

# 運用報告書(全体版)

第10期<決算日2025年1月14日>

## 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型

### 当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 商品分類   | 追加型投信／内外／資産複合  |
| 信託期間   | 2015年10月30日から無期限です。  |
| 運用方針   | 信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。  |
| 主要投資対象 | <p>投資のソムリエ<br/>リスク 抑制型</p> <p>国内債券パッジ・<br/>ファンド・マーケット</p> <p>国内株式パッジ・<br/>ファンド（露店化）・マーケット</p> <p>為替フルヘッジ<br/>外国債券パッジ・<br/>ファンド・マーケット</p> <p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p> <p>外 国 株 式 パ ッ ジ<br/>・ ファ ン ド ・ マ ザ フ ァ ン ド</p> <p>J-R E I T インテグリス<br/>東京証券取引所に上場し、東証R E I T指標に採用されている（ま<br/>たは採用予定）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>外 国 リ ッ ト ・ パ ッ ジ<br/>・ フ ァ ン ド ・ マ ザ フ ァ ン ド</p> <p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券<sup>※</sup>を主要投資対象とし<br/>ます。<br/>※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものも含みます。）さ<br/>れている不動産投資信託証券とします。</p> <p>イ マ ー ジ ィ ング 債 券<br/>パッジ・マーケット</p> <p>新興国 の公社債を主要投資対象とします。</p> <p>外 国 の 債 券 取引 所 に 上 場 し て い る 株 式 を 主 要 投 資 対 象 と し ま す。<br/>※D R (預託証券) もしくは株式と同等の投資効果が得られる権<br/>利を表示する証券および証書等を含みます。</p> |
| 運用方法   | <p>国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。</p> <p>外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に円での為替ヘッジを行い、一部または全部の為替ヘッジを軽減します。</p> <p>基準価額の変動リスクを年率2%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。</p> <p>※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率2%程度の収益を目指すことを意味するものではありません。</p> <p>基本配分戦略（月次）では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。</p> <p>機動的配分戦略（日次）では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（0%～100%）を変更します。</p>   |
| 組入制限   | 各マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。  |
| 分配方針   | <p>決算日（原則として1月11日、休業日の場合は翌営業日。）に、終業控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。</p>  |

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-644

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで  
お客様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。

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型」は、2025年1月14日に第10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/>

# 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型

## ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額        |        |          | 株組比率      | 式入率      | 株先比       | 式物率    | 債組比率   | 券入率    | 新株予約権付社債(転換社債)比率 | 債先比    | 券物率      | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|-------------|--------|----------|-----------|----------|-----------|--------|--------|--------|------------------|--------|----------|-------------------|------|
|                 | (分配落)       | 税込み分配金 | 期中騰落率    |           |          |           |        |        |        |                  |        |          |                   |      |
| 6期(2021年1月12日)  | 円<br>11,475 | 円<br>0 | %<br>2.8 | %<br>11.5 | %<br>0.9 | %<br>77.3 | %<br>— | %<br>— | %<br>— | %<br>—           | %<br>— | %<br>5.5 | 百万円<br>19,406     |      |
| 7期(2022年1月11日)  | 11,420      | 0      | △0.5     | 14.6      | 0.8      | 64.4      | —      | —      | —      | —                | —      | 5.4      | 31,855            |      |
| 8期(2023年1月11日)  | 10,296      | 0      | △9.8     | 13.7      | 0.8      | 47.1      | —      | —      | —      | —                | —      | 6.5      | 41,621            |      |
| 9期(2024年1月11日)  | 10,381      | 0      | 0.8      | 29.2      | 1.1      | 53.3      | —      | —      | —      | —                | —      | 6.8      | 45,698            |      |
| 10期(2025年1月14日) | 10,444      | 0      | 0.6      | 14.5      | 0.5      | 70.1      | —      | —      | —      | —                | —      | 3.1      | 48,542            |      |

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債（転換社債）比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含む場合があります。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指數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標を定めておりません。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額の推移

| 年月日                | 基準価額<br>騰落率 | 基 準 価 額 |           | 株組比       | 式入率      | 株先比       | 式物率    | 債組比    | 券入率    | 新株予約権付社債(転換社債)比率 | 債先比    | 券物率      | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 |
|--------------------|-------------|---------|-----------|-----------|----------|-----------|--------|--------|--------|------------------|--------|----------|-------------------|
|                    |             | %       | 円         |           |          |           |        |        |        |                  |        |          |                   |
| (期首)<br>2024年1月11日 | 10,381      | %<br>—  | 円<br>29.2 | %<br>29.2 | %<br>1.1 | %<br>53.3 | %<br>— | %<br>— | %<br>— | %<br>—           | %<br>— | %<br>6.8 |                   |
| 1月末                | 10,422      | 0.4     | 30.1      | 0.9       | 52.9     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 6.7      |                   |
| 2月末                | 10,508      | 1.2     | 28.2      | 0.8       | 45.0     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 5.6      |                   |
| 3月末                | 10,646      | 2.6     | 26.7      | 0.8       | 57.0     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 4.9      |                   |
| 4月末                | 10,527      | 1.4     | 23.5      | 0.9       | 33.7     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 5.3      |                   |
| 5月末                | 10,471      | 0.9     | 19.0      | 0.8       | 64.0     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 5.0      |                   |
| 6月末                | 10,582      | 1.9     | 17.8      | 0.7       | 51.7     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 5.6      |                   |
| 7月末                | 10,566      | 1.8     | 19.8      | 0.7       | 62.0     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 4.7      |                   |
| 8月末                | 10,608      | 2.2     | 16.9      | 0.7       | 52.7     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 6.1      |                   |
| 9月末                | 10,666      | 2.7     | 14.3      | 0.6       | 69.1     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 4.1      |                   |
| 10月末               | 10,606      | 2.2     | 11.2      | △0.1      | 51.5     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 3.5      |                   |
| 11月末               | 10,612      | 2.2     | 13.1      | 0.4       | 70.2     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 4.1      |                   |
| 12月末               | 10,542      | 1.6     | 14.6      | 0.5       | 73.2     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 3.6      |                   |
| (期末)<br>2025年1月14日 | 10,444      | 0.6     | 14.5      | 0.5       | 70.1     | —         | —      | —      | —      | —                | —      | 3.1      |                   |

(注1) 謄落率は期首比です。

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

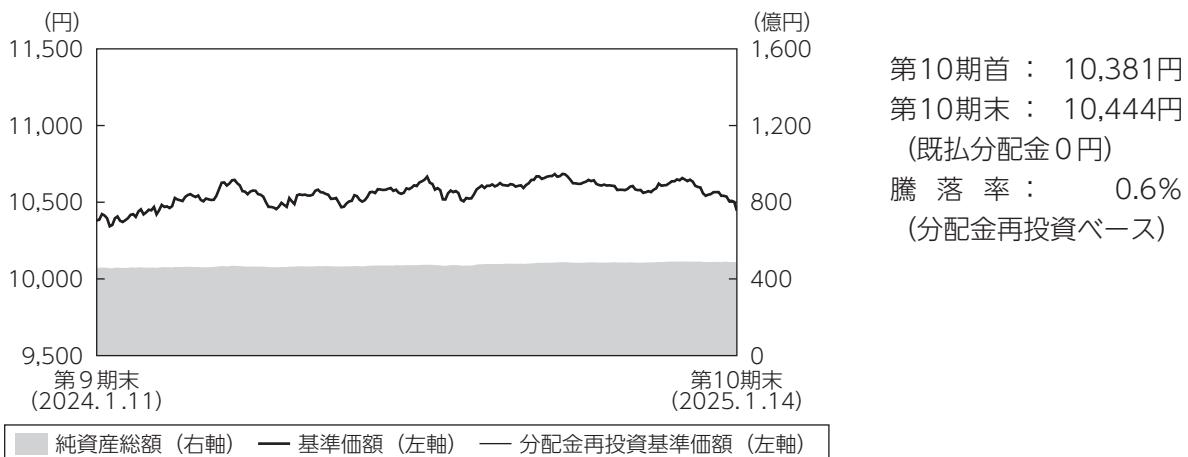
(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含む場合があります。

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

(注5) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

### 基準価額等の推移



（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

債券市場は、日銀の追加利上げへの警戒感などから国内金利が上昇（価格は下落）し、米国の利下げ観測が後退する局面があったことなどから、先進国金利も上昇しました。株式市場は、円安が進行したことや米国の大型ハイテク株が好調だったことなどを背景に、国内市場・海外市場ともに上昇しました。当ファンドは、パフォーマンスのよかつた先進国株式等がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

| 組入ファンド                       | 騰落率   |
|------------------------------|-------|
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | △4.3% |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  | 10.5% |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | △3.8% |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 28.7% |
| J-R-E-I-Tインデックスファンド・マザーファンド  | △5.6% |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 11.4% |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 8.5%  |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 16.3% |

## 投資環境

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

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

先進国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りはともに上昇しました。米国債は、F R B（米連邦準備理事会）が利下げを開始したことなどを受けて、利回りが低下（価格は上昇）する局面もありましたが、堅調な雇用統計、米大統領選挙でトランプ氏が勝利したことなどで利回りは上昇しました。ドイツ債についても、E C B（欧州中央銀行）が利下げを実施しましたが、米国の金利上昇につられ利回りは上昇しました。

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

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

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

新興国債券市場は上昇しました。米国債利回りはF R Bの利下げ開始に向けて低下（価格は上昇）する局面もありましたが、堅調な経済指標などを背景とした更なる利下げの織り込みの後退や大統領選挙でのトランプ氏の勝利などから、利回りは上昇しました。米国債利回りの上昇は新興国債券のマイナス要因となったものの、対米国債のスプレッド（利回り格差）の縮小やインカム収入がプラス要因となつた結果、新興国債券は上昇しました。

新興国株式市場（円換算ベース）は上昇しました。米国の利下げ観測を受け新興国市場でも金利低下期待から堅調に推移した後、2024年7月には米ハイテク株下落の影響から大きく調整する場面も見られましたが、9月にはF R Bの大幅利下げや中国の大規模な景気刺激策の発表を受けて反発しました。10月以降は米大統領選挙を巡る不透明感やトランプ氏が当選したことによる関税引き上げなどが懸念され上値の重い展開のまま期末を迎えるました。

為替市場では、ドル／円相場は、堅調な米国の経済指標を背景に米国金利が上昇したことを受け、前期末対比で円安ドル高となりました。ユーロ／円相場については、期前半は ECB の早期利下げ観測が後退する中で円安ユーロ高となりましたが、後半はユーロ圏景況感の悪化などを背景に、円高ユーロ安となりました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

#### 【基本配分戦略（月次）】

8つのマザーファンドおよび為替ヘッジに関する基本配分比率を月次で決定し、リバランスを行いました。期を通じ、安定資産へ45～70%程度、リスク性資産へ20～45%程度配分しました。

#### 【機動的配分戦略（日次）】

当期は市場が下落するリスクが高まったと判断したことから、リスク性資産については2024年8月前半や10月などに、安定資産については海外金利が上昇した4月や10月など複数の期間において、現金等の配分を高める運用を行いました。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

### ●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

### ●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

## ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

### 【運用状況】

#### ○資産配分

#### 期首 (前期末)

|            | 資 産        | 比 率   |       |
|------------|------------|-------|-------|
| 安定資産       | 国内債券       | 27.9% | 46.2% |
|            | 為替ヘッジ先進国債券 | 18.2% |       |
| リスク性<br>資産 | 新興国債券      | 7.1%  | 44.1% |
|            | 国内株式       | 9.5%  |       |
|            | 先進国株式      | 18.6% |       |
|            | 新興国株式      | 2.5%  |       |
|            | 国内リート      | 3.5%  |       |
|            | 先進国リート     | 3.0%  |       |
|            | 現金等        | 9.7%  |       |

#### 期末

|            | 資 産        | 比 率   |       |
|------------|------------|-------|-------|
| 安定資産       | 国内債券       | 28.5% | 64.0% |
|            | 為替ヘッジ先進国債券 | 35.4% |       |
| リスク性<br>資産 | 新興国債券      | 7.0%  | 25.1% |
|            | 国内株式       | 2.0%  |       |
|            | 先進国株式      | 11.3% |       |
|            | 新興国株式      | 1.9%  |       |
|            | 国内リート      | 1.0%  |       |
|            | 先進国リート     | 2.0%  |       |
|            | 現金等        | 10.9% |       |

※1 比率は純資産総額に対する割合です。

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

### 分配金

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかつた利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

| 項目         | 当期                        |  |
|------------|---------------------------|--|
|            | 2024年1月12日<br>～2025年1月14日 |  |
| 当期分配金（税引前） | －円                        |  |
| 対基準価額比率    | －%                        |  |
| 当期の収益      | －円                        |  |
| 当期の収益以外    | －円                        |  |
| 翌期繰越分配対象額  | 1,349円                    |  |

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下四捨五入で算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

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

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

## 今後の運用方針

### ●当ファンド

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

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

### ●為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

### ●J－R E I T インデックスファンド・マザーファンド

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

### ●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしてパッシブ運用を行います。

### ●エマージング債券パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

### ●エマージング株式パッシブ・マザーファンド

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目          | 第10期                        |         | 項目の概要  |  |
|-------------|-----------------------------|---------|--|--|
|             | (2024年1月12日<br>～2025年1月14日) |         |  |  |
|             | 金額                          | 比率      |  |  |
| (a) 信託報酬    | 69円                         | 0.654%  | (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10,559円です。<br>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<br>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、<br>口座内でのファンドの管理等の対価<br>受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価 |  |
| (投信会社)      | (33)                        | (0.310) |  |  |
| (販売会社)      | (33)                        | (0.310) |  |  |
| (受託会社)      | ( 4)                        | (0.033) |  |  |
| (b) 売買委託手数料 | 0                           | 0.001   | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<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) |  |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |  |
| (投資証券)      | ( 0)                        | (0.000) |  |  |
| (c) 有価証券取引税 | 0                           | 0.001   | (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)                        | (0.001) |  |  |
| (投資信託受益証券)  | ( 0)                        | (0.000) |  |  |
| (投資証券)      | ( 0)                        | (0.000) |  |  |
| (d) その他費用   | 2                           | 0.020   | (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)      | ( 2)                        | (0.015) | 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)                        | (0.003) | 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)                        | (0.002) | その他は、信託事務の処理に要する諸費用等   |  |
| 合計          | 71                          | 0.677   |  |  |

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

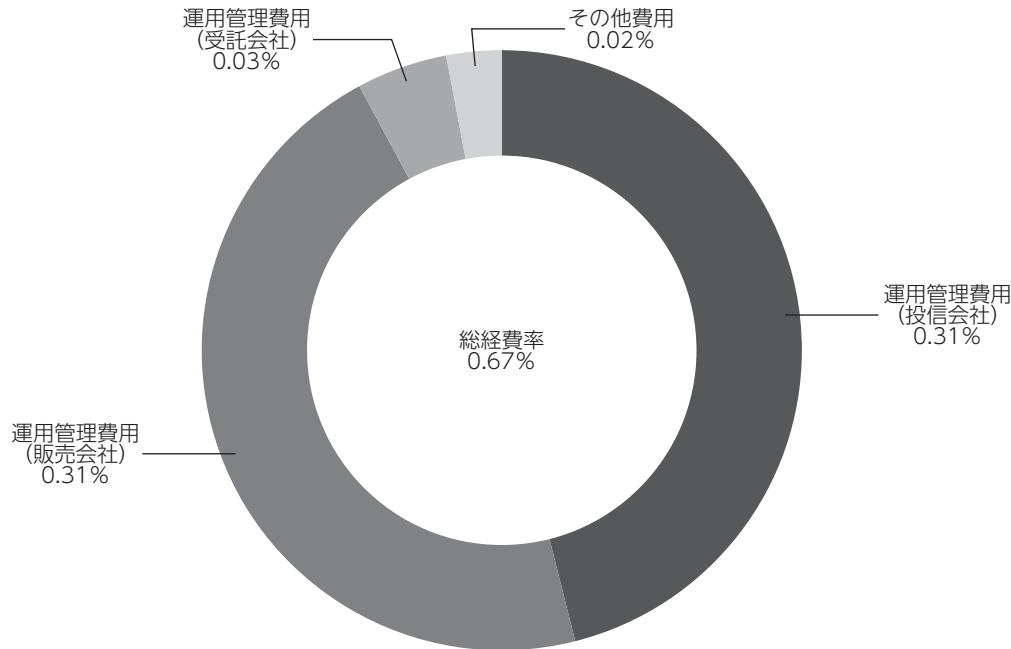
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.67%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ■売買及び取引の状況（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

### 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建       |          | 売建         |            |
|-----------|----------|----------|------------|------------|
|           | 新規買付額    | 決済額      | 新規売付額      | 決済額        |
| 外国 株式先物取引 | 百万円<br>- | 百万円<br>- | 百万円<br>944 | 百万円<br>946 |

(注) 金額は受渡代金です。

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

|                              | 設 定              |                  | 解 約              |                  |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
|                              | □ 数              | 金 額              | □ 数              | 金 額              |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 千口<br>28,854,546 | 千円<br>35,195,000 | 千口<br>27,482,248 | 千円<br>33,661,000 |
| 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  | 433,805          | 2,056,000        | 1,233,574        | 5,793,000        |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 37,668,106       | 43,661,000       | 29,578,137       | 34,175,132       |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 673,541          | 6,428,000        | 1,211,131        | 10,884,000       |
| J—REITインデックスファンド・マザーファンド     | 1,142,988        | 2,617,000        | 1,606,996        | 3,681,000        |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 622,757          | 1,350,000        | 895,432          | 1,869,000        |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 2,060,409        | 5,057,000        | 2,113,274        | 5,069,000        |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 418,065          | 738,000          | 635,139          | 1,103,000        |

## ■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               | 当 期                         |                       |                      |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------|----------------------|
|                   | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | エマージング株式パッシブ・マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額     | 204,683,933千円               | 308,130,618千円         | 26,588,042千円         |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 569,546,723千円               | 1,503,678,265千円       | 90,675,662千円         |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.35                        | 0.20                  | 0.29                 |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2024年1月12日から2025年1月14日まで）

### 【投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型における利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項目              | 当期    |
|-----------------|-------|
| 売買委託手数料総額(A)    | 643千円 |
| うち利害関係人への支払額(B) | 12千円  |
| (B)/(A)         | 1.9%  |

(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。

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

### 期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 | 当期             |                    |           |                |                    |           |
|-----|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| 区分  | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 公社債 | 百万円<br>607,173 | 百万円<br>69,127      | %<br>11.4 | 百万円<br>619,640 | 百万円<br>94,904      | %<br>15.3 |

平均保有割合 2.3%

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

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

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 | 当期             |                    |          |               |                    |           |
|-----|----------------|--------------------|----------|---------------|--------------------|-----------|
| 区分  | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 株式  | 百万円<br>121,170 | 百万円<br>860         | %<br>0.7 | 百万円<br>83,513 | 百万円<br>11,498      | %<br>13.8 |

平均保有割合 0.4%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 当期           |            |              |
|----|--------------|------------|--------------|
|    | 買付額          | 売付額        | 当期末保有額       |
| 株式 | 百万円<br>1,188 | 百万円<br>769 | 百万円<br>7,853 |

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種類 | 当期  |            |
|----|-----|------------|
|    | 買付額 |            |
| 株式 |     | 百万円<br>387 |

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決算期         | 当期   |               |                    |           |               |                    |           |
|-------------|------|---------------|--------------------|-----------|---------------|--------------------|-----------|
|             | 区分   | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C     | うち利害関係人<br>との取引状況D |           |
| 投資証券        | 投資証券 | 百万円<br>62,900 | 百万円<br>38,388      | %<br>61.0 | 百万円<br>80,536 | 百万円<br>45,721      | %<br>56.8 |
| 不動産投信指数先物取引 |      | 19,253        | 14,395             | 74.8      | 19,456        | 14,534             | 74.7      |

平均保有割合 0.7%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種類   | 当期  |              |
|------|-----|--------------|
|      | 買付額 |              |
| 投資証券 |     | 百万円<br>4,051 |

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

### 【エマージング債券パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

### 【エマージング株式パッシブ・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### 親投資信託残高

|                              | 期 首 (前期末)        | 当 期 末            |                  |
|------------------------------|------------------|------------------|------------------|
|                              | □ 数              | □ 数              | 評 価 額            |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 千口<br>10,215,598 | 千口<br>11,587,896 | 千円<br>13,856,806 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  | 998,753          | 198,984          | 953,135          |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 7,082,847        | 15,172,817       | 17,189,284       |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 1,083,058        | 545,469          | 5,493,255        |
| J－R E I T インデックスファンド・マザーファンド | 678,148          | 214,139          | 477,018          |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 718,519          | 445,843          | 948,265          |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 1,430,371        | 1,377,506        | 3,378,609        |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 743,438          | 526,363          | 943,191          |

## ■投資信託財産の構成

2025年1月14日現在

| 項<br>目                       | 当<br>期<br>末      |           |
|------------------------------|------------------|-----------|
|                              | 評<br>価<br>額      | 比<br>率    |
| 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 千円<br>13,856,806 | %<br>28.4 |
| 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  | 953,135          | 2.0       |
| 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 17,189,284       | 35.2      |
| 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド        | 5,493,255        | 11.3      |
| J－REITインデックスファンド・マザーファンド     | 477,018          | 1.0       |
| 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド      | 948,265          | 1.9       |
| エマージング債券パッシブ・マザーファンド         | 3,378,609        | 6.9       |
| エマージング株式パッシブ・マザーファンド         | 943,191          | 1.9       |
| コール・ローン等、その他                 | 5,574,442        | 11.4      |
| 投 資 信 託 財 産 総 額              | 48,814,008       | 100.0     |

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2025年1月14日現在、79,643千円、0.2%、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは269,262,920千円、97.5%、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは1,814,094,623千円、99.9%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは105,803,024千円、99.9%、エマージング債券パッシブ・マザーファンドは122,037,236千円、99.8%、エマージング株式パッシブ・マザーファンドは104,765,778千円、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、2025年1月14日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=157.57円、1カナダ・ドル=109.61円、1オーストラリア・ドル=97.43円、1香港・ドル=20.24円、1シンガポール・ドル=115.05円、1ニュージーランド・ドル=88.24円、1台湾・ドル=4.755円、1イギリス・ポンド=192.39円、1イスラエル・シェケル=43,399円、1イスラエル・ペソ=171.87円、1トルコ・リラ=4,442円、1デンマーク・クローネ=21.64円、1ノルウェー・クローネ=13.80円、1スウェーデン・クローナ=14.00円、1メキシコ・ペソ=7.633円、1フィリピン・ペソ=2.683円、100チリ・ペソ=15.633円、100コロンビア・ペソ=3.656円、1ウェスト・ディナール=511.26円、1カタール・リアル=43.30円、1サウジアラビア・リアル=42.04円、1インド・ルピー=1.83円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=42.97円、1ブラジル・レアル=25.831円、1チェコ・クロナ=6.398円、100韓国・ウォン=10.76円、1オフショア・人民元=21.447円、1マレーシア・リンギット=35.004円、1南アフリカ・ランド=8.29円、1タイ・バーツ=4.54円、1ポーランド・ズロチ=37.794円、100ハンガリー・フォリント=39.134円、1ユーロ=161.43円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2025年1月14日)現在

| 項               | 目                                 | 当期末             |
|-----------------|-----------------------------------|-----------------|
| (A) 資産          | コール・ローン等                          | 59,309,971,874円 |
|                 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)        | 5,356,283,136   |
|                 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)  | 13,856,806,522  |
|                 | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額) | 953,135,266     |
|                 | 17,189,284,637                    |                 |
|                 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)        | 5,493,255,131   |
|                 | J-R E I Tインデックスファンド・マザーファンド(評価額)  | 477,018,114     |
|                 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)      | 948,265,076     |
|                 | エマージング債券パッシブ・マザーファンド(評価額)         | 3,378,609,081   |
|                 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド(評価額)         | 943,191,440     |
|                 | 未収入金                              | 10,634,480,398  |
|                 | 差入委託証拠金                           | 79,643,073      |
| (B) 負債          | 未払金                               | 10,767,172,600  |
|                 | 未払解約金                             | 10,588,119,346  |
|                 | 未払信託報酬                            | 18,329,638      |
|                 | その他の未払費用                          | 160,040,795     |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 48,542,799,274                    |                 |
| 元本              | 46,480,266,387                    |                 |
| 次期繰越損益金         | 2,062,532,887                     |                 |
| (D) 受益権総口数      | 46,480,266,387口                   |                 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,444円                           |                 |

(注) 期首における元本額は44,022,826,311円、当期中ににおける追加設定元本額は9,219,674,974円、同解約元本額は6,762,234,898円です。

## ■損益の状況

当期 自2024年1月12日 至2025年1月14日

| 項                  | 目               | 当期 |
|--------------------|-----------------|----|
| (A) 配当等収益          | 22,747,245円     |    |
| 受取利息               | 9,994,496       |    |
| その他収益金             | 12,829,066      |    |
| 支払利息               | △76,317         |    |
| (B) 有価証券売買損益       | 435,328,196     |    |
| 売買益                | 3,287,963,543   |    |
| 売買損                | △2,852,635,347  |    |
| (C) 先物取引等取引損益      | △8,697,018      |    |
| 取引益                | 14,977,247      |    |
| 取引損                | △23,674,265     |    |
| (D) 信託報酬等          | △312,390,930    |    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 136,987,493     |    |
| (F) 前期繰越損益金        | △1,955,491,818  |    |
| (G) 追加信託差損益金       | 3,881,037,212   |    |
| (配当等相当額)           | (4,606,914,135) |    |
| (売買損益相当額)          | (△725,876,923)  |    |
| (H) 合計(E+F+G)      | 2,062,532,887   |    |
| 次期繰越損益金(H)         | 2,062,532,887   |    |
| 追加信託差損益金           | 3,881,037,212   |    |
| (配当等相当額)           | (4,613,528,478) |    |
| (売買損益相当額)          | (△732,491,266)  |    |
| 分配準備積立金            | 1,661,044,727   |    |
| 繰越損益金              | △3,479,549,052  |    |

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

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

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

(注4) 分配金の計算過程

| 項                    | 目             | 当期 |
|----------------------|---------------|----|
| (a) 経費控除後の配当等収益      | 535,923,449円  |    |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益  | 0             |    |
| (c) 収益調整金            | 4,613,528,478 |    |
| (d) 分配準備積立金          | 1,125,121,278 |    |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 6,274,573,205 |    |
| (f) 1万口当たり当期分配対象額    | 1,349.94      |    |
| (g) 分配金              | 0             |    |
| (h) 1万口当たり分配金        | 0             |    |

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。

### 《お知らせ》

#### 約款変更のお知らせ

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

(2024年4月12日)

# 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第21期（決算日 2024年2月14日）  
 (計算期間 2023年2月15日～2024年2月14日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第21期の運用状況をご報告申し上げます。

**当ファンドの仕組みは次の通りです。**

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

### ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | NOMURA-BPI総合 |             | 債券組入比率 | 新株予約権付社債(転換社債)比率 | 債券先物比率 | 純資産額        |
|-----------------|----------|--------------|-------------|--------|------------------|--------|-------------|
|                 |          | 期中騰落率        | (ベンチマーク)    |        |                  |        |             |
| 17期（2020年2月14日） | 円 13,197 | % 1.2        | ポイント 390.72 | % 1.2  | % 99.4           | % —    | 百万円 222,859 |
| 18期（2021年2月15日） | 13,022   | △1.3         | 385.59      | △1.3   | 99.2             | —      | 273,346     |
| 19期（2022年2月14日） | 12,872   | △1.2         | 381.31      | △1.1   | 99.6             | —      | 553,303     |
| 20期（2023年2月14日） | 12,411   | △3.6         | 367.66      | △3.6   | 99.7             | —      | 554,514     |
| 21期（2024年2月14日） | 12,339   | △0.6         | 365.56      | △0.6   | 99.6             | —      | 535,043     |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

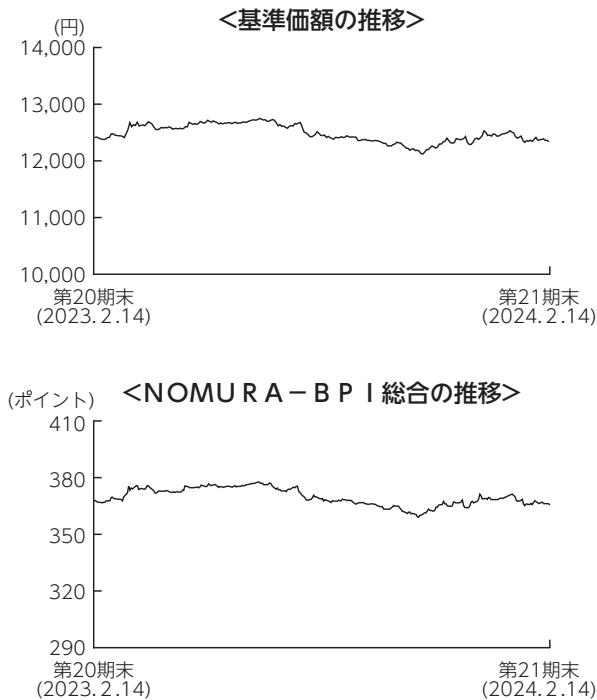
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年2月15日から2024年2月14日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は12,339円となり、前期末比で0.6%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初から2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどを受けて、利回りは上昇しました。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要を受けて利回りは低下しました。2024年1月から期末にかけては日銀のマイナス金利政策解除の観測が高まつたことなどから利回りは上昇しました。

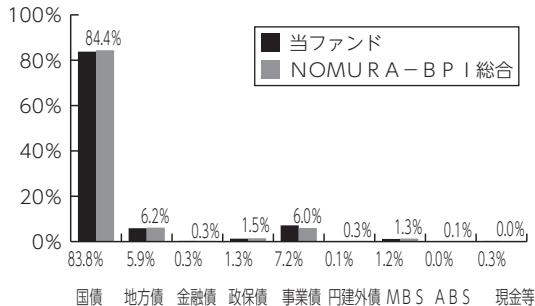
### ポートフォリオについて

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

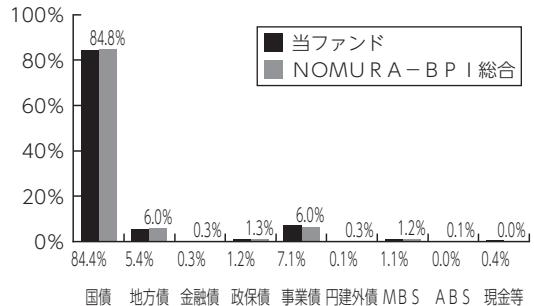
## 【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

