.1 | 0.9 |
| (期　末)<br>2025年6月23日 | 20,948 | 1.2 | 221,013.22 | 2.0 | 98.9 | 1.2 |

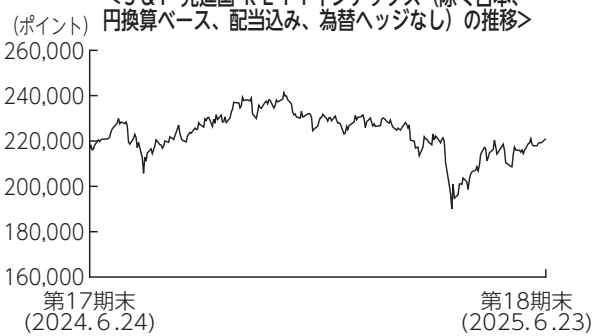
(注1) 騰落率は期首比です。
(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2024年６月25日から2025年６月23日まで）

<基準価額の推移>




<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）の推移>




### 基準価額の推移

当期末の基準価額は20,948円となり、前期末比で1.2％上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

為替市場で全ての指数構成通貨に対し円高となったことがマイナスの寄与となりましたが、米国や豪州など投資対象の多くのリート市場が上昇したことから基準価額は上昇しました。

### 投資環境

外国リート市場は上昇しました。期前半は米豪での利下げ期待や欧州の景況感指数改善などを受けて上昇基調となりました。2024年12月に米国の利下げペースの鈍化が示唆されたことなどから上値の重い展開となり、2025年４月に米政権による相互関税発表を受けて景気悪化懸念が強まり大幅に下落しました。期末にかけては関税による直接の影響を受けにくい資産としてリートが選好され上昇しました。

為替市場では全ての指数構成通貨に対して円高となりました。期初は日銀の追加利上げ、米国の早期利下げ観測などを受けて円高米ドル安となりました。その後は日銀が利上げを急がない姿勢を示したことなどから円安米ドル高基調に回帰しました。期後半は米トランプ政権の関税政策を巡る懸念などから米ドルに対して円高となりましたが、欧州主要国による財政刺激策への期待が高まったことなどからユーロに対しては円安方向での推移となりました。

### ポートフォリオについて

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

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.0％上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8％下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

### 今後の運用方針

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

## ■１万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| (a) 売買委託手数料 | 5円 | 0.024% | (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 |
| (先物・オプション) | (1) | (0.005) | 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料 |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.002) | |
| (投資証券) | (4) | (0.017) | |
| (b) 有価証券取引税 | 5 | 0.021 | (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 |
| (投資信託受益証券) | (0) | (0.001) | 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 |
| (投資証券) | (4) | (0.020) | |
| (c) その他費用 | 7 | 0.034 | (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) | (5) | (0.022) | 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 |
| (その他) | (2) | (0.012) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計 | 17 | 0.079 | |
| 期中の平均基準価額は21,241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（2024年６月25日から2025年６月23日まで）

(1) 投資信託受益証券、投資証券

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **アメリカ** | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千口 | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTEQUIT | 43.231<br>(−) | 4,392<br>(−) | 38.646<br>(−) | 3,820<br>(−) |
| ALEXANDER'S INC. | 0.117<br>(−) | 23<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| BXP INC | 39.862<br>(−) | 2,845<br>(−) | 33.525<br>(−) | 2,312<br>(−) |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 90.421<br>(−) | 3,461<br>(−) | 62.2<br>(−) | 2,340<br>(−) |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 32.206<br>(−) | 278<br>(−) | 23.668<br>(−) | 210<br>(−) |
| AGREE REALTY CORP | 30.418<br>(−) | 2,255<br>(−) | 22.356<br>(−) | 1,664<br>(−) |
| BRT APARTMENTS CORP | 1.775<br>(−) | 33<br>(−) | 3.445<br>(−) | 61<br>(−) |
| SL GREEN | 19.91<br>(−) | 1,349<br>(−) | 14.347<br>(−) | 893<br>(−) |
| EPR PROPERTIES | 19.367<br>(−) | 910<br>(−) | 16.373<br>(−) | 803<br>(−) |
| PROLOGIS INC | 253.026<br>(−) | 28,774<br>(−) | 216.185<br>(−) | 24,744<br>(−) |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 39.192<br>(−) | 8,448<br>(−) | 33.72<br>(−) | 7,147<br>(−) |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 76.645<br>(−) | 701<br>(−) | 66.244<br>(−) | 592<br>(−) |

| | 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 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 29.979<br>(−) | 3,531<br>(−) | 25.929<br>(−) | 3,065<br>(−) |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 22.378<br>(−) | 367<br>(−) | 21.553<br>(−) | 345<br>(−) |
| EQUINIX INC | 27.039<br>(−) | 23,114<br>(−) | 22.068<br>(−) | 18,400<br>(−) |
| NNN REIT INC | 47.144<br>(−) | 2,025<br>(−) | 37.68<br>(−) | 1,641<br>(−) |
| CTO REALTY GROUTH INC | 5.088<br>(−) | 98<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| COUSINS PROPERTIES INC | 49.164<br>(−) | 1,410<br>(−) | 36.195<br>(−) | 1,011<br>(−) |
| SITE CENTERS CORP | 25.142<br>(△56.166) | 392<br>(−) | 18.872<br>(−) | 258<br>(−) |
| SAFEHOLD INC | 10.093<br>(−) | 184<br>(−) | 6.07<br>(−) | 110<br>(−) |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | −<br>(−) | −<br>(−) | 11.922<br>(−) | 10<br>(−) |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 18.096<br>(−) | 5,255<br>(−) | 15.527<br>(−) | 4,515<br>(−) |
| EQUITY RESIDENTIAL | 96.151<br>(−) | 6,839<br>(−) | 84.377<br>(−) | 5,967<br>(−) |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 20.192<br>(−) | 2,126<br>(−) | 15.964<br>(−) | 1,637<br>(−) |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 34.141<br>(−) | 1,776<br>(−) | 28.699<br>(−) | 1,520<br>(−) |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 198.997<br>(−) | 4,102<br>(−) | 174.559<br>(−) | 3,530<br>(−) |
| EQUITY COMMONWEALTH | 13.402<br>(−) | 266<br>(−) | 56.631<br>(−) | 213<br>(−) |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 28.511<br>(−) | 876<br>(−) | 23.693<br>(−) | 703<br>(−) |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 7.842<br>(−) | 39<br>(−) | 8.211<br>(−) | 42<br>(−) |
| WELLTOWER INC | 179.5<br>(−) | 24,251<br>(−) | 145.975<br>(−) | 20,062<br>(−) |
| EAST GROUP | 15.16<br>(−) | 2,628<br>(−) | 11.348<br>(−) | 1,997<br>(−) |
| KIMCO REALTY | 192.826<br>(−) | 4,274<br>(−) | 163.226<br>(−) | 3,515<br>(−) |
| KILROY REALTY CORP | 23.802<br>(−) | 837<br>(−) | 19.924<br>(−) | 652<br>(−) |
| LTC PROPERTIES INC | 10.632<br>(−) | 392<br>(−) | 7.07<br>(−) | 250<br>(−) |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 30.073<br>(−) | 82<br>(−) | 16.982<br>(−) | 49<br>(−) |

| | 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 |
| LAMAR ADVERTISING CO | 54.832<br>(−) | 7,140<br>(−) | 15.611<br>(−) | 1,841<br>(−) |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 39.063<br>(−) | 182<br>(−) | 21.911<br>(−) | 87<br>(−) |
| IRON MOUNTAIN INC | 82.503<br>(−) | 8,496<br>(−) | 70.284<br>(−) | 6,814<br>(−) |
| THE MACERICH COMPANY | 82.718<br>(−) | 1,433<br>(−) | 56.79<br>(−) | 942<br>(−) |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 54.71<br>(−) | 3,731<br>(−) | 45.729<br>(−) | 3,084<br>(−) |
| ACADIA REALTY TRUST | 40.891<br>(−) | 889<br>(−) | 25.51<br>(−) | 539<br>(−) |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 197.705<br>(−) | 3,221<br>(−) | 175.369<br>(−) | 2,761<br>(−) |
| MID AMERICA | 32.821<br>(−) | 5,144<br>(−) | 28.359<br>(−) | 4,478<br>(−) |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 13.726<br>(−) | 1,030<br>(−) | 10.606<br>(−) | 774<br>(−) |
| CENTERSPACE | 4.088<br>(−) | 266<br>(−) | 3.312<br>(−) | 209<br>(−) |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 1.567<br>(−) | 39<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| GETTY REALTY CORP | 12.67<br>(−) | 385<br>(−) | 10.751<br>(−) | 324<br>(−) |
| REALTY INCOME CORP | 250.234<br>(−) | 14,400<br>(−) | 202.152<br>(−) | 11,641<br>(−) |
| REGENCY CENTERS CORP | 45.189<br>(−) | 3,217<br>(−) | 39.814<br>(−) | 2,843<br>(−) |
| UDR INC | 83.618<br>(−) | 3,578<br>(−) | 73.116<br>(−) | 3,139<br>(−) |
| COPT DEFENCE PROPERTIES | 26.725<br>(−) | 777<br>(−) | 23.398<br>(−) | 656<br>(−) |
| SAUL CENTERS INC | 0.999<br>(−) | 39<br>(−) | 0.174<br>(−) | 7<br>(−) |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 85.509<br>(−) | 14,057<br>(−) | 81.45<br>(−) | 13,325<br>(−) |
| PUBLIC STORAGE | 43.318<br>(−) | 13,609<br>(−) | 37.3<br>(−) | 11,485<br>(−) |
| SUN COMMUNITIES INC | 35.356<br>(−) | 4,482<br>(−) | 32.43<br>(−) | 4,189<br>(−) |
| TANGER INC | 30.864<br>(−) | 972<br>(−) | 25.285<br>(−) | 779<br>(−) |
| UMH PROPERTIES INC | 12.667<br>(−) | 233<br>(−) | 5.196<br>(−) | 92<br>(−) |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 12.096<br>(−) | 184<br>(−) | 6.012<br>(−) | 80<br>(−) |