### ○セクター別構成比

期首（前期末）

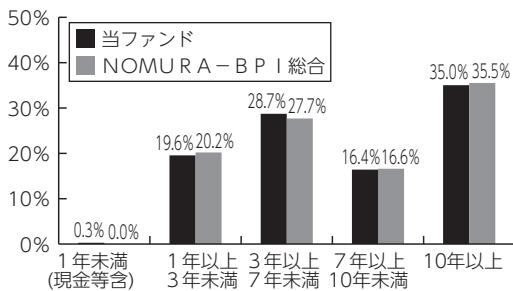


期末

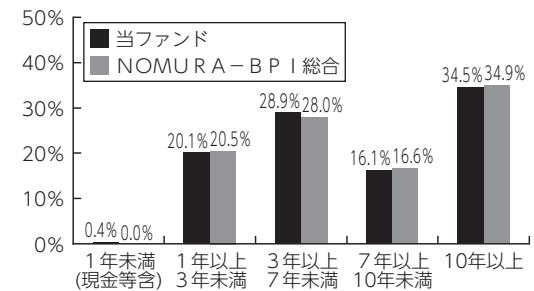


### ○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



### ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI 総合は、前期末比で0.6%下落しました。  
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

### 今後の運用方針

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

## ■1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■売買及び取引の状況（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

公社債

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

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 |   | 当期             |                    |          |                |                    |          |
|-----|---|----------------|--------------------|----------|----------------|--------------------|----------|
| 区分  | 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A      | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C      |
| 公社債 |   | 百万円<br>716,806 | 百万円<br>57,522      | %<br>8.0 | 百万円<br>727,467 | 百万円<br>67,522      | %<br>9.3 |

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

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

| 区分    | 当期末               |                   |           |            |           |           | 残存期間別組入比率 |
|-------|-------------------|-------------------|-----------|------------|-----------|-----------|-----------|
|       | 額面金額              | 評価額               | 組入比率      | うちB格以下組入比率 | 5年以上      | 2年以上      |           |
| 国債証券  | 千円<br>464,585,000 | 千円<br>451,739,708 | %<br>84.4 | %<br>—     | %<br>52.8 | %<br>21.6 | %<br>10.1 |
| 地方債証券 | 29,139,330        | 29,000,791        | 5.4       | 4.5        | 3.2       | 1.7       | 0.5       |
| 特殊債券  | 27,236,846        | 27,002,386        | 5.0       | —          | 3.3       | 1.3       | 0.5       |
| 金融債券  | 1,600,000         | 1,591,110         | 0.3       | —          | —         | 0.2       | 0.1       |
| 普通社債券 | 24,520,000        | 23,641,007        | 4.4       | 0.1        | 2.1       | 1.8       | 0.4       |
| 合計    | 547,081,176       | 532,975,004       | 99.6      | 4.6        | 61.4      | 26.7      | 11.6      |

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

(注2) 無格付銘柄については、B格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

| 銘柄               | 当期末    |            |            |            |
|------------------|--------|------------|------------|------------|
|                  | 利率     | 額面金額       | 評価額        | 償還年月日      |
| (国債証券)           | %      | 千円         | 千円         |            |
| 446回 利付国庫債券(2年)  | 0.0050 | 1,500,000  | 1,500,075  | 2025/03/01 |
| 143回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 3,700,000  | 3,704,033  | 2025/03/20 |
| 338回 利付国庫債券(10年) | 0.4000 | 3,230,000  | 3,244,082  | 2025/03/20 |
| 75回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 180,000    | 184,120    | 2025/03/20 |
| 76回 利付国庫債券(20年)  | 1.9000 | 70,000     | 71,449     | 2025/03/20 |
| 77回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 40,000     | 40,872     | 2025/03/20 |
| 447回 利付国庫債券(2年)  | 0.0050 | 1,000,000  | 999,940    | 2025/04/01 |
| 448回 利付国庫債券(2年)  | 0.0050 | 2,000,000  | 1,999,620  | 2025/05/01 |
| 449回 利付国庫債券(2年)  | 0.0050 | 1,800,000  | 1,799,406  | 2025/06/01 |
| 339回 利付国庫債券(10年) | 0.4000 | 3,980,000  | 3,999,462  | 2025/06/20 |
| 78回 利付国庫債券(20年)  | 1.9000 | 250,000    | 256,255    | 2025/06/20 |
| 79回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 50,000     | 51,318     | 2025/06/20 |
| 80回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 90,000     | 92,493     | 2025/06/20 |
| 451回 利付国庫債券(2年)  | 0.0050 | 12,500,000 | 12,489,875 | 2025/08/01 |
| 145回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 7,300,000  | 7,303,431  | 2025/09/20 |
| 340回 利付国庫債券(10年) | 0.4000 | 3,300,000  | 3,317,325  | 2025/09/20 |
| 81回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 400,000    | 412,292    | 2025/09/20 |
| 82回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 140,000    | 144,526    | 2025/09/20 |
| 455回 利付国庫債券(2年)  | 0.0050 | 2,900,000  | 2,894,548  | 2025/12/01 |
| 146回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 4,700,000  | 4,699,530  | 2025/12/20 |
| 341回 利付国庫債券(10年) | 0.3000 | 3,620,000  | 3,632,959  | 2025/12/20 |
| 83回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 70,000     | 72,569     | 2025/12/20 |
| 84回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 170,000    | 175,927    | 2025/12/20 |

| 銘柄               | 当期末    |           |           |            |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  | 利率     | 額面金額      | 評価額       | 償還年月日      |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 456回 利付国庫債券(2年)  | 0.1000 | 900,000   | 899,658   | 2026/01/01 |
| 147回 利付国庫債券(5年)  | 0.0050 | 5,750,000 | 5,736,200 | 2026/03/20 |
| 342回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 3,520,000 | 3,518,521 | 2026/03/20 |
| 85回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 590,000   | 614,355   | 2026/03/20 |
| 86回 利付国庫債券(20年)  | 2.3000 | 120,000   | 125,454   | 2026/03/20 |
| 87回 利付国庫債券(20年)  | 2.2000 | 120,000   | 125,204   | 2026/03/20 |
| 148回 利付国庫債券(5年)  | 0.0050 | 3,610,000 | 3,599,855 | 2026/06/20 |
| 343回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 4,090,000 | 4,087,586 | 2026/06/20 |
| 88回 利付国庫債券(20年)  | 2.3000 | 590,000   | 619,966   | 2026/06/20 |
| 89回 利付国庫債券(20年)  | 2.2000 | 10,000    | 10,484    | 2026/06/20 |
| 149回 利付国庫債券(5年)  | 0.0050 | 1,680,000 | 1,674,556 | 2026/09/20 |
| 344回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 3,570,000 | 3,567,215 | 2026/09/20 |
| 90回 利付国庫債券(20年)  | 2.2000 | 470,000   | 495,154   | 2026/09/20 |
| 91回 利付国庫債券(20年)  | 2.3000 | 110,000   | 116,172   | 2026/09/20 |
| 150回 利付国庫債券(5年)  | 0.0050 | 1,470,000 | 1,464,575 | 2026/12/20 |
| 345回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 4,890,000 | 4,885,110 | 2026/12/20 |
| 92回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 1,160,000 | 1,224,565 | 2026/12/20 |
| 151回 利付国庫債券(5年)  | 0.0050 | 1,900,000 | 1,891,507 | 2027/03/20 |
| 152回 利付国庫債券(5年)  | 0.1000 | 1,890,000 | 1,887,089 | 2027/03/20 |
| 346回 利付国庫債券(10年) | 0.1000 | 4,540,000 | 4,533,008 | 2027/03/20 |
| 93回 利付国庫債券(20年)  | 2.0000 | 370,000   | 391,115   | 2027/03/20 |
| 94回 利付国庫債券(20年)  | 2.1000 | 670,000   | 710,293   | 2027/03/20 |
| 153回 利付国庫債券(5年)  | 0.0050 | 5,210,000 | 5,179,677 | 2027/06/20 |

| 銘柄                  | 当期末    |           |           |            |
|---------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                     | 利率     | 額面金額      | 評価額       | 償還年月日      |
| <b>(国債証券)</b>       |        |           |           |            |
| 3 4 7回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,500,000 | 4,488,030 | 2027/06/20 |
| 9 5回 利付国庫債券 (20年)   | 2.3000 | 550,000   | 588,835   | 2027/06/20 |
| 9 6回 利付国庫債券 (20年)   | 2.1000 | 120,000   | 127,675   | 2027/06/20 |
| 1 5 4回 利付国庫債券 (5年)  | 0.1000 | 1,400,000 | 1,394,750 | 2027/09/20 |
| 3 4 8回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,070,000 | 4,054,737 | 2027/09/20 |
| 9 7回 利付国庫債券 (20年)   | 2.2000 | 660,000   | 707,104   | 2027/09/20 |
| 9 8回 利付国庫債券 (20年)   | 2.1000 | 160,000   | 170,848   | 2027/09/20 |
| 1 5 5回 利付国庫債券 (5年)  | 0.3000 | 5,700,000 | 5,715,162 | 2027/12/20 |
| 1 5 6回 利付国庫債券 (5年)  | 0.2000 | 4,300,000 | 4,295,055 | 2027/12/20 |
| 3 4 9回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,850,000 | 5,820,984 | 2027/12/20 |
| 9 9回 利付国庫債券 (20年)   | 2.1000 | 750,000   | 803,587   | 2027/12/20 |
| 1 5 7回 利付国庫債券 (5年)  | 0.2000 | 4,400,000 | 4,389,308 | 2028/03/20 |
| 1 5 8回 利付国庫債券 (5年)  | 0.1000 | 3,600,000 | 3,576,672 | 2028/03/20 |
| 3 5 0回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 6,600,000 | 6,557,232 | 2028/03/20 |
| 1 0 0回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 830,000   | 895,528   | 2028/03/20 |
| 1 0 1回 利付国庫債券 (20年) | 2.4000 | 230,000   | 250,021   | 2028/03/20 |
| 1 5 9回 利付国庫債券 (5年)  | 0.1000 | 2,100,000 | 2,083,326 | 2028/06/20 |
| 1 6 0回 利付国庫債券 (5年)  | 0.2000 | 900,000   | 896,715   | 2028/06/20 |
| 1 6 1回 利付国庫債券 (5年)  | 0.3000 | 1,700,000 | 1,700,714 | 2028/06/20 |
| 3 5 1回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 2,400,000 | 2,380,944 | 2028/06/20 |
| 1 0 2回 利付国庫債券 (20年) | 2.4000 | 500,000   | 545,590   | 2028/06/20 |
| 1 0 3回 利付国庫債券 (20年) | 2.3000 | 160,000   | 173,902   | 2028/06/20 |
| 1 0 4回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 110,000   | 118,614   | 2028/06/20 |
| 1 6 2回 利付国庫債券 (5年)  | 0.3000 | 1,400,000 | 1,398,726 | 2028/09/20 |
| 1 6 3回 利付国庫債券 (5年)  | 0.4000 | 3,000,000 | 3,010,860 | 2028/09/20 |
| 3 5 2回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,950,000 | 4,900,648 | 2028/09/20 |
| 1 0 5回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 640,000   | 691,891   | 2028/09/20 |
| 1 0 6回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 500,000   | 542,805   | 2028/09/20 |
| 1 6 4回 利付国庫債券 (5年)  | 0.2000 | 1,700,000 | 1,687,437 | 2028/12/20 |
| 3 5 3回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 3,690,000 | 3,646,900 | 2028/12/20 |
| 1 0 7回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 600,000   | 650,166   | 2028/12/20 |
| 1 0 8回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 690,000   | 741,115   | 2028/12/20 |
| 3 5 4回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 2,460,000 | 2,428,020 | 2029/03/20 |
| 1 0 9回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 350,000   | 377,223   | 2029/03/20 |
| 1 1 0回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 440,000   | 478,627   | 2029/03/20 |
| 3 5 5回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,130,000 | 4,072,634 | 2029/06/20 |
| 1 1 1回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 460,000   | 504,629   | 2029/06/20 |
| 1 1 2回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 740,000   | 807,909   | 2029/06/20 |
| 3 5 6回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 2,700,000 | 2,660,040 | 2029/09/20 |
| 1回 利付国庫債券 (30年)     | 2.8000 | 110,000   | 124,787   | 2029/09/20 |
| 1 1 3回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 1,370,000 | 1,501,136 | 2029/09/20 |
| 3 5 7回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,800,000 | 5,707,142 | 2029/12/20 |
| 1 1 4回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 410,000   | 450,827   | 2029/12/20 |
| 1 1 5回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 360,000   | 397,911   | 2029/12/20 |
| 2回 利付国庫債券 (30年)     | 2.4000 | 100,000   | 111,942   | 2030/02/20 |
| 3 5 8回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,150,000 | 5,059,617 | 2030/03/20 |
| 1 1 6回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 530,000   | 587,589   | 2030/03/20 |

| 銘柄                  | 当期末    |           |           |            |
|---------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                     | 利率     | 額面金額      | 評価額       | 償還年月日      |
| <b>(国債証券)</b>       |        |           |           |            |
| 1 1 7回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 470,000   | 518,273   | 2030/03/20 |
| 3 5 9回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,050,000 | 3,971,146 | 2030/06/20 |
| 1 1 8回 利付国庫債券 (20年) | 2.0000 | 555,000   | 610,111   | 2030/06/20 |
| 1 1 9回 利付国庫債券 (20年) | 1.8000 | 470,000   | 510,857   | 2030/06/20 |
| 3 6 0回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,100,000 | 4,010,661 | 2030/09/20 |
| 1 2 1回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 640,000   | 700,774   | 2030/09/20 |
| 1 2 2回 利付国庫債券 (20年) | 1.8000 | 570,000   | 620,473   | 2030/09/20 |
| 4回 利付国庫債券 (30年)     | 2.9000 | 200,000   | 232,534   | 2030/11/20 |
| 3 6 1回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,500,000 | 5,366,845 | 2030/12/20 |
| 1 2 3回 利付国庫債券 (20年) | 2.1000 | 350,000   | 388,598   | 2030/12/20 |
| 3 6 2回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 4,210,000 | 4,097,466 | 2031/03/20 |
| 1 2 5回 利付国庫債券 (20年) | 2.2000 | 600,000   | 671,682   | 2031/03/20 |
| 1 2 6回 利付国庫債券 (20年) | 2.0000 | 510,000   | 563,733   | 2031/03/20 |
| 1 2 7回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 540,000   | 593,184   | 2031/03/20 |
| 3 6 3回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,070,000 | 4,919,370 | 2031/06/20 |
| 1 2 8回 利付国庫債券 (20年) | 1.9000 | 370,000   | 406,974   | 2031/06/20 |
| 3 6 4回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,950,000 | 5,754,780 | 2031/09/20 |
| 1 3 0回 利付国庫債券 (20年) | 1.8000 | 910,000   | 995,094   | 2031/09/20 |
| 6回 利付国庫債券 (30年)     | 2.4000 | 200,000   | 227,966   | 2031/11/20 |
| 3 6 5回 利付国庫債券 (10年) | 0.1000 | 5,430,000 | 5,236,366 | 2031/12/20 |
| 1 3 2回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 30,000    | 32,606    | 2031/12/20 |
| 1 3 3回 利付国庫債券 (20年) | 1.8000 | 630,000   | 689,472   | 2031/12/20 |
| 3 6 6回 利付国庫債券 (10年) | 0.2000 | 4,880,000 | 4,731,208 | 2032/03/20 |
| 1 3 4回 利付国庫債券 (20年) | 1.8000 | 200,000   | 219,108   | 2032/03/20 |
| 1 3 5回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 130,000   | 141,415   | 2032/03/20 |
| 1 3 6回 利付国庫債券 (20年) | 1.6000 | 360,000   | 388,825   | 2032/03/20 |
| 3 6 7回 利付国庫債券 (10年) | 0.2000 | 5,700,000 | 5,510,076 | 2032/06/20 |
| 1 3 7回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 480,000   | 522,571   | 2032/06/20 |
| 1 3 8回 利付国庫債券 (20年) | 1.5000 | 1,060,000 | 1,136,691 | 2032/06/20 |
| 1 3 9回 利付国庫債券 (20年) | 1.6000 | 980,000   | 1,058,694 | 2032/06/20 |
| 3 6 8回 利付国庫債券 (10年) | 0.2000 | 4,750,000 | 4,577,860 | 2032/09/20 |
| 1 4 0回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 850,000   | 925,658   | 2032/09/20 |
| 3 6 9回 利付国庫債券 (10年) | 0.5000 | 5,220,000 | 5,150,208 | 2032/12/20 |
| 1 4 1回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 1,060,000 | 1,155,007 | 2032/12/20 |
| 1 4 2回 利付国庫債券 (20年) | 1.8000 | 430,000   | 472,342   | 2032/12/20 |
| 3 7 0回 利付国庫債券 (10年) | 0.5000 | 4,900,000 | 4,822,384 | 2033/03/20 |
| 1 4 3回 利付国庫債券 (20年) | 1.6000 | 1,230,000 | 1,329,716 | 2033/03/20 |
| 1 4 4回 利付国庫債券 (20年) | 1.5000 | 750,000   | 804,367   | 2033/03/20 |
| 3 7 1回 利付国庫債券 (10年) | 0.4000 | 5,200,000 | 5,058,716 | 2033/06/20 |
| 1 1回 利付国庫債券 (30年)   | 1.7000 | 250,000   | 272,517   | 2033/06/20 |
| 1 4 5回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 2,250,000 | 2,452,657 | 2033/06/20 |
| 3 7 2回 利付国庫債券 (10年) | 0.8000 | 5,300,000 | 5,338,001 | 2033/09/20 |
| 1 2回 利付国庫債券 (30年)   | 2.1000 | 230,000   | 259,299   | 2033/09/20 |
| 1 4 6回 利付国庫債券 (20年) | 1.7000 | 2,240,000 | 2,442,473 | 2033/09/20 |
| 3 7 3回 利付国庫債券 (10年) | 0.6000 | 1,200,000 | 1,182,948 | 2033/12/20 |
| 1 3回 利付国庫債券 (30年)   | 2.0000 | 150,000   | 167,725   | 2033/12/20 |
| 1 4 7回 利付国庫債券 (20年) | 1.6000 | 1,290,000 | 1,393,703 | 2033/12/20 |

| 銘柄               | 当期末    |           |           |            |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  | 利率     | 額面金額      | 評価額       | 償還年月日      |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 14回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 340,000   | 393,546   | 2034/03/20 |
| 148回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 2,730,000 | 2,922,055 | 2034/03/20 |
| 15回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 260,000   | 303,960   | 2034/06/20 |
| 149回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 2,290,000 | 2,450,139 | 2034/06/20 |
| 16回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 240,000   | 280,944   | 2034/09/20 |
| 150回 利付国庫債券(20年) | 1.4000 | 2,930,000 | 3,103,192 | 2034/09/20 |
| 17回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 270,000   | 313,731   | 2034/12/20 |
| 151回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 3,160,000 | 3,279,574 | 2034/12/20 |
| 18回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 400,000   | 461,116   | 2035/03/20 |
| 152回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 2,440,000 | 2,529,108 | 2035/03/20 |
| 19回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 280,000   | 323,002   | 2035/06/20 |
| 153回 利付国庫債券(20年) | 1.3000 | 2,740,000 | 2,866,067 | 2035/06/20 |
| 20回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 330,000   | 388,287   | 2035/09/20 |
| 154回 利付国庫債券(20年) | 1.2000 | 3,020,000 | 3,121,653 | 2035/09/20 |
| 21回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 310,000   | 357,981   | 2035/12/20 |
| 155回 利付国庫債券(20年) | 1.0000 | 2,280,000 | 2,301,933 | 2035/12/20 |
| 22回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 290,000   | 341,709   | 2036/03/20 |
| 156回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 2,280,000 | 2,140,509 | 2036/03/20 |
| 23回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 350,000   | 412,664   | 2036/06/20 |
| 157回 利付国庫債券(20年) | 0.2000 | 2,580,000 | 2,353,218 | 2036/06/20 |
| 158回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,140,000 | 2,018,041 | 2036/09/20 |
| 25回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 330,000   | 381,212   | 2036/12/20 |
| 159回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,840,000 | 1,750,244 | 2036/12/20 |
| 26回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 620,000   | 724,240   | 2037/03/20 |
| 160回 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 1,820,000 | 1,747,691 | 2037/03/20 |
| 161回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,760,000 | 1,662,443 | 2037/06/20 |
| 27回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 620,000   | 732,170   | 2037/09/20 |
| 162回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 1,930,000 | 1,816,940 | 2037/09/20 |
| 163回 利付国庫債券(20年) | 0.6000 | 2,430,000 | 2,278,538 | 2037/12/20 |
| 28回 利付国庫債券(30年)  | 2.5000 | 770,000   | 909,832   | 2038/03/20 |
| 164回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,750,000 | 2,533,245 | 2038/03/20 |
| 165回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,250,000 | 2,063,587 | 2038/06/20 |
| 29回 利付国庫債券(30年)  | 2.4000 | 860,000   | 1,003,749 | 2038/09/20 |
| 166回 利付国庫債券(20年) | 0.7000 | 1,540,000 | 1,447,061 | 2038/09/20 |
| 167回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,350,000 | 2,136,009 | 2038/12/20 |
| 30回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 880,000   | 1,014,041 | 2039/03/20 |
| 168回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 1,590,000 | 1,416,610 | 2039/03/20 |
| 169回 利付国庫債券(20年) | 0.3000 | 1,520,000 | 1,326,412 | 2039/06/20 |
| 31回 利付国庫債券(30年)  | 2.2000 | 720,000   | 818,337   | 2039/09/20 |
| 170回 利付国庫債券(20年) | 0.3000 | 1,900,000 | 1,649,352 | 2039/09/20 |
| 171回 利付国庫債券(20年) | 0.3000 | 1,740,000 | 1,502,507 | 2039/12/20 |
| 32回 利付国庫債券(30年)  | 2.3000 | 970,000   | 1,114,646 | 2040/03/20 |
| 172回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 1,380,000 | 1,205,098 | 2040/03/20 |
| 173回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 2,360,000 | 2,050,202 | 2040/06/20 |
| 33回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 1,180,000 | 1,299,840 | 2040/09/20 |
| 174回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 2,400,000 | 2,074,008 | 2040/09/20 |
| 175回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,020,000 | 1,767,378 | 2040/12/20 |

| 銘柄               | 当期末    |           |           |            |
|------------------|--------|-----------|-----------|------------|
|                  | 利率     | 額面金額      | 評価額       | 償還年月日      |
| (国債証券)           | %      | 千円        | 千円        |            |
| 34回 利付国庫債券(30年)  | 2.2000 | 1,200,000 | 1,355,760 | 2041/03/20 |
| 176回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,500,000 | 2,177,675 | 2041/03/20 |
| 177回 利付国庫債券(20年) | 0.4000 | 1,750,000 | 1,490,195 | 2041/06/20 |
| 35回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 1,060,000 | 1,162,088 | 2041/09/20 |
| 178回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,800,000 | 2,416,932 | 2041/09/20 |
| 179回 利付国庫債券(20年) | 0.5000 | 2,200,000 | 1,890,306 | 2041/12/20 |
| 36回 利付国庫債券(30年)  | 2.0000 | 1,370,000 | 1,499,465 | 2042/03/20 |
| 180回 利付国庫債券(20年) | 0.8000 | 2,520,000 | 2,277,072 | 2042/03/20 |
| 181回 利付国庫債券(20年) | 0.9000 | 1,900,000 | 1,742,262 | 2042/06/20 |
| 37回 利付国庫債券(30年)  | 1.9000 | 1,360,000 | 1,464,638 | 2042/09/20 |
| 182回 利付国庫債券(20年) | 1.1000 | 2,150,000 | 2,035,319 | 2042/09/20 |
| 183回 利付国庫債券(20年) | 1.4000 | 1,700,000 | 1,688,661 | 2042/12/20 |
| 38回 利付国庫債券(30年)  | 1.8000 | 850,000   | 898,509   | 2043/03/20 |
| 184回 利付国庫債券(20年) | 1.1000 | 1,880,000 | 1,769,700 | 2043/03/20 |
| 39回 利付国庫債券(30年)  | 1.9000 | 1,210,000 | 1,297,144 | 2043/06/20 |
| 185回 利付国庫債券(20年) | 1.1000 | 2,100,000 | 1,969,632 | 2043/06/20 |
| 40回 利付国庫債券(30年)  | 1.8000 | 1,030,000 | 1,085,002 | 2043/09/20 |
| 186回 利付国庫債券(20年) | 1.5000 | 1,900,000 | 1,904,313 | 2043/09/20 |
| 41回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 1,060,000 | 1,095,764 | 2043/12/20 |
| 187回 利付国庫債券(20年) | 1.3000 | 500,000   | 482,860   | 2043/12/20 |
| 42回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 1,000,000 | 1,032,470 | 2044/03/20 |
| 43回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 1,410,000 | 1,453,949 | 2044/06/20 |
| 44回 利付国庫債券(30年)  | 1.7000 | 1,130,000 | 1,163,719 | 2044/09/20 |
| 45回 利付国庫債券(30年)  | 1.5000 | 1,150,000 | 1,141,835 | 2044/12/20 |
| 46回 利付国庫債券(30年)  | 1.5000 | 1,870,000 | 1,853,656 | 2045/03/20 |
| 47回 利付国庫債券(30年)  | 1.6000 | 1,340,000 | 1,349,661 | 2045/06/20 |
| 48回 利付国庫債券(30年)  | 1.4000 | 1,720,000 | 1,667,454 | 2045/09/20 |
| 49回 利付国庫債券(30年)  | 1.4000 | 1,300,000 | 1,257,906 | 2045/12/20 |
| 50回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,150,000 | 982,985   | 2046/03/20 |
| 51回 利付国庫債券(30年)  | 0.3000 | 1,520,000 | 1,153,011 | 2046/06/20 |
| 52回 利付国庫債券(30年)  | 0.5000 | 1,500,000 | 1,188,690 | 2046/09/20 |
| 53回 利付国庫債券(30年)  | 0.6000 | 1,220,000 | 986,199   | 2046/12/20 |
| 54回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,790,000 | 1,510,348 | 2047/03/20 |
| 55回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,080,000 | 908,452   | 2047/06/20 |
| 56回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,040,000 | 872,092   | 2047/09/20 |
| 57回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,730,000 | 1,446,193 | 2047/12/20 |
| 1回 利付国庫債券(40年)   | 2.4000 | 110,000   | 126,511   | 2048/03/20 |
| 58回 利付国庫債券(30年)  | 0.8000 | 1,660,000 | 1,383,377 | 2048/03/20 |
| 59回 利付国庫債券(30年)  | 0.7000 | 1,120,000 | 907,625   | 2048/06/20 |
| 60回 利付国庫債券(30年)  | 0.9000 | 1,330,000 | 1,126,895 | 2048/09/20 |
| 61回 利付国庫債券(30年)  | 0.7000 | 1,060,000 | 852,515   | 2048/12/20 |
| 2回 利付国庫債券(40年)   | 2.2000 | 330,000   | 365,445   | 2049/03/20 |
| 62回 利付国庫債券(30年)  | 0.5000 | 720,000   | 547,336   | 2049/03/20 |
| 63回 利付国庫債券(30年)  | 0.4000 | 1,100,000 | 810,128   | 2049/06/20 |
| 64回 利付国庫債券(30年)  | 0.4000 | 1,300,000 | 952,718   | 2049/09/20 |
| 65回 利付国庫債券(30年)  | 0.4000 | 1,300,000 | 948,844   | 2049/12/20 |
| 3回 利付国庫債券(40年)   | 2.2000 | 540,000   | 596,343   | 2050/03/20 |

| 銘柄                  | 当期末    |             |             |            |
|---------------------|--------|-------------|-------------|------------|
|                     | 利率     | 額面金額        | 評価額         | 償還年月日      |
| <b>(国債証券)</b>       |        |             |             |            |
| 66回 利付国庫債券(30年)     | 0.4000 | 1,090,000   | 791,677     | 2050/03/20 |
| 67回 利付国庫債券(30年)     | 0.6000 | 1,270,000   | 971,626     | 2050/06/20 |
| 68回 利付国庫債券(30年)     | 0.6000 | 1,340,000   | 1,021,401   | 2050/09/20 |
| 69回 利付国庫債券(30年)     | 0.7000 | 1,360,000   | 1,062,323   | 2050/12/20 |
| 4回 利付国庫債券(40年)      | 2.2000 | 720,000     | 793,389     | 2051/03/20 |
| 70回 利付国庫債券(30年)     | 0.7000 | 1,400,000   | 1,089,788   | 2051/03/20 |
| 71回 利付国庫債券(30年)     | 0.7000 | 1,480,000   | 1,148,021   | 2051/06/20 |
| 72回 利付国庫債券(30年)     | 0.7000 | 1,290,000   | 997,118     | 2051/09/20 |
| 73回 利付国庫債券(30年)     | 0.7000 | 1,390,000   | 1,071,606   | 2051/12/20 |
| 5回 利付国庫債券(40年)      | 2.0000 | 710,000     | 749,781     | 2052/03/20 |
| 74回 利付国庫債券(30年)     | 1.0000 | 1,390,000   | 1,160,872   | 2052/03/20 |
| 75回 利付国庫債券(30年)     | 1.3000 | 1,320,000   | 1,188,316   | 2052/06/20 |
| 76回 利付国庫債券(30年)     | 1.4000 | 1,320,000   | 1,215,733   | 2052/09/20 |
| 77回 利付国庫債券(30年)     | 1.6000 | 1,600,000   | 1,543,632   | 2052/12/20 |
| 6回 利付国庫債券(40年)      | 1.9000 | 940,000     | 969,976     | 2053/03/20 |
| 78回 利付国庫債券(30年)     | 1.4000 | 1,800,000   | 1,653,048   | 2053/03/20 |
| 79回 利付国庫債券(30年)     | 1.2000 | 1,600,000   | 1,396,880   | 2053/06/20 |
| 80回 利付国庫債券(30年)     | 1.8000 | 1,700,000   | 1,713,226   | 2053/09/20 |
| 81回 利付国庫債券(30年)     | 1.6000 | 200,000     | 192,046     | 2053/12/20 |
| 7回 利付国庫債券(40年)      | 1.7000 | 880,000     | 864,503     | 2054/03/20 |
| 8回 利付国庫債券(40年)      | 1.4000 | 990,000     | 900,286     | 2055/03/20 |
| 9回 利付国庫債券(40年)      | 0.4000 | 1,890,000   | 1,252,408   | 2056/03/20 |
| 10回 利付国庫債券(40年)     | 0.9000 | 1,930,000   | 1,499,783   | 2057/03/20 |
| 11回 利付国庫債券(40年)     | 0.8000 | 1,040,000   | 775,236     | 2058/03/20 |
| 12回 利付国庫債券(40年)     | 0.5000 | 1,420,000   | 938,236     | 2059/03/20 |
| 13回 利付国庫債券(40年)     | 0.5000 | 2,090,000   | 1,362,889   | 2060/03/20 |
| 14回 利付国庫債券(40年)     | 0.7000 | 2,100,000   | 1,461,096   | 2061/03/20 |
| 15回 利付国庫債券(40年)     | 1.0000 | 2,340,000   | 1,795,271   | 2062/03/20 |
| 16回 利付国庫債券(40年)     | 1.3000 | 1,700,000   | 1,429,513   | 2063/03/20 |
| 小計                  | -      | 464,585,000 | 451,739,708 | -          |
| <b>(地方債証券)</b>      |        |             |             |            |
| 5回 東京都公募公債 20年      | 2.1100 | 100,000     | 102,178     | 2025/03/19 |
| 213回 神奈川県公募公債       | 0.5340 | 100,000     | 100,461     | 2025/03/19 |
| 144回 共同発行市場公募地方債    | 0.4700 | 400,000     | 401,568     | 2025/03/25 |
| 146回 共同発行市場公募地方債    | 0.5530 | 600,000     | 603,186     | 2025/05/23 |
| 27年度4回 千葉県公募公債      | 0.6020 | 200,000     | 201,294     | 2025/07/25 |
| 148回 共同発行市場公募地方債    | 0.5530 | 500,000     | 502,880     | 2025/07/25 |
| 7回 東京都公募公債 20年      | 2.1600 | 100,000     | 103,173     | 2025/09/19 |
| 1回 静岡県公募公債 20年      | 2.1800 | 100,000     | 103,196     | 2025/09/19 |
| 150回 共同発行市場公募地方債    | 0.5100 | 300,000     | 301,635     | 2025/09/25 |
| 27年度15回 愛知県公募公債 10年 | 0.4710 | 100,000     | 100,483     | 2025/11/27 |
| 153回 共同発行市場公募地方債    | 0.4690 | 100,000     | 100,479     | 2025/12/25 |
| 27年度9回 千葉県公募公債      | 0.0950 | 100,000     | 99,716      | 2026/03/25 |
| 157回 共同発行市場公募地方債    | 0.0800 | 120,000     | 119,607     | 2026/04/24 |
| 9回 東京都公募公債 20年      | 2.4400 | 200,000     | 210,298     | 2026/06/19 |
| 159回 共同発行市場公募地方債    | 0.0700 | 200,000     | 199,224     | 2026/06/25 |
| 160回 共同発行市場公募地方債    | 0.0500 | 500,000     | 497,755     | 2026/07/24 |