| | 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 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.912<br>(−) | 38<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| VENTAS INC | 135.076<br>(−) | 8,571<br>(−) | 98.791<br>(−) | 6,304<br>(−) |
| VORNADO REALTY TRUST | 46.471<br>(−) | 1,735<br>(−) | 37.159<br>(−) | 1,321<br>(−) |
| ELME COMMUNITIES | 23.082<br>(−) | 380<br>(−) | 18.843<br>(−) | 312<br>(−) |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 55.489<br>(−) | 1,346<br>(−) | 46.696<br>(−) | 1,085<br>(−) |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 58.771<br>(−) | 9,259<br>(−) | 50.342<br>(−) | 7,750<br>(−) |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 38.04<br>(−) | 370<br>(−) | 32.129<br>(−) | 313<br>(−) |
| CUBESMART | 60.618<br>(−) | 2,747<br>(−) | 51.015<br>(−) | 2,258<br>(−) |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 89.401<br>(−) | 14,506<br>(−) | 80.318<br>(−) | 12,365<br>(−) |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 44.136<br>(−) | 360<br>(−) | 40.499<br>(−) | 310<br>(−) |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 151.984<br>(−) | 772<br>(−) | 129.841<br>(−) | 690<br>(−) |
| DOUGLAS EMMETT INC | 43.164<br>(−) | 709<br>(−) | 37.982<br>(−) | 598<br>(−) |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 8.617<br>(−) | 144<br>(−) | 61.216<br>(−) | 1,065<br>(−) |
| PIEDMONT REALTY TRUST INC | 20.997<br>(−) | 177<br>(−) | 14.362<br>(−) | 109<br>(−) |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 14.143<br>(−) | 91<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| TERRENO REALTY CORP | 28.503<br>(−) | 1,762<br>(−) | 21.82<br>(−) | 1,384<br>(−) |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 11.271<br>(−) | 270<br>(−) | 8.356<br>(−) | 187<br>(−) |
| RLJ LODGING TRUST | 28.837<br>(−) | 245<br>(−) | 27.019<br>(−) | 202<br>(−) |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 65.464<br>(−) | 1,521<br>(−) | 57.363<br>(−) | 1,345<br>(−) |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 21.711<br>(−) | 268<br>(−) | 14.426<br>(−) | 172<br>(−) |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | −<br>(−) | −<br>(−) | 23.664<br>(−) | 5<br>(−) |
| CHATHAM LODGING TRUST | 5.703<br>(−) | 51<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 61.626<br>(−) | 1,107<br>(−) | 50.305<br>(−) | 855<br>(−) |

| | 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 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 19.591<br>(−) | 80<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 49.97<br>(−) | 1,819<br>(−) | 40.51<br>(−) | 1,496<br>(−) |
| WP CAREY INC | 62.913<br>(−) | 3,711<br>(−) | 54.686<br>(−) | 3,287<br>(−) |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 12.34<br>(−) | 228<br>(−) | 11.725<br>(−) | 208<br>(−) |
| GLADSTONE LAND CORP | 1.258<br>(−) | 12<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 94.944<br>(−) | 1,609<br>(−) | 90.486<br>(−) | 1,533<br>(−) |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 16.056<br>(−) | 1,621<br>(−) | 13.622<br>(−) | 1,337<br>(−) |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 13.138<br>(−) | 142<br>(−) | 1<br>(−) | 11<br>(−) |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 63.965<br>(−) | 2,643<br>(−) | 47.234<br>(−) | 1,985<br>(−) |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 83.961<br>(−) | 3,134<br>(−) | 73.962<br>(−) | 2,760<br>(−) |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 62.304<br>(−) | 1,239<br>(−) | 50.904<br>(−) | 1,019<br>(−) |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 6.629<br>(−) | 626<br>(−) | 5.998<br>(−) | 495<br>(−) |
| JBG SMITH PROPERTIES | 15.934<br>(−) | 255<br>(−) | 18.121<br>(−) | 305<br>(−) |
| INVITATION HOMES INC | 159.43<br>(−) | 5,442<br>(−) | 140.256<br>(−) | 4,797<br>(−) |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 27.939<br>(−) | 260<br>(−) | 15.367<br>(−) | 126<br>(−) |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 2.605<br>(−) | 57<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 53.501<br>(−) | 1,693<br>(−) | 36.87<br>(−) | 1,149<br>(−) |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 79.283<br>(−) | 3,878<br>(−) | 67.841<br>(−) | 3,349<br>(−) |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 74.947<br>(−) | 1,968<br>(−) | 60.403<br>(−) | 1,575<br>(−) |
| POSTAL REALTY TRUST INC | 2.534<br>(−) | 36<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 15.898<br>(−) | 466<br>(−) | 10.44<br>(−) | 306<br>(−) |
| OUTFRONT MEDIA INC | 79.561<br>(△0.306) | 1,433<br>(23) | 19.416<br>(−) | 318<br>(−) |
| FARMLAND PARTNERS INC | 2.121<br>(−) | 25<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |

| | 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 |
| NETSTREIT CORP | 17.969<br>(−) | 291<br>(−) | 11.765<br>(−) | 185<br>(−) |
| CARETRUST REIT INC | 63.168<br>(−) | 1,859<br>(−) | 35.687<br>(−) | 1,000<br>(−) |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 2.975<br>(−) | 36<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| PHILLIPS EDISON & CO INC | 34.067<br>(−) | 1,233<br>(−) | 28.002<br>(−) | 1,005<br>(−) |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | −<br>(−) | −<br>(−) | 58.614<br>(−) | 2,292<br>(−) |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 47.357<br>(−) | 804<br>(−) | 39.942<br>(−) | 667<br>(−) |
| MODIV INC | 3.617<br>(−) | 60<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 1.5<br>(−) | 38<br>(−) | 5.109<br>(−) | 125<br>(−) |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD | 211.1<br>(−) | 124<br>(△9) | 110<br>(−) | 62<br>(−) |
| LINEAGE INC | 38.103<br>(−) | 2,991<br>(−) | 11.953<br>(−) | 753<br>(−) |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 67.856<br>(−) | 1,866<br>(−) | 23.652<br>(−) | 698<br>(−) |
| FRONTVIEW REIT INC | 6.654<br>(−) | 89<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| MILLROSE PROPERTIES INC | 64.904<br>(−) | 1,642<br>(−) | 11.749<br>(−) | 302<br>(−) |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES | 2.065<br>(−) | 66<br>(−) | 1.904<br>(−) | 59<br>(−) |
| PARAMOUNT GROUP INC | 20.252<br>(−) | 100<br>(−) | 2<br>(−) | 9<br>(−) |
| SILA REALTY TRUST INC | 30.377<br>(−) | 747<br>(−) | 6.791<br>(−) | 178<br>(−) |
| CURBLINE PROPERTIES CORP | 16.282<br>(38.582) | 386<br>(−) | 13.851<br>(−) | 330<br>(−) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 27.989<br>(−) | 581<br>(−) | 20.894<br>(−) | 412<br>(−) |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 14.363<br>(△23.495) | 203<br>(−) | 12.556<br>(−) | 143<br>(−) |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 22.284<br>(−) | 304<br>(−) | 19.97<br>(−) | 241<br>(−) |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC | 42.669<br>(−) | 224<br>(−) | 28.348<br>(−) | 137<br>(−) |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 3.246<br>(−) | 132<br>(−) | 2.741<br>(−) | 112<br>(−) |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST | 15.496<br>(−) | 644<br>(−) | 13.156<br>(−) | 527<br>(−) |