| 銘柄                 | 当期末    |         |         |            |
|--------------------|--------|---------|---------|------------|
|                    | 利率     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| <b>(地方債証券)</b>     |        |         |         |            |
| 1回 兵庫県公募公債 15年     | 1.6600 | 200,000 | 206,898 | 2026/07/29 |
| 28年度6回 北海道公募公債     | 0.0700 | 100,000 | 99,557  | 2026/08/31 |
| 760回 東京都公募公債       | 0.0450 | 100,000 | 99,497  | 2026/09/18 |
| 10回 東京都公募公債 20年    | 2.3300 | 300,000 | 316,152 | 2026/09/18 |
| 4回 京都市公募公債 20年     | 2.5100 | 100,000 | 105,820 | 2026/09/18 |
| 413回 大阪府公募公債 10年   | 0.0210 | 100,000 | 99,385  | 2026/10/28 |
| 190回 大阪府公募公債 5年    | 0.0010 | 300,000 | 297,792 | 2026/12/25 |
| 166回 共同発行市場公募地方債   | 0.1800 | 500,000 | 498,905 | 2027/01/25 |
| 令和3年度3回 仙台市公募公債 5年 | 0.0010 | 300,000 | 297,768 | 2027/01/28 |
| 28年度8回 福岡県公募公債     | 0.2400 | 100,000 | 99,941  | 2027/02/24 |
| 169回 共同発行市場公募地方債   | 0.2050 | 500,000 | 498,950 | 2027/04/23 |
| 419回 大阪府公募公債 10年   | 0.1960 | 100,000 | 99,713  | 2027/04/27 |
| 2回 静岡県公募公債 15年     | 1.4060 | 100,000 | 103,695 | 2027/06/25 |
| 5回 兵庫県公募公債 12年     | 0.6870 | 100,000 | 101,282 | 2027/07/07 |
| 173回 共同発行市場公募地方債   | 0.2150 | 400,000 | 398,672 | 2027/08/25 |
| 29年度4回 大阪市公募公債     | 0.1500 | 200,000 | 198,716 | 2027/09/21 |
| 174回 共同発行市場公募地方債   | 0.1450 | 100,000 | 99,375  | 2027/09/24 |
| 24年度1回 福岡県公募公債 15年 | 1.3290 | 100,000 | 103,700 | 2027/11/29 |
| 178回 共同発行市場公募地方債   | 0.2300 | 100,000 | 99,513  | 2028/01/25 |
| 179回 共同発行市場公募地方債   | 0.2400 | 500,000 | 497,510 | 2028/02/25 |
| 29年度6回 広島市公募公債     | 0.2300 | 300,000 | 298,389 | 2028/02/25 |
| 29年度13回 京都府公募公債    | 0.2000 | 109,330 | 108,537 | 2028/03/16 |
| 5回 兵庫県公募公債 15年     | 1.3100 | 300,000 | 311,415 | 2028/05/26 |
| 783回 東京都公募公債       | 0.2200 | 110,000 | 109,153 | 2028/06/20 |
| 4回 静岡県公募公債 15年     | 1.3380 | 100,000 | 104,014 | 2028/06/23 |
| 30年度8回 北海道公募公債     | 0.2490 | 400,000 | 396,768 | 2028/08/31 |
| 30年度7回 神戸市公募公債 30年 | 0.2540 | 300,000 | 297,681 | 2028/09/20 |
| 第91回 川崎市公募公債       | 0.1850 | 200,000 | 197,832 | 2028/09/20 |
| 7回 静岡県公募公債 20年     | 2.3200 | 300,000 | 325,803 | 2028/09/21 |
| 30年度3回 広島県公募公債     | 0.2540 | 100,000 | 99,224  | 2028/09/25 |
| 30年度3回 堺市公募公債      | 0.1950 | 100,000 | 98,742  | 2028/12/19 |
| 237回 神奈川県公募公債      | 0.1350 | 200,000 | 197,008 | 2028/12/20 |
| 20回2号 福岡県公募公債      | 2.0500 | 100,000 | 107,617 | 2028/12/20 |
| 6回 大阪市公募公債 20年     | 2.2100 | 200,000 | 216,702 | 2028/12/20 |
| 17回 横浜市公募公債 20年    | 2.0700 | 100,000 | 107,737 | 2028/12/20 |
| 6回 北九州市公募公債 20年    | 2.0300 | 100,000 | 107,471 | 2028/12/20 |
| 30年度6回 福岡県公募公債     | 0.2000 | 200,000 | 197,622 | 2028/12/21 |
| 189回 共同発行市場公募地方債   | 0.2100 | 100,000 | 98,855  | 2028/12/25 |
| 30年度14回 北海道公募公債    | 0.1950 | 400,000 | 394,936 | 2028/12/28 |
| 18回 東京都公募公債 20年    | 2.2200 | 100,000 | 108,736 | 2029/03/19 |
| 30年度19回 愛知県公募公債    | 0.1150 | 200,000 | 196,408 | 2029/03/28 |
| 30年度3回 岡山県公募公債 10年 | 0.1500 | 200,000 | 196,756 | 2029/03/29 |
| 194回 共同発行市場公募地方債   | 0.1100 | 300,000 | 294,294 | 2029/05/25 |
| 6回 川崎市公募公債 20年     | 2.2100 | 200,000 | 217,928 | 2029/05/25 |
| 令和元年度1回 福岡県公募公債    | 0.0290 | 200,000 | 195,300 | 2029/06/21 |
| 9回 兵庫県公募公債 15年     | 1.0200 | 100,000 | 102,798 | 2029/07/13 |
| 11回 神奈川県公募公債 20年   | 2.0800 | 100,000 | 108,530 | 2029/07/20 |

| 銘柄                  | 当期末    |         |         |            |
|---------------------|--------|---------|---------|------------|
|                     | 利率     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| (地方債証券)             | %      | 千円      | 千円      |            |
| 196回 共同発行市場公募地方債    | 0.0600 | 500,000 | 488,870 | 2029/07/25 |
| 796回 東京都公募公債        | 0.0400 | 200,000 | 195,152 | 2029/09/20 |
| 令和元年度 9回 静岡県公募公債    | 0.0500 | 200,000 | 195,262 | 2029/09/20 |
| 令和元年度3回 横浜市公募公債     | 0.0500 | 400,000 | 390,400 | 2029/10/16 |
| 令和元年度16回 芦屋市公募公債    | 0.0500 | 200,000 | 195,074 | 2029/10/23 |
| 21回 東京都公募公債 20年     | 2.1900 | 100,000 | 109,761 | 2029/12/20 |
| 17回 さいたま市公募公債       | 0.1100 | 200,000 | 195,662 | 2029/12/25 |
| 令和元年度第8回 埼玉県公募公債    | 0.1350 | 200,000 | 195,830 | 2030/01/30 |
| 21年度2回 福岡県公募公債(20年) | 2.2300 | 100,000 | 110,220 | 2030/02/22 |
| 203回 共同発行市場公募地方債    | 0.0950 | 100,000 | 97,629  | 2030/02/25 |
| 802回 東京都公募公債        | 0.1300 | 400,000 | 391,140 | 2030/03/19 |
| 511回 名古屋市公募公債 10年   | 0.0750 | 200,000 | 194,898 | 2030/03/27 |
| 令和2年度1回 京都府公募公債     | 0.1350 | 400,000 | 390,784 | 2030/04/12 |
| 令和2年 2回 大阪市公募公債     | 0.1310 | 300,000 | 292,668 | 2030/05/22 |
| 9回 埼玉県公募公債 20年      | 2.1500 | 100,000 | 110,017 | 2030/05/24 |
| 8回 静岡県公募公債 15年      | 0.8280 | 200,000 | 203,708 | 2030/06/07 |
| 令和2年度 10回 静岡県公募公債   | 0.1350 | 100,000 | 97,296  | 2030/09/20 |
| 令和2年5回 福岡県公募公債      | 0.1350 | 100,000 | 97,228  | 2030/10/23 |
| 36回2号 宮城県公募公債 10年   | 0.1350 | 250,000 | 242,980 | 2030/10/28 |
| 令和2年度1回 福島県公募公債     | 0.1350 | 200,000 | 194,252 | 2030/11/27 |
| 令和2年度1回 高知県公募公債     | 0.1350 | 200,000 | 194,252 | 2030/11/27 |
| 22年度14回 愛知県公募公債     | 0.0870 | 300,000 | 330,165 | 2030/12/13 |
| 9回 京都市公募公債 20年      | 2.1430 | 200,000 | 220,734 | 2030/12/17 |
| 813回 東京都公募公債        | 0.1790 | 300,000 | 292,077 | 2030/12/20 |
| 16回 神奈川県公募公債 20年    | 0.2090 | 300,000 | 330,453 | 2031/01/24 |
| 464回 大阪府公募公債 10年    | 0.0720 | 200,000 | 192,918 | 2031/01/28 |
| 令和2年度19回 北海道公募公債    | 0.1450 | 100,000 | 96,870  | 2031/02/26 |
| 令和2年度14回 京都府公募公債    | 0.2140 | 200,000 | 194,634 | 2031/03/12 |
| 令和2年 7回 広島県公募公債     | 0.2140 | 200,000 | 194,680 | 2031/03/19 |
| 251回 神奈川県公募公債 10年   | 0.1990 | 200,000 | 194,474 | 2031/03/20 |
| 令和2年度 14回 静岡県公募公債   | 0.1400 | 200,000 | 193,670 | 2031/03/20 |
| 令和3年度1回 長野県公募公債 10年 | 0.1900 | 200,000 | 194,180 | 2031/04/16 |
| 令和3年度2回 兵庫県公募公債     | 0.1750 | 100,000 | 96,880  | 2031/04/25 |
| 467回 大阪府公募公債 10年    | 0.1640 | 200,000 | 193,604 | 2031/04/28 |
| 469回 大阪府公募公債 10年    | 0.1280 | 200,000 | 192,658 | 2031/06/27 |
| 11回 北九州市公募公債 20年    | 2.0190 | 300,000 | 329,586 | 2031/07/18 |
| 令和3年 5回 千葉県公募公債     | 0.1050 | 200,000 | 191,810 | 2031/09/25 |
| 472回 大阪府公募公債 10年    | 0.1000 | 200,000 | 191,586 | 2031/09/29 |
| 474回 大阪府公募公債 10年    | 0.1190 | 300,000 | 287,223 | 2031/11/28 |
| 19回 神奈川県公募公債 20年    | 1.8180 | 100,000 | 108,645 | 2032/01/30 |
| 227回 共同発行市場公募地方債    | 0.2440 | 500,000 | 482,465 | 2032/02/25 |
| 228回 共同発行市場公募地方債    | 0.1990 | 500,000 | 480,210 | 2032/03/25 |
| 258回 神奈川県公募公債 10年   | 0.2900 | 300,000 | 289,497 | 2032/06/18 |
| 24年度2回 福岡県公募公債(20年) | 1.6350 | 300,000 | 321,906 | 2032/08/16 |
| 10回 大阪府公募公債 20年     | 1.7200 | 200,000 | 215,816 | 2032/09/24 |
| 24年度12回 神戸市公募公債     | 1.7110 | 200,000 | 215,950 | 2032/12/17 |
| 14回 千葉県公募公債 20年     | 1.1370 | 100,000 | 102,889 | 2033/04/15 |

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

| 銘柄                     | 当期末    |         |         |            |
|------------------------|--------|---------|---------|------------|
|                        | 利率     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| (特殊債券)                 | %      | 千円      | 千円      |            |
| 23回 国際協力銀行債券           | 2.0900 | 100,000 | 103,358 | 2025/12/19 |
| 61回 住宅金融支援機構債券         | 1.8300 | 100,000 | 102,881 | 2025/12/19 |
| F538回 地方公共団体金融機関債券     | 0.0200 | 500,000 | 497,820 | 2025/12/25 |
| 40回 政保日本政策金融公庫債券       | 0.0200 | 103,000 | 102,648 | 2026/03/13 |
| 33回 政保日本政策投資銀行社債       | 0.0200 | 300,000 | 298,941 | 2026/03/16 |
| 87回 中日本高速道路債券          | 0.0600 | 400,000 | 397,924 | 2026/03/18 |
| 11回 独立行政法人福祉医療機構       | 2.5700 | 100,000 | 104,754 | 2026/03/20 |
| 271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.0200 | 300,000 | 298,920 | 2026/03/31 |
| 187回 住宅金融支援機構債券        | 0.0900 | 100,000 | 99,599  | 2026/04/20 |
| 83回 地方公共団体金融機関債券 10年   | 0.0900 | 400,000 | 398,380 | 2026/04/28 |
| 80回 住宅金融支援機構債券         | 1.5890 | 100,000 | 103,368 | 2026/09/18 |
| 321回 住宅金融支援機構債券        | 0.0100 | 500,000 | 496,460 | 2026/09/18 |
| 325回 住宅金融支援機構債券        | 0.0100 | 500,000 | 496,460 | 2026/09/18 |
| 79回 政保地方公共団体金融機関債券     | 1.5070 | 300,000 | 309,873 | 2026/11/06 |
| 91回 政保地方公共団体金融機関債券     | 0.0850 | 100,000 | 99,662  | 2026/12/14 |
| 300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.1150 | 100,000 | 99,707  | 2027/01/29 |
| F147回 地方公共団体金融機関債券     | 0.2910 | 200,000 | 206,076 | 2027/03/19 |
| 78回 日本政策投資銀行債券         | 0.2250 | 300,000 | 299,007 | 2027/04/13 |
| 309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.1400 | 800,000 | 797,536 | 2027/04/30 |
| 96回 地方公共団体金融機関債券       | 0.2050 | 500,000 | 497,990 | 2027/05/28 |
| 72回 東日本高速道路社債          | 0.1200 | 200,000 | 198,316 | 2027/06/18 |
| 98回 政保地方公共団体金融機関債券     | 0.1600 | 100,000 | 99,661  | 2027/07/16 |
| 222回 住宅金融支援機構債券        | 0.2100 | 300,000 | 297,939 | 2027/11/19 |
| 103回 政保地方公共団体金融機関債券    | 0.1550 | 100,000 | 99,449  | 2027/12/17 |
| 124回 住宅金融支援機構債券        | 1.4280 | 100,000 | 103,914 | 2027/12/20 |
| 77回 東日本高速道路社債          | 0.1100 | 300,000 | 296,307 | 2027/12/20 |
| 230回 住宅金融支援機構債券        | 0.2600 | 300,000 | 298,044 | 2028/02/18 |
| 113回 政保地方公共団体金融機関債券    | 0.2190 | 100,000 | 99,208  | 2028/10/16 |
| 9回 新関西国際空港社債           | 1.2310 | 200,000 | 206,138 | 2028/12/20 |
| 1回 地方公共団体金融機関債券 20年    | 2.0700 | 200,000 | 214,862 | 2028/12/20 |
| 93回 都市再生債券             | 1.1020 | 100,000 | 102,925 | 2029/06/20 |
| 1回 地方公共団体金融機関債券 20年    | 2.2660 | 300,000 | 327,294 | 2029/06/28 |
| 2回 地方公共団体金融機関債券 20年    | 2.2660 | 300,000 | 328,032 | 2029/08/28 |
| 12回 新関西国際空港社債          | 1.0670 | 200,000 | 204,900 | 2029/09/20 |
| 39回 住宅金融支援機構債券         | 2.1500 | 200,000 | 217,514 | 2029/09/20 |
| 97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構  | 2.1000 | 100,000 | 109,439 | 2029/12/28 |
| 78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券  | 0.8010 | 100,000 | 101,254 | 2030/05/28 |
| 109回 都市再生機構債券          | 0.9180 | 200,000 | 203,884 | 2030/06/20 |
| 15回 日本政策金融公庫債券         | 1.9110 | 200,000 | 216,362 | 2030/10/29 |
| 121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8000 | 500,000 | 541,375 | 2030/10/31 |
| 13回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 2.1320 | 100,000 | 109,893 | 2031/01/28 |
| 90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券  | 0.2000 | 200,000 | 192,776 | 2031/05/30 |
| 75回 住宅金融支援機構債券         | 2.0660 | 350,000 | 383,484 | 2031/06/13 |
| 75回 日本高速道路保有・債務返済機構    | 1.9600 | 100,000 | 108,901 | 2031/09/19 |
| 153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8000 | 100,000 | 108,696 | 2031/12/26 |
| 19回 地方公共団体金融機関債券       | 1.8400 | 200,000 | 216,450 | 2031/12/26 |
| 156回 日本政策投資銀行債券        | 0.2990 | 400,000 | 384,036 | 2032/04/14 |

| 銘柄                     | 当期末    |         |         |            |
|------------------------|--------|---------|---------|------------|
|                        | 利率     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| (特殊債券)                 | %      | 千円      | 千円      |            |
| 23回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 1.6800 | 100,000 | 107,062 | 2032/07/28 |
| 115回 住宅金融支援機構債券        | 1.8110 | 100,000 | 107,963 | 2032/09/14 |
| 15回 国際協力機構債            | 1.7240 | 100,000 | 107,271 | 2032/09/17 |
| 24回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 1.7020 | 200,000 | 214,502 | 2032/09/28 |
| 188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.4000 | 100,000 | 105,383 | 2033/04/28 |
| 28回 日本道路・機構承継債         | 2.8300 | 500,000 | 586,595 | 2033/12/20 |
| 124回 日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.5500 | 100,000 | 105,372 | 2034/03/17 |
| 36回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 1.5660 | 100,000 | 105,597 | 2034/04/28 |
| 39回 地方公共団体金融機関債券       | 1.4250 | 500,000 | 520,115 | 2034/09/28 |
| 42回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 0.9990 | 300,000 | 298,458 | 2035/01/26 |
| 239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.1600 | 300,000 | 306,267 | 2035/02/28 |
| 159回 住宅金融支援機構債券        | 1.1250 | 100,000 | 100,422 | 2035/05/18 |
| 155回 日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.3000 | 100,000 | 102,214 | 2035/06/20 |
| 44回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 1.2980 | 200,000 | 204,606 | 2035/06/28 |
| 250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.2780 | 100,000 | 103,148 | 2035/06/29 |
| 第262回 政保道路債            | 1.1090 | 500,000 | 504,910 | 2035/11/30 |
| 172回 高速道路機構債           | 0.2880 | 200,000 | 179,802 | 2036/06/20 |
| 286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.3100 | 200,000 | 182,272 | 2036/08/29 |
| 59回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 0.6690 | 100,000 | 93,194  | 2037/04/28 |
| 319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.6300 | 200,000 | 187,104 | 2037/07/31 |
| 26回 高速道路機構債            | 0.2670 | 200,000 | 233,730 | 2037/09/18 |
| 337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.5910 | 100,000 | 92,332  | 2038/01/29 |
| 233回 住宅金融支援機構債券        | 0.5830 | 100,000 | 90,651  | 2038/04/20 |
| F174回 地方公共団体金融機関債券     | 1.8890 | 300,000 | 323,085 | 2038/05/28 |
| 210回 高速道路機構債           | 0.6770 | 100,000 | 91,457  | 2038/09/17 |
| 50回 高速道路機構債            | 0.5000 | 300,000 | 261,801 | 2039/03/18 |
| 77回 地方公共団体金融機関債券 20年   | 0.2000 | 300,000 | 249,837 | 2039/09/28 |
| 125回 日本政策投資銀行債券        | 0.3790 | 500,000 | 423,105 | 2040/04/24 |
| 288回 政保地方公共団体金融機関債券    | 1.4370 | 300,000 | 299,532 | 2040/07/27 |
| 116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.8000 | 100,000 | 105,683 | 2040/08/31 |
| 40回 貸付債権担保住宅金融公庫債券     | 1.9300 | 39,840  | 39,922  | 2041/03/10 |
| 148回 住宅金融支援機構債券        | 1.9750 | 250,000 | 262,347 | 2043/12/18 |
| 27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 2.0500 | 14,543  | 15,049  | 2044/08/10 |
| 29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.9500 | 91,485  | 95,618  | 2044/10/10 |
| 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.8100 | 137,552 | 142,813 | 2045/05/10 |
| 159回 日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.6070 | 100,000 | 97,988  | 2045/06/20 |
| 38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.6100 | 19,385  | 20,065  | 2045/07/10 |
| 1回 高速道路機構債             | 2.9900 | 300,000 | 365,850 | 2045/09/20 |
| 260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.3900 | 200,000 | 190,616 | 2045/10/31 |
| 169回 高速道路機構債           | 1.2000 | 100,000 | 90,510  | 2045/12/20 |
| 268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 1.2800 | 100,000 | 93,062  | 2046/01/31 |
| 49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.7600 | 16,717  | 17,291  | 2046/06/10 |
| 52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.5100 | 19,533  | 20,123  | 2046/09/10 |
| 53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.4800 | 20,588  | 21,207  | 2046/10/10 |
| 19回 高速道路機構債            | 2.7500 | 150,000 | 176,331 | 2047/03/20 |
| 60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.3400 | 25,093  | 25,777  | 2047/05/10 |
| 64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 1.1600 | 61,990  | 63,137  | 2047/09/10 |

| 銘柄                     | 当期末    |            |            |            |
|------------------------|--------|------------|------------|------------|
|                        | 利率     | 額面金額       | 評価額        | 償還年月日      |
| <b>(特殊債券)</b>          |        |            |            |            |
| 36回 高速道路機構債            | %      | 千円         | 千円         |            |
| 36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 2.8400 | 300,000    | 357,984    | 2048/03/20 |
| 76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.2100 | 27,869     | 28,479     | 2048/09/10 |
| 82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.0000 | 34,215     | 34,555     | 2049/03/10 |
| 84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.0100 | 34,841     | 35,184     | 2049/05/10 |
| 86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 1.0000 | 38,462     | 38,743     | 2049/07/10 |
| 90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.8700 | 39,819     | 39,807     | 2049/11/10 |
| 398回 政保道路債             | 0.4220 | 300,000    | 215,955    | 2049/12/28 |
| 93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.6000 | 45,186     | 44,313     | 2050/02/10 |
| 10回 地方公共団体金融機関債券 30年   | 0.5170 | 300,000    | 218,448    | 2050/04/28 |
| 96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.7400 | 50,831     | 50,142     | 2050/05/10 |
| 131回 日本政策投資銀行債券        | 0.7000 | 100,000    | 76,186     | 2050/06/20 |
| 165回 都市再生機構債券          | 0.7090 | 200,000    | 152,808    | 2050/06/20 |
| 99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券    | 0.8800 | 52,733     | 52,311     | 2050/08/10 |
| 418回 高速道路機構債           | 0.6300 | 200,000    | 148,552    | 2051/08/31 |
| 420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.6800 | 200,000    | 150,504    | 2051/10/31 |
| 114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.3400 | 199,941    | 190,849    | 2051/11/10 |
| 117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4600 | 67,846     | 65,087     | 2052/02/10 |
| 118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4700 | 67,335     | 64,691     | 2052/03/10 |
| 119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4600 | 67,696     | 64,966     | 2052/04/10 |
| 126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4300 | 211,506    | 201,639    | 2052/11/10 |
| 128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4200 | 211,575    | 201,595    | 2053/01/10 |
| 130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4200 | 144,312    | 137,350    | 2053/03/10 |
| 131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4000 | 215,997    | 205,032    | 2053/04/10 |
| 132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4000 | 214,077    | 203,291    | 2053/05/10 |
| 137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4700 | 373,440    | 355,589    | 2053/10/10 |
| 139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4600 | 74,406     | 70,786     | 2053/12/10 |
| 142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.3200 | 76,806     | 72,208     | 2054/03/10 |
| 154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.3000 | 248,163    | 231,548    | 2055/03/10 |
| 162回 日本高速道路保有・債務返済機構   | 1.8610 | 100,000    | 97,883     | 2055/03/19 |
| 156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.3500 | 330,528    | 309,275    | 2055/05/10 |
| 160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.3700 | 254,616    | 238,524    | 2055/09/10 |
| 168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.4000 | 260,364    | 243,979    | 2056/05/10 |
| 170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券   | 0.3600 | 794,556    | 742,520    | 2056/07/10 |
| 413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構 | 0.6800 | 200,000    | 135,102    | 2061/02/28 |
| 小計                     | -      | 27,236,846 | 27,002,386 | -          |
| <b>(金融債券)</b>          |        |            |            |            |
| い第843号 利付商工債           | %      | 千円         | 千円         |            |
| 369回 利附信金中金債(5年)       | 0.1200 | 100,000    | 99,735     | 2025/08/27 |
| い第851号 利付商工債           | 0.0600 | 400,000    | 398,876    | 2025/08/27 |
| 377回 利附信金中金債(5年)       | 0.0900 | 300,000    | 298,101    | 2026/04/27 |
| い第854号 利付商工債           | 0.0400 | 300,000    | 298,296    | 2026/04/27 |
| い第855号 利付商工債           | 0.0800 | 300,000    | 297,708    | 2026/07/27 |
| い第855号 利付商工債           | 0.0800 | 200,000    | 198,394    | 2026/08/27 |
| 小計                     | -      | 1,600,000  | 1,591,110  | -          |
| <b>(普通社債券)</b>         |        |            |            |            |
| 10回 キリンホールディングス社債      | %      | 千円         | 千円         |            |
| 26回 西日本高速道路社債          | 0.6030 | 100,000    | 100,381    | 2025/02/28 |
| 29回 三井住友ファイナンス&リース社債   | 0.6040 | 100,000    | 100,504    | 2025/05/21 |
| 29回 三井住友ファイナンス&リース社債   | 0.1900 | 200,000    | 199,544    | 2025/06/11 |

| 銘柄                             | 当期末    |         |         |            |
|--------------------------------|--------|---------|---------|------------|
|                                | 利率     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| <b>(普通社債券)</b>                 |        |         |         |            |
| 12回 セブン&アイ・ホールディングス社債          | %      | 千円      | 千円      |            |
| 39回 東日本旅客鉄道社債                  | 0.7810 | 100,000 | 100,653 | 2025/06/20 |
| 497回 関西電力社債                    | 2.0500 | 300,000 | 307,218 | 2025/06/20 |
| 13回 電源開発社債                     | 1.0020 | 100,000 | 100,872 | 2025/06/20 |
| 12回 新生銀行社債                     | 0.3600 | 200,000 | 204,598 | 2025/06/20 |
| 42回 東日本旅客鉄道社債                  | 2.1100 | 200,000 | 205,810 | 2025/09/19 |
| 27回 首都高速道路社債                   | 0.0600 | 400,000 | 398,236 | 2025/12/19 |
| 14回 セブン&アイ・ホールディングス社債          | 0.1900 | 200,000 | 199,314 | 2025/12/19 |
| 26回 トヨタ自動車社債                   | 0.0500 | 200,000 | 198,672 | 2026/03/18 |
| 42回 王子ホールディングス社債               | 0.0800 | 200,000 | 198,504 | 2026/03/24 |
| 96回 トヨタファイナンス社債                | 0.0600 | 100,000 | 99,312  | 2026/04/15 |
| 163回 東日本旅客鉄道社債                 | 0.0500 | 300,000 | 298,002 | 2026/04/15 |
| 28回 芙蓉総合リース社債                  | 0.1400 | 300,000 | 297,675 | 2026/04/21 |
| 493回 九州電力社債                    | 0.1000 | 200,000 | 198,446 | 2026/05/25 |
| 106回 住友不動産社債                   | 0.4000 | 100,000 | 99,866  | 2026/05/26 |
| 24回 大和ハウス工業社債                  | 0.0800 | 200,000 | 198,476 | 2026/06/03 |
| 40回 三井ケミカルホールディングス社債           | 0.0900 | 100,000 | 99,148  | 2026/06/03 |
| 35回 三菱マテリアル社債                  | 0.1100 | 300,000 | 297,507 | 2026/06/05 |
| 11回 クレディ・アグリコル・エヌ・エー・バンク(2016) | 0.4000 | 100,000 | 99,016  | 2026/06/10 |
| 57回 東日本高速道路社債                  | 0.1100 | 100,000 | 99,523  | 2026/06/19 |
| 79回 東日本高速道路社債                  | 0.0500 | 300,000 | 298,149 | 2026/06/19 |
| 83回 東日本高速道路社債                  | 0.0500 | 200,000 | 198,766 | 2026/06/19 |
| 61回 西日本高速道路債券                  | 0.0400 | 500,000 | 496,800 | 2026/06/19 |
| 69回 ホンダファイナンス社債                | 0.0900 | 300,000 | 297,672 | 2026/06/19 |
| 4回 東京地下鉄社債                     | 2.3800 | 120,000 | 125,644 | 2026/06/19 |
| 307回 北陸電力社債                    | 1.0550 | 100,000 | 101,459 | 2026/06/25 |
| 90回 中日本高速道路債券                  | 0.0500 | 200,000 | 198,712 | 2026/07/27 |
| 20回 三井住友信託銀行社債                 | 0.1300 | 300,000 | 297,354 | 2026/07/27 |
| 3回 野村ホールディングス社債                | 0.2800 | 300,000 | 296,466 | 2026/09/04 |
| 91回 中日本高速道路債券                  | 0.0400 | 500,000 | 496,400 | 2026/09/17 |
| 62回 西日本高速道路債券                  | 0.0400 | 500,000 | 496,395 | 2026/09/18 |
| 17回 パナソニック社債                   | 0.4700 | 100,000 | 99,897  | 2026/09/18 |
| 27回 三井住友ファイナンス&リース社債           | 0.2200 | 200,000 | 198,732 | 2026/10/16 |
| 488回 東北電力社債                    | 0.2900 | 100,000 | 99,574  | 2026/10/23 |
| 33回 西日本高速道路債券                  | 0.2700 | 300,000 | 299,535 | 2026/12/14 |
| 34回 西日本高速道路債券                  | 0.3350 | 200,000 | 199,772 | 2027/02/16 |
| 12回 りそな銀行劣後社債                  | 2.4640 | 100,000 | 104,231 | 2027/03/15 |
| 88回 三菱東京UFJ銀行社債                | 2.3400 | 100,000 | 105,786 | 2027/04/20 |
| 508回 関西電力社債                    | 0.4550 | 300,000 | 299,376 | 2027/04/23 |
| 340回 北海道電力社債                   | 0.4800 | 300,000 | 299,703 | 2027/04/23 |
| 108回 住友不動産社債                   | 0.4000 | 200,000 | 199,262 | 2027/05/07 |
| 30回 東レ社債                       | 0.3750 | 300,000 | 298,335 | 2027/07/16 |
| 32回 東海旅客鉄道社債                   | 2.3100 | 100,000 | 106,514 | 2027/09/17 |
| 311回 北陸電力社債                    | 0.8470 | 100,000 | 100,996 | 2027/09/24 |
| 25回 フランス互益組合銀行(BFCM)円債社債(2017) | 0.5100 | 300,000 | 295,200 | 2027/10/12 |
| 81回 トヨタファイナンス社債                | 0.2650 | 100,000 | 99,148  | 2027/10/22 |
| 525回 東北電力社債                    | 0.2200 | 200,000 | 197,394 | 2027/10/25 |

| 銘柄                         | 当期末     |         |         |            |
|----------------------------|---------|---------|---------|------------|
|                            | 利 率     | 額面金額    | 評 価 額   | 償還年月日      |
| <b>(普通社債券)</b>             |         |         |         |            |
| 5 4 回 電源開発社債               | 0.3800  | 100,000 | 99,222  | 2027/11/19 |
| 1 7 回 NTTファイナンス社債          | 0.2800  | 300,000 | 296,820 | 2027/12/20 |
| 5 6 回 三菱UFJリース社債           | 0.4550  | 300,000 | 297,744 | 2028/01/18 |
| 1 2 回 ソフトバンク社債             | 0.4200  | 400,000 | 389,284 | 2028/06/02 |
| 7 回 ファーストリテイリング社債          | 0.4050  | 200,000 | 198,098 | 2028/06/06 |
| 5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債 | 0.4940  | 100,000 | 98,784  | 2028/10/25 |
| 2 1 回 西日本旅客鉄道社債            | 2.2470  | 100,000 | 107,938 | 2029/03/21 |
| 23回 三井住友ファイナンス＆リース社債       | 0.3900  | 100,000 | 98,027  | 2029/04/12 |
| 1 4 回 ブリヂストン社債             | 0.3750  | 300,000 | 294,570 | 2029/04/19 |
| 8 0 回 東京急行電鉄社債             | 1.2110  | 100,000 | 102,704 | 2029/04/27 |
| 5 3 0 回 関西電力社債             | 0.4050  | 400,000 | 392,104 | 2029/06/20 |
| 7 3 回 三井物産社債               | 0.2900  | 400,000 | 390,344 | 2029/07/11 |
| 5 3 2 回 中部電力社債             | 0.2240  | 200,000 | 194,654 | 2029/07/25 |
| 7 回 ニッコンHD社債               | 0.2800  | 300,000 | 290,241 | 2029/10/11 |
| 8 0 回 日立キャピタル社債            | 0.2800  | 200,000 | 193,470 | 2029/10/19 |
| 6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債          | 2.1490  | 100,000 | 108,359 | 2029/12/21 |
| 6 7 回 東日本高速道路社債            | 0.2200  | 200,000 | 195,508 | 2030/01/31 |
| 1 9 回 パナソニック社債             | 0.3700  | 100,000 | 97,017  | 2030/03/05 |
| 1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債          | 0.2650  | 100,000 | 97,265  | 2030/04/22 |
| 6 0 回 西日本旅客鉄道社債            | 0.2550  | 200,000 | 194,260 | 2030/05/21 |
| 5 2 1 回 東北電力社債             | 0.4500  | 400,000 | 390,836 | 2030/05/24 |
| 4 2 5 回 中国電力社債             | 0.3700  | 100,000 | 97,185  | 2030/06/25 |
| 3 回 ダイドーグループHD社債           | 0.5100  | 300,000 | 292,026 | 2030/07/16 |
| 31回 三井住友ファイナンス＆リース社債       | 0.3900  | 200,000 | 193,402 | 2030/08/09 |
| 6 回 横浜高速鉄道社債               | 0.4500  | 200,000 | 193,926 | 2030/09/17 |
| 1 8 回 NTTファイナンス社債          | 0.3800  | 400,000 | 388,756 | 2030/09/20 |
| 7 1 回 東日本旅客鉄道社債            | 1.9050  | 100,000 | 107,357 | 2030/09/27 |
| 1 7 回 ダイセル社債               | 0.5000  | 300,000 | 290,607 | 2030/12/13 |
| 8 6 回 日立キャピタル社債            | 0.4000  | 300,000 | 288,195 | 2030/12/20 |
| 7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債          | 0.20980 | 200,000 | 217,508 | 2030/12/20 |
| 2 3 回 パナソニック社債             | 0.3900  | 200,000 | 192,236 | 2030/12/24 |
| 3 0 回 光通信社債                | 0.9800  | 200,000 | 187,466 | 2031/01/31 |
| 7 4 回 西日本旅客鉄道社債            | 0.2300  | 100,000 | 95,906  | 2031/04/22 |
| 4 9 1 回 九州電力社債             | 0.3400  | 300,000 | 287,508 | 2031/04/25 |
| 5 8 回 川崎重工業社債              | 0.3000  | 300,000 | 284,229 | 2031/07/15 |
| 5 4 1 回 関西電力社債             | 0.3700  | 300,000 | 286,134 | 2031/09/19 |

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

## ■投資信託財産の構成

2024年2月14日現在

| 項 目                     | 当 期 末             |           |
|-------------------------|-------------------|-----------|
|                         | 評 価 額             | 比 率       |
| 公 社 債                   | 千円<br>532,975,004 | %<br>99.6 |
| コ ー ル ・ 口 一 ン 等 、 そ の 他 | 2,195,447         | 0.4       |
| 投 資 信 託 財 产 総 額         | 535,170,451       | 100.0     |

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

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月14日)現在

| 項  | 目   | 当期末  |
|--|---|--|
| (A) 資<br>公<br>未<br>前<br><br>(B) 負<br>未<br><br>(C) 純<br>元<br>次<br>期<br>益<br>1<br>万<br>口<br>当<br>た<br>り<br><br>(D) 受<br>益<br>權<br>総<br>越<br>損<br>益<br>金<br>額<br>口<br>基<br>準<br>価<br>額<br>(C/D) | 資<br>公<br>未<br>前<br><br>社<br>利<br>費<br><br>債<br>金<br><br>額(A-B)<br>本<br>金<br>額(C/D) | 535,170,451,990円<br>1,146,537,036<br>532,975,004,601<br>851,415,151<br>197,495,202<br>127,352,000<br>127,352,000<br>535,043,099,990<br>433,635,920,893<br>101,407,179,097<br>433,635,920,893円<br>12,339円 |

(注1) 期首元本額  
追加設定元本額  
一部解約元本額

(注2) 期末における元本の内訳

D IAM国内債券パッジ・ファンド  
MITO ラップ型ファンド(安定型)  
MITO ラップ型ファンド(中立型)  
MITO ラップ型ファンド(積極型)  
グローバル8資産ラップファンド(安定型)  
グローバル8資産ラップファンド(中立型)  
グローバル8資産ラップファンド(積極型)  
たわらノーロード 国内債券  
たわらノーロード バランス(8資産均等型)  
たわらノーロード バランス(堅実型)  
たわらノーロード バランス(標準型)  
たわらノーロード バランス(積極型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)  
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)  
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)  
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)  
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)  
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)  
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)  
D IAM国内債券インデックスファンド<DC年金>  
Oneグローバルバランス  
D IAMバランス・ファンド<DC年金>1 安定型  
D IAMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型  
D IAMバランス・ファンド<DC年金>3 成長型  
D IAM D Cバランス30インデックスファンド  
D IAM D Cバランス50インデックスファンド  
D IAM D Cバランス70インデックスファンド  
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)  
マネックス資産設計ファンド(育成型)  
マネックス資産設計ファンド エボリューション  
D IAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)  
D IAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)  
D IAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)  
投資のソムリエ  
ブルーズコントロール  
投資のソムリエ<DC年金>  
D IAM 8資産バランスファンドN<DC年金>  
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>  
投資のソムリエ<DC年金>/リスク抑制型  
リスク抑制世界8資産バランスファンド  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)  
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)  
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>  
リスクコントロール世界資産分散ファンド  
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)

4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)  
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>  
イカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家認定)  
イカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家認定)  
マルチアセット・イカム戦略ファンド2020-08 (適格機関投資家認定)  
イカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家認定)  
イカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家認定)  
イカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家認定)  
マルチアセット・イカム戦略ファンド2021-06 (適格機関投資家認定)  
シグナルヘッジ付き(2021-06 (適格機関投資家認定)  
イカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家認定)  
マルチアセット・イカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)(2021-09 (適格機関投資家認定)  
マルチアセット・シグナルヘッジ付き(2022-05 (適格機関投資家認定)  
ギモモル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家認定)  
D IAM国内債券パッジファンド(適格機関投資家向け)  
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家認定)  
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家認定)  
AM On e マルチアセット・イカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(2022-05 (適格機関投資家認定)  
D IAMアーリーダラーンズ25VA (適格機関投資家認定)  
One收益追求型マルチアセット戦略ファンド I (適格機関投資家認定)  
One收益追求型マルチアセット戦略ファンド II (I (適格機関投資家認定)  
One收益追求型マルチアセット戦略ファンド III (III (適格機関投資家認定)  
イカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家認定)  
リスクファンドワールド資産(ラップ) (F OF S) (適格機関投資家専用)  
AM On e コアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家認定)  
D IAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家認定)  
D IAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)  
D IAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家認定)  
D IAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)  
D IAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家認定)  
D IAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家認定)  
D IAMバランスファンド25VA (適格機関投資家認定)  
D IAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家認定)  
D IAMバランスファンド50VA (適格機関投資家認定)  
D IAMグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家認定)  
D IAMグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家認定)  
D IAM グローバル・アセット・バランスファンド30VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンド25VA (2VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンド3 VA (3 VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界アセットバランスファンド4 VA (4 VA (適格機関投資家認定)  
D IAM世界バランス25VA (適格機関投資家認定)  
D IAM国内バランス30VA (適格機関投資家認定)  
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家認定)  
動的パッケージファンド<DC年金>  
コア資産形成ファンド  
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>  
MH AM動的パッケージファンド(適格機関投資家認定)  
MH AM日本債券パッジファンド(適格機関投資家認定)  
MH AM動的パッケージ4資産ファンド(適格機関投資家認定)  
期末元本合計

## ■損益の状況

当期 自2023年2月15日 至2024年2月14日

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

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第22期（決算日 2024年2月7日）

（計算期間 2023年2月8日～2024年2月7日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第22期の運用状況をご報告申し上げます。

**当ファンドの仕組みは次の通りです。**

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

## ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額     | 東証株価指数(TOPIX) |               | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額              |
|----------------|----------|---------------|---------------|--------|--------|-------------------|
|                |          | 期騰落率          | (配当込み)ベンチマーク  |        |        |                   |
| 18期（2020年2月7日） | 円 27,423 | % 13.2        | ポイント 2,642.55 | % 13.2 | % 97.6 | % 2.4 百万円 269,760 |
| 19期（2021年2月8日） | 31,202   | 13.8          | 3,006.47      | 13.8   | 97.7   | 2.3 318,586       |
| 20期（2022年2月7日） | 31,896   | 2.2           | 3,073.66      | 2.2    | 97.4   | 2.5 397,336       |
| 21期（2023年2月7日） | 33,751   | 5.8           | 3,251.81      | 5.8    | 98.0   | 1.9 396,982       |
| 22期（2024年2月7日） | 44,494   | 31.8          | 4,286.44      | 31.8   | 97.6   | 2.5 542,130       |

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                | 基 準 価 額     | 東証株価指数(T O P I X) |                    | 株式組入率  | 株式先物比率    |
|----------------------|-------------|-------------------|--------------------|--------|-----------|
|                      |             | 騰 落 率             | (配当込み)<br>(バンチマーク) |        |           |
| (期 首)<br>2023年 2月 7日 | 円<br>33,751 | %<br>—            | ポイント<br>3,251.81   | %<br>— | %<br>98.0 |
| 2 月 末                | 33,931      | 0.5               | 3,269.12           | 0.5    | 98.8      |
| 3 月 末                | 34,508      | 2.2               | 3,324.74           | 2.2    | 96.1      |
| 4 月 末                | 35,438      | 5.0               | 3,414.45           | 5.0    | 97.9      |
| 5 月 末                | 36,715      | 8.8               | 3,537.93           | 8.8    | 97.3      |
| 6 月 末                | 39,491      | 17.0              | 3,805.00           | 17.0   | 98.4      |
| 7 月 末                | 40,083      | 18.8              | 3,861.80           | 18.8   | 97.5      |
| 8 月 末                | 40,253      | 19.3              | 3,878.51           | 19.3   | 97.5      |
| 9 月 末                | 40,464      | 19.9              | 3,898.26           | 19.9   | 97.6      |
| 10 月 末               | 39,253      | 16.3              | 3,781.64           | 16.3   | 97.3      |
| 11 月 末               | 41,378      | 22.6              | 3,986.65           | 22.6   | 97.7      |
| 12 月 末               | 41,289      | 22.3              | 3,977.63           | 22.3   | 96.9      |
| 2024年 1 月 末          | 44,516      | 31.9              | 4,288.36           | 31.9   | 97.8      |
| (期 末)<br>2024年 2月 7日 | 44,494      | 31.8              | 4,286.44           | 31.8   | 97.6      |
|                      |             |                   |                    |        | 2.5       |

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年2月8日から2024年2月7日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は44,494円となり、前期末比で31.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

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

### ポートフォリオについて

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

## 【運用状況】

(注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

### ○組入上位10業種

#### 期首（前期末）

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

#### 期末

| No. | 業種     | 比率    |
|-----|--------|-------|
| 1   | 電気機器   | 16.9% |
| 2   | 輸送用機器  | 8.9   |
| 3   | 情報・通信業 | 7.4   |
| 4   | 卸売業    | 7.1   |
| 5   | 銀行業    | 6.9   |
| 6   | 化学     | 5.8   |
| 7   | 機械     | 5.2   |
| 8   | サービス業  | 4.5   |
| 9   | 医薬品    | 4.4   |
| 10  | 小売業    | 4.1   |

### ○組入上位10銘柄

#### 期首（前期末）

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

#### 期末

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

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で31.8%上昇しました。

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

### 今後の運用方針

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

## ■1万口当たりの費用明細

| 項目                                | 当期               |                              | 項目の概要  |
|-----------------------------------|------------------|------------------------------|--|
|                                   | 金額               | 比率                           |  |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(0)<br>(0) | 0.001%<br>(0.000)<br>(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 |
| (b) その他費用<br>(その他の)               | 0<br>(0)         | 0.000<br>(0.000)             | (b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等              |
| 合計                                | 1                | 0.001                        |  |
| 期中の平均基準価額は38,764円です。              |                  |                              |  |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

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

## ■売買及び取引の状況 (2023年2月8日から2024年2月7日まで)

### (1) 株式

|    |    | 買付                             |                          | 売付               |                   |
|----|----|--------------------------------|--------------------------|------------------|-------------------|
|    |    | 株数                             | 金額                       | 株数               | 金額                |
| 国内 | 上場 | 千株<br>68,285.4<br>(56,521.786) | 千円<br>152,756,646<br>(一) | 千株<br>58,527.986 | 千円<br>124,543,615 |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

### (2) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建             |                | 売建       |          |
|-----------|----------------|----------------|----------|----------|
|           | 新規買付額          | 決済額            | 新規売付額    | 決済額      |
| 国内 株式先物取引 | 百万円<br>122,918 | 百万円<br>121,163 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

(注) 金額は受渡代金です。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目                | 当期            |
|-------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額     | 277,300,261千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 438,574,353千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.63          |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年2月8日から2024年2月7日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決算期 |   | 当期             |                    |           |                |                    |           |
|-----|---|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| 区分  | 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 株式  | 式 | 百万円<br>152,756 | 百万円<br>103,694     | %<br>67.9 | 百万円<br>124,543 | 百万円<br>58,472      | %<br>46.9 |

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 当期           |              |              |
|----|--------------|--------------|--------------|
|    | 買付額          | 売付額          | 当期末保有額       |
| 株式 | 百万円<br>1,537 | 百万円<br>1,475 | 百万円<br>5,468 |

### (3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種類 | 当期  |            |
|----|-----|------------|
|    | 買付額 | 額          |
| 株式 |     | 百万円<br>198 |

### (4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項目              | 当期      |
|-----------------|---------|
| 売買委託手数料総額(A)    | 4,122千円 |
| うち利害関係人への支払額(B) | 2千円     |
| (B)/(A)         | 0.1%    |

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

## ■組入資産の明細

### (1) 国内株式

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       |           | 当期末 |    |    | 銘柄            | 期首(前期末) |       |           | 当期末               |       |       | 銘柄        | 期首(前期末) |    |     | 当期末 |    |    |
|----------------------|---------|-------|-----------|-----|----|----|---------------|---------|-------|-----------|-------------------|-------|-------|-----------|---------|----|-----|-----|----|----|
|                      | 株数      | 株数    | 評価額       | 千株  | 千株 | 千円 |               | 株数      | 株数    | 評価額       | 千株                | 千株    | 千円    |           | 株数      | 株数 | 評価額 | 千株  | 千株 | 千円 |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |       |           |     |    |    | 日本ハウスホールディングス | 26.6    | 30.5  | 9,241     | 中村屋               | 2.8   | 3.5   | 10,955    |         |    |     |     |    |    |
| 極洋                   | 7.3     | 7.8   | 32,019    |     |    |    | 新日本建設         | 18.8    | 20.1  | 25,607    | 江崎グリコ             | 38.5  | 41.2  | 175,512   |         |    |     |     |    |    |
| ニッスイ                 | 191.5   | 205   | 184,869   |     |    |    | 東亜道路工業        | 2.3     | 5.7   | 39,159    | 名糖産業              | 5.5   | 5.7   | 10,032    |         |    |     |     |    |    |
| マルハニチロ               | 28.4    | 30.4  | 91,139    |     |    |    | 日本道路          | 2.7     | 16.8  | 35,028    | 井村屋グループ           | 7.2   | 8.6   | 21,224    |         |    |     |     |    |    |
| 雪国まいたけ               | 16.3    | 17.5  | 16,887    |     |    |    | 東亜建設工業        | 11.5    | 11.1  | 42,013    | 不二家               | 9.3   | 9.9   | 24,363    |         |    |     |     |    |    |
| カネコ種苗                | 5.9     | 5.8   | 8,305     |     |    |    | 日本国土開発        | 40.2    | 40.8  | 21,583    | 山崎製パン             | 90    | 96.4  | 344,244   |         |    |     |     |    |    |
| サカタのタネ               | 21.8    | 23.3  | 81,550    |     |    |    | 若狭建設          | 6       | 5     | 15,375    | 第一屋製パン            | 2.2   | 1.2   | 933       |         |    |     |     |    |    |
| ホクタ                  | 17      | 16.4  | 29,208    |     |    |    | 東洋建設          | 43.4    | 36.1  | 45,377    | モロゾフ              | 4.3   | 4.6   | 18,446    |         |    |     |     |    |    |
| ホクリョウ                | 2.5     | 1.5   | 1,576     |     |    |    | 五洋建設          | 189.9   | 203.3 | 164,754   | 亀田製菓              | 8.6   | 8.2   | 37,228    |         |    |     |     |    |    |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |       |           |     |    |    | 世紀東急工業        | 17.7    | 18.4  | 36,340    | 寿司スピリッツ           | 14.3  | 68.1  | 131,092   |         |    |     |     |    |    |
| 住石ホールディングス           | 26.4    | 23.2  | 41,644    |     |    |    | 福田組           | 5.1     | 5.4   | 29,106    | カルビー              | 61.5  | 65.9  | 207,321   |         |    |     |     |    |    |
| 日鉄鉱業                 | 7.6     | 8.2   | 42,230    |     |    |    | 住友林業          | 102.7   | 123.9 | 536,363   | 森永乳業              | 24.5  | 50.3  | 150,472   |         |    |     |     |    |    |
| 三井住友ホールディングス         | 8.7     | 12.1  | 33,807    |     |    |    | 日本基礎技術        | 7.2     | 3.8   | 1,862     | 六甲パター             | 9.9   | 10.6  | 14,034    |         |    |     |     |    |    |
| I N P E X            | 707.9   | 758.2 | 1,534,975 |     |    |    | 巴コボーレーション     | 13.5    | 8.1   | 4,957     | ヤクルト本社            | 96.1  | 205.7 | 645,898   |         |    |     |     |    |    |
| 石油資源開発               | 22.2    | 23.8  | 143,514   |     |    |    | 大和ハウス工業       | 374.1   | 396.6 | 1,745,040 | 明治ホールディングス        | 83.4  | 176.5 | 638,047   |         |    |     |     |    |    |
| K&Oナシゲループ            | 8.7     | 9.3   | 21,259    |     |    |    | ライト工業         | 25.5    | 29.5  | 60,770    | 雪印メグミルク           | 32.6  | 34.8  | 80,179    |         |    |     |     |    |    |
| <b>建設業 (2.1%)</b>    |         |       |           |     |    |    | 積木ハウス         | 419.4   | 434.9 | 1,419,078 | プリマハム             | 18.2  | 19.3  | 44,911    |         |    |     |     |    |    |
| ショーピードホールディングス       | 26.1    | 27.9  | 181,935   |     |    |    | 日特建設          | 12.9    | 13.7  | 16,618    | 日本ハム              | 52.6  | 61.9  | 322,994   |         |    |     |     |    |    |
| ミライ・ト・ワン             | 66.5    | 67.8  | 133,599   |     |    |    | 北陸電気工事        | 9.3     | 9.8   | 12,475    | 林兼産業              | 3.7   | 2.2   | 1,295     |         |    |     |     |    |    |
| タマホーム                | 12.1    | 12.9  | 51,729    |     |    |    | ユアテック         | 29.9    | 31.6  | 43,418    | 丸大食品              | 13.5  | 14.5  | 24,490    |         |    |     |     |    |    |
| サンヨーホームズ             | 2.2     | 1.1   | 841       |     |    |    | 日本リーテック       | 8.9     | 11.2  | 14,772    | S Foods           | 14.9  | 15.9  | 51,357    |         |    |     |     |    |    |
| 日本アクア                | 7.1     | 3.8   | 3,940     |     |    |    | 四電工           | 5.7     | 6     | 23,520    | 柿安本店              | 5.3   | 5.6   | 14,504    |         |    |     |     |    |    |
| ファーストコーポレーション        | 4.3     | 2.6   | 2,080     |     |    |    | 中電工           | 20.8    | 22.3  | 64,224    | 伊藤ハムホールディングス      | 104.7 | 22    | 92,730    |         |    |     |     |    |    |
| ベステラ                 | 3.7     | 2.2   | 2,156     |     |    |    | 関電工           | 73.6    | 89.9  | 145,368   | サッポロホールディングス      | 44.3  | 47.4  | 317,817   |         |    |     |     |    |    |
| キャンディル               | 2.7     | 1.7   | 994       |     |    |    | さんでん          | 94.5    | 101   | 269,114   | アセブールホールディングス     | 310.6 | 332.7 | 1,863,120 |         |    |     |     |    |    |
| ダイセキ彌焼リューション         | 3.4     | 1.8   | 1,864     |     |    |    | 東京エヌシス        | 13.3    | 14.3  | 16,459    | キリンホールディングス       | 606.7 | 599.7 | 1,274,962 |         |    |     |     |    |    |
| 第一カッターベン興業           | 5.1     | 5.9   | 8,673     |     |    |    | トーエニック        | 4.4     | 4.7   | 25,380    | 宝ホールディングス         | 91.8  | 98.3  | 120,859   |         |    |     |     |    |    |
| 安藤・間                 | 110.9   | 118.7 | 146,831   |     |    |    | 住友電設          | 12.8    | 13.7  | 43,771    | オエノホールディングス       | 40.1  | 43    | 15,867    |         |    |     |     |    |    |
| 東急建設                 | 54.6    | 64.2  | 53,286    |     |    |    | 日本電設工業        | 22      | 26.9  | 56,221    | 養命酒製造             | 4.4   | 4.8   | 9,004     |         |    |     |     |    |    |
| コムジョホールディングス         | 64.8    | 65.5  | 209,534   |     |    |    | エクシオグループ      | 61.5    | 70.1  | 231,750   | コ・コ・ホーリングホールディングス | 105.3 | 112.8 | 224,697   |         |    |     |     |    |    |
| ピーアールホールディングス        | 30.5    | 30.1  | 11,197    |     |    |    | 新日本空調         | 7.4     | 9.3   | 24,914    | ライフレンジ カンパニー      | —     | 2.1   | 12,558    |         |    |     |     |    |    |
| 高松コントラショングループ        | 12.5    | 15.2  | 45,113    |     |    |    | 九電工           | 32.6    | 31    | 180,358   | サントリ食品インターナショナル   | 94.7  | 101.4 | 499,090   |         |    |     |     |    |    |
| 東建コーポレーション           | 5.5     | 5.2   | 49,712    |     |    |    | 三機工業          | 29.7    | 31    | 58,218    | ダブルオーブルホールディングス   | 7.6   | 16.3  | 47,449    |         |    |     |     |    |    |
| ソネック                 | 2       | 1     | 946       |     |    |    | 日揮ホールディングス    | 132.4   | 141.9 | 247,757   | 伊藤園               | 45.5  | 48.8  | 206,619   |         |    |     |     |    |    |
| ヤマウラ                 | 9.8     | 10.4  | 16,421    |     |    |    | 中外炉工業         | 4.4     | 4.7   | 12,520    | キーコーヒー            | 15.1  | 16.1  | 33,182    |         |    |     |     |    |    |
| オリエンタル白石             | 68.7    | 75.8  | 27,288    |     |    |    | ヤマト           | 10.1    | 5.3   | 5,262     | ユニカフェ             | 4.1   | 2.2   | 1,991     |         |    |     |     |    |    |
| 大成建設                 | 133.2   | 134.2 | 750,446   |     |    |    | 太平電業          | 8.4     | 8.9   | 39,382    | ジャパンフーズ           | 1.5   | 1     | 1,408     |         |    |     |     |    |    |
| 大林組                  | 478.7   | 512.8 | 733,816   |     |    |    | 高砂熱電工業        | 32.3    | 38.4  | 140,352   | 日清オリオグループ         | 19    | 20.3  | 93,583    |         |    |     |     |    |    |
| 清水建設                 | 402.5   | 406.6 | 426,116   |     |    |    | 三晃金属工業        | 1.4     | 0.9   | 4,432     | 不二製油グループ本社        | 31.3  | 33.5  | 78,993    |         |    |     |     |    |    |
| 飛島建設                 | 14.9    | 14.8  | 22,362    |     |    |    | 朝日工業社         | 5.6     | 6.7   | 21,373    | かどや製油             | 1.2   | 0.8   | 3,048     |         |    |     |     |    |    |
| 長谷工コーポレーション          | 138.2   | 131.6 | 252,408   |     |    |    | 明星工業          | 23      | 27.8  | 31,580    | ジョーオイルミルズ         | 13.7  | 16.5  | 34,419    |         |    |     |     |    |    |
| 松井建設                 | 12.6    | 13.4  | 11,390    |     |    |    | 大氣社           | 16.1    | 16.5  | 74,002    | キッコーマン            | 89.1  | 95.4  | 865,468   |         |    |     |     |    |    |
| 錢高組                  | 1.5     | 1     | 4,605     |     |    |    | ダイヤン          | 8.9     | 18.9  | 32,470    | 味の素               | 329   | 342.1 | 1,935,601 |         |    |     |     |    |    |
| 鹿島建設                 | 296.9   | 318   | 882,132   |     |    |    | 日比谷総合設備       | 11.5    | 10.4  | 27,716    | ブルドックソース          | 5.4   | 7.6   | 16,036    |         |    |     |     |    |    |
| 不動トラ                 | 9.3     | 9.9   | 22,423    |     |    |    | フィル・カンパニー     | 2.4     | 2.2   | 1,720     | キユーピー             | 72.2  | 77.4  | 203,368   |         |    |     |     |    |    |
| 大建建設                 | 4.3     | 2.5   | 3,622     |     |    |    | スチールホールディングス  | 14.4    | 30.9  | 13,812    | ハウス食品グループ本社       | 41.3  | 49.6  | 155,843   |         |    |     |     |    |    |
| 鉄建建設                 | 9.6     | 10.3  | 22,845    |     |    |    | イシゴニ・ホールディングス | 140.2   | 165.3 | 253,900   | カゴメ               | 62.7  | 61.9  | 225,192   |         |    |     |     |    |    |
| 西松建設                 | 22.7    | 27.4  | 122,149   |     |    |    | 東洋エンジニアリング    | 17.7    | 21.1  | 17,069    | 焼津水産化學工業          | 5.6   | 2.8   | 3,774     |         |    |     |     |    |    |
| 三井住友建設               | 107.5   | 106.6 | 44,025    |     |    |    | レイズネクスト       | 19.4    | 20.8  | 32,760    | アリアケジャパン          | 11.8  | 14.4  | 66,384    |         |    |     |     |    |    |
| 大豊建設                 | 5.6     | 4.9   | 18,791    |     |    |    | ニッポン          | 36.3    | 43.1  | 98,871    | ピエトロ              | 1.7   | 0.9   | 1,627     |         |    |     |     |    |    |
| 佐田建設                 | 7.7     | 4.1   | 2,972     |     |    |    | 日清製粉グループ本社    | 124.3   | 133.1 | 277,779   | エバラ食品工業           | 3.3   | 3.4   | 9,999     |         |    |     |     |    |    |
| ナカノフード一建設            | 8.5     | 4.5   | 2,344     |     |    |    | 日東富士製粉        | 2.2     | 2.3   | 11,983    | やまみ               | 1.2   | 0.9   | 3,676     |         |    |     |     |    |    |
| 奥村組                  | 21.7    | 23.2  | 122,264   |     |    |    | 昭和産業          | 11.8    | 14    | 46,550    | ニチレイ              | 61.6  | 66    | 247,500   |         |    |     |     |    |    |
| 東鉄工業                 | 18.5    | 17.8  | 53,186    |     |    |    | 鳥越製粉          | 9.8     | 5.6   | 3,964     | 東洋水産              | 67.9  | 72.8  | 586,258   |         |    |     |     |    |    |
| イチケン                 | 2.7     | 1.6   | 3,854     |     |    |    | 中部飼料          | 18.7    | 19.9  | 23,979    | イートアンドホールディングス    | 5.8   | 6.8   | 14,531    |         |    |     |     |    |    |
| 富士ピー・エス              | 6.1     | 2.9   | 1,290     |     |    |    | フィード・ワン       | 19.7    | 21    | 20,748    | 大冷                | 1.7   | 1     | 1,945     |         |    |     |     |    |    |
| 浅沼組                  | 10.7    | 10.6  | 45,421    |     |    |    | 東洋精糖          | 2.4     | 1.2   | 2,784     | ショーロード・ホールディングス   | 8.6   | 6.5   | 7,618     |         |    |     |     |    |    |
| 戸田建設                 | 164.6   | 194.1 | 185,773   |     |    |    | 日本甜菜製糖        | 8       | 8.4   | 18,093    | 日清食品ホールディングス      | 47.3  | 151.9 | 718,942   |         |    |     |     |    |    |
| 熊谷組                  | 23.2    | 23.7  | 93,378    |     |    |    | DM三井建ホールディングス | 13.3    | 14.3  | 46,761    | 永谷園ホールディングス       | 6.7   | 7.1   | 16,109    |         |    |     |     |    |    |
| 北野建設                 | 2.3     | 1.2   | 3,720     |     |    |    | 塩水港精糖         | 14.9    | 8.4   | 2,553     | 一正蒲鉾              | 5.2   | 2.8   | 2,066     |         |    |     |     |    |    |
| 植木組                  | 3.4     | 1.8   | 3,162     |     |    |    | ウェルネオシュガー     | 7       | 7.2   | 16,653    | フジツコ              | 13.9  | 14.8  | 29,096    |         |    |     |     |    |    |
| 矢作建設工業               | 18.4    | 19.5  | 28,431    |     |    |    | 森永製菓          | 24.9    | 61.6  | 174,328   | ロック・フィールド         | 15.1  | 17.6  | 28,424    |         |    |     |     |    |    |
| ピース三菱                | 17.2    | 18.2  | 18,345    |     |    |    |               |         |       |           | 日本たばこ産業           | 884.9 | 874.8 | 3,445,837 |         |    |     |     |    |    |