| | 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 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 5.166<br>(−) | 93<br>(−) | 3.269<br>(−) | 53<br>(−) |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 52.437<br>(−) | 725<br>(−) | 45.206<br>(−) | 592<br>(−) |
| GLOBAL NET LEASE INC | 43.767<br>(−) | 335<br>(−) | 36.593<br>(−) | 287<br>(−) |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST | −<br>(1.299) | −<br>(6) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| CLIPPER REALTY INC | −<br>(−) | −<br>(−) | 5.086<br>(−) | 25<br>(−) |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 40.377<br>(−) | 535<br>(−) | 35.909<br>(−) | 436<br>(−) |
| VICI PROPERTIES INC | 291.947<br>(−) | 9,187<br>(−) | 245.783<br>(−) | 7,786<br>(−) |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | 25.686<br>(−) | 720<br>(−) | 19.209<br>(−) | 537<br>(−) |
| **カナダ** | 千口 | 千カナダ・ドル | 千口 | 千カナダ・ドル |
| SMARTCENTRES REIT | 17.913<br>(−) | 445<br>(−) | 16.024<br>(−) | 401<br>(−) |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | 21.977<br>(−) | 1,000<br>(−) | 20.699<br>(−) | 935<br>(−) |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | 30.315<br>(−) | 298<br>(−) | 22.708<br>(−) | 220<br>(−) |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 31.493<br>(−) | 529<br>(−) | 27.833<br>(−) | 467<br>(−) |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 42.219<br>(−) | 760<br>(−) | 38.025<br>(−) | 683<br>(−) |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 21.247<br>(−) | 350<br>(−) | 16.945<br>(−) | 283<br>(−) |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 6.805<br>(−) | 506<br>(−) | 5.908<br>(−) | 446<br>(−) |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | 12.3<br>(−) | 177<br>(−) | 12.862<br>(−) | 182<br>(−) |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 27.291<br>(−) | 322<br>(−) | 21.252<br>(−) | 234<br>(−) |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 22.539<br>(−) | 111<br>(−) | 16.369<br>(−) | 77<br>(−) |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 1.515<br>(−) | 25<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | 29.88<br>(−) | 359<br>(−) | 25.124<br>(−) | 305<br>(−) |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | −<br>(−) | −<br>(−) | 15.423<br>(−) | 54<br>(−) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2.224<br>(△13.116) | 159<br>(−) | 1.45<br>(−) | 107<br>(−) |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | −<br>(−) | −<br>(−) | 3.727<br>(−) | 48<br>(−) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **カナダ** | 千口 | 千カナダ・ドル | 千口 | 千カナダ・ドル |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 54.181<br>(−) | 776<br>(−) | 45.151<br>(−) | 640<br>(−) |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4.763<br>(−) | 64<br>(−) | 1.963<br>(−) | 28<br>(−) |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11.349<br>(−) | 169<br>(−) | 8.846<br>(−) | 124<br>(−) |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | −<br>(−) | −<br>(−) | 9.891<br>(−) | 56<br>(−) |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | −<br>(−) | −<br>(−) | 8.104<br>(−) | 151<br>(−) |
| PRIMARIS REIT | 9.073<br>(−) | 134<br>(−) | 6.005<br>(−) | 86<br>(−) |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 6.095<br>(13.116) | 420<br>(−) | 5.89<br>(−) | 393<br>(−) |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 19.109<br>(−) | 356<br>(−) | 17.633<br>(−) | 327<br>(−) |
| **オーストラリア** | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千口 | 千オーストラリア・ドル |
| BWP TRUST | 114.333<br>(−) | 405<br>(−) | 79.523<br>(−) | 276<br>(−) |
| MIRVAC GROUP | 1,100.632<br>(−) | 2,340<br>(−) | 966.672<br>(−) | 2,037<br>(−) |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 411.021<br>(−) | 161<br>(−) | 284.549<br>(−) | 97<br>(−) |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 133.446<br>(−) | 474<br>(−) | 102.76<br>(−) | 352<br>(−) |
| GPT GROUP | 564.705<br>(−) | 2,594<br>(−) | 487.841<br>(−) | 2,221<br>(−) |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 214.241<br>(−) | 372<br>(−) | 184.857<br>(−) | 295<br>(−) |
| ABACUS GROUP | 151.328<br>(−) | 185<br>(−) | 126.021<br>(−) | 142<br>(−) |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 43.78<br>(−) | 112<br>(−) | 29.887<br>(−) | 73<br>(−) |
| STOCKLAND | 681.217<br>(−) | 3,410<br>(−) | 582.604<br>(−) | 2,863<br>(−) |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 77.173<br>(−) | 403<br>(−) | 61.46<br>(−) | 316<br>(−) |
| DEXUS | 324.893<br>(−) | 2,341<br>(−) | 289.326<br>(−) | 2,067<br>(−) |
| GOODMAN GROUP | 648.067<br>(−) | 21,943<br>(−) | 454.26<br>(−) | 14,462<br>(−) |
| VICINITY CENTRES | 1,033.272<br>(−) | 2,257<br>(−) | 901.659<br>(−) | 1,953<br>(−) |
| CHARTER HALL GROUP | 123.526<br>(−) | 1,883<br>(−) | 107.979<br>(−) | 1,650<br>(−) |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 99.333<br>(−) | 244<br>(−) | 93.266<br>(−) | 211<br>(−) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **オーストラリア** | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千口 | 千オーストラリア・ドル |
| REGION GROUP | 196.645<br>(−) | 441<br>(−) | 160.826<br>(−) | 353<br>(−) |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 102.026<br>(−) | 308<br>(−) | 70.073<br>(−) | 203<br>(−) |
| ARENA REIT | 116.482<br>(−) | 458<br>(−) | 98.972<br>(−) | 362<br>(−) |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 132.692<br>(−) | 501<br>(−) | 116.508<br>(−) | 430<br>(−) |
| NATIONAL STORAGE REIT | 398.406<br>(−) | 952<br>(−) | 302.185<br>(−) | 684<br>(−) |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | −<br>(−) | −<br>(−) | 85.857<br>(−) | 321<br>(−) |
| GDI PROPERTY GROUP | −<br>(−) | −<br>(−) | 222.442<br>(−) | 139<br>(−) |
| RURAL FUNDS GROUP | 18.897<br>(−) | 38<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| SCENTRE GROUP | 1,512.501<br>(−) | 5,224<br>(−) | 1,323.021<br>(−) | 4,520<br>(−) |
| HMC CAPITAL LTD | 19.198<br>(−) | 150<br>(−) | 116.34<br>(−) | 907<br>(−) |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 426.042<br>(−) | 534<br>(−) | 401.969<br>(−) | 489<br>(−) |
| ABACUS STORAGE KING | 26.931<br>(−) | 40<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| DIGICO INFRASTRUCTURE REIT | 172.616<br>(−) | 652<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| WAYPOINT REIT LTD | 157.866<br>(−) | 402<br>(−) | 135.2<br>(−) | 335<br>(−) |
| **香港** | 千口 | 千香港・ドル | 千口 | 千香港・ドル |
| LINK REIT | 684.2<br>(−) | 24,880<br>(−) | 594.6<br>(−) | 21,681<br>(−) |
| PROSPERITY REIT | −<br>(−) | −<br>(−) | 538<br>(−) | 703<br>(−) |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 240<br>(−) | 234<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| CHAMPION REIT | 541<br>(−) | 1,031<br>(−) | 397<br>(−) | 759<br>(−) |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | −<br>(−) | −<br>(−) | 97<br>(−) | 204<br>(−) |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 417<br>(−) | 1,757<br>(−) | 305<br>(−) | 1,241<br>(−) |
| **シンガポール** | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千口 | 千シンガポール・ドル |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,847.9<br>(−) | 3,784<br>(△5) | 1,425.7<br>(−) | 2,951<br>(−) |
| CAPLAND ASCENDAS REIT | 1,037.5<br>(−) | 2,761<br>(△41) | 911.9<br>(−) | 2,446<br>(−) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **シンガポール** | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千口 | 千シンガポール・ドル |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 460.5<br>(−) | 529<br>(−) | 406.3<br>(−) | 484<br>(−) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 988.8<br>(−) | 1,251<br>(△48) | 869.7<br>(−) | 1,119<br>(−) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 541.9<br>(−) | 268<br>(−) | 439.7<br>(−) | 211<br>(−) |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 442.5<br>(−) | 386<br>(△37) | 275.5<br>(−) | 239<br>(−) |
| KEPPEL REIT | 570.4<br>(−) | 501<br>(−) | 379.9<br>(−) | 332<br>(−) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 257.9<br>(−) | 569<br>(−) | 116.2<br>(−) | 257<br>(−) |
| ESR REIT | 900.3<br>(△2,268.126) | 364<br>(△3) | 754.8<br>(−) | 268<br>(−) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 43.7<br>(−) | 42<br>(△2) | 25.7<br>(−) | 24<br>(−) |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 370.6<br>(−) | 261<br>(−) | 255.1<br>(−) | 177<br>(−) |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | 258.5<br>(−) | 330<br>(△4) | 266.1<br>(−) | 338<br>(−) |
| PARKWAY LIFE REIT | 70.3<br>(−) | 268<br>(△5) | 46.1<br>(−) | 176<br>(−) |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 631.3<br>(−) | 1,374<br>(△2) | 565.8<br>(−) | 1,218<br>(−) |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | 655.4<br>(−) | 818<br>(△9) | 596<br>(−) | 731<br>(−) |
| PARAGON REIT | 144.8<br>(−) | 125<br>(△9) | 631.9<br>(−) | 545<br>(−) |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | −<br>(−) | −<br>(△3) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,431.8<br>(−) | 456<br>(△2) | 350<br>(−) | 97<br>(−) |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 543.5<br>(−) | 285<br>(−) | 514.1<br>(−) | 255<br>(−) |
| KEPPEL DC REIT | 607.9<br>(−) | 1,324<br>(△11) | 326.3<br>(−) | 691<br>(−) |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 865.8<br>(−) | 821<br>(△36) | 762.5<br>(−) | 707<br>(−) |
| **ニュージーランド** | 千口 | 千ニュージーランド・ドル | 千口 | 千ニュージーランド・ドル |
| PRECINCT PROPERTIES | 53.021<br>(−) | 68<br>(−) | 682.787<br>(−) | 842<br>(−) |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 261.648<br>(−) | 533<br>(−) | 230.089<br>(−) | 452<br>(−) |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 195.651<br>(−) | 177<br>(−) | 837.488<br>(−) | 746<br>(−) |
| ARGOSY PROPERTY LTD | −<br>(−) | −<br>(−) | 365.062<br>(−) | 383<br>(−) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **イギリス** | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千口 | 千イギリス・ポンド |
| BRITISH LAND CO PLC | 307.938<br>(−) | 1,223<br>(−) | 243.714<br>(−) | 939<br>(−) |
| DERWENT LONDON PLC | 28.973<br>(−) | 612<br>(−) | 24.776<br>(−) | 495<br>(−) |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 52.191<br>(−) | 581<br>(−) | 44.819<br>(−) | 464<br>(−) |
| HAMMERSON PLC | 596.478<br>(△1,651.85) | 352<br>(−) | 305.931<br>(−) | 223<br>(−) |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 218.197<br>(−) | 1,308<br>(−) | 191.127<br>(−) | 1,123<br>(−) |
| WORKSPACE GROUP PLC | 32.073<br>(−) | 174<br>(−) | 24.551<br>(−) | 117<br>(−) |
| UNITE GROUP PLC | 141.19<br>(−) | 1,268<br>(−) | 117.07<br>(−) | 1,027<br>(−) |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 270.414<br>(−) | 263<br>(−) | 221.761<br>(−) | 210<br>(−) |
| SEGRO PLC | 402.778<br>(−) | 3,127<br>(−) | 346.21<br>(−) | 2,617<br>(−) |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 87.456<br>(−) | 289<br>(−) | 78.877<br>(−) | 255<br>(−) |
| ASSURA PLC | 562.594<br>(−) | 244<br>(−) | 426.406<br>(−) | 191<br>(−) |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI | 41.106<br>(−) | 20<br>(△89) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| HELICAL PLC | 38.078<br>(−) | 80<br>(−) | 30.179<br>(−) | 57<br>(−) |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 120.402<br>(−) | 89<br>(−) | 131.069<br>(−) | 95<br>(−) |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | 50.446<br>(−) | 386<br>(−) | 43.791<br>(−) | 315<br>(−) |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 621.175<br>(−) | 1,200<br>(−) | 534.671<br>(−) | 1,015<br>(−) |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 143.555<br>(−) | 129<br>(−) | 433.505<br>(−) | 404<br>(−) |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 600.812<br>(−) | 814<br>(−) | 524.917<br>(−) | 684<br>(−) |
| NEWRIVER REIT PLC | 109.861<br>(−) | 83<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| PRS REIT PLC/THE | 122.665<br>(−) | 136<br>(−) | 90.412<br>(−) | 103<br>(−) |
| CLS HOLDINGS PLC | 34.892<br>(−) | 33<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| SOCIAL HOUSING REIT PLC | 38.996<br>(−) | 22<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 475.419<br>(−) | 355<br>(−) | 437.485<br>(−) | 325<br>(−) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **イギリス** | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千口 | 千イギリス・ポンド |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 739.172<br>(−) | 1,101<br>(−) | 559.959<br>(−) | 824<br>(−) |
| CUSTODIAN REIT PLC | 19.054<br>(−) | 15<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 89.437<br>(−) | 81<br>(−) | 62.775<br>(−) | 57<br>(−) |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 113.176<br>(−) | 102<br>(−) | 57.353<br>(−) | 47<br>(−) |
| AEW UK REIT PLC | 26.078<br>(−) | 22<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| REGIONAL REIT LTD | 56.439<br>(△212.903) | 77<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 122.879<br>(−) | 158<br>(−) | 121.894<br>(−) | 167<br>(−) |
| CARE REIT PLC | 40<br>(−) | 34<br>(−) | 209.602<br>(−) | 226<br>(−) |
| **イスラエル** | 千口 | 千イスラエル・シュケル | 千口 | 千イスラエル・シュケル |
| REIT 1 LTD | 38.616<br>(−) | 686<br>(−) | 26.71<br>(−) | 460<br>(−) |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 11.037<br>(−) | 76<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 279.451<br>(−) | 519<br>(−) | 194.086<br>(−) | 350<br>(−) |
| **韓国** | 千口 | 千韓国・ウォン | 千口 | 千韓国・ウォン |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 67.558<br>(−) | 402,425<br>(−) | 42.662<br>(−) | 247,646<br>(−) |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 21.537<br>(−) | 119,412<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| LOTTE REIT CO LTD | 58.779<br>(−) | 205,903<br>(△1,082) | 43.085<br>(−) | 150,779<br>(−) |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | 53.697<br>(−) | 248,581<br>(−) | 51.452<br>(−) | 235,069<br>(−) |
| JR REIT XXVII | 21.638<br>(−) | 67,240<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| SK REITS CO LTD | 17.826<br>(−) | 88,164<br>(△3,199) | 9.358<br>(−) | 46,260<br>(−) |
| LOTTE REIT CO LTD-RTS | −<br>(9.139) | −<br>(16) | 9.139<br>(−) | 686<br>(−) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS | −<br>(16.132) | −<br>(−) | 16.132<br>(−) | 2,392<br>(−) |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 29.722<br>(−) | 146,307<br>(−) | 20.162<br>(−) | 92,030<br>(−) |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | −<br>(−) | −<br>(−) | 23.341<br>(−) | 83,146<br>(−) |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | 6.161<br>(−) | 22,924<br>(−) | 27.734<br>(−) | 99,743<br>(−) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **韓国** | 千口 | 千韓国・ウォン | 千口 | 千韓国・ウォン |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT CO LTD-RTS | – | – | 2.927 | 994 |
| | (2.927) | (–) | (–) | (–) |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD-RTS | – | – | 11.39 | 215 |
| | (11.39) | (–) | (–) | (–) |
| **ユーロ（ガーンジィ）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | 8.162 | 300 | 8.014 | 276 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| **ユーロ（シンガポール）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST | – | – | – | – |
| | (138.04) | (–) | (–) | (–) |
| STONEWEG EUROPEAN REIT | 83.6 | 131 | 75.4 | 114 |
| | (△138.04) | (△12) | (–) | (–) |
| **ユーロ（アイルランド）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC | 103.308 | 96 | 34.658 | 32 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| **ユーロ（オランダ）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| VASTNED RETAIL | 2.267 | 53 | 9.621 | 228 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| WERELDHAVE NV | 11.442 | 172 | 8.755 | 135 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| NSI NV | 0.438 | 9 | – | – |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 9.884 | 237 | 9.349 | 230 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| **ユーロ（ベルギー）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| COFINIMMO SA | 11.329 | 714 | 9.344 | 583 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| RETAIL ESTATES | 3.726 | 231 | 3.184 | 195 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| WAREHOUSES DE PAUW | 48.752 | 1,091 | 41.171 | 921 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| MONTEA SCA | 5.337 | 379 | 2.932 | 209 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| AEDIFICA | 13.067 | 795 | 11.101 | 676 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| CARE PROPERTY INVEST NV | 7.366 | 88 | 5.731 | 67 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| MONTEA NV-RTS | – | – | 8.025 | 6 |
| | (8.025) | (–) | (–) | (–) |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 8.474 | 252 | 5.806 | 163 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| **ユーロ（フランス）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| GECINA SA | 14.471 | 1,352 | 11.978 | 1,083 |
| | (–) | (–) | (–) | (–) |
| ICADE | 6.051 | 136 | 5.467 | 117 |
| | (–) | (△14) | (–) | (–) |

| | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| **ユーロ（フランス）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| ALTAREA | 0.376<br>(−) | 40<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |
| KLEPIERRE | 77.427<br>(−) | 2,274<br>(△8) | 57.796<br>(−) | 1,705<br>(−) |
| COVIVIO | 13.266<br>(−) | 682<br>(△22) | 10.116<br>(−) | 518<br>(−) |
| MERCIALYS | 18.458<br>(−) | 200<br>(−) | 14.7<br>(−) | 169<br>(−) |
| CARMILA SA | 19.343<br>(−) | 332<br>(△29) | 13.526<br>(−) | 227<br>(−) |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 27.398<br>(−) | 1,996<br>(△151) | 23.263<br>(−) | 1,730<br>(−) |
| **ユーロ（ドイツ）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| HAMBORNER REIT AG | 9.06<br>(−) | 58<br>(−) | 4.748<br>(−) | 28<br>(−) |
| **ユーロ（スペイン）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 97.604<br>(−) | 562<br>(−) | 64.029<br>(−) | 358<br>(−) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 4.5<br>(−) | 36<br>(−) | 23.964<br>(−) | 196<br>(−) |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 126.721<br>(−) | 1,299<br>(△33) | 84.464<br>(−) | 851<br>(−) |
| **ユーロ（イタリア）** | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 4.648<br>(−) | 14<br>(−) | −<br>(−) | −<br>(−) |

（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 |
| 外国 | 不動産投信指数先物取引 | 百万円<br>19,721 | 百万円<br>19,373 | 百万円<br>－ | 百万円<br>－ |