| 銘柄             | 期首(前期末)   | 当期末       |              |               | 銘柄          | 期首(前期末)     | 当期末           |                  |            | 銘柄         | 期首(前期末)      | 当期末     |    |     |
|----------------|-----------|-----------|--------------|---------------|-------------|-------------|---------------|------------------|------------|------------|--------------|---------|----|-----|
|                |           | 株数        | 株数           | 評価額           |             |             | 株数            | 株数               | 評価額        |            |              | 株数      | 株数 | 評価額 |
| ケンコーマヨネーズ      | 千株<br>9.3 | 千株<br>9.9 | 千円<br>18,087 | クラレ           | 千株<br>217.3 | 千株<br>213.4 | 千円<br>331,410 | ダイキヨーニシカワ        | 千株<br>30.1 | 千株<br>32.4 | 千円<br>24,008 |         |    |     |
| わらやく洋ホールディングス  | 9.9       | 9.6       | 27,273       | 旭化成           | 853.9       | 990.8       | 1,028,945     | 竹本容器             | 4.1        | 2.6        | 2,038        |         |    |     |
| などり            | 8.6       | 9.1       | 19,810       | 共和レザー         | 7.1         | 3.8         | 3,066         | 森六ホールディングス       | 6.9        | 7.6        | 21,796       |         |    |     |
| イフジ産業          | 2.2       | 1.2       | 1,696        | 巴川コーポレーション    | 3.8         | 1.8         | 1,713         | 恵和               | 8.9        | 10.5       | 15,004       |         |    |     |
| ファーマフーズ        | 20.7      | 20.7      | 20,637       | レナック・ホールディングス | 132.1       | 141.5       | 417,778       | 日本化粧             | 104.3      | 111.9      | 142,616      |         |    |     |
| ユーブレナ          | 86.6      | 89.6      | 58,956       | 住友化学          | 1,014.5     | 1,086.7     | 334,160       | カーリットホールディングス    | 12.3       | 15.8       | 15,452       |         |    |     |
| 紀文食品           | 10.5      | 12.5      | 14,650       | 住友精化          | 5.8         | 6.9         | 34,362        | 日本精化             | 7.8        | 9.7        | 27,460       |         |    |     |
| ピックルホールディングス   | 7.9       | 8.4       | 10,878       | 日産化学          | 64.9        | 68.8        | 422,569       | 扶桑化学工業           | 12.7       | 15.5       | 71,145       |         |    |     |
| ミヨシ油脂          | 4.2       | 2.5       | 3,312        | ラサ工業          | 5.3         | 5.6         | 12,773        | トリケミカル研究所        | 18.3       | 17.8       | 67,551       |         |    |     |
| 理研ビタミン         | 11.6      | 12.5      | 29,025       | クレハ           | 11.7        | 32          | 90,400        | A D E K A        | 47.7       | 51.1       | 146,989      |         |    |     |
| 繊維製品(0.4%)     | 片倉工業      | 12.6      | 13.5         | 24,124        | 多木化学        | 5.4         | 5.7           | 18,069           | 日油         | 42.3       | 44.2         | 313,820 |    |     |
| グンゼ            | 10.2      | 10.4      | 57,824       | ティカ           | 9.2         | 12.7        | 17,957        | 新日本理化            | 16.8       | 8.9        | 1,797        |         |    |     |
| 東洋紡            | 59        | 63.3      | 70,516       | 石原産業          | 24.7        | 24.3        | 38,078        | ハリマ化成グループ        | 8.7        | 9.1        | 8,153        |         |    |     |
| ユニチャカ          | 41.4      | 47.3      | 7,804        | 片倉コーポアグリ      | 2.5         | 1.6         | 1,788         | 花王               | 333        | 331.2      | 1,903,737    |         |    |     |
| 富士筋ホールディングス    | 5.4       | 6.4       | 27,392       | 日本曹達          | 14.7        | 17.3        | 99,821        | 第一工業製薬           | 5          | 5.8        | 17,202       |         |    |     |
| 倉敷紡績           | 10.2      | 10.4      | 31,824       | 東ソーラー         | 182.6       | 195.3       | 374,089       | 石原ケミカル           | 6.3        | 6.6        | 12,526       |         |    |     |
| シキボウ           | 6.8       | 7.7       | 9,255        | トクヤマ          | 44.1        | 47.3        | 106,827       | 日華化学             | 5          | 2.6        | 2,371        |         |    |     |
| 日本毛織           | 36        | 37.5      | 52,650       | セントラル硝子       | 21.9        | 15.6        | 45,411        | ニイタカ             | 2.2        | 1.3        | 2,459        |         |    |     |
| ダイワウ波          | 21.5      | 10.4      | 936          | 東亜合成          | 68.5        | 70.5        | 108,534       | 三洋化成工業           | 8.5        | 9          | 37,620       |         |    |     |
| トーア筋コーポレーション   | 4.2       | 2.5       | 1,085        | 大阪ソーダ         | 8.2         | 10.2        | 111,078       | 有機合成業品工業         | 9.2        | 5.2        | 1,497        |         |    |     |
| ダイドーリミテッド      | 18.6      | 9.4       | 5,499        | 関東電化工業        | 26.4        | 28.3        | 25,724        | 大日本塗料            | 16.9       | 16.3       | 18,842       |         |    |     |
| 帝国織維           | 15.4      | 16.5      | 35,475       | 信越化学工業        | 49.7        | 53.3        | 130,105       | 日本ペイントホールディングス   | 605.1      | 777.7      | 905,242      |         |    |     |
| 帝人             | 131.6     | 140.7     | 191,914      | 日本カーバイド工業     | 4.6         | 6.2         | 9,684         | 関西ペイント           | 125.3      | 143.5      | 336,507      |         |    |     |
| 東レ             | 916.3     | 981.2     | 732,465      | 堺化学工業         | 10.4        | 11.1        | 21,356        | 神東塗料             | 10.4       | 5.3        | 673          |         |    |     |
| 住江織物           | 2.5       | 1.3       | 3,140        | 第一希元素化工業      | 12.5        | 16          | 15,536        | 中国塗料             | 22.4       | 30.1       | 58,604       |         |    |     |
| 日本フェルト         | 6.7       | 3.7       | 1,602        | チタン工業         | 1.4         | 0.9         | 1,011         | 日本特殊塗料           | 7.7        | 4.7        | 6,392        |         |    |     |
| イチカワ           | 1.5       | 0.8       | 1,420        | エア・ウォーター      | 129         | 138.2       | 281,098       | 藤倉化成             | 18.6       | 16.8       | 7,879        |         |    |     |
| 日東製綱           | 1.3       | 0.7       | 1,096        | 日本酸素ホールディングス  | 132.6       | 142.1       | 589,430       | 太陽ホールディングス       | 20.7       | 25.5       | 78,030       |         |    |     |
| アツギ            | 7.1       | 4.5       | 2,493        | 日本化学工業        | 4.5         | 5.3         | 10,414        | D I C            | 53.5       | 57.2       | 160,245      |         |    |     |
| ダイニック          | 3         | 2.1       | 1,478        | 東邦アセチレン       | 2.6         | 6.9         | 2,587         | サカタインクス          | 30.3       | 32.6       | 46,324       |         |    |     |
| セーレン           | 26.4      | 28.3      | 69,561       | 日本パーカライジング    | 67.8        | 65.3        | 80,580        | a r t i e n c e  | 26.7       | 31.9       | 88,426       |         |    |     |
| ソート            | 3.9       | 2.1       | 1,446        | 高圧ガス工業        | 20.1        | 21.4        | 18,489        | T & K T O K A    | 12.2       | 14         | 19,698       |         |    |     |
| 東海染工           | 1.3       | 0.6       | 493          | チタン工業         | 1.4         | 0.9         | 1,011         | 富士フイルムホールディングス   | 262.7      | 272        | 2,674,304    |         |    |     |
| 小松マテーレ         | 19.9      | 21.2      | 16,620       | 四国化成ホールディングス  | 16.2        | 18.7        | 32,893        | 資生堂              | 285.8      | 306.2      | 1,292,164    |         |    |     |
| ワコールホールディングス   | 26.3      | 30        | 104,220      | 戸田工業          | 3.1         | 3.3         | 5,336         | ライオン             | 164.3      | 191.9      | 250,333      |         |    |     |
| ホギメディカル        | 18.4      | 19.3      | 65,523       | ステラ・ケミファ      | 8           | 7.9         | 25,991        | 高砂香料工業           | 9.3        | 11         | 39,985       |         |    |     |
| クラウディアホールディングス | 2.7       | 1.5       | 609          | 保土谷化学工業       | 3.9         | 4.6         | 16,491        | マンダム             | 29.5       | 31.7       | 41,685       |         |    |     |
| T S I ホールディングス | 48.8      | 47.6      | 32,368       | 日本触媒          | 20.8        | 21.3        | 118,917       | ミルボン             | 20.3       | 19.9       | 69,291       |         |    |     |
| マツオカコーポレーション   | 3.3       | 2         | 3,420        | 大日精化工業        | 9.6         | 10.2        | 27,907        | ファンケル            | 59.9       | 64.1       | 142,109      |         |    |     |
| ワールド           | 17.5      | 20.7      | 41,193       | カネカ           | 31.3        | 37.2        | 132,990       | コーセー             | 27.9       | 29.8       | 279,643      |         |    |     |
| 三陽商会           | 4.6       | 5.5       | 15,581       | 三菱瓦斯化学        | 102.1       | 109.4       | 257,746       | コタ               | 11.6       | 13.5       | 21,181       |         |    |     |
| ナイガイ           | 4.1       | 2.1       | 548          | 三井化学          | 112.7       | 120.8       | 501,320       | シーボン             | 1.5        | 0.9        | 1,342        |         |    |     |
| オワードホールディングス   | 88.5      | 86.3      | 46,774       | J S R         | 127.7       | 159.5       | 634,810       | ポーラ・オルビアホールディングス | 70.2       | 75.2       | 115,657      |         |    |     |
| ルックホールディングス    | 3.5       | 4.1       | 11,020       | 東京応化工業        | 23.9        | 69.9        | 245,978       | ノエビアホールディングス     | 12.2       | 13.1       | 67,858       |         |    |     |
| キムラタン          | 72.8      | 42.8      | 770          | 大阪有機化成工業      | 10.3        | 12.3        | 36,961        | アジュバホールディングス     | 3          | 1.6        | 1,489        |         |    |     |
| ゴールドワイン        | 24.3      | 25.9      | 244,159      | 三菱ケミカルグループ    | 922.8       | 1,070.7     | 921,123       | 新日本製薬            | 7.8        | 8.4        | 15,002       |         |    |     |
| デサン            | 23.5      | 25.2      | 83,160       | K Hネオケム       | 22.7        | 22.3        | 52,851        | I - n e          | —          | 2.9        | 6,820        |         |    |     |
| キンブ            | 5.4       | 2.5       | 1,740        | ダイセル          | 201         | 188.3       | 272,281       | アクシージア           | —          | 7.2        | 6,098        |         |    |     |
| ヤマトイタナショナル     | 9.8       | 5.1       | 1,545        | 住友ベーライト       | 20.2        | 20.5        | 153,114       | エステー             | 10.6       | 11.3       | 17,277       |         |    |     |
| バルプ・紙(0.2%)    | 6.1       | 8         | 31,520       | 積水化学工業        | 279.7       | 294.3       | 606,258       | アグロ カネショウ        | 5.5        | 5.9        | 7,782        |         |    |     |
| 特種東海製紙         | 569.8     | 610       | 351,482      | 日本ゼオン         | 82          | 100.4       | 128,662       | コニシ              | 22.9       | 42.4       | 55,925       |         |    |     |
| 王子ホールディングス     | 71.1      | 82.6      | 113,657      | アイカ工業         | 34.5        | 37          | 128,760       | 長谷川香料            | 28.4       | 28         | 92,820       |         |    |     |
| 日本製紙           | 15.1      | 8.8       | 5,447        | U B E         | 70.4        | 69.7        | 176,166       | 星光P M C          | 6.4        | —          | —            |         |    |     |
| 北越コーポレーション     | 86.4      | 72        | 98,856       | 旭有機材          | 9.1         | 9.7         | 36,908        | 小林製薬             | 39.8       | 42.7       | 271,572      |         |    |     |
| 中越パルプ工業        | 4.7       | 2.6       | 5,220        | タキロンシーアイ      | 30.2        | 37.4        | 23,262        | 荒川化学工業           | 11.7       | 12.4       | 13,912       |         |    |     |
| 大王製紙           | 60.3      | 64.7      | 73,952       | 二チパン          | 8.5         | 7.9         | 13,919        | メッツ              | 11.2       | 12.1       | 52,574       |         |    |     |
| ア波製紙           | 2.9       | 1.8       | 864          | リケンテクノス       | 29.5        | 31.6        | 30,999        | 日本高純度化学          | 3.4        | 3.3        | 8,880        |         |    |     |
| レンゴー           | 124.6     | 133.4     | 137,402      | 大倉工業          | 6.4         | 6.8         | 20,400        | タカラバイオ           | 36.9       | 39.5       | 48,506       |         |    |     |
| トーモク           | 7.9       | 8.5       | 19,507       | 横水化成品工業       | 18.7        | 20.7        | 9,480         | J C U            | 15.5       | 16.4       | 62,238       |         |    |     |
| ザ・パック          | 10.1      | 10.9      | 36,842       | 群衆化学工業        | 2.7         | 3.4         | 11,900        | 新田ゼラチン           | 7.5        | 4.4        | 3,335        |         |    |     |
| 化学(5.9%)       | 57.6      | 61.7      | 14,314       | タイガースポリマー     | 5.8         | 3           | 2,946         | O A T アグリオ       | 5          | 4.8        | 9,115        |         |    |     |
| 北の達人コーポレーション   |           |           |              | ミライアル         | 3.7         | 2.2         | 3,344         | デクセリアルズ          | 39.5       | 36.8       | 197,395      |         |    |     |
|                |           |           |              | ダイキアクシス       | 4.4         | 2.7         | 1,935         | アース製薬            | 12.4       | 13.3       | 61,047       |         |    |     |
|                |           |           |              |               |             |             |               | 北興化学工業           | 13.8       | 14.8       | 15,554       |         |    |     |