（注）金額は受渡代金です。

## ■利害関係人との取引状況等（2024年６月25日から2025年６月23日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

(1) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| **不動産ファンド** | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| **(アメリカ)** | | | | | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 291.8 | 291.8 | 55 | 8,165 | 0.0 |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 72.7 | 72.7 | 0 | 0 | 0.0 |
| PRIME US REIT | 349.36 | 349.36 | 48 | 7,114 | 0.0 |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE | 299.8 | 400.9 | 198 | 29,072 | 0.0 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME | 839 | 839 | 52 | 7,620 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 63.579 | 68.164 | 4,864 | 712,702 | 0.7 |
| ALEXANDER'S INC. | 0.86 | 0.977 | 220 | 32,295 | 0.0 |
| BXP INC | 58.553 | 64.89 | 4,637 | 679,421 | 0.7 |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC | 99.906 | 128.127 | 4,734 | 693,573 | 0.7 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO-A | 53.077 | 61.615 | 522 | 76,545 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 40.554 | 48.616 | 3,628 | 531,533 | 0.5 |
| BRT APARTMENTS CORP | 5.643 | 3.973 | 62 | 9,196 | 0.0 |
| SL GREEN | 26.178 | 31.741 | 2,041 | 299,138 | 0.3 |
| EPR PROPERTIES | 30.568 | 33.562 | 1,956 | 286,651 | 0.3 |
| PROLOGIS INC | 373.989 | 410.83 | 43,420 | 6,361,121 | 6.6 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 57.357 | 62.829 | 13,006 | 1,905,412 | 2.0 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 118.308 | 128.709 | 1,124 | 164,800 | 0.2 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 43.034 | 47.084 | 5,442 | 797,317 | 0.8 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 33.67 | 34.495 | 518 | 75,954 | 0.1 |
| EQUINIX INC | 38.337 | 43.308 | 38,235 | 5,601,539 | 5.8 |
| NNN REIT INC | 74.063 | 83.527 | 3,549 | 520,059 | 0.5 |
| CTO REALTY GROUTH INC | 7.42 | 12.508 | 225 | 33,056 | 0.0 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 61.428 | 74.397 | 2,268 | 332,315 | 0.3 |
| SITE CENTERS CORP | 72.757 | 22.861 | 285 | 41,864 | 0.0 |
| SAFEHOLD INC | 17.116 | 21.139 | 324 | 47,505 | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 11.922 | – | – | – | – |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 25.937 | 28.506 | 8,105 | 1,187,440 | 1.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 139.306 | 151.08 | 10,423 | 1,526,970 | 1.6 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 30.104 | 34.332 | 3,278 | 480,229 | 0.5 |
| FIRST INDUSTRIAL RT | 53.458 | 58.9 | 2,894 | 424,021 | 0.4 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 284.288 | 308.726 | 5,279 | 773,404 | 0.8 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 43.229 | – | – | – | – |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 42.731 | 47.549 | 1,500 | 219,775 | 0.2 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 69.695 | 69.326 | 168 | 24,679 | 0.0 |
| WELLTOWER INC | 241.529 | 275.054 | 41,599 | 6,094,277 | 6.3 |
| EAST GROUP | 19.335 | 23.147 | 3,974 | 582,240 | 0.6 |
| KIMCO REALTY | 270.439 | 300.039 | 6,267 | 918,234 | 0.9 |
| KILROY REALTY CORP | 43.143 | 47.021 | 1,649 | 241,651 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 17.329 | 20.891 | 730 | 107,026 | 0.1 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 89.231 | 102.322 | 382 | 56,063 | 0.1 |
| LAMAR ADVERTISING CO | – | 39.221 | 4,710 | 690,022 | 0.7 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 65.638 | 82.79 | 362 | 53,123 | 0.1 |
| IRON MOUNTAIN INC | 118.409 | 130.628 | 13,236 | 1,939,152 | 2.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| THE MACERICH COMPANY | 87.151 | 113.079 | 1,801 | 263,897 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 75.334 | 84.315 | 5,294 | 775,714 | 0.8 |
| ACADIA REALTY TRUST | 42.601 | 57.982 | 1,102 | 161,562 | 0.2 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 284.799 | 307.135 | 4,812 | 705,075 | 0.7 |
| MID AMERICA | 47.191 | 51.653 | 7,673 | 1,124,177 | 1.2 |
| NATIONAL HEALTH INVS INC | 17.553 | 20.673 | 1,463 | 214,333 | 0.2 |
| CENTERSPACE | 6.258 | 7.034 | 438 | 64,209 | 0.1 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 5.83 | 7.397 | 184 | 27,026 | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | 19.838 | 21.757 | 623 | 91,350 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 351.747 | 399.829 | 22,862 | 3,349,315 | 3.5 |
| REGENCY CENTERS CORP | 66.651 | 72.026 | 5,123 | 750,655 | 0.8 |
| UDR INC | 122.38 | 132.882 | 5,453 | 798,934 | 0.8 |
| COPT DEFENCE PROPERTIES | 46.331 | 49.658 | 1,416 | 207,552 | 0.2 |
| SAUL CENTERS INC | 4.875 | 5.7 | 196 | 28,859 | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 131.66 | 135.719 | 21,344 | 3,126,973 | 3.2 |
| PUBLIC STORAGE | 63.885 | 69.903 | 20,277 | 2,970,648 | 3.1 |
| SUN COMMUNITIES INC | 50.345 | 53.271 | 6,718 | 984,187 | 1.0 |
| TANGER INC | 44.528 | 50.107 | 1,504 | 220,440 | 0.2 |
| UMH PROPERTIES INC | 26.733 | 34.204 | 572 | 83,882 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 15.124 | 21.208 | 304 | 44,678 | 0.0 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 4.814 | 5.726 | 237 | 34,821 | 0.0 |
| VENTAS INC | 163.523 | 199.808 | 12,478 | 1,828,028 | 1.9 |
| VORNADO REALTY TRUST | 64.543 | 73.855 | 2,977 | 436,144 | 0.5 |
| ELME COMMUNITIES | 36.795 | 41.034 | 648 | 94,981 | 0.1 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 88.708 | 97.501 | 2,211 | 323,958 | 0.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 85.525 | 93.954 | 13,723 | 2,010,545 | 2.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 46.375 | 46.375 | 78 | 11,481 | 0.0 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 82.956 | 88.867 | 773 | 113,265 | 0.1 |
| CUBESMART | 91.225 | 100.828 | 4,272 | 625,860 | 0.6 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 131.081 | 140.164 | 24,587 | 3,602,078 | 3.7 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 85.756 | 89.393 | 681 | 99,792 | 0.1 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST | 242.489 | 264.632 | 1,174 | 172,132 | 0.2 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 67.612 | 72.794 | 1,083 | 158,685 | 0.2 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | 52.599 | – | – | – | – |
| PIEDMONT REALTY TRUST INC | 52.568 | 59.203 | 438 | 64,181 | 0.1 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 41.424 | 55.567 | 270 | 39,644 | 0.0 |
| TERRENO REALTY CORP | 39.063 | 45.746 | 2,642 | 387,162 | 0.4 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 19.557 | 22.472 | 454 | 66,600 | 0.1 |
| RLJ LODGING TRUST | 62.698 | 64.516 | 463 | 67,956 | 0.1 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 107.852 | 115.953 | 1,946 | 285,213 | 0.3 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 48.508 | 55.793 | 530 | 77,731 | 0.1 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 23.664 | – | – | – | – |
| CHATHAM LODGING TRUST | 19.711 | 25.414 | 175 | 25,764 | 0.0 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 93.511 | 104.832 | 1,913 | 280,281 | 0.3 |
| WHITESTONE REIT | 18.939 | 18.939 | 232 | 34,071 | 0.0 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 52.743 | 72.334 | 204 | 29,989 | 0.0 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| STAG INDUSTRIAL INC | 73.55 | 83.01 | 3,019 | 442,294 | 0.5 |
| WP CAREY INC | 88.393 | 96.62 | 6,125 | 897,416 | 0.9 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 30.467 | 31.082 | 556 | 81,598 | 0.1 |
| GLADSTONE LAND CORP | 13.328 | 14.586 | 148 | 21,753 | 0.0 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 152.91 | 157.368 | 2,388 | 349,965 | 0.4 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 24.192 | 26.626 | 2,630 | 385,351 | 0.4 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 25.65 | 37.788 | 265 | 38,862 | 0.0 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 87.811 | 104.542 | 3,821 | 559,777 | 0.6 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT | 129.991 | 139.99 | 5,105 | 747,946 | 0.8 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 90.754 | 102.154 | 1,811 | 265,339 | 0.3 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | 11.565 | 12.196 | 707 | 103,700 | 0.1 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 34.53 | 32.343 | 577 | 84,672 | 0.1 |
| INVITATION HOMES INC | 232.585 | 251.759 | 8,491 | 1,244,053 | 1.3 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 51.841 | 64.413 | 552 | 80,870 | 0.1 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 15.197 | 17.802 | 292 | 42,849 | 0.0 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | 70.815 | 87.446 | 2,828 | 414,430 | 0.4 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES | 26.881 | 26.881 | 126 | 18,508 | 0.0 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 109.672 | 121.114 | 5,653 | 828,252 | 0.9 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 121.708 | 136.252 | 3,542 | 518,983 | 0.5 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 22.683 | 22.683 | 56 | 8,340 | 0.0 |
| POSTAL REALTY TRUST INC | 7.238 | 9.772 | 147 | 21,574 | 0.0 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 4.384 | 4.384 | 65 | 9,633 | 0.0 |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 28.156 | 33.614 | 936 | 137,145 | 0.1 |
| OUTFRONT MEDIA INC | – | 59.839 | 944 | 138,334 | 0.1 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 16.653 | 18.774 | 211 | 30,996 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | 17.231 | 17.231 | 95 | 14,060 | 0.0 |
| ORION PROPERTIES INC | 20.368 | 20.368 | 41 | 6,027 | 0.0 |
| NETSTREIT CORP | 28.72 | 34.924 | 582 | 85,392 | 0.1 |
| CARETRUST REIT INC | 57.387 | 84.868 | 2,550 | 373,616 | 0.4 |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 13.637 | 16.612 | 221 | 32,416 | 0.0 |
| PHILLIPS EDISON & CO INC | 49.443 | 55.508 | 1,964 | 287,870 | 0.3 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 58.614 | – | – | – | – |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 75.796 | 83.211 | 1,355 | 198,581 | 0.2 |
| MODIV INC | – | 3.617 | 52 | 7,731 | 0.0 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 10.705 | 7.096 | 180 | 26,498 | 0.0 |
| LINEAGE INC | – | 26.15 | 1,170 | 171,474 | 0.2 |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 26.412 | 70.616 | 2,532 | 371,083 | 0.4 |
| FRONTVIEW REIT INC | – | 6.654 | 77 | 11,288 | 0.0 |
| MILLROSE PROPERTIES INC | – | 53.155 | 1,511 | 221,390 | 0.2 |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES | 5.763 | 5.924 | 197 | 28,969 | 0.0 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 63.997 | 82.249 | 522 | 76,514 | 0.1 |
| SILA REALTY TRUST INC | – | 23.586 | 571 | 83,688 | 0.1 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 26.662 | 26.662 | 165 | 24,178 | 0.0 |
| CURBLINE PROPERTIES CORP | – | 41.013 | 939 | 137,652 | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 47.399 | 54.494 | 1,012 | 148,331 | 0.2 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | 40.047 | 18.359 | 414 | 60,677 | 0.1 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| **(アメリカ)** | | 千口 | 千口 | 千アメリカ・ドル | 千円 | % |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | | 41.188 | 43.502 | 533 | 78,133 | 0.1 |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING I | | 99.47 | 113.791 | 464 | 68,015 | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | | 9.712 | 10.217 | 342 | 50,202 | 0.1 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | | 28.153 | 30.493 | 988 | 144,782 | 0.1 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | | 9.794 | 11.691 | 195 | 28,636 | 0.0 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | | 91.043 | 98.274 | 1,140 | 167,150 | 0.2 |
| GLOBAL NET LEASE INC | | 77.69 | 84.864 | 633 | 92,871 | 0.1 |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE | | 15.267 | 16.566 | 64 | 9,392 | 0.0 |
| CLIPPER REALTY INC | | 5.086 | – | – | – | – |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | | 85.07 | 89.538 | 910 | 133,403 | 0.1 |
| VICI PROPERTIES INC | | 421.682 | 467.846 | 15,097 | 2,211,767 | 2.3 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC | | 37.579 | 44.056 | 1,203 | 176,328 | 0.2 |
| 小計 | 口数・金額 | 10,964.702 | 12,144.049 | 508,101 | 74,436,926 | – |
| | 銘柄数<比率> | 139銘柄<77.1%> | 141銘柄<76.9%> | – | – | 76.9 |
| **(カナダ)** | | 千口 | 千口 | 千カナダ・ドル | 千円 | % |
| SMARTCENTRES REIT | | 28.245 | 30.134 | 762 | 81,243 | 0.1 |
| CANADIAN APT PPTYS REIT | | 33.079 | 34.357 | 1,502 | 159,978 | 0.2 |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT | | 52.945 | 60.552 | 660 | 70,343 | 0.1 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | | 41.415 | 45.075 | 795 | 84,712 | 0.1 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST | | 59.372 | 63.566 | 1,118 | 119,125 | 0.1 |
| ALLIED PROPERTIES REIT | | 25.873 | 30.175 | 510 | 54,396 | 0.1 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | | 2.585 | 2.585 | 42 | 4,514 | 0.0 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | | 9.777 | 10.674 | 749 | 79,821 | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | | 21.895 | 21.895 | 165 | 17,625 | 0.0 |
| CROMBIE REAL ESTATE INV | | 21.726 | 21.164 | 311 | 33,217 | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | | 27.652 | 33.691 | 458 | 48,788 | 0.1 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES | | 51.343 | 57.513 | 285 | 30,374 | 0.0 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT | | 6.485 | 8 | 146 | 15,546 | 0.0 |
| DREAM INDUSTRIAL REIT | | 53.218 | 57.974 | 683 | 72,780 | 0.1 |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 15.423 | – | – | – | – |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | | 12.342 | – | – | – | – |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | | 3.727 | – | – | – | – |
| CHOICE PROPERTIES REIT | | 64.451 | 73.481 | 1,075 | 114,547 | 0.1 |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | | 7.386 | 10.186 | 148 | 15,770 | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 22.105 | 24.608 | 390 | 41,583 | 0.0 |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 9.891 | – | – | – | – |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 8.104 | – | – | – | – |
| SLATE GROCERY REIT | | 12.169 | 12.169 | 175 | 18,645 | 0.0 |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | | 14.455 | 14.455 | 107 | 11,451 | 0.0 |
| PRIMARIS REIT | | 20.442 | 23.51 | 343 | 36,573 | 0.0 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | | – | 13.321 | 919 | 97,870 | 0.1 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV | | 23.694 | 25.17 | 491 | 52,315 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 649.799 | 674.255 | 11,844 | 1,261,227 | – |
| | 銘柄数<比率> | 26銘柄<1.3%> | 22銘柄<1.3%> | – | – | 1.3 |
| **(オーストラリア)** | | 千口 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % |
| BWP TRUST | | 222.212 | 257.022 | 920 | 86,713 | 0.1 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| **(オーストラリア)** | 千口 | 千口 | 千オーストラリア・ドル | 千円 | % |
| MIRVAC GROUP | 1,620.072 | 1,754.032 | 3,964 | 373,577 | 0.4 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 520.52 | 646.992 | 223 | 21,035 | 0.0 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 204.746 | 235.432 | 944 | 88,970 | 0.1 |
| GPT GROUP | 774.713 | 851.577 | 4,291 | 404,473 | 0.4 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 341.038 | 370.422 | 642 | 60,566 | 0.1 |
| ABACUS GROUP | 168.642 | 193.949 | 235 | 22,207 | 0.0 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU | 137.586 | 151.479 | 443 | 41,826 | 0.0 |
| STOCKLAND | 964.954 | 1,063.567 | 5,955 | 561,291 | 0.6 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 157.084 | 172.797 | 953 | 89,889 | 0.1 |
| DEXUS | 441.787 | 477.354 | 3,331 | 314,001 | 0.3 |
| GOODMAN GROUP | 704.819 | 898.626 | 31,065 | 2,927,612 | 3.0 |
| VICINITY CENTRES | 1,588.997 | 1,720.61 | 4,335 | 408,618 | 0.4 |
| CHARTER HALL GROUP | 194.616 | 210.163 | 4,110 | 387,400 | 0.4 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 101.9 | 107.967 | 272 | 25,640 | 0.0 |
| REGION GROUP | 466.538 | 502.357 | 1,185 | 111,727 | 0.1 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 213.14 | 245.093 | 781 | 73,681 | 0.1 |
| ARENA REIT | 147.24 | 164.75 | 632 | 59,619 | 0.1 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 265.944 | 282.128 | 1,193 | 112,466 | 0.1 |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 93.159 | 93.159 | 261 | 24,669 | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 509.415 | 605.636 | 1,459 | 137,551 | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 85.857 | – | – | – | – |
| GDI PROPERTY GROUP | 222.442 | – | – | – | – |
| RURAL FUNDS GROUP | 148.357 | 167.254 | 302 | 28,529 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | 2,106.223 | 2,295.703 | 8,264 | 778,849 | 0.8 |
| HMC CAPITAL LTD | 97.142 | – | – | – | – |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 745.38 | 769.453 | 1,007 | 94,992 | 0.1 |
| HEALTHCO REIT | 202.023 | 202.023 | 152 | 14,374 | 0.0 |
| ABACUS STORAGE KING | 224.215 | 251.146 | 396 | 37,395 | 0.0 |
| CENTURIA OFFICE REIT | 185.985 | 185.985 | 214 | 20,243 | 0.0 |
| DIGICO INFRASTRUCTURE REIT | – | 172.616 | 650 | 61,327 | 0.1 |
| WAYPOINT REIT LTD | 266.477 | 289.143 | 740 | 69,757 | 0.1 |
| 小計 口数・金額 | 14,123.223 | 15,338.435 | 78,936 | 7,439,011 | – |
| 小計 銘柄数<比率> | 31銘柄<7.6%> | 29銘柄<7.7%> | – | – | 7.7 |
| **(香港)** | 千口 | 千口 | 千香港・ドル | 千円 | % |
| LINK REIT | 1,047.12 | 1,136.72 | 47,230 | 881,325 | 0.9 |
| PROSPERITY REIT | 538 | – | – | – | – |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR | 908 | 1,148 | 895 | 16,708 | 0.0 |
| CHAMPION REIT | 735.07 | 879.07 | 1,784 | 33,298 | 0.0 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | 439 | 342 | 752 | 14,039 | 0.0 |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T | 591 | 703 | 3,339 | 62,310 | 0.1 |
| 小計 口数・金額 | 4,258.19 | 4,208.79 | 54,002 | 1,007,683 | – |
| 小計 銘柄数<比率> | 6銘柄<0.9%> | 5銘柄<1.0%> | – | – | 1.0 |
| **(シンガポール)** | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 2,061.809 | 2,484.009 | 5,390 | 612,391 | 0.6 |
| CAPLAND ASCENDAS REIT | 1,441.46 | 1,567.06 | 4,074 | 462,887 | 0.5 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR | 898.09 | 952.29 | 1,066 | 121,172 | 0.1 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (シンガポール) | | 千口 | 千口 | 千シンガポール・ドル | 千円 | % |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 1,375.42 | 1,494.52 | 1,718 | 195,261 | 0.2 |
| STARHILL GLOBAL REIT | | 530.3 | 632.5 | 319 | 36,288 | 0.0 |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | | 997.316 | 1,164.316 | 995 | 113,097 | 0.1 |
| KEPPEL REIT | | 910 | 1,100.5 | 968 | 110,024 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | | 472.4 | 614.1 | 1,369 | 155,582 | 0.2 |
| ESR REIT | | 2,395.84 | 273.214 | 650 | 73,874 | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | | 277.2 | 295.2 | 230 | 26,159 | 0.0 |
| CAPITALAND CHINA TRUST | | 449.78 | 565.28 | 378 | 43,028 | 0.0 |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD | | 273.095 | 265.495 | 342 | 38,910 | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REIT | | 163.1 | 187.3 | 758 | 86,180 | 0.1 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | | 852.62 | 918.12 | 1,799 | 204,442 | 0.2 |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL | | 957 | 1,016.4 | 1,240 | 140,877 | 0.1 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | | 464.5 | 464.5 | 262 | 29,816 | 0.0 |