| 銘柄              | 期首(前期末)   | 当期末       |              |                  | 銘柄             | 期首(前期末)   | 当期末         |                 |                 | 銘柄       | 期首(前期末)       | 当期末    |    |     |  |
|-----------------|-----------|-----------|--------------|------------------|----------------|-----------|-------------|-----------------|-----------------|----------|---------------|--------|----|-----|--|
|                 |           | 株数        | 株数           | 評価額              |                |           | 株数          | 株数              | 評価額             |          |               | 株数     | 株数 | 評価額 |  |
| 大成ラミック          | 千株<br>4.3 | 千株<br>4.2 | 千円<br>12,978 | ビービー・カストロール      | 千株<br>4.6      | 千株<br>2.5 | 千円<br>2,165 | 丸一鋼管            | 千株<br>42.9      | 千株<br>46 | 千円<br>175,766 |        |    |     |  |
| クミアイ化工業         | 54.5      | 58.3      | 49,088       | 富士石油             | 27.9           | 42.7      | 15,799      | モリ工業            | 2.9             | 2.6      | 12,701        |        |    |     |  |
| 日本農業            | 25.1      | 26.9      | 18,372       | M O R E S C O    | 4              | 2.3       | 3,302       | 大同特殊鋼           | 17.7            | 95.1     | 159,625       |        |    |     |  |
| アキレス            | 8.9       | 9.3       | 14,563       | 出光興産             | 152.1          | 814.3     | 663,328     | 日本高周波鋼業         | 4.2             | 2.7      | 1,495         |        |    |     |  |
| 有沢製作所           | 22.4      | 25.7      | 28,861       | ENEOSホールディングス    | 2,473.4        | 2,321.7   | 1,380,714   | 日本冶金工業          | 10.3            | 11       | 46,860        |        |    |     |  |
| 日東電工            | 99.4      | 94.2      | 1,211,412    | コモエネルギーホールディングス  | 54.1           | 43.5      | 262,522     | 山陽特殊製鋼          | 13.9            | 15       | 33,135        |        |    |     |  |
| レック             | 19.5      | 18.8      | 19,627       | ゴム製品(0.7%)       | 横浜ゴム           | 77.9      | 74.2        | 263,039         | 愛知製鋼            | 8.2      | 8.7           | 30,145 |    |     |  |
| 三光合成            | 17.1      | 18.5      | 12,358       | TOYOTIRE         | 78.6           | 84.3      | 215,470     | 日本金属            | 2.8             | 1.9      | 1,675         |        |    |     |  |
| さもと             | 18.1      | 10.7      | 2,257        | ブリヂストン           | 437.2          | 429.2     | 2,721,557   | 大太平洋金属          | 10              | 12.9     | 17,518        |        |    |     |  |
| 藤森工業            | 10.8      | 11.6      | 46,458       | 住友ゴム工業           | 134.2          | 143.8     | 250,212     | 新日本電工           | 90              | 75.4     | 21,338        |        |    |     |  |
| 前澤化成工業          | 8.8       | 9.4       | 15,087       | 藤倉コンポジット         | 8.7            | 11.3      | 16,283      | 栗本鐵工所           | 6.7             | 7        | 25,690        |        |    |     |  |
| 未来工業            | 5         | 5.3       | 25,943       | オカモト             | 7.6            | 6.9       | 33,637      | 虹技              | 1.7             | 0.9      | 1,345         |        |    |     |  |
| ウェーブロックホールディングス | 3.7       | 2.4       | 1,634        | フコク              | 7.2            | 7.7       | 11,526      | 日本鉄管            | 1.4             | 0.8      | 942           |        |    |     |  |
| J S P           | 9.6       | 10.3      | 22,000       | ニッタ              | 13.9           | 14.9      | 55,055      | 三菱製鋼            | 8.8             | 11.2     | 18,715        |        |    |     |  |
| エフピコ            | 25.9      | 27.7      | 81,659       | 住友理工             | 26.7           | 22.8      | 27,405      | 日亜鋼業            | 13.3            | 7.4      | 2,464         |        |    |     |  |
| 天馬              | 11.7      | 10.7      | 24,695       | 三ツ星ベルト           | 20             | 17.8      | 84,995      | 日本精線            | 2               | 2.1      | 11,571        |        |    |     |  |
| 信越ボリマー          | 25.4      | 31.6      | 50,876       | バンドー化学           | 21.8           | 21.8      | 38,368      | エンゼル・ホールディングス   | 8.7             | 11.9     | 7,032         |        |    |     |  |
| 東リ              | 27.6      | 14.4      | 5,745        | ガラス・土石製品(0.7%)   | ガラス・土石製品(0.7%) | 16.3      | 18.6        | 93,372          | シンニッサン          | 13.7     | 8.6           | 2,356  |    |     |  |
| ニフコ             | 49.4      | 43.9      | 166,468      | 日東紡績             | 139.3          | 130.8     | 742,551     | 新家工業            | 2.7             | 1.5      | 4,807         |        |    |     |  |
| バルカー            | 11.5      | 12.3      | 52,152       | AGC              | 69.8           | 69.9      | 42,499      | 非鉄金属(0.7%)      | 20              | 19.2     | 23,596        |        |    |     |  |
| ユニ・チャーム         | 285.2     | 305.5     | 1,605,402    | 日本板硝子            | 1.9            | 1.1       | 3,861       | 大紀アルミニウム工業所     | 38.1            | 44.2     | 76,112        |        |    |     |  |
| ショーエコパレーション     | 3.8       | 2.1       | 1,289        | 石塚硝子             | 4.4            | 2.4       | 3,508       | 日本金属鉱業          | 41              | 43.9     | 213,529       |        |    |     |  |
| 医薬品(4.5%)       |           |           |              | 日本山村硝子           | 55.8           | 59.8      | 210,675     | 東邦亜鉛            | 8.4             | 9.8      | 10,966        |        |    |     |  |
| 協和キリン           | 165.4     | 177.2     | 401,889      | オハラ              | 6.5            | 7         | 8,085       | 三菱マテリアル         | 94              | 108      | 299,268       |        |    |     |  |
| 武田薬品工業          | 1,211.6   | 1,297.8   | 5,475,418    | 住友大阪セメント         | 19.3           | 24.4      | 91,378      | 住友金属鉱山          | 163.4           | 174.9    | 700,299       |        |    |     |  |
| アステラス製薬         | 1,312.1   | 1,286.3   | 2,085,735    | 太平洋セメント          | 87.2           | 86.7      | 269,897     | DOWAホールディングス    | 31.7            | 37.3     | 189,633       |        |    |     |  |
| 住友ファーマ          | 101.5     | 108.8     | 37,536       | 日本ヒューム           | 12.5           | 12.8      | 11,571      | 古河機械金属          | 20.6            | 20       | 38,400        |        |    |     |  |
| 塩野義製薬           | 175       | 184.9     | 1,303,360    | 日本コンクリート工業       | 27.3           | 28.4      | 13,433      | エス・サイエンス        | 76.5            | 41.9     | 921           |        |    |     |  |
| わかむと製薬          | 11.5      | 6.8       | 1,421        | 三谷セキサン           | 5.8            | 5.9       | 30,916      | 大衛テクノムテクロジーズ    | 20.6            | 26.2     | 73,124        |        |    |     |  |
| 日本新薬            | 32.3      | 38.4      | 196,224      | アシパリホールディングス     | 21.8           | 20.8      | 16,889      | 東邦チタニウム         | 25.5            | 31.2     | 58,032        |        |    |     |  |
| 中外製薬            | 428.6     | 459       | 2,383,587    | 東海カーボン           | 114.9          | 135.3     | 139,494     | UACJ            | 19.7            | 21.2     | 87,874        |        |    |     |  |
| 科研製薬            | 23.4      | 25.1      | 88,126       | 日本カーボン           | 7.8            | 7.8       | 34,476      | C Kサンエツ         | 2.6             | 2.7      | 10,395        |        |    |     |  |
| エーザイ            | 166.6     | 178.4     | 1,163,346    | 東洋炭素             | 8.6            | 10.3      | 51,706      | 古河電気工業          | 46.9            | 50.2     | 138,526       |        |    |     |  |
| ロート製薬           | 132.6     | 142.1     | 428,857      | リリカケンパンニリミテド     | 6.8            | 8.1       | 63,909      | 住友電気工業          | 486.4           | 564.4    | 1,170,283     |        |    |     |  |
| 小野薬品工業          | 264.2     | 311.2     | 783,446      | TOTO             | 90.4           | 96.8      | 362,322     | フジクラ            | 151.1           | 177.9    | 220,951       |        |    |     |  |
| 久光製薬            | 30.4      | 32.6      | 135,746      | 日本碍子             | 162            | 170.6     | 317,316     | SWCC            | 15.8            | 16.9     | 52,728        |        |    |     |  |
| 持田製薬            | 16.4      | 16.9      | 53,573       | 日本特殊陶業           | 104.2          | 122.8     | 51,928      | タツタ電線           | 28.8            | 26.8     | 18,438        |        |    |     |  |
| 參天製薬            | 257.6     | 267.2     | 383,031      | ダントホールディングス      | 8.7            | 4.3       | 4,076       | カナレー電気          | 2               | 1.1      | 1,860         |        |    |     |  |
| 扶桑製品工業          | 4.3       | 5.2       | 11,502       | MA RUWA          | 5.1            | 5.4       | 165,780     | 平河ヒューテック        | 8.2             | 9.6      | 13,113        |        |    |     |  |
| 日本ケミファ          | 1.2       | 0.7       | 1,123        | 品川リフレクトリーズ       | 3.8            | 18.1      | 36,905      | リヨーピ            | 15              | 16.1     | 44,452        |        |    |     |  |
| ツムラ             | 43.1      | 46.2      | 135,527      | 黒崎播磨             | 2.8            | 3         | 38,670      | アーレディティ         | 13.8            | 7.4      | 5,683         |        |    |     |  |
| キッセイ薬品工業        | 21.2      | 24.3      | 76,788       | ヨータイ             | 9.2            | 9.1       | 13,276      | AREホールディングス     | 57.1            | 56.8     | 110,135       |        |    |     |  |
| 生化学工業           | 26.2      | 24.9      | 19,247       | 東京窯業             | 11.6           | 7         | 3,619       | 金属製品(0.5%)      | 8.3             | 7.5      | 11,377        |        |    |     |  |
| 宋研化学            | 22.2      | 26.9      | 52,159       | ニッカトー            | 5.6            | 3         | 1,746       | 稻葉製作所           | 3.9             | 7.6      | 26,676        |        |    |     |  |
| 鳥居薬品            | 7.3       | 7.9       | 29,032       | Fujisawaホールディングス | 10.9           | 39.4      | 132,975     | 宮地エンジニアリンググループ  | 3.3             | 6.6      | 27,324        |        |    |     |  |
| J C R ファーマ      | 46.3      | 49.6      | 49,600       | クニミネ工業           | 3.6            | 1.9       | 1,934       | トーカロ            | 38.7            | 43.6     | 66,664        |        |    |     |  |
| 東和薬品            | 21.1      | 22.5      | 60,007       | E-アンドエーティアリール    | 2.4            | 1.4       | 1,939       | アルファ            | 4.5             | 2.4      | 3,844         |        |    |     |  |
| 富士製薬工業          | 8.9       | 10.8      | 21,330       | ニチアス             | 34.6           | 37.1      | 127,624     | SUMCO           | 268.1           | 268      | 605,680       |        |    |     |  |
| ゼリア新薬工業         | 19        | 20.3      | 44,883       | ニチハ              | 17.1           | 18.4      | 60,812      | 川田テクノロジーズ       | 3.3             | 3.6      | 27,324        |        |    |     |  |
| そせいイグループ        | —         | 48.1      | 68,783       | 鉄鋼(1.0%)         | 日本製鉄           | 630.7     | 675.6       | 2,408,514       | RS Technologies | 9.4      | 10.1          | 28,300 |    |     |  |
| 第一三共            | 1,192.7   | 1,277.5   | 5,764,080    | 神戸製鋼所            | 283.2          | 303.4     | 627,431     | ジェイティックコーポレーション | 1.7             | 1.2      | 2,440         |        |    |     |  |
| 杏林製薬            | 29.7      | 31.8      | 56,095       | 中山製鋼所            | 29             | 34.6      | 32,627      | 信和              | 6.8             | 4.3      | 3,276         |        |    |     |  |
| 大幸薬品            | 24.8      | 30.3      | 9,271        | 合同製鐵             | 7              | 8.5       | 49,810      | 東洋製錬ホールディングス    | 93.2            | 86.6     | 208,186       |        |    |     |  |
| タイト             | 9.6       | 11.3      | 22,328       | JFEホールディングス      | 376.4          | 419.6     | 973,681     | ホッカンホールディングス    | 7.5             | 7.4      | 13,704        |        |    |     |  |
| 大冢ホールディングス      | 313.3     | 305       | 1,717,150    | 東京製鐵             | 39.6           | 42.5      | 73,992      | 櫻井ブリッジホールディングス  | 18.6            | 23.6     | 67,189        |        |    |     |  |
| 大正製薬ホールディングス    | 30.4      | 32.6      | 280,294      | 共英製鋼             | 16.1           | 17.3      | 37,056      | 駒井ハルティック        | 2.1             | 1.2      | 2,511         |        |    |     |  |
| ペプチドリーム         | 66.4      | 71.1      | 92,536       | 大和工業             | 23.2           | 28.5      | 241,366     | 高田機工            | 0.6             | 0.5      | 1,832         |        |    |     |  |
| セルソース           | —         | 4.1       | 5,362        | 東京鋼鐵             | 6.7            | 6.7       | 36,046      | 三和ホールディングス      | 129.6           | 151.6    | 357,548       |        |    |     |  |
| あすけ製薬ホールディングス   | 14        | 15        | 28,530       | 大阪製鐵             | 6.6            | 7         | 15,456      | 文化シャッター         | 40.6            | 39.5     | 58,776        |        |    |     |  |
| サワイグループホールディングス | 31.3      | 33.5      | 190,782      | 淀川製鋼所            | 16.1           | 17.2      | 67,768      | 三協立山            | 16.1            | 19       | 17,347        |        |    |     |  |
| 石油・石炭製品(0.5%)   |           |           |              | 中部鋼鋳             | 11.7           | 9.9       | 24,146      | アルインコ           | 10.8            | 11.5     | 11,994        |        |    |     |  |
| 日本コースクス工業       | 123.5     | 148.7     | 19,033       |                  |                |           |             | 東洋シャッター         | 2.2             | 1.5      | 1,096         |        |    |     |  |
| ニチレキ            | 16.3      | 19.1      | 46,699       |                  |                |           |             |                 |                 |          |               |        |    |     |  |
| ユンロ化學工業         | 7.1       | 7.6       | 15,716       |                  |                |           |             |                 |                 |          |               |        |    |     |  |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当期末   |           |     | 銘柄           | 期首(前期末) | 当期末   |           |     | 銘柄                | 期首(前期末) | 当期末     |           |     |
|------------------|---------|-------|-----------|-----|--------------|---------|-------|-----------|-----|-------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                  |         | 株数    | 株数        | 評価額 |              |         | 株数    | 株数        | 評価額 |                   |         | 株数      | 株数        | 評価額 |
| LIXIL            | 205.2   | 235.5 | 461,580   | 千円  | タツモ          | 7.5     | 8.9   | 27,501    | 千円  | マースグループホールディングス   | 千株      | 千株      | 千円        |     |
| 日本ファイルコン         | 8.2     | 4.4   | 2,415     |     | ナブテスコ        | 86.5    | 92.7  | 261,367   |     | フクシマガリレイ          | 8.2     | 7.5     | 20,287    |     |
| ノーリツ             | 20.7    | 25    | 39,425    |     | 三井海洋開発       | 17.3    | 18.7  | 42,710    |     | オーワズミ             | 10.1    | 9.7     | 49,567    |     |
| 長府製作所            | 14.1    | 15    | 31,575    |     | レオン自動機       | 14.6    | 17.1  | 25,667    |     | ダイコク電機            | 4.6     | 2.5     | 1,125     |     |
| リンナイ             | 25.5    | 72.2  | 234,577   |     | SMC          | 44.7    | 44.2  | 3,495,336 |     | 竹内製作所             | 7.5     | 7.3     | 26,207    |     |
| ダイニチ工業           | 6.5     | 3.5   | 2,467     |     | ホソカワミクロン     | 10.6    | 9.5   | 43,937    |     | アマノ               | 25      | 26.8    | 136,144   |     |
| 日東精工             | 20.6    | 21.9  | 11,979    |     | ユニオンツール      | 6.1     | 6.5   | 21,287    |     | JUKI              | 39.1    | 41.9    | 153,521   |     |
| 三洋工業             | 1.4     | 0.8   | 2,628     |     | 瑞光           | —       | 10.6  | 19,758    |     | サンデン              | 21.4    | 22.8    | 10,510    |     |
| 岡部               | 22.6    | 26.9  | 21,439    |     | オイレス工業       | 19.3    | 20.1  | 41,767    |     | ジャノメ              | 18.3    | 9.8     | 1,871     |     |
| ジーテクト            | 15.7    | 19.2  | 40,569    |     | 日精エーエスピー機械   | 6.3     | 5.9   | 24,750    |     | マックス              | 14.1    | 15      | 10,785    |     |
| 東プレ              | 24.9    | 26.6  | 59,451    |     | サトーホールディングス  | 19.6    | 21    | 44,604    |     | グローリー             | 17      | 20.8    | 65,312    |     |
| 高周波熱鍊            | 22.8    | 23.3  | 24,651    |     | 技研製作所        | 14.3    | 13.9  | 28,592    |     | 新晃工業              | 35.7    | 35.4    | 104,500   |     |
| 東京製綱             | 8.4     | 9.8   | 13,308    |     | 日本エアーテック     | 7       | 6.9   | 8,438     |     | 大和冷機工業            | 13.8    | 14.9    | 43,746    |     |
| サンコール            | 11.1    | 13.4  | 6,432     |     | カワタ          | 3.6     | 2     | 2,056     |     | セガミホールディングス       | 21.2    | 22.7    | 34,640    |     |
| モリテックスチール        | 9.4     | 6.1   | 1,756     |     | 日精樹脂工業       | 10.3    | 11    | 12,848    |     | 日本ピストンリング         | 110.8   | 131.9   | 288,069   |     |
| パイオラックス          | 19.4    | 18.7  | 49,816    |     | オカダアイヨン      | 3.8     | 2.2   | 5,992     |     | リケン               | 4.2     | —       | —         |     |
| エイチワン            | 14.7    | 15.5  | 13,919    |     | ワエイシホールディングス | 5.2     | 5.5   | 12,787    |     | TPR               | 5.5     | —       | —         |     |
| 日本発条             | 124.7   | 133.5 | 165,540   |     | 小松製作所        | 646     | 692.2 | 2,975,767 |     | ツバキ・ナカシマ          | 15.8    | 18.7    | 39,344    |     |
| 中央発條             | 7.8     | 11.2  | 8,366     |     | 住友重機械工業      | 81.5    | 87.4  | 343,744   |     | ホシザキ              | 34      | 29.7    | 22,156    |     |
| アドベネクス           | 1.5     | 0.8   | 859       |     | 日立建機         | 54.9    | 58.8  | 248,547   |     | 大豊工業              | 88.7    | 87.1    | 468,336   |     |
| 立川ブライド工業         | 6.4     | 6.8   | 10,077    |     | 日工           | 20.6    | 21.9  | 16,665    |     | 日本精工              | 12.1    | 12.8    | 10,636    |     |
| 三益半導体工業          | 10.8    | 13.6  | 43,588    |     | 巴工業          | 6       | 5.8   | 21,054    |     | NTN               | 253     | 273.4   | 217,981   |     |
| <b>機械 (5.3%)</b> |         |       |           |     | 井関農機         | 12.9    | 13.8  | 16,449    |     | ジェイテクト            | 271.8   | 320.3   | 90,773    |     |
| 日本ドライケミカル        | 3       | 1.6   | 4,659     |     | TOWA         | 14      | 16.4  | 126,772   |     | 不二越               | 122.7   | 131.4   | 182,974   |     |
| 日本製錫所            | 38      | 40.7  | 95,461    |     | 丸山製作所        | 2.2     | 1.1   | 3,053     |     | 日本トムソン            | 10.2    | 10.9    | 36,951    |     |
| 三浦工業             | 57.6    | 61.7  | 172,358   |     | 北川鉄工所        | 5.4     | 5.8   | 8,642     |     | THK               | 33.7    | 40.3    | 23,938    |     |
| タクマ              | 42.4    | 49.9  | 86,227    |     | ローチ          | 7.2     | 7.7   | 140,294   |     | ユーシン精機            | 79.6    | 85.2    | 229,230   |     |
| ソガミ              | 30.6    | 32.8  | 39,655    |     | タカキタ         | 3.6     | 2.2   | 1,093     |     | 前澤給装工業            | 10.8    | 11.8    | 8,106     |     |
| オーフマ             | 13.8    | 12.9  | 89,113    |     | クボタ          | 729.6   | 772   | 1,711,910 |     | イーグル工業            | 15.3    | 16.3    | 28,036    |     |
| 芝浦機械             | 13.7    | 14.7  | 49,612    |     | 荏原実業         | 6.6     | 7.8   | 25,038    |     | 前澤工業              | 7.1     | 4.2     | 4,544     |     |
| アマダ              | 220     | 235.6 | 374,368   |     | 三菱化工作機       | 4.4     | 5.2   | 19,162    |     | 日本ピラー工業           | 12.8    | 13.7    | 63,568    |     |
| アイダエンジニアリング      | 28.4    | 34.2  | 28,864    |     | 月島ホールディングス   | 18.7    | 20    | 27,160    |     | キット               | 50.7    | 49.5    | 60,439    |     |
| TAKISAWA         | 3.3     |       |           |     | 帝國電機製作所      | 10      | 10.4  | 30,014    |     | マキタ               | 171.5   | 168.4   | 641,267   |     |
| FUJII            | 60      | 69.5  | 171,943   |     | 東京機械製作所      | 2.9     | 1.7   | 795       |     | 三井E&S             | 63.2    | 73.3    | 55,194    |     |
| 牧野フライス製作所        | 15.3    | 16.3  | 93,073    |     | 新東工業         | 28.2    | 29.9  | 33,308    |     | 日立造船              | 113     | 130.3   | 131,212   |     |
| オーエスジー           | 65.8    | 65.1  | 130,427   |     | 鶴谷工業         | 12.9    | 13.9  | 34,485    |     | 三菱重工業             | 241.1   | 258.2   | 2,674,952 |     |
| ダイジェット工業         | 1.3     | 0.7   | 578       |     | アイチコポレーション   | 19.6    | 20.6  | 22,783    |     | IHI               | 86.9    | 109.9   | 302,719   |     |
| 旭ダイヤモンド工業        | 38.5    | 34    | 29,444    |     | 小森コーポレーション   | 31.9    | 36.4  | 46,555    |     | サノヤスホールディングス      | 16.8    | 9.6     | 1,392     |     |
| DMG森精機           | 83.6    | 89.5  | 292,844   |     | 鶴見製作所        | 10.5    | 11.3  | 40,112    |     | スター精密             | 26      | 27.5    | 47,630    |     |
| ソディック            | 37.9    | 35.9  | 25,848    |     | 日本ギア工業       | 4       | 2.5   | 1,667     |     | 電気機器 (17.3%)      | 17.3%   | 17.3%   | 17.3%     |     |
| ディスコ             | 22.1    | 71.1  | 3,046,635 |     | 酒井重工業        | 2       | 2.3   | 15,663    |     | 日清紡ホールディングス       | 112.1   | 111     | 138,139   |     |
| 日東工具             | 6.8     | 7.2   | 14,212    |     | 荏原製作所        | 56.4    | 60.6  | 574,912   |     | イビデン              | 79      | 77      | 556,094   |     |
| 日進工具             | 11.6    | 13.7  | 14,138    |     | 石井鐵工所        | 1       | 0.8   | 2,166     |     | コニカミノルタ           | 307.8   | 329.8   | 158,996   |     |
| パンチ工業            | 10.7    | 6.4   | 2,771     |     | 西島製作所        | 12      | 12.7  | 31,686    |     | プラザーア工業           | 184.2   | 197.3   | 520,378   |     |
| 富士ダイス            | 5.9     | 8.7   | 6,194     |     | 北越工業         | 13.8    | 14.8  | 36,304    |     | ミネベアミツミ           | 239.8   | 256.9   | 749,248   |     |
| 豊和工業             | 6.6     | 3.6   | 2,782     |     | ダイキン工業       | 164.6   | 176.3 | 3,731,389 |     | 日立製作所             | 670.5   | 709.7   | 8,317,684 |     |
| ニデックオーケー         | 5       | —     | —         |     | オルガノ         | 19      | 17.7  | 113,811   |     | 東芝                | 265.3   | —       | —         |     |
| 石川製作所            | 3.1     | 1.7   | 1,955     |     | トヨヨタカネツ      | 5.3     | 5     | 21,375    |     | 三菱電機              | 1,425   | 1,643.6 | 3,311,854 |     |
| リケンNPR           | —       | 16    | 43,872    |     | 栗田工業         | 77.1    | 82.6  | 454,217   |     | 富士電機              | 83.8    | 89.8    | 726,482   |     |
| 東洋機械金属           | 8.5     | 5.4   | 3,877     |     | 椿本チエイン       | 19.5    | 20.9  | 97,498    |     | 東洋電機製造            | 3.9     | 2.3     | 2,410     |     |
| 津田駒工業            | 2.3     | 1.2   | 465       |     | 大同工業         | 5       | 2.9   | 2,177     |     | 安川電機              | 163.4   | 160.4   | 852,686   |     |
| エンシュウ            | 2.6     | 1.5   | 1,059     |     | 木村化工作機       | 10.5    | 11.3  | 8,226     |     | シーフニアテクノロジー       | 15.2    | 16.3    | 35,925    |     |
| 島精機製作所           | 21.9    | 23.5  | 32,994    |     | アネスト岩田       | 23.4    | 22.8  | 29,617    |     | 明電舎               | 20.9    | 27.4    | 76,062    |     |
| オプトラン            | 20.4    | 24.3  | 42,330    |     | ダイワフ         | 71.1    | 249.2 | 714,581   |     | オリジン              | 2.8     | 1.5     | 1,830     |     |
| NCホールディングス       | 2.5     | 1.6   | 2,560     |     | サムコ          | 4.5     | 4     | 18,840    |     | 山洋電気              | 6       | 6.4     | 37,248    |     |
| イワキ              | 9.3     | 9.8   | 22,628    |     | 加藤製作所        | 5.8     | 3.3   | 5,016     |     | デンヨー              | 10.5    | 11.3    | 25,820    |     |
| フリュー             | 14.4    | 13.9  | 17,903    |     | 油研工業         | 1.7     | 1.1   | 2,550     |     | PHCホールディングス       | 19.2    | 27.6    | 41,565    |     |
| ヤマシンフィルタ         | 32.8    | 35.5  | 12,815    |     | タダメ          | 72.6    | 85    | 99,917    |     | KOKUSAI ELECTRIC  | —       | 57.1    | 227,258   |     |
| 日阪製作所            | 13.3    | 16.1  | 16,051    |     | フジテック        | 50.5    | 34.5  | 125,925   |     | ソシオネクスト           | 14.1    | 107.2   | 393,745   |     |
| やまびこ             | 22.5    | 24.1  | 38,969    |     | CKD          | 38.1    | 40.9  | 103,027   |     | 東芝テック             | 20.6    | 18.9    | 60,669    |     |
| 野村マイクロ・サイエンス     | 4.6     | 5     | 66,250    |     | 平和           | 45.8    | 43.7  | 95,877    |     | 芝浦メカトロニクス         | 2.7     | 8.4     | 63,924    |     |
| 平田機工             | 6.6     | 7.1   | 49,629    |     | 理想科学工業       | 12.3    | 11.8  | 35,636    |     | マブチモーター           | 34.3    | 72.6    | 184,186   |     |
| PEGASUS          | 15.3    | 16.3  | 7,237     |     | SANKYO       | 27.1    | 34    | 306,000   |     | ニデック              | 334.9   | 326     | 1,782,894 |     |
| マルマエ             | 6.7     | 6.4   | 11,532    |     | 日本金銭機械       | 15.2    | 17.8  | 25,703    |     | ヨー・エム・シー・エレクトロニクス | 9.9     | 9.3     | 3,227     |     |

| 銘柄                   | 期首(前期末)   | 当期末       |              |                | 銘柄         | 期首(前期末)    | 当期末          |               |            | 銘柄         | 期首(前期末)      | 当期末 |    |     |
|----------------------|-----------|-----------|--------------|----------------|------------|------------|--------------|---------------|------------|------------|--------------|-----|----|-----|
|                      |           | 株数        | 株数           | 評価額            |            |            | 株数           | 株数            | 評価額        |            |              | 株数  | 株数 | 評価額 |
| トレックス・セミコンダクター       | 千株<br>6.5 | 千株<br>7.6 | 千円<br>13,056 | マクセル           | 千株<br>29.9 | 千株<br>32.6 | 千円<br>51,182 | キヤノン電子        | 千株<br>15.1 | 千株<br>16.2 | 千円<br>33,712 |     |    |     |
| 東光高岳                 | 8.4       | 8.9       | 21,119       | 古野電気           | 18         | 19.2       | 39,052       | キヤノン          | 749        | 729.3      | 2,980,649    |     |    |     |
| ダブル・スコープ             | 45.1      | 42.3      | 30,709       | スマジコポレーション     | 12.6       | 19.8       | 22,928       | リコー           | 342.2      | 366.6      | 465,398      |     |    |     |
| ダイヘン                 | 12.5      | 14.8      | 95,756       | アイコム           | 5.4        | 5.7        | 20,491       | 象印マホービン       | 40.8       | 39.7       | 56,413       |     |    |     |
| ヤーマン                 | 23.8      | 28.7      | 28,814       | リオン            | 5.7        | 6.1        | 15,512       | MUTOHホールディングス | 1.7        | 0.9        | 1,874        |     |    |     |
| JVCケンウッド             | 125.5     | 116.6     | 76,606       | 横河電機           | 150.9      | 161.6      | 472,356      | 東京エレクトロン      | 96.3       | 309.5      | 8,814,560    |     |    |     |
| ミマキエンジニアリング          | 13.1      | 14        | 13,440       | 新電元工業          | 5.3        | 5.6        | 17,640       | イノテック         | 9.1        | 9.7        | 18,119       |     |    |     |
| I-P EX               | 7.6       | 10.2      | 17,911       | アズビル           | 95.4       | 100.6      | 463,061      | 輸送用機器（9.1%）   |            |            |              |     |    |     |
| 日新電機                 | 33        | —         | —            | 東亜ディーケーケー      | 5.9        | 3.1        | 2,935        | トヨタ紡織         | 57.5       | 61.6       | 145,468      |     |    |     |
| 大崎電気工業               | 32.5      | 32.3      | 21,899       | 日本光電工業         | 63.1       | 62.7       | 249,984      | 芦森工業          | 2.3        | 1.3        | 3,120        |     |    |     |
| オムロン                 | 126.3     | 112.8     | 625,137      | チノー            | 5.7        | 6.1        | 14,609       | ユニプレス         | 24.5       | 26.2       | 29,055       |     |    |     |
| 日東工業                 | 18.6      | 19.9      | 84,973       | 共和電業           | 11.6       | 6.1        | 2,580        | 豊田自動織機        | 99.8       | 124.7      | 1,685,320    |     |    |     |
| I DEC                | 20.3      | 21.8      | 60,669       | 日本電子材料         | 9          | 9          | 17,208       | モリタホールディングス   | 24         | 25.7       | 39,603       |     |    |     |
| 正興電機製作所              | 4.6       | 2.2       | 2,457        | 堀場製作所          | 30.3       | 27.9       | 344,983      | 三櫻工業          | 20.9       | 22.3       | 19,824       |     |    |     |
| 不二電機工業               | 2.5       | 1.3       | 1,492        | アドバンテスト        | 107.5      | 418.9      | 2,561,573    | デンソー          | 281.6      | 1,206.3    | 3,042,891    |     |    |     |
| ジエラ・コサ コーポレーション      | 45.3      | 57.6      | 148,348      | 小野測器           | 4.5        | 2.7        | 1,242        | 東海理化電機製作所     | 38.6       | 41.2       | 94,677       |     |    |     |
| サクサホールディングス          | 2.6       | 1.5       | 4,252        | エスペック          | 10.9       | 11.7       | 29,881       | 川崎重工業         | 102.9      | 119.4      | 418,735      |     |    |     |
| メルコホールディングス          | 3.7       | 4.6       | 14,950       | キーエンス          | 136.5      | 146.3      | 9,389,534    | 名村造船所         | 31.2       | 36.4       | 49,140       |     |    |     |
| テクノ・メディカ             | 3.3       | 3.5       | 6,685        | 日置電機           | 7.1        | 6.9        | 45,126       | 日本車輪製造        | 5.3        | 4.8        | 10,972       |     |    |     |
| ダイヤドーム・トリックルホールディングス | 4.5       | 5.5       | 3,839        | シスメックス         | 117.7      | 126.2      | 960,760      | 三菱ロジスネクスト     | 21.8       | 23.3       | 36,441       |     |    |     |
| 日本電気                 | 195       | 193.9     | 1,835,069    | 日本マイクロニクス      | 22.5       | 26.3       | 109,934      | 近畿車輛          | 1.5        | 0.9        | 1,806        |     |    |     |
| 富士通                  | 137.4     | 135.9     | 3,125,020    | メガチップス         | 11.2       | 11.6       | 55,100       | 日産自動車         | 1,939.1    | 1,973.1    | 1,211,680    |     |    |     |
| 沖電気工業                | 62.3      | 66.8      | 71,876       | OBARA GROUP    | 6.4        | 8          | 31,520       | いすゞ自動車        | 396.9      | 425.1      | 868,904      |     |    |     |
| 岩崎通信機                | 5.4       | 3.1       | 2,154        | 澤藤電機           | 1.4        | 0.8        | 1,047        | トヨタ自動車        | 7,495.9    | 8,028.6    | 26,173,236   |     |    |     |
| 電気興業                 | 5.5       | 6.6       | 15,635       | 原田工業           | 5.5        | 2.9        | 2,180        | 日野自動車         | 175.8      | 219.9      | 102,473      |     |    |     |
| サンケン電気               | 12.8      | 13.7      | 10,860       | ゴーセル           | 16.4       | 15.6       | 22,807       | 三菱自動車工業       | 532.6      | 570.4      | 259,931      |     |    |     |
| ナカヨ                  | 2.1       | 1.1       | 1,261        | イリソ電子工業        | 12.6       | 13.4       | 40,803       | エフテック         | 8.3        | 4.5        | 3,091        |     |    |     |
| アイホン                 | 8.4       | 8         | 22,936       | オブテックスグループ     | 25.1       | 26.8       | 47,168       | レッシュホールディングス  | 4.7        | 2.8        | 1,878        |     |    |     |
| ルネサスエレクトロニクス         | 899.7     | 963.8     | 2,288,061    | 平代田インテグレー      | 4.7        | 5.7        | 15,600       | GMB           | 2.4        | 1.3        | 1,635        |     |    |     |
| セイコーエプソン             | 183.6     | 189.5     | 448,546      | レザーテック         | 62.5       | 67         | 2,674,640    | ファルテック        | 2.1        | 1.3        | 726          |     |    |     |
| ワコム                  | 109.2     | 112.3     | 83,438       | スタンレー電気        | 97.1       | 93.6       | 248,929      | 武藏精密工業        | 33.3       | 35.7       | 61,368       |     |    |     |
| アルパック                | 32.7      | 32.4      | 244,911      | 岩崎電気           | 4.4        | —          | —            | 日産車体          | 24.1       | 14.8       | 14,518       |     |    |     |
| アクセル                 | 4.5       | 5.9       | 13,440       | ウシオ電機          | 71.3       | 74.3       | 152,835      | 新明和工業         | 42.9       | 42.1       | 49,088       |     |    |     |
| E I Z O              | 10.1      | 10.8      | 53,460       | 赤谷電機産業         | 9.8        | 5          | 1,430        | 極東開発工業        | 24         | 24.2       | 58,007       |     |    |     |
| ジャパンディスプレイ           | 528.8     | 636.3     | 12,726       | ハリオ・テリ・ホールディング | 11.1       | 6.5        | 3,458        | トピー工業         | 11.1       | 11.9       | 34,867       |     |    |     |
| 日本信号                 | 31.4      | 33.7      | 32,183       | エノモト           | 3.1        | 1.8        | 2,921        | ティラド          | 3.4        | 3.2        | 12,080       |     |    |     |
| 京三製作所                | 29        | 30.9      | 14,368       | 日本セラミック        | 13.9       | 11.9       | 31,475       | 曙ブレーキ工業       | 83.3       | 89.1       | 10,157       |     |    |     |
| 能美防災                 | 18.7      | 20        | 46,040       | 遠藤照明           | 5.4        | 2.9        | 4,428        | タチエス          | 21.6       | 27         | 53,460       |     |    |     |
| ホーチキ                 | 10.3      | 11        | 23,386       | 古河電池           | 10.1       | 10.7       | 10,047       | NOK           | 53         | 56.8       | 116,553      |     |    |     |
| 星和電機                 | 5.2       | 2.9       | 1,392        | 双信電機           | 5          | 2.6        | 767          | フタバ産業         | 36.5       | 39.2       | 38,376       |     |    |     |
| エレコム                 | 32.9      | 35.3      | 59,551       | 山一電機           | 11.9       | 13.1       | 28,767       | カヤバ           | 13.1       | 14.1       | 71,064       |     |    |     |
| パソニック・ホールディングス       | 1,628.6   | 1,744.5   | 2,495,507    | 国研             | 11.9       | 12.7       | 51,752       | 大同メタル工業       | 26.6       | 28.6       | 16,330       |     |    |     |
| シャープ                 | 166       | 248.9     | 214,576      | 日本電子           | 34.2       | 36.6       | 243,353      | プレス工業         | 60.8       | 58.4       | 39,303       |     |    |     |
| アンリツ                 | 97.1      | 104       | 121,108      | カシオ計算機         | 101.6      | 105.6      | 133,108      | ミクニ           | 14         | 8.2        | 4,108        |     |    |     |
| 富士通ゼネラル              | 39.1      | 41.9      | 87,990       | ファナック          | 133.9      | 713        | 2,812,785    | 太平洋工業         | 31.3       | 33.5       | 50,116       |     |    |     |
| ソニー・グループ             | 965.7     | 1,034.3   | 14,790,490   | 日本シイムケイ        | 29         | 31.1       | 23,387       | 河西工業          | 16.1       | 10.3       | 1,936        |     |    |     |
| T DK                 | 218.4     | 233.8     | 1,776,646    | エンプラス          | 4          | 4.3        | 46,827       | アイシン          | 105.4      | 112.8      | 595,358      |     |    |     |
| 帝国通信工業               | 6.2       | 6.5       | 12,668       | 大真空            | 16.6       | 21.8       | 19,140       | マツダ           | 451.5      | 483.6      | 919,807      |     |    |     |
| タムラ製作所               | 59.1      | 58.8      | 31,810       | ローム            | 63.1       | 270.3      | 719,538      | 今仙電機製作所       | 7.7        | 4.1        | 3,075        |     |    |     |
| アルプスアルパイン            | 123.1     | 131.9     | 141,133      | 浜松ホトニクス        | 109.5      | 117.3      | 661,102      | 本田技研工業        | 1,109.7    | 3,565.6    | 6,098,958    |     |    |     |
| 池上通信機                | 4         | 2         | 1,796        | 三井ハイテック        | 14.1       | 12.9       | 95,382       | ズスキ           | 250.8      | 268.5      | 1,942,597    |     |    |     |
| 日本電波工業               | 16.5      | 17.7      | 21,169       | 新光電気工業         | 48.3       | 51.7       | 281,765      | S U B A R U   | 432        | 453.4      | 1,403,273    |     |    |     |
| 鈴木                   | 7.4       | 7.9       | 9,875        | 京セラ            | 212.1      | 908.5      | 1,887,408    | 安永            | 5.4        | 2.8        | 1,909        |     |    |     |
| メイコー                 | 15.1      | 14.7      | 67,326       | 太陽誘電           | 66.5       | 71.2       | 244,287      | ヤマハ発動機        | 214.5      | 631.9      | 896,982      |     |    |     |
| 日本トリム                | 3.1       | 3.3       | 10,923       | 村田製作所          | 414        | 1,330.3    | 3,976,931    | T B K         | 11.7       | 7          | 2,961        |     |    |     |
| ローランド ディージー.         | 7.7       | 8.1       | 31,509       | 双葉電子工業         | 25.8       | 27.8       | 14,066       | エクセディ         | 22.2       | 23.9       | 68,712       |     |    |     |
| フォスター電機              | 12.8      | 10.9      | 12,327       | 北陸電気工業         | 4.5        | 2.4        | 3,381        | 豊田合成          | 39.8       | 41.9       | 123,730      |     |    |     |
| SMK                  | 3.3       | 3.8       | 9,500        | ニチコン           | 27.9       | 38.4       | 48,384       | 愛三工業          | 22.6       | 24.2       | 35,283       |     |    |     |
| ヨコオ                  | 10.9      | 13        | 18,564       | 日本ケミコン         | 13.5       | 15.6       | 21,871       | 盟和産業          | 1.5        | 0.9        | 931          |     |    |     |
| ティアップ                | 18.8      | 10.6      | 1,049        | K O A          | 20.6       | 22.1       | 32,199       | 日本プラス         | 9.5        | 5.5        | 3,327        |     |    |     |
| ホシデン                 | 33        | 33.6      | 60,312       | 市光工業           | 19.7       | 26.4       | 15,892       | ヨロズ           | 12.6       | 13.7       | 13,672       |     |    |     |
| ヒロセ電機                | 22.8      | 21.8      | 354,032      | 小糸製作所          | 164.2      | 151.5      | 305,727      | エフ・シー・シー      | 24.3       | 25.9       | 54,131       |     |    |     |
| 日本航空電子工業             | 28.3      | 35.3      | 86,732       | ミツバ            | 25.6       | 27.4       | 30,907       | シマノ           | 55.8       | 59.1       | 1,245,532    |     |    |     |
| TOA                  | 15.7      | 16.8      | 18,900       | SCREENホールディングス | 23.3       | 50         | 817,250      | ティ・エス テック     | 62.5       | 52         | 100,568      |     |    |     |