| PARAGON REIT | | 487.1 | – | – | – | – |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT | | 112.4 | 112.4 | 0 | 0 | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T | | 242.3 | 242.3 | 151 | 17,204 | 0.0 |
| OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | – | 1,081.8 | 313 | 35,641 | 0.0 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | | 716.6 | 746 | 376 | 42,800 | 0.0 |
| KEPPEL DC REIT | | 537.3 | 818.9 | 1,891 | 214,911 | 0.2 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T | | 1,178.864 | 1,282.164 | 1,044 | 118,718 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 17,794.494 | 18,278.368 | 25,343 | 2,879,272 | – |
| | 銘柄数<比率> | 22銘柄<2.9%> | 22銘柄<3.0%> | – | – | 3.0 |
| (ニュージーランド) | | 千口 | 千口 | 千ニュージーランド・ドル | 千円 | % |
| PRECINCT PROPERTIES | | 629.766 | – | – | – | – |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | | 431.888 | 463.447 | 915 | 79,842 | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | | 641.837 | – | – | – | – |
| ARGOSY PROPERTY LTD | | 365.062 | – | – | – | – |
| 小計 | 口数・金額 | 2,068.553 | 463.447 | 915 | 79,842 | – |
| | 銘柄数<比率> | 4銘柄<0.3%> | 1銘柄<0.1%> | – | – | 0.1 |
| (イギリス) | | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| BRITISH LAND CO PLC | | 379.583 | 443.807 | 1,703 | 334,738 | 0.3 |
| DERWENT LONDON PLC | | 45.359 | 49.556 | 1,020 | 200,618 | 0.2 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | | 79.274 | 86.646 | 880 | 173,001 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | | 1,555.881 | 194.578 | 574 | 112,803 | 0.1 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 304.255 | 331.325 | 2,070 | 406,949 | 0.4 |
| WORKSPACE GROUP PLC | | 55.71 | 63.232 | 270 | 53,122 | 0.1 |
| INTU PROPERTIES PLC | | 231.04 | 231.04 | 0 | 0 | 0.0 |
| UNITE GROUP PLC | | 160.222 | 184.342 | 1,581 | 310,826 | 0.3 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | | 535.453 | 584.106 | 604 | 118,806 | 0.1 |
| SEGRO PLC | | 540.554 | 597.122 | 4,123 | 810,394 | 0.8 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | | 164.077 | 172.656 | 608 | 119,604 | 0.1 |
| ASSURA PLC | | 1,209.341 | 1,345.529 | 672 | 132,211 | 0.1 |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI | | 134.607 | 175.713 | 8 | 1,726 | 0.0 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT | | 203.492 | 203.492 | 109 | 21,594 | 0.0 |
| HELICAL PLC | | 42.126 | 50.025 | 115 | 22,660 | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | | 233.467 | 222.8 | 178 | 35,159 | 0.0 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| **(イギリス)** | | 千口 | 千口 | 千イギリス・ポンド | 千円 | % |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD | | 87.913 | 94.568 | 635 | 124,794 | 0.1 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | | 823.481 | 909.985 | 1,839 | 361,594 | 0.4 |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU | | 289.95 | – | – | – | – |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | | 788.97 | 864.865 | 1,318 | 259,193 | 0.3 |
| WAREHOUSE REIT PLC | | 182.285 | 182.285 | 195 | 38,330 | 0.0 |
| NEWRIVER REIT PLC | | 113.885 | 223.746 | 161 | 31,746 | 0.0 |
| PRS REIT PLC/THE | | 210.972 | 243.225 | 277 | 54,490 | 0.1 |
| CLS HOLDINGS PLC | | 45.585 | 80.477 | 52 | 10,406 | 0.0 |
| SOCIAL HOUSING REIT PLC | | 117.315 | 156.311 | 109 | 21,564 | 0.0 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | | 496.398 | 534.332 | 449 | 88,310 | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | | 921.889 | 1,101.102 | 1,638 | 321,986 | 0.3 |
| CUSTODIAN REIT PLC | | 186.443 | 205.497 | 161 | 31,782 | 0.0 |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | | 252.776 | 279.438 | 289 | 56,892 | 0.1 |
| HOME REIT PLC | | 286.621 | 286.621 | 0 | 0 | 0.0 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | | 244.328 | 300.151 | 304 | 59,811 | 0.1 |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | | 147.597 | 147.597 | 64 | 12,704 | 0.0 |
| AEW UK REIT PLC | | 50.684 | 76.762 | 78 | 15,386 | 0.0 |
| REGIONAL REIT LTD | | 236.558 | 80.094 | 91 | 17,912 | 0.0 |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | | 190.244 | 191.229 | 298 | 58,625 | 0.1 |
| CARE REIT PLC | | 169.602 | – | – | – | – |
| 小計 | 口数・金額 | 11,717.937 | 10,894.254 | 22,490 | 4,419,751 | – |
| | 銘柄数<比率> | 36銘柄<4.9%> | 34銘柄<4.6%> | – | – | 4.6 |
| **(イスラエル)** | | 千口 | 千口 | 千イスラエル・シュケル | 千円 | % |
| REIT 1 LTD | | 80.765 | 92.671 | 2,028 | 85,271 | 0.1 |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | | 84.461 | 95.498 | 974 | 40,945 | 0.0 |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | | 293.689 | 379.054 | 769 | 32,329 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 458.915 | 567.223 | 3,771 | 158,546 | – |
| | 銘柄数<比率> | 3銘柄<0.1%> | 3銘柄<0.2%> | – | – | 0.2 |
| **(韓国)** | | 千口 | 千口 | 千韓国・ウォン | 千円 | % |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | | 27.173 | 52.069 | 279,610 | 29,694 | 0.0 |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | | – | 21.537 | 101,439 | 10,772 | 0.0 |
| LOTTE REIT CO LTD | | 48.275 | 63.969 | 233,806 | 24,830 | 0.0 |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | | 22.542 | 24.787 | 106,955 | 11,358 | 0.0 |
| JR REIT XXVII | | 65.671 | 87.309 | 235,734 | 25,034 | 0.0 |
| SK REITS CO LTD | | 48.785 | 57.253 | 259,069 | 27,513 | 0.0 |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | | 63.994 | 73.554 | 309,294 | 32,847 | 0.0 |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | | 23.341 | – | – | – | – |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | | 21.573 | – | – | – | – |
| 小計 | 口数・金額 | 321.354 | 380.478 | 1,525,911 | 162,051 | – |
| | 銘柄数<比率> | 8銘柄<0.2%> | 7銘柄<0.2%> | – | – | 0.2 |
| **(ユーロ…ガーンジィ)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | | 12.584 | 12.732 | 457 | 76,987 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 12.584 | 12.732 | 457 | 76,987 | – |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.1%> | 1銘柄<0.1%> | – | – | 0.1 |
| **(ユーロ…シンガポール)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST | | – | 138.04 | 209 | 35,291 | 0.0 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| **(ユーロ…シンガポール)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| STONEWEG EUROPEAN REIT | | 129.84 | – | – | – | – |
| 小計 | 口数・金額 | 129.84 | 138.04 | 209 | 35,291 | – |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.0%> | 1銘柄<0.0%> | – | – | 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 | | 175.735 | 244.385 | 257 | 43,243 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 175.735 | 244.385 | 257 | 43,243 | – |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.0%> | 1銘柄<0.0%> | – | – | 0.0 |
| **(ユーロ…オランダ)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| VASTNED RETAIL | | 7.354 | – | – | – | – |
| WERELDHAVE NV | | 13.999 | 16.686 | 282 | 47,487 | 0.0 |
| NSI NV | | 7.519 | 7.957 | 181 | 30,514 | 0.0 |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | | 17.867 | 18.402 | 476 | 80,166 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 46.739 | 43.045 | 940 | 158,168 | – |
| | 銘柄数<比率> | 4銘柄<0.2%> | 3銘柄<0.2%> | – | – | 0.2 |
| **(ユーロ…ベルギー)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| COFINIMMO SA | | 14.851 | 16.836 | 1,308 | 220,173 | 0.2 |
| RETAIL ESTATES | | 4.857 | 5.399 | 329 | 55,485 | 0.1 |
| WAREHOUSES DE PAUW | | 71.418 | 78.999 | 1,644 | 276,648 | 0.3 |
| MONTEA SCA | | 7.158 | 9.563 | 621 | 104,552 | 0.1 |
| AEDIFICA | | 19.207 | 21.173 | 1,420 | 238,963 | 0.2 |
| CARE PROPERTY INVEST NV | | 15.092 | 16.727 | 208 | 35,055 | 0.0 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | 14 | 16.668 | 528 | 88,872 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 146.583 | 165.365 | 6,062 | 1,019,751 | – |
| | 銘柄数<比率> | 7銘柄<1.0%> | 7銘柄<1.1%> | – | – | 1.1 |
| **(ユーロ…フランス)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| GECINA SA | | 20.75 | 23.243 | 2,161 | 363,580 | 0.4 |
| ICADE | | 12.549 | 13.133 | 305 | 51,336 | 0.1 |
| ALTAREA | | 1.894 | 2.27 | 226 | 38,143 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 78.795 | 98.426 | 3,322 | 558,905 | 0.6 |
| COVIVIO | | 20.325 | 23.475 | 1,206 | 202,952 | 0.2 |
| MERCIALYS | | 37.38 | 41.138 | 441 | 74,314 | 0.1 |
| CARMILA SA | | 22.407 | 28.224 | 468 | 78,804 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 41.142 | 45.277 | 3,675 | 618,233 | 0.6 |
| 小計 | 口数・金額 | 235.242 | 275.186 | 11,808 | 1,986,271 | – |
| | 銘柄数<比率> | 8銘柄<1.8%> | 8銘柄<2.1%> | – | – | 2.1 |
| **(ユーロ…ドイツ)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| HAMBORNER REIT AG | | 28.721 | 33.033 | 216 | 36,337 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 28.721 | 33.033 | 216 | 36,337 | – |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.0%> | 1銘柄<0.0%> | – | – | 0.0 |
| **(ユーロ…スペイン)** | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | 115.299 | 148.874 | 876 | 147,489 | 0.2 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | 19.464 | – | – | – | – |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 134.73 | 176.987 | 1,932 | 325,079 | 0.3 |
| 小計 | 口数・金額 | 269.493 | 325.861 | 2,809 | 472,568 | – |
| | 銘柄数<比率> | 3銘柄<0.4%> | 2銘柄<0.5%> | – | – | 0.5 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | 比率 |
| (ユーロ…イタリア) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | | 20.555 | 25.203 | 76 | 12,886 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 20.555 | 25.203 | 76 | 12,886 | － |
| | 銘柄数<比率> | 1銘柄<0.0%> | 1銘柄<0.0%> | － | － | 0.0 |
| 合計 | 口数・金額 | 63,422.659 | 64,212.149 | － | 95,685,822 | － |
| | 銘柄数<比率> | 302銘柄<99.0%> | 289銘柄<98.9%> | － | － | 98.9 |

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 外国 | DJ US REAL ESTATE | 百万円<br>1,126 | 百万円<br>－ |

(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

2025年6月23日現在

| 項目 | 当期末 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 95,685,822 | 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 1,646,184 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 97,332,006 | 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、96,682,903千円、99.3%です。
(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2025年6月23日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝146.50円、1カナダ・ドル＝106.48円、1オーストラリア・ドル＝94.24円、1香港・ドル＝18.66円、1シンガポール・ドル＝113.61円、1ニュージーランド・ドル＝87.23円、1イギリス・ポンド＝196.52円、1イスラエル・シュケル＝42.035円、100韓国・ウォン＝10.62円、1ユーロ＝168.20円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年６月23日)現在

| 項目 | 当期末 |
|---|---|
| **(A) 資産** | **97,488,247,286円** |
| コール・ローン等 | 858,046,529 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 10,467,858,445 |
| 投資証券(評価額) | 85,217,963,611 |
| 未収入金 | 204,442,636 |
| 未収配当金 | 345,255,008 |
| 差入委託証拠金 | 394,681,057 |
| **(B) 負債** | **731,539,625** |
| 未払金 | 731,113,625 |
| 未払解約金 | 426,000 |
| **(C) 純資産総額(A－B)** | **96,756,707,661** |
| 元本 | 46,189,776,013 |
| 次期繰越損益金 | 50,566,931,648 |
| **(D) 受益権総口数** | **46,189,776,013口** |
| **１万口当たり基準価額(C／D)** | **20,948円** |

(注１) 期首元本額 42,455,688,196円
追加設定元本額 32,488,564,002円
一部解約元本額 28,754,476,185円

(注２) 期末における元本の内訳

| | |
|---|---|
| たわらノーロード 先進国リート（為替ヘッジなし）<ラップ専用> | 5,602,026,367円 |
| ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（安定型） | 1,523,181円 |
| ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（中立型） | 7,963,957円 |
| ＭＩＴＯ ラップ型ファンド（積極型） | 19,540,765円 |
| グローバル８資産ラップファンド（安定型） | 18,733,352円 |
| グローバル８資産ラップファンド（中立型） | 17,942,428円 |
| グローバル８資産ラップファンド（積極型） | 7,657,005円 |
| たわらノーロード 先進国リート | 16,851,853,401円 |
| たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> | 293,536,718円 |
| たわらノーロード バランス（８資産均等型） | 5,412,250,343円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型） | 30,708,096円 |
| たわらノーロード バランス（標準型） | 758,567,649円 |
| たわらノーロード バランス（積極型） | 1,911,576,425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） | 51,136,874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） | 517,085,572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） | 674,028,929円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型） | 1,138,569,887円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定型） | 625,416円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型） | 34,114,009円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（成長型） | 19,159,473円 |
| たわらノーロード 最適化バランス（積極型） | 43,528,364円 |
| Ｏｎｅ ＤＣ 先進国リートインデックスファンド | 3,778,451,801円 |
| マネックス資産設計ファンド（隔月分配型） | 13,628,168円 |
| マネックス資産設計ファンド（育成型） | 553,920,418円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 77,596,840円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国10） | 174,621,042円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国20） | 313,506,856円 |
| ＤＩＡＭ ＤＣ ８資産バランスファンド（新興国30） | 627,683,243円 |
| 投資のソムリエ | 2,701,467,359円 |
| 投資のソムリエ<ＤＣ年金> | 404,356,318円 |
| ＤＩＡＭ ８資産バランスファンドＮ<ＤＣ年金> | 261,681,414円 |
| 投資のソムリエ<ＤＣ年金>リスク抑制型 | 477,423,250円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド | 1,116,539,935円 |
| ワールドアセットバランス（基本コース） | 207,955,038円 |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） | 260,128,362円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045） | 62,631,328円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055） | 33,626,279円 |
| リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ） | 5,338,593円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035） | 106,210,850円 |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド | 193,978,198円 |
| ９資産分散投資・スタンダード<ＤＣ年金> | 157,525,332円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040） | 39,049,099円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050） | 35,965,136円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060） | 21,619,283円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065） | 6,755,336円 |
| Ｏｎｅグローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け> | 61,143,256円 |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2070） | 71,836円 |
| ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド | 320,487,783円 |
| ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド<ＤＣ年金> | 461,943,087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） | 980,574円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンドＩＩ2021－04（適格機関投資家限定） | 711,941円 |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021－09（適格機関投資家限定） | 501,108円 |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024－01（適格機関投資家限定） | 5,202円 |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定） | 40,583,156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（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用） | 1,696,702円 |
| ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け） | 29,604,707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） | 69,246,013円 |
| ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定） | 157,449,631円 |
| 期末元本合計 | 46,189,776,013円 |

## ■損益の状況

当期　自2024年６月25日　至2025年６月23日

| 項目 | 当期 |
|---|---|
| **(A) 配当等収益** | **3,781,994,181円** |
| 受取配当金 | 3,733,610,368 |
| 受取利息 | 27,405,642 |
| その他収益金 | 20,978,171 |
| **(B) 有価証券売買損益** | **△3,646,801,926** |
| 売買益 | 8,374,191,662 |
| 売買損 | △12,020,993,588 |
| **(C) 先物取引等取引損益** | **△19,748,200** |
| 取引益 | 271,868,840 |
| 取引損 | △291,617,040 |
| **(D) その他費用** | **△32,877,458** |
| **(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)** | **82,566,597** |
| **(F) 前期繰越損益金** | **45,426,156,360** |
| **(G) 解約差損益金** | **△31,330,320,307** |
| **(H) 追加信託差損益金** | **36,388,528,998** |
| **(I) 合計(E＋F＋G＋H)** | **50,566,931,648** |
| **次期繰越損益金(I)** | **50,566,931,648** |

（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**

■投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

（2025年４月１日）