| 銘柄                | 期首(前期末)   | 当期末       |              |     | 銘柄               | 期首(前期末)       | 当期末         |                 |     | 銘柄                     | 期首(前期末)     | 当期末         |                 |     |
|-------------------|-----------|-----------|--------------|-----|------------------|---------------|-------------|-----------------|-----|------------------------|-------------|-------------|-----------------|-----|
|                   |           | 株数        | 株数           | 評価額 |                  |               | 株数          | 株数              | 評価額 |                        |             | 株数          | 株数              | 評価額 |
| ジャムコ              | 千株<br>6.6 | 千株<br>7.1 | 千円<br>10,792 |     | 共同印刷             | 千株<br>3.8     | 千円<br>4.1   | 千円<br>13,940    |     | サカイ引越センター              | 千株<br>6.5   | 千株<br>16.2  | 千円<br>42,816    |     |
| 精密機器 (2.3%)       |           |           |              |     | N I S S H A      | 千株<br>26      | 千円<br>25    | 千円<br>39,500    |     | 近畿グループホールディングス         | 千株<br>136.3 | 千株<br>146   | 千円<br>657,146   |     |
| テルモ               | 426.5     | 408.8     | 2,073,842    |     | TAKARA & COMPANY | 千株<br>0.6     | 千円<br>0.5   | 千円<br>779       |     | 阪急阪神ホールディングス           | 千株<br>181.7 | 千株<br>194.7 | 千円<br>887,832   |     |
| クリエートメディア         | 4.2       | 2.1       | 1,871        |     | アシックス            | 千株<br>8.8     | 千円<br>8.6   | 千円<br>24,355    |     | 南海電気鉄道                 | 千株<br>65.1  | 千株<br>65.1  | 千円<br>193,867   |     |
| 日機装               | 34.1      | 34.1      | 38,396       |     | ツヅミ              | 千株<br>126     | 千円<br>124.6 | 千円<br>585,620   |     | 京阪ホールディングス             | 千株<br>56.3  | 千株<br>80.5  | 千円<br>288,914   |     |
| 日本エム・ディ・エム        | 8         | 11.6      | 8,444        |     | ローランド            | 千株<br>10      | 千円<br>10.8  | 千円<br>52,164    |     | 神戸電鉄                   | 千株<br>3.7   | 千株<br>4     | 千円<br>11,508    |     |
| 島津製作所             | 166.2     | 194.3     | 750,386      |     | 小松ウォール工業         | 千株<br>5.1     | 千円<br>6     | 千円<br>19,410    |     | 名古屋鉄道                  | 千株<br>150.6 | 千株<br>150.6 | 千円<br>340,657   |     |
| J M S             | 12.8      | 13.4      | 6,994        |     | ヤマハ              | 千株<br>86.1    | 千円<br>92.2  | 千円<br>316,891   |     | 山陽電気鉄道                 | 千株<br>10.3  | 千株<br>11    | 千円<br>24,057    |     |
| クボテック             | 3.2       | 1.8       | 459          |     | 河合楽器製作所          | 千株<br>3.7     | 千円<br>4.4   | 千円<br>15,422    |     | アルピス物流                 | 千株<br>10.9  | 千株<br>11.7  | 千円<br>22,101    |     |
| 長野計器              | 9.9       | 10.6      | 24,348       |     | クリナップ            | 千株<br>15.4    | 千円<br>14.3  | 千円<br>11,096    |     | ヤマトホールディングス            | 千株<br>174.5 | 千株<br>186.9 | 千円<br>451,550   |     |
| ブイ・テクノロジー         | 6.6       | 7.7       | 20,713       |     | ビジョン             | 千株<br>86.9    | 千円<br>93.1  | 千円<br>149,565   |     | 山九                     | 千株<br>34.7  | 千株<br>37.1  | 千円<br>199,820   |     |
| 東京計器              | 10.4      | 11.2      | 20,798       |     | 兼松サステック          | 千株<br>0.6     | 千円<br>—     | 千円<br>—         |     | 丸運                     | 千株<br>6.5   | 千株<br>3.7   | 千円<br>1,036     |     |
| 愛知時計電機            | 5.4       | 6.3       | 16,304       |     | キンギューム           | 千株<br>12.2    | 千円<br>13    | 千円<br>11,323    |     | 丸全昭和運輸                 | 千株<br>8.5   | 千株<br>9     | 千円<br>37,350    |     |
| インター・アクション        | 6.4       | 8.8       | 9,900        |     | リネットック           | 千株<br>27.4    | 千円<br>29.4  | 千円<br>82,114    |     | セコムホールディングス            | 千株<br>72.2  | 千株<br>77.3  | 千円<br>87,194    |     |
| オーパル              | 10.7      | 5.7       | 3,100        |     | イトーキ             | 千株<br>27.9    | 千円<br>30    | 千円<br>46,920    |     | トナミホールディングス            | 千株<br>2.5   | 千株<br>3.2   | 千円<br>14,864    |     |
| 東京精密              | 29.9      | 29.9      | 283,631      |     | 任天堂              | 千株<br>861.9   | 千円<br>923.1 | 千円<br>7,725,423 |     | ニッコンホールディングス           | 千株<br>43.7  | 千株<br>46.7  | 千円<br>148,926   |     |
| マニー               | 60.1      | 58.5      | 120,217      |     | 三菱鉛筆             | 千株<br>19.4    | 千円<br>20.8  | 千円<br>40,996    |     | 日本石油輸送                 | 千株<br>0.8   | 千株<br>0.7   | 千円<br>2,009     |     |
| ニコン               | 212.3     | 211.4     | 319,108      |     | タカラスタンダード        | 千株<br>26.4    | 千円<br>30.8  | 千円<br>57,934    |     | 福山通運                   | 千株<br>10.4  | 千株<br>16.7  | 千円<br>71,309    |     |
| トプコン              | 71.8      | 71.1      | 122,043      |     | コヨク              | 千株<br>65.7    | 千円<br>59.9  | 千円<br>141,573   |     | セイノーホールディングス           | 千株<br>84.9  | 千株<br>82.1  | 千円<br>177,294   |     |
| オリンパス             | 853.3     | 900       | 1,930,500    |     | ナカバヤシ            | 千株<br>15      | 千円<br>15.7  | 千円<br>8,478     |     | エスラングループ本社             | 千株<br>3.7   | 千株<br>1.8   | 千円<br>1,564     |     |
| 理研計器              | 8.5       | 10.4      | 82,472       |     | グローブライド          | 千株<br>11      | 千円<br>13.1  | 千円<br>27,248    |     | 神奈川中央交通                | 千株<br>3.9   | 千株<br>4     | 千円<br>12,440    |     |
| タムロン              | 10.2      | 9         | 51,570       |     | オカムラ             | 千株<br>41.1    | 千円<br>44.1  | 千円<br>96,005    |     | AZ-COMS和ホールディングス       | 千株<br>32.9  | 千株<br>37.3  | 千円<br>56,770    |     |
| H O Y A           | 291.5     | 287.8     | 5,295,520    |     | 美津濃              | 千株<br>13.5    | 千円<br>14.5  | 千円<br>63,945    |     | C & Fロジホールディングス        | 千株<br>13.2  | 千株<br>14.1  | 千円<br>24,745    |     |
| シード               | 6.2       | 3.3       | 2,646        |     | 電気・ガス業 (1.4%)    | 千株<br>1,230.6 | 千円<br>1,318 | 千円<br>1,005,502 |     | 九州旅客鉄道                 | 千株<br>96.3  | 千株<br>103.2 | 千円<br>348,093   |     |
| ノーリツ鋼機            | 12.9      | 13.9      | 45,599       |     | 東京電力ホールディングス     | 千株<br>503.1   | 千円<br>538.8 | 千円<br>1,057,395 |     | S Gホールディングス            | 千株<br>261.6 | 千株<br>245.1 | 千円<br>460,910   |     |
| A&Dホールディングス       | 19.9      | 21.3      | 45,156       |     | 中部電力             | 千株<br>527.1   | 千円<br>564.6 | 千円<br>1,080,362 |     | NIJOPP EXPRESSホールディングス | 千株<br>50.9  | 千株<br>49.5  | 千円<br>429,066   |     |
| 朝日エンタッピング         | 152.5     | 178.2     | 515,176      |     | 関西電力             | 千株<br>217.4   | 千円<br>254   | 千円<br>251,053   |     | 海運業 (0.9%)             | 千株<br>364.6 | 千株<br>418.4 | 千円<br>2,048,068 |     |
| シチズン時計            | 149.9     | 134.5     | 130,868      |     | 中国電力             | 千株<br>128.7   | 千円<br>149.5 | 千円<br>106,279   |     | 日本郵船                   | 千株<br>240.2 | 千株<br>316.8 | 千円<br>1,674,288 |     |
| リズム               | 3.8       | 1.5       | 5,355        |     | 北陸電力             | 千株<br>333.7   | 千円<br>384.9 | 千円<br>386,632   |     | 商船三井                   | 千株<br>116.1 | 千株<br>117.2 | 千円<br>823,330   |     |
| 大研医器              | 9.3       | 5.6       | 3,029        |     | 東北電力             | 千株<br>116.5   | 千円<br>136.2 | 千円<br>140,830   |     | 川崎汽船                   | 千株<br>7.3   | 千株<br>7.9   | 千円<br>40,211    |     |
| メニコン              | 46.9      | 50.3      | 107,013      |     | 四国電力             | 千株<br>315     | 千円<br>337   | 千円<br>389,403   |     | N Sユナイテッド海運            | 千株<br>11.8  | 千株<br>7.1   | 千円<br>5,530     |     |
| シンシア              | 1.2       | 0.8       | 468          |     | 九州電力             | 千株<br>131.7   | 千円<br>141.2 | 千円<br>89,873    |     | 明海グループ                 | 千株<br>50    | 千株<br>53.6  | 千円<br>72,306    |     |
| 松風                | 6.2       | 6.6       | 17,721       |     | 北海道電力            | 千株<br>31.9    | 千円<br>37.3  | 千円<br>40,768    |     | 共栄タンカー                 | 千株<br>2.2   | 千株<br>1.2   | 千円<br>1,225     |     |
| セイコーブループ          | 21.2      | 20.4      | 54,835       |     | 沖縄電力             | 千株<br>102.8   | 千円<br>120.1 | 千円<br>308,596   |     | 乾汽船                    | 千株<br>17.3  | 千株<br>17.1  | 千円<br>18,365    |     |
| ニプロ               | 113.8     | 121.9     | 146,462      |     | 電源開発             | 千株<br>8.9     | 千円<br>10.6  | 千円<br>4,706     |     | 空運業 (0.4%)             | 千株<br>334.8 | 千株<br>358.5 | 千円<br>1,001,111 |     |
| その他製品 (2.4%)      |           |           |              |     | エフソン             | 千株<br>24.3    | 千円<br>26    | 千円<br>19,994    |     | 日本航空                   | 千株<br>370.8 | 千株<br>397.2 | 千円<br>1,287,722 |     |
| K Y O R I T S U   | 17.6      | 9.7       | 1,959        |     | イーレックス           | 千株<br>36.3    | 千円<br>39    | 千円<br>47,697    |     | ANAホールディングス            | 千株<br>2.5   | 千株<br>1.3   | 千円<br>2,442     |     |
| 中本パックス            | 3.8       | 2.1       | 3,645        |     | レノバ              | 千株<br>288.6   | 千円<br>309.1 | 千円<br>1,021,575 |     | 倉庫・運輸関連業 (0.1%)        | 千株<br>3.9   | 千株<br>4.2   | 千円<br>29,232    |     |
| スノーピーク            | 23.3      | 20.8      | 17,700       |     | 東京瓦斯             | 千株<br>276.6   | 千円<br>296.2 | 千円<br>918,516   |     | トランコム                  | 千株<br>10.3  | 千株<br>11.1  | 千円<br>29,903    |     |
| パラマウントベッドホールディングス | 31.6      | 30.4      | 81,016       |     | 大阪瓦斯             | 千株<br>53.8    | 千円<br>63.3  | 千円<br>189,108   |     | 三菱倉庫                   | 千株<br>12.7  | 千株<br>13.6  | 千円<br>158,498   |     |
| トランザクション          | 10.5      | 9.6       | 23,654       |     | 東邦瓦斯             | 千株<br>8.2     | 千円<br>8.7   | 千円<br>19,992    |     | 三井倉庫ホールディングス           | 千株<br>37.5  | 千株<br>39.4  | 千円<br>99,169    |     |
| 靴美堂               | 3.5       | 1.8       | 1,398        |     | 広島ガス             | 千株<br>12.8    | 千円<br>15.3  | 千円<br>29,024    |     | 住友倉庫                   | 千株<br>5.5   | 千株<br>6.7   | 千円<br>20,937    |     |
| ニホンフラッシュ          | 12.9      | 13.7      | 13,110       |     | 静岡ガス             | 千株<br>31.2    | 千円<br>29.2  | 千円<br>29,784    |     | 滋賀倉庫                   | 千株<br>16.4  | 千株<br>17    | 千円<br>2,669     |     |
| 前田工織              | 11.6      | 12.4      | 38,750       |     | マツオワーター          | 千株<br>17      | 千円<br>17.5  | 千円<br>37,275    |     | 東洋倉庫                   | 千株<br>27.6  | 千株<br>29.4  | 千円<br>18,610    |     |
| 永大産業              | 13        | 7.5       | 1,770        |     | 陸運業 (2.7%)       | 千株<br>12.2    | 千円<br>13    | 千円<br>32,162    |     | 日本トランシスティ              | 千株<br>2.2   | 千株<br>1.1   | 千円<br>2,125     |     |
| アートネイチャー          | 14.1      | 13.2      | 10,520       |     | S B Sホールディングス    | 千株<br>150     | 千円<br>160.6 | 千円<br>628,749   |     | ケイヒン                   | 千株<br>6.7   | 千株<br>7.8   | 千円<br>9,063     |     |
| フリヤ金属             | —         | 3.5       | 32,690       |     | 相鉄ホールディングス       | 千株<br>45.1    | 千円<br>52.3  | 千円<br>148,139   |     | 中央倉庫                   | 千株<br>2.1   | 千株<br>1.3   | 千円<br>1,463     |     |
| パンダイナムコホールディングス   | 124.7     | 400.6     | 1,212,215    |     | 東急               | 千株<br>382.7   | 千円<br>410   | 千円<br>704,995   |     | 安田倉庫                   | 千株<br>9.5   | 千株<br>10    | 千円<br>12,110    |     |
| アイフィスジャパン         | 3.5       | 1.9       | 1,145        |     | 京浜急行電鉄           | 千株<br>154.8   | 千円<br>180.9 | 千円<br>234,265   |     | ファイズホールディングス           | 千株<br>2.3   | 千株<br>0.9   | 千円<br>1,191     |     |
| S H O E I         | 14.4      | 33.1      | 64,611       |     | 小田急電鉄            | 千株<br>206.9   | 千円<br>241.8 | 千円<br>533,289   |     | 東洋埠頭                   | 千株<br>3.5   | 千株<br>1.9   | 千円<br>2,644     |     |
| フランスペドホールディングス    | 16.8      | 19        | 26,448       |     | 京王電鉄             | 千株<br>72.2    | 千円<br>70.3  | 千円<br>294,416   |     | 上組                     | 千株<br>65.3  | 千株<br>67.4  | 千円<br>228,620   |     |
| パロットコボレーション       | 21.4      | 20.6      | 82,523       |     | 京成電鉄             | 千株<br>88      | 千円<br>94.3  | 千円<br>650,670   |     | サンリツ                   | 千株<br>2.8   | 千株<br>1.6   | 千円<br>1,259     |     |
| 萩原工業              | 9.1       | 9.8       | 14,592       |     | 富士急行             | 千株<br>16.8    | 千円<br>18    | 千円<br>78,570    |     | キムラユニティー               | 千株<br>5.9   | 千株<br>3.1   | 千円<br>5,031     |     |
| フジリルインターナショナル     | 27.7      | 29.6      | 51,504       |     | 東日本旅客鉄道          | 千株<br>231.6   | 千円<br>268.6 | 千円<br>2,417,400 |     | キューソーフローティングシステム       | 千株<br>7.3   | 千株<br>6.6   | 千円<br>6,039     |     |
| タカラトミー            | 62.9      | 66.6      | 158,474      |     | 西日本旅客鉄道          | 千株<br>174.3   | 千円<br>173.4 | 千円<br>1,112,361 |     | 東海運                    | 千株<br>7.5   | 千株<br>3.8   | 千円<br>1,113     |     |
| 広済堂ホールディングス       | 8.2       | 37.6      | 27,786       |     | 東海旅客鉄道           | 千株<br>105.2   | 千円<br>156.3 | 千円<br>2,124,390 |     | エーアイティー                | 千株<br>8.6   | 千株<br>9.2   | 千円<br>17,056    |     |
| エヌティールホールディングス    | 2.9       | 1.7       | 1,113        |     | 西武ホールディングス       | 千株<br>165.1   | 千円<br>176.9 | 千円<br>375,028   |     | 内外トランスライン              | 千株<br>5     | 千株<br>5.8   | 千円<br>14,018    |     |
| タカノ               | 4.6       | 2.4       | 2,412        |     | 鴻池運輸             | 千株<br>23.3    | 千円<br>24.9  | 千円<br>47,484    |     | 日本コンセプト                | 千株<br>4.2   | 千株<br>5.3   | 千円<br>9,306     |     |
| プロネクサス            | 11.4      | 15.2      | 19,319       |     | 西日本鉄道            | 千株<br>36.4    | 千円<br>39.1  | 千円<br>96,264    |     | 情報・通信業 (7.6%)          | 千株<br>45.7  | 千株<br>57.2  | 千円<br>133,218   |     |
| ホクシン              | 9.4       | 4.8       | 552          |     | ハマキョウレックス        | 千株<br>10.7    | 千円<br>12.5  | 千円<br>50,187    |     | NECネットエスアイ             | 千株<br>—     | 千株<br>—     | 千円<br>—         |     |
| ウッドワン             | 4         | 2.4       | 2,464        |     |                  |               |             |                 |     |                        |             |             |                 |     |
| 大建工業              | 8.3       | —         | —            |     |                  |               |             |                 |     |                        |             |             |                 |     |
| TOPPANホールディングス    | 178.5     | 179.7     | 708,018      |     |                  |               |             |                 |     |                        |             |             |                 |     |
| 大日本印刷             | 162       | 159.8     | 668,763      |     |                  |               |             |                 |     |                        |             |             |                 |     |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期期末  |         |                        | 銘柄          | 期首(前期末) | 当期期末      |       |                           | 銘柄            | 期首(前期末) | 当期期末      |        |     |
|----------------------|---------|-------|---------|------------------------|-------------|---------|-----------|-------|---------------------------|---------------|---------|-----------|--------|-----|
|                      |         | 株数    | 株数      | 評価額                    |             |         | 株数        | 株数    | 評価額                       |               |         | 株数        | 株数     | 評価額 |
| クロスキャット              |         | 千株    | 千株      | 千円                     | アドソル日進      | 千株      | 千株        | 千円    |                           | F I G         | 千株      | 千株        | 千円     |     |
| システム                 | 230.2   | 7.8   | 9.3     | 10,918                 | ODKソリューションズ | 5.8     | 6.2       | 9,901 |                           | システムサポート      | 14.1    | 7.6       | 2,287  |     |
| デジタルアーツ              |         | 221.9 | 8.7     | 63,907                 | フリービット      | 2.7     | 1.3       | 782   |                           | アルテリア・ネットワークス | 5.3     | 5.7       | 10,847 |     |
| 日鉄ソリューションズ           | 23.4    | 9.3   | 9.3     | 39,246                 | コムチュア       | 7.1     | 6.4       | 9,158 |                           | 東海ソフト         | 8.8     | 10.6      | 6,190  |     |
| キューブシステム             |         | 25    | 7.8     | 8,884                  | サイバーコム      | 2       | —         | —     |                           | ウイングアーク1st    | 12.7    | —         | —      |     |
| コア                   | 5.9     | 6.5   | 6.5     | 11,648                 | アステリア       | 10.7    | 11.5      | 7,233 |                           | L i n k - U   | 1.9     | 1.1       | 1,283  |     |
| 手間いらず                | 2.3     | 2.5   | 6,695   | アイル                    | 7.6         | 6.8     | 21,964    |       | ヒューミュニケーションズ・ホールディングス     | 3.7           | 3.9     | 4,539     |        |     |
| ラクーンホールディングス         | 11.4    | 10.9  | 7,542   | マークラインズ                | 7.4         | 7.9     | 23,700    |       | サーバーワークス                  | 2.8           | 3       | 12,120    |        |     |
| ソリントンシステムズ           | 7       | 7.6   | 10,716  | メデカル・データ・ビジョン          | 20.4        | 17.5    | 11,095    |       | 東名                        | 0.9           | 0.5     | 1,140     |        |     |
| ソフトウェアホールディングス       | 5.7     | 12.1  | 21,634  | g u m i                | 21.1        | 23.8    | 9,496     |       | ヴィツツ                      | 1.2           | 0.6     | 493       |        |     |
| T I S                | 153.9   | 160.4 | 546,803 | ショーケース                 | 3           | 1.5     | 499       |       | トビラシステムズ                  | 3.1           | 1.9     | 1,654     |        |     |
| テスマホールディングス          | 5.6     | 3     | 1,422   | モバイルファクトリー             | 2.6         | 1.4     | 1,016     |       | S a n s a n               | 44.7          | 48.1    | 67,772    |        |     |
| グリー                  | 36.7    | 49.1  | 28,428  | テラスライ                  | 5.9         | 6.3     | 9,620     |       | L i n k - U               | 2.3           | 1.6     | 1,014     |        |     |
| GMOペパボ               | 2       | 1.8   | 2,149   | デジタル・ライフマーケティング・テクノロジー | 7.9         | 7.6     | 13,512    |       | ギフティ                      | 14.9          | 12.9    | 19,866    |        |     |
| コエフテクホールディングス        | 85.8    | 91.9  | 165,098 | P C I ホールディングス         | 5.1         | 2.4     | 2,433     |       | メドレー                      | 13.7          | 19.7    | 90,915    |        |     |
| 三菱総合研究所              | 6.7     | 7.2   | 35,352  | アイビーシー                 | 1.9         | 1       | 468       |       | ベース                       | 4.6           | 5.1     | 16,294    |        |     |
| ボルテージ                | 3.6     | 1.8   | 487     | ネオジャパン                 | 4.5         | 4.9     | 5,169     |       | J M D C                   | 22.5          | 25      | 91,900    |        |     |
| 電算                   | 0.8     | 0.8   | 1,197   | P R T I M E S          | 3.4         | 2.9     | 6,223     |       | フォーカスシステムズ                | 10            | 9.8     | 10,280    |        |     |
| A G S                | 5.3     | 2.7   | 2,459   | ラクス                    | 64.7        | 69.4    | 165,484   |       | クレスコ                      | 10.5          | 12      | 23,604    |        |     |
| ファインデックス             | 10.7    | 11.6  | 11,774  | ランドコンピュータ              | 3           | 3.1     | 2,749     |       | フジ・メディア・ホールディングス          | 131.4         | 140.9   | 276,938   |        |     |
| ブレインパッド              | 10.2    | 12.2  | 15,396  | ダブルスタンダード              | 5.6         | 4.5     | 7,389     |       | オーピック                     | 45.7          | 49      | 1,099,315 |        |     |
| K L a b              | 27.2    | 26.9  | 9,657   | オープンドア                 | 9.6         | 8.5     | 8,007     |       | ジャストシステム                  | 19.7          | 21.1    | 62,329    |        |     |
| ポートワインホールディングス       | 23.4    | 25    | 12,125  | マイネット                  | 4           | 2.1     | 583       |       | T D C ソフト                 | 11.6          | 13.7    | 29,085    |        |     |
| ネクソン                 | 354     | 328.2 | 948,662 | アカツキ                   | 6.5         | 7       | 17,528    |       | L I N E ヤフー               | 1,948.4       | 2,087.7 | 904,600   |        |     |
| アイスタイル               | 39.8    | 47.8  | 19,550  | ベネフィットジャパン             | 0.8         | 0.4     | 498       |       | トレンドマイクロ                  | 79            | 69.3    | 572,279   |        |     |
| エムアップホールディングス        | 16.7    | 18    | 17,964  | U b i c o m ホールディングス   | 4.2         | 4.6     | 7,369     |       | I D ホールディングス              | 9.3           | 9.9     | 16,780    |        |     |
| エイチーム                | 9.9     | 8.7   | 4,863   | カナミックソフトワーク            | 19.7        | 15.8    | 6,699     |       | 日本オラクル                    | 26.2          | 28.1    | 316,827   |        |     |
| エニグモ                 | 17.4    | 18.6  | 6,510   | ノムラシステムコ-ボレーション        | 11.7        | 7.1     | 809       |       | アルファシステムズ                 | 4.3           | 3.9     | 12,246    |        |     |
| テクノスジャパン             | 10      | 5.8   | 3,700   | チエンジボルディングス            | 33.5        | 31.9    | 43,830    |       | フューチャー                    | 34.1          | 31.3    | 53,303    |        |     |
| e n i s h            | 9.2     | 6.6   | 1,214   | シンクロ・フード               | 7.6         | 4.1     | 2,681     |       | C A C Holdings            | 8.6           | 7.9     | 14,180    |        |     |
| コロプラ                 | 53.2    | 56.9  | 35,676  | オーネット                  | 6.7         | 5.4     | 11,485    |       | S B テクノロジー                | 5.8           | 6.2     | 13,615    |        |     |
| オルトプラス               | 9.2     | 5.8   | 881     | キャビル・セプト・プランニング        | 2.4         | 1.3     | 978       |       | トーセ                       | 3.2           | 1.9     | 1,345     |        |     |
| プロドリーフ               | 79.9    | 69.6  | 43,708  | セグエグブループ               | 3.3         | 2.1     | 1,936     |       | オーピックビジネスコンサルタント          | 26.9          | 20.6    | 145,477   |        |     |
| ワス・マーティングループ         | 7.3     | 3.1   | 1,779   | エイトレット                 | 1.9         | 1       | 1,416     |       | 伊藤忠テクノソリューションズ            | 73.5          | —       | —         |        |     |
| デジタルハーベストホールディングス    | 8.6     | 9.1   | 9,500   | マクロミル                  | 26.8        | 28.8    | 22,320    |       | アイテイフオ                    | 18.2          | 18.8    | 22,729    |        |     |
| システム情報               | 12.1    | —     | —       | ビーグリー                  | 2.1         | 1.4     | 1,785     |       | 東計電算                      | 2             | 4.1     | 15,088    |        |     |
| メディアアドワ              | 5.5     | 6.6   | 8,210   | オロ                     | 4.1         | 5.3     | 15,184    |       | エックスネット                   | 1.8           | 1       | 1,105     |        |     |
| じげん                  | 39.9    | 42.8  | 22,256  | ユーモーラーカル               | 5           | 6.2     | 12,920    |       | 大塚商会                      | 77.6          | 72.7    | 434,964   |        |     |
| ブイキューブ               | 16.4    | 17.5  | 5,285   | テモナ                    | 2.3         | 1.5     | 384       |       | サイボウズ                     | 18.9          | 20.2    | 45,510    |        |     |
| エンカレッジ・テクノロジ         | 2.9     | 1.5   | 958     | ニーズウェル                 | 3.7         | 3.6     | 2,862     |       | 電通総研                      | 16.6          | 17.8    | 96,654    |        |     |
| サイバーリンクス             | 3.9     | 2.5   | 2,022   | マネーフォワード               | 32.9        | 32.7    | 187,567   |       | A C C E S S               | 16.2          | 15.2    | 12,768    |        |     |
| ディー・エル・イー            | 8.8     | 4.6   | 846     | サインポスト                 | 4.7         | 2.5     | 1,280     |       | デジタルガレージ                  | 24.3          | 23.4    | 82,251    |        |     |
| フィックススターズ            | 15.5    | 16.5  | 26,383  | SUN A S T E R I S K    | 7.2         | 10.4    | 9,994     |       | イーエムシステムズ                 | 22.8          | 24.5    | 16,709    |        |     |
| CARTA HOLDINGS       | 6.4     | 6.9   | 10,736  | ガスブルク・コサティング           | —           | 8.7     | 21,228    |       | ウェザーニューズ                  | 4.2           | 4.5     | 22,995    |        |     |
| オプティム                | 11.2    | 15.1  | 13,816  | 電算システムホールディングス         | 6.6         | 6.5     | 19,220    |       | C I J                     | 11.4          | 24.4    | 16,714    |        |     |
| セレス                  | 5.5     | 5.9   | 7,351   | APPIER GROUP           | 38.9        | 50.1    | 85,671    |       | ビジネスエンジニアリング              | 2.6           | 2.8     | 12,474    |        |     |
| S H I F T            | 10      | 9.7   | 266,604 | ビジュナル                  | —           | 11.2    | 102,816   |       | 日本エンターブライズ                | 12.4          | 6.6     | 818       |        |     |
| ティーガイア               | 14.3    | 15.4  | 31,339  | ソルクシーズ                 | 10.2        | 5.3     | 2,141     |       | WOWOW                     | 7.6           | 11      | 12,760    |        |     |
| セック                  | 1.7     | 1.8   | 9,180   | フェイス                   | 3.4         | 1.8     | 874       |       | スカラ                       | 12.7          | 13.5    | 10,260    |        |     |
| テクマトリックス             | 25      | 26.8  | 50,946  | プロトコ-ボレーション            | 17.1        | 16.1    | 21,960    |       | インテリジェント ウェイブ             | 6.5           | 3.5     | 3,934     |        |     |
| プロシップ                | 6       | 7.1   | 9,989   | ハイマックス                 | 4.3         | 4.5     | 6,309     |       | A N Y C O L O R           | —             | 15.5    | 52,390    |        |     |
| ガーネットオンライン・エンターテイメント | 41.9    | 38.2  | 94,984  | 野村総合研究所                | 280.9       | 324.9   | 1,374,327 |       | W O W W O R L D G R O U P | 2.2           | —       | —         |        |     |
| GMOペイメントゲートウェイ       | 31.3    | 29.3  | 258,250 | サイバネットシステム             | 11.5        | —       | —         |       | I M A G I C A G R O U P   | 11.2          | 14.7    | 10,216    |        |     |
| ザッパラス                | 3.4     | 1.5   | 649     | C E ホールディングス           | 6.2         | 3.4     | 2,067     |       | ネットワンシステムズ                | 51            | 59.2    | 160,106   |        |     |
| システムリサーチ             | 4.2     | 5     | 17,125  | 日本システム技術               | 5.1         | 5.4     | 17,577    |       | システムソフト                   | 46.4          | 50.8    | 2,946     |        |     |
| インターネットシステム          | 76.4    | 70.1  | 198,207 | インターボールディングス           | 15.5        | 16.6    | 28,552    |       | アルゴグラフィックス                | 12.6          | 13.5    | 56,025    |        |     |
| さくらインターネット           | 15.3    | 16.5  | 62,452  | 東邦システムサイエンス            | 3.5         | 5.5     | 6,897     |       | マーベラス                     | 22.3          | 23.8    | 17,635    |        |     |
| ヴィンクス                | 3.6     | —     | —       | ソースネクスト                | 69.6        | 67.1    | 9,662     |       | エイベックス                    | 23.2          | 25      | 35,225    |        |     |
| GMOプロフルカイ・ホールディングス   | 4.2     | 4.5   | 12,370  | インフォコム                 | 17.6        | 18.9    | 41,598    |       | B I P R O G Y             | 50.4          | 48      | 215,760   |        |     |
| S R A ホールディングス       | 7       | 7.5   | 29,100  | シングルク・ホールディングス         | 23          | 22.1    | 55,581    |       | 株式会社エレクトロニクス              | 8.5           | —       | —         |        |     |
| システムインテグレータ          | 3.7     | 2     | 868     | H E R O Z              | 4.5         | 5.8     | 8,094     |       | 都築電気                      | 7.2           | 7.7     | 18,641    |        |     |
| 朝日ネット                | 14.8    | 15.8  | 9,938   | ラクスル                   | 38.7        | 35.3    | 37,523    |       | T B S ホールディングス            | 70.2          | 73.7    | 297,748   |        |     |
| e B A S E            | 19.3    | 20.7  | 14,717  | メルカリ                   | 61.8        | 71.4    | 174,037   |       | 日本テレビホールディングス             | 121.3         | 129.8   | 290,946   |        |     |
| アバントグループ             | 17.3    | 18.5  | 25,326  | I P S                  | 4.4         | 4.2     | 8,513     |       | 朝日放送グループホールディングス          | 13            | 13.7    | 9,617     |        |     |

| 銘柄                   | 期首(前期末)    |            |  | 当期末                |           |           | 銘柄      | 期首(前期末) |            |          | 当期末          |          |       | 銘柄    | 期首(前期末)   |          |       | 当期末     |           |     |
|----------------------|------------|------------|--|--------------------|-----------|-----------|---------|---------|------------|----------|--------------|----------|-------|-------|-----------|----------|-------|---------|-----------|-----|
|                      | 株数         | 株数         | 評価額  | 株数                 | 株数        | 評価額       |         | 株数      | 株数         | 評価額      | 株数           | 株数       | 評価額   |       | 株数        | 株数       | 評価額   | 株数      | 株数        | 評価額 |
| テレビ朝日本ホールディングス       | 千株<br>33.3 | 千株<br>35.6 | 千円<br>78,498   | ハイパー               | 千株<br>2.5 | 千円<br>1.6 | 481     | シーケス    | 千株<br>20.5 | 千株<br>22 | 千円<br>34,342 | 田中商事     | 3.9   | 1.9   | 1,575     | オーハシテクニカ | 7.2   | 8.1     | 15,106    |     |
| スカパーJSATホールディングス     | 121.3      | 113.9      | 94,878   | あいホールディングス         | 23.1      | 24.8      | 61,032  | 白銅      | 5.3        | 4.5      | 11,092       | ダイコー通産   | 1.4   | 0.7   | 845       | 伊藤忠商事    | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| テレビ東京ホールディングス        | 9.8        | 10.6       | 35,139   | ディープエックス           | 3.5       | 1.9       | 2,036   | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| 日本BS放送               | 4.4        | 2.4        | 2,186  | ダイワボウホールディングス      | 59        | 68.5      | 215,364 | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| ビジョン                 | 18.1       | 22.1       | 25,061   | マクニカホールディングス       | 35.4      | 36.6      | 295,179 | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| スマートバリュー             | 3          | 1.9        | 750  | ラクト・ジャパン           | 5.7       | 6         | 13,512  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| USEN-NEXT HOLDINGS   | 12.3       | 16.4       | 68,634   | グリムス               | 6         | 6.5       | 13,351  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| ワイアレスゲート             | 5.5        | 2.8        | 800  | パルターエースター・ホールディングス | 21.1      | 23.4      | 27,963  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| コネクシオ                | 8.9        | -          | -  | 八洲電機               | 11.8      | 12.5      | 16,175  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| 日本通信                 | 126.2      | 144.3      | 34,199   | メディアホールディングス       | 9.2       | 9         | 6,705   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| クロップス                | 2.1        | 0.9        | 918  | レスター・ホールディングス      | 13.8      | 13.2      | 39,930  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| 日本電信電話               | 1,754.4    | 43,620.3   | 7,999,963  | ジオリーブグループ          | 2.7       | 1.6       | 2,134   | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| KDDI                 | 1,058      | 1,133.2    | 5,211,586  | 大光                 | 5.2       | 3.6       | 2,300   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| ソフトバンク               | 2,199.3    | 2,360      | 4,589,020  | OCHIホールディングス       | 2.9       | 1.6       | 2,560   | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| 光通信                  | 16.1       | 14.8       | 385,170  | TOKAIホールディングス      | 71.3      | 84        | 84,420  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| エムティーアイ              | 12.5       | 10.1       | 6,201  | 黒谷                 | 3.7       | 2.2       | 1,344   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| GMOインターネットグループ       | 50.9       | 54.2       | 141,733  | Cominix            | 2.4       | 1.4       | 1,188   | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| ファイバーゲート             | 7.3        | 7.9        | 7,394  | 三洋貿易               | 14.9      | 17.5      | 22,505  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| アドマーマテイクンコミュニケーションズ  | 3.1        | 1.8        | 423  | ビューティガレージ          | 2.3       | 4.9       | 10,520  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| KADOKAWA             | 72.3       | 77.5       | 250,945  | ウイン・パートナーズ         | 10.5      | 10.1      | 12,726  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| 学研ホールディングス           | 22.8       | 24.4       | 24,644   | ミタチ産業              | 3.3       | 1.9       | 2,133   | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| ゼンリン                 | 23.3       | 25.1       | 21,433   | シップルスアホールディングス     | 51.9      | 55.6      | 123,320 | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| 昭文社ホールディングス          | 5.6        | 2.9        | 1,078  | 明治電機工業             | 5.5       | 5.8       | 8,479   | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| インプレスホールディングス        | 10.8       | 6.6        | 1,168  | デカワーズホールディングス      | 5.2       | 3         | 1,782   | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| アイネット                | 8.4        | 8.9        | 17,132   | スタート・ホールディングス      | 2.5       | 1.8       | 2,842   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| 松竹                   | 7.8        | 7.6        | 77,558   | コメダホールディングス        | 35.3      | 37.9      | 104,869 | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| 東宝                   | 85.7       | 81.6       | 386,294  | ビーバンドットコム          | 1.7       | 0.9       | 363     | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| 東映                   | 3.8        | 4.8        | 96,624   | アセンテック             | 4.7       | 5.9       | 3,363   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| NTTデータグループ           | 429.6      | 383.4      | 800,730  | 富士興産               | 2.9       | 1.9       | 4,145   | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| ピー・シー・エー             | 7.8        | 8.4        | 13,255   | 協栄産業               | 1.1       | 0.7       | 2,093   | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| ビジネスプレイン太田昭和         | 5.9        | 5.7        | 12,768   | フジタ・マカホールディングス     | 14.3      | 13.8      | 34,099  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| DTS                  | 29.1       | 30.9       | 112,630  | ヤマエグループホールディングス    | 8.2       | 8.7       | 27,013  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 68.8       | 67         | 416,606  | 小野建                | 13.4      | 15.4      | 28,490  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| シーアーシー               | 19.2       | 18.5       | 30,691   | 佐鳥電機               | 2.5       | 1.4       | 3,102   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| カブコン                 | 136        | 131.1      | 738,617  | エコートレーディング         | 2.5       | 1.3       | 1,602   | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| アイ・エス・ピー             | 7          | 7.5        | 11,790   | 伯東                 | 8.3       | 8.9       | 51,798  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| ジャステック               | 8.4        | 9          | 11,934   | コンドーテック            | 11.1      | 11.9      | 14,399  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| S C S K              | 111.7      | 102.6      | 272,043  | 中山福                | 6.6       | 3.9       | 1,407   | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| N S W                | 5.4        | 6.3        | 18,685   | ナガフレーベン            | 18.2      | 19.6      | 45,942  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| アイネス                 | 9.5        | 11.4       | 16,917   | 三菱食品               | 13.4      | 14.3      | 72,644  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| T K C                | 24.6       | 23.3       | 88,307   | 松田産業               | 10.9      | 11.8      | 31,222  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| 富士ソフト                | 15.5       | 29.5       | 188,800  | 第一興商               | 27.9      | 59.9      | 120,279 | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| N S D                | 48.8       | 52.3       | 140,373  | メドバルホールディングス       | 149.7     | 157.3     | 373,194 | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| コナミグループ              | 58.6       | 54.9       | 507,111  | S P K              | 6.4       | 6.9       | 13,882  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| 番内ピューターホールディングス      | 9.5        | 9.1        | 23,241   | 萩原電気ホールディングス       | 5.5       | 6.6       | 33,990  | 丸紅      | 1,140.3    | 1,289.8  | 3,077,462    | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| J B C C ホールディングス     | 9.9        | 9.7        | 38,121   | アズワン               | 21.2      | 24.2      | 133,027 | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高橋通商     | 126.5 | 135.5 | 1,260,150 | 白鶴       | 5.3   | 4.5     | 11,092    |     |
| ミクロク情報サービス           | 12.5       | 13.3       | 25,961   | ズデン                | 5.1       | 5.4       | 12,123  | 三共生興    | 20.7       | 21.5     | 16,748       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | ダイコー通産   | 890.1 | 1,039.9 | 7,004,766 |     |
| ソフトバンクグループ           | 791.6      | 723.4      | 4,787,461  | 尾家産業               | 3.1       | 1.6       | 2,945   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 高島       | 2.1   | 4.7   | 6,363     | 長瀬産業     | 67.9  | 70.9    | 170,620   |     |
| <b>卸売業(7.3%)</b>     |            |            | 高干穂交易<br>オハシリスアホールディングス<br>伊藤忠食品<br>エレマテック<br>あらた<br>トーメンデバイス<br>東京エレクトロン デバイス<br>飛行フィールズホールディングス<br>双日<br>アルフレッサ ホールディングス<br>横浜冷凍 | シモジマ               | 9.9       | 10.4      | 13,478  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | シーケス     | 20.5  | 22    | 34,342    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | ドウシシャ              | 15.3      | 14.3      | 30,358  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 田中商事     | 3.9   | 1.9   | 1,575     | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | 小津産業               | 2.9       | 1.5       | 2,479   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | オーハシテクニカ | 7.2   | 8.1   | 15,106    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | 高速                 | 7.5       | 9.2       | 21,675  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 白銅       | 5.3   | 4.5   | 11,092    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | たけびし               | 5.6       | 5.9       | 11,859  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | リックス               | 2.7       | 2.6       | 9,282   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | シーケス     | 20.5  | 22    | 34,342    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | 丸文                 | 12.9      | 13.8      | 21,307  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 田中商事     | 3.9   | 1.9   | 1,575     | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | ハピネット              | 12.3      | 13.2      | 37,501  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | オーハシテクニカ | 7.2   | 8.1   | 15,106    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | 橋本総業ホールディングス       | 5.8       | 6.1       | 7,917   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 白銅       | 5.3   | 4.5   | 11,092    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  | 日本ライフライン           | 42.3      | 45.4      | 59,519  | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | 伊藤忠商事    | 1.4   | 0.7   | 845       | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            | 日本ライフライン<br>タカショ一<br>進和<br>IDOM<br>エスケイジャパン<br>ダイトロン   | タカショ一              | 12.5      | 13.5      | 6,709   | 蝶理      | 7.8        | 9.7      | 28,624       | シーケス     | 20.5  | 22    | 34,342    | 高島       | 2.1   | 4.7     | 6,363     |     |
|                      |            |            |  |                    |           |           |         |         |            |          |              |          |       |       |           |          |       |         |           |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末)    | 当期末        |              |                                     | 銘柄                 | 期首(前期末)     | 当期末           |   |              | 銘柄         | 期首(前期末)      | 当期末   |    |     |
|--------------------|------------|------------|--------------|-------------------------------------|--------------------|-------------|---------------|---|--------------|------------|--------------|-------|----|-----|
|                    |            | 株数         | 株数           | 評価額                                 |                    |             | 株数            | 株数  | 評価額          |            |              | 株数    | 株数 | 評価額 |
| 立花エレテック            | 千株<br>10.5 | 千株<br>10.3 | 千円<br>32,136 | Mon ota R O                         | 千株<br>204.7        | 千株<br>219.3 | 千円<br>302,962 | アドヴァングループ                                 | 千株<br>13.8   | 千株<br>14.7 | 千円<br>15,611 |       |    |     |
| フォーバル              | 5.5        | 6.1        | 8,430        | 東京一番フーズ                             | 3.1                | 1.7         | 904           | アルビス                                      | 4.7          | 5          | 13,345       |       |    |     |
| P A L T A C        | 22.7       | 20.9       | 91,667       | D D グループ                            | 8.3                | 4.4         | 6,688         | コナカ                                       | 14           | 7.4        | 3,145        |       |    |     |
| 三谷産業               | 25.3       | 27         | 10,449       | きちりホールディングス                         | 3.1                | 1.8         | 1,848         | ハウス オーブ ロゼ                                | 1.7          | 0.9        | 1,457        |       |    |     |
| 太平洋興発              | 4.4        | 2.5        | 2,085        | アーカンサスホールディングス                      | 11.8               | —           | —             | G-7ホールディングス                               | 18           | 16.9       | 23,474       |       |    |     |
| 西日本ホールディングス        | 3.6        | 3.9        | 24,921       | J.フロント リテイリング                       | 179.5              | 177.5       | 266,871       | イオン北海道                                    | 21.4         | 45.7       | 42,546       |       |    |     |
| ヤシマハスホールディングス      | 1          | 0.6        | 1,345        | ドトール 日本ホールディングス                     | 25.6               | 27.4        | 58,882        | コジマ                                       | 28           | 25.6       | 18,790       |       |    |     |
| コーナ商事ホールディングス      | 8.2        | 10.9       | 8,120        | マツキヨココカラ&カンパニー                      | 87.6               | 281.4       | 781,588       | ヒマラヤ                                      | 4.1          | 2.2        | 2,057        |       |    |     |
| K P P グループホールディングス | 33.6       | 40         | 28,720       | プロンコピリー                             | 7.6                | 9.1         | 30,348        | コーナ商事                                     | 19.5         | 19         | 75,240       |       |    |     |
| ヤマタネ               | 6.4        | 6.8        | 16,694       | Z O Z O                             | 95.5               | 98.6        | 331,986       | エコス                                       | 5.4          | 5.7        | 14,335       |       |    |     |
| 丸紅建材リース            | 0.8        | 0.5        | 1,429        | トレジャー・ファクトリー                        | 3.9                | 8.5         | 12,316        | ワタミ                                       | 17.4         | 16.4       | 16,613       |       |    |     |
| 日鉄物産               | 9.9        | —          | —            | 物語コーポレーション                          | 8                  | 25.8        | 136,224       | マルシェ                                      | 4            | 2.5        | 607          |       |    |     |
| 泉州電業               | 7.2        | 7.2        | 27,252       | 三越伊勢丹ホールディングス                       | 243.1              | 260.5       | 509,928       | カバノフ・イタチ・カヨカホールディングス                      | 291.5        | 312.4      | 1,032,482    |       |    |     |
| トラスコ中山             | 30.3       | 32.5       | 79,040       | H a m e e                           | 5                  | 6.2         | 6,776         | 西松屋 チーン                                   | 32           | 30.4       | 64,873       |       |    |     |
| オートパックスセブン         | 50.2       | 53.9       | 87,587       | マーケットエンターパライズ                       | 1.3                | 0.6         | 616           | ゼンショーホールディングス                             | 79           | 78.8       | 580,046      |       |    |     |
| モリト                | 10.4       | 11.1       | 15,717       | ウエルシアホールディングス                       | 74.9               | 80.2        | 210,244       | 幸楽苑ホールディングス                               | 9.5          | 11.4       | 14,979       |       |    |     |
| 加藤産業               | 17.5       | 19.2       | 89,376       | クリエイソードホールディングス                     | 23.8               | 21.9        | 70,737        | ハーベスレイ                                    | 4.5          | 2.4        | 2,179        |       |    |     |
| 北恵                 | 2.9        | 1.7        | 1,463        | 丸善CHIホールディングス                       | 15.4               | 8.3         | 2,705         | サイゼリヤ                                     | 24           | 22.9       | 111,866      |       |    |     |
| イエローハット            | 25.5       | 24.6       | 46,321       | ミサワ                                 | 2.4                | 1.5         | 928           | V T ホールディングス                              | 54.8         | 58.8       | 31,281       |       |    |     |
| J K ホールディングス       | 11.4       | 11.9       | 12,316       | ティーライフ                              | 1.7                | 0.9         | 1,268         | 魚力  | 4.5          | 5.4        | 13,046       |       |    |     |
| 日伝                 | 8.6        | 10.5       | 28,602       | エー・ピー・ホールディングス                      | 1.9                | 1.7         | 1,654         | ボーラ                                       | 3.2          | 1.8        | 439          |       |    |     |
| 北沢産業               | 7.1        | 4.2        | 1,302        | ムニム                                 | 4                  | 2.1         | 3,059         | フジ・コーポレーション                               | 8.2          | 7.4        | 13,090       |       |    |     |
| 杉本商事               | 6.2        | 7.3        | 16,439       | シュッピン                               | 10.7               | 14          | 14,182        | ユナイテッドアローズ                                | 15.4         | 18.2       | 35,672       |       |    |     |
| 因幡電機産業             | 37.4       | 40.1       | 140,350      | オイシック・ラ・大地                          | 19.4               | 20.8        | 28,579        | ハイディ日高                                    | 21.4         | 22.9       | 65,494       |       |    |     |
| 東テク                | 4.9        | 5.1        | 33,507       | ネクステージ                              | 32.9               | 35.3        | 84,296        | Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S | 7.1          | 3.7        | 536          |       |    |     |
| ミスマグリープ本社          | 217.9      | 233.6      | 542,302      | ジョイフル本田                             | 42.8               | 45          | 87,390        | コロワイド                                     | 66.6         | 66.5       | 154,047      |       |    |     |
| アルテック              | 7.1        | 3.7        | 925          | 鳥貴族ホールディングス                         | 5.4                | 5.7         | 21,004        | ビーシードコボレーション                              | 15.7         | —          | —            |       |    |     |
| タキヒヨー              | 3.1        | 1.6        | 1,929        | ホットランド                              | 11                 | 11.8        | 23,847        | 壱番屋                                       | 11.5         | 12.2       | 76,738       |       |    |     |
| 蔵王産業               | 2.2        | 1.2        | 3,084        | すからくらホールディングス                       | 197.4              | 211.4       | 501,652       | トップカルチャーヤ                                 | 4.2          | 2.2        | 345          |       |    |     |
| ズスケン               | 44.9       | 58.9       | 271,941      | S F P ホールディングス                      | 7.9                | 8.5         | 18,062        | P L A N T                                 | 3.2          | 1.5        | 2,422        |       |    |     |
| ジェコス               | 9.4        | 9.3        | 11,085       | 綿半ホールディングス                          | 11.4               | 12          | 17,760        | スギホールディングス                                | 29.1         | 31.2       | 217,807      |       |    |     |
| グローセル              | 15.4       | 18.1       | 13,538       | ショックスホールディングス                       | 2.6                | 3.2         | 9,478         | 葉王堂ホールディングス                               | 8            | 7.6        | 19,486       |       |    |     |
| <b>小売業(4.2%)</b>   |            |            |              |                                     | コマイデ・スマート・ホールディングス | 47.2        | 43.1          | 43,143                                    | ヴィア・ホールディングス | 17.9       | 10.2         | 1,560 |    |     |
| ローソン               | 35.8       | 32.9       | 337,883      | ゴフダイジェスト・オンライン                      | 6.5                | 7           | 4,340         | スクワール                                     | 21.5         | 23         | 22,264       |       |    |     |
| サンエー               | 11         | 11.8       | 54,044       | B E E N O S                         | 8.2                | 6.3         | 9,097         | ヨンドシホールディングス                              | 12.4         | 14.6       | 28,776       |       |    |     |
| カワチ薬品              | 11.4       | 12.1       | 32,827       | あさひ                                 | 12.1               | 14.3        | 18,661        | 木曾路                                       | 21.9         | 23.4       | 61,167       |       |    |     |
| エービーシー・マート         | 21.1       | 67.7       | 176,561      | 日本調剤                                | 9.9                | 10.5        | 15,330        | S R S ホールディングス                            | 23.8         | 25.5       | 29,860       |       |    |     |
| ハードオフコーポレーション      | 5.2        | 5.5        | 10,092       | コスモス薬品                              | 14.2               | 13.1        | 209,600       | 千趣会                                       | 27.1         | 28.4       | 7,838        |       |    |     |
| アスクル               | 29.8       | 37.3       | 73,854       | トエール                                | 5.8                | 3.1         | 2,458         | タカキュー                                     | 9.2          | —          | —            |       |    |     |
| ゲオホールディングス         | 15.2       | 17.4       | 41,394       | セブン&ア・ホールディングス                      | 497.8              | 533.1       | 3,238,049     | リテールパートナーズ                                | 21.5         | 23         | 39,951       |       |    |     |
| アダストリア             | 17.4       | 18.7       | 67,600       | クリエイト・スマート・ホールディングス                 | 108.7              | 104.7       | 114,332       | ケーヨー                                      | 23.4         | —          | —            |       |    |     |
| ジーフット              | 6.8        | 5.7        | 1,692        | ツルハホールディングス                         | 30.3               | 32.5        | 357,662       | 上新電機                                      | 12.9         | 15.3       | 36,352       |       |    |     |
| シーヴィ・エス・ペイエリア      | 1.7        | 0.9        | 686          | サンマルクホールディングス                       | 11.7               | 12.5        | 28,000        | 日本瓦斯                                      | 77.4         | 82         | 195,693      |       |    |     |
| くら寿司               | 16.9       | 18.1       | 71,314       | フェリシモ                               | 2.9                | 1.5         | 1,375         | ロイヤルホールディングス                              | 28           | 27.3       | 69,560       |       |    |     |
| キャンドゥ              | 5.2        | 5.5        | 14,778       | トリドールホールディングス                       | 35.9               | 43.4        | 195,213       | 東天紅                                       | 0.6          | 0.5        | 421          |       |    |     |
| I K ホールディングス       | 4          | 2.3        | 878          | TOKYO - B A S E                     | 14.8               | 18.5        | 5,716         | いなげや                                      | 14.1         | 15         | 19,110       |       |    |     |
| パルフルホールディングス       | 14.1       | 30.4       | 69,403       | ワルフ・ラ・ス・ホールディングス                    | 2.1                | 1.4         | 1,440         | チヨダ                                       | 13.8         | 14.8       | 13,246       |       |    |     |
| エディオン              | 57.2       | 61.2       | 94,186       | J M ホールディングス                        | 12.3               | 11.7        | 27,565        | ライフコーポレーション                               | 12.6         | 16.2       | 60,993       |       |    |     |
| サーラコーポレーション        | 30.3       | 32.5       | 26,097       | サンドラッグホールディングス                      | 5.8                | 2.8         | 2,251         | リンガーハット                                   | 18.6         | 20         | 48,060       |       |    |     |
| ワッツ                | 6.3        | 3.3        | 1,940        | アランザホールディングス                        | 10.8               | 11.6        | 13,502        | M r M a x H D                             | 20.4         | 19.5       | 12,285       |       |    |     |
| ハローズ               | 6.6        | 7          | 30,065       | 串かつ田中ホールディングス                       | 3.8                | 4.1         | 8,077         | テナラライド                                    | 13.7         | 9.1        | 2,884        |       |    |     |
| フジオフードグループ本社       | 12.1       | 17.4       | 25,021       | パロックジャパンリテッド                        | 9.4                | 12          | 9,828         | A O K I ホールディングス                          | 26.8         | 33.2       | 39,441       |       |    |     |
| あみやき亭              | 3.5        | 3.7        | 16,668       | クリスリのオキホールディングス                     | 12.9               | 46.6        | 146,277       | オーツワ                                      | 23           | 22.2       | 20,024       |       |    |     |
| ひらまつ               | 27.2       | 16.4       | 4,428        | 力の源ホールディングス                         | 7.4                | 7.9         | 11,502        | コメリ                                       | 22.3         | 23.8       | 77,588       |       |    |     |
| 大黒天物産              | 4.4        | 4.8        | 42,096       | F O O D & L I F E C O M P A N I E S | 83                 | 82.5        | 235,578       | 青山商事                                      | 30.9         | 33.1       | 60,275       |       |    |     |
| ハニーズホールディングス       | 11.4       | 13.7       | 23,235       | メイカルシステムネットワーク                      | 12.6               | 16.8        | 9,727         | しまむら                                      | 16.9         | 18.2       | 293,475      |       |    |     |
| フーマライズホールディングス     | 2.9        | 1.6        | 1,046        | 一家ホールディングス                          | 2.8                | 1.7         | 1,196         | はせがわ                                      | 6.2          | 3.3        | 1,191        |       |    |     |
| アルペン               | 11.9       | 12.7       | 25,501       | ジャパンクラフトホールディングス                    | 4                  | 4.9         | 823           | 高島屋                                       | 108.9        | 106.9      | 235,393      |       |    |     |
| ハブ                 | 4.1        | 2.2        | 1,610        | はるやまホールディングス                        | 5.3                | 3.3         | 1,966         | 松屋  | 24.5         | 26.2       | 25,361       |       |    |     |
| ワオルホールディングス        | 19.9       | 21.3       | 34,655       | ノジマ                                 | 47.2               | 44.9        | 72,199        | イチ・ツー・オー リテイリング                           | 70.3         | 68.5       | 124,533      |       |    |     |
| ジンズホールディングス        | 8.6        | 9.2        | 37,996       | カッパ・クリエイト                           | 22.8               | 24.3        | 41,917        | 近鉄百貨店                                     | 4.6          | 6.6        | 16,962       |       |    |     |
| ピックカメラ             | 96         | 82.3       | 110,693      | ライトオン                               | 9.7                | 5.2         | 2,168         | 丸井グループ                                    | 106.5        | 102.7      | 250,177      |       |    |     |
| DCMホールディングス        | 88.1       | 81.8       | 112,311      | 良品計画                                | 186.3              | 168.9       | 356,885       | アクシアル リテイリング                              | 9.9          | 10.6       | 41,605       |       |    |     |
| ペッパーフードサービス        | 30.2       | 35.8       | 3,329        | バリミキホールディングス                        | 16.5               | 8.6         | 4,222         | 井筒屋                                       | 6.1          | 3.2        | 1,139        |       |    |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末)     | 当期期末        |                 |                            | 銘柄            | 期首(前期末)         | 当期期末                        |               |                 | 銘柄                    | 期首(前期末)     | 当期期末        |              |     |
|--------------------|-------------|-------------|-----------------|----------------------------|---------------|-----------------|-----------------------------|---------------|-----------------|-----------------------|-------------|-------------|--------------|-----|
|                    |             | 株数          | 株数              | 評価額                        |               |                 | 株数                          | 株数            | 評価額             |                       |             | 株数          | 株数           | 評価額 |
| イオン                | 千株<br>489.7 | 千株<br>524.4 | 千円<br>1,878,925 | リそなホールディングス<br>244.4       | 千株<br>1,679.2 | 千円<br>1,366,197 | 野村ホールディングス<br>2,476.6       | 千株<br>2,421.5 | 千円<br>1,955,845 | セブン                   | 千株<br>118.4 | 千株<br>126.5 | 千円<br>89,182 |     |
| イズミ                | 22          | 27.4        | 95,543          | 三井住友トラスト・ホールディングス<br>982.5 | 517.5         | 1,501,526       | 岡三証券グループ<br>丸三証券            | 44.7          | 47.9            | 東洋証券                  | 44.6        | 38.2        | 12,644       |     |
| 平和堂                | 24          | 25.9        | 57,342          | 三井住友フィナンシャルグループ<br>千葉銀行    | 1,023.9       | 7,870,719       | 新興ファイナンシャル・ホールディングス<br>光世証券 | 146.2         | 171             | セイ                    | 146.2       | 171         | 97,470       |     |
| フジ                 | 22.2        | 23.7        | 46,333          | 群馬銀行                       | 374.7         | 401.3           | いちよし証券                      | 2.7           | 1.4             | 水戸証券                  | 36.2        | 42.5        | 19,167       |     |
| ヤオコー               | 16.3        | 17.5        | 149,677         | 武蔵野銀行                      | 260.6         | 279.5           | 松井証券                        | 24.6          | 27              | いちよし証券                | 24.6        | 27          | 20,196       |     |
| ゼビオホールディングス        | 19.7        | 21          | 21,084          | 千葉興業銀行                     | 28            | 27.2            | 松井証券                        | 79.5          | 70.9            | 日興証券                  | 79.5        | 70.9        | 60,265       |     |
| ケーズホールディングス        | 114.9       | 103.9       | 135,277         | 筑波銀行                       | 59.1          | 63.1            | マネックスグループ                   | 150.1         | 141             | 日興証券                  | 16.8        | 19.7        | 102,930      |     |
| Olympicグループ        | 5.2         | 3           | 1,644           | 七十七銀行                      | 43            | 41.9            | 極東証券                        | 15.3          | 16.4            | 岩井コモホールディングス          | 15.3        | 16.4        | 19,660       |     |
| 日産東京靴専ホールディングス     | 16.4        | 10.3        | 5,088           | 秋田銀行                       | 9             | 9.6             | アイザワ証券グループ                  | 19.4          | 20.8            | アイザワ証券                | 19.4        | 20.8        | 34,653       |     |
| シルバーライフ            | 3.3         | 3           | 2,511           | 山形銀行                       | 15            | 16              | マネーパートナーズグループ               | 12.5          | 6.7             | マネーパートナーズグループ         | 12.5        | 6.7         | 25,168       |     |
| Genky DrugStores   | 6.3         | 6.8         | 43,724          | 岩手銀行                       | 9.2           | 9.1             | スマートペース・グループ                | 15            | 16.1            | スマートペース・グループ          | 15          | 16.1        | 1,996        |     |
| ナルヤ・インターナショナル      | 2.1         | 1.1         | 1,333           | 東邦銀行                       | 107.2         | 113.7           | スパークス・グループ                  | 2.8           | 2.9             | 小林洋行                  | 2.8         | 2.9         | 739          |     |
| ブックオフ・ホールディングス     | 8.4         | 9           | 11,205          | 東北銀行                       | 6             | 3.1             | アドバンスクリエイト                  | 7.8           | 8.3             | アドバンスクリエイト            | 7.8         | 8.3         | 8,540        |     |
| ギフトホールディングス        | 3.1         | 6.5         | 18,265          | ふくおかフィナンシャルグループ            | 107.3         | 125.4           | その他金融業(1.2%)                | 35.2          | 37.7            | その他金融業(1.2%)          | 35.2        | 37.7        | 400,951      |     |
| アインホールディングス        | 19.9        | 21.3        | 100,812         | スルガ銀行                      | 118.5         | 126.9           | かんぽ生命保険                     | 163.3         | 146.6           | かんぽ生命保険               | 163.3       | 146.6       | 400,951      |     |
| 元気寿司               | 4.1         | 8.7         | 30,972          | 八十二銀行                      | 275.5         | 309             | F Pパートナー                    | —             | 2.9             | F Pパートナー              | —           | 2.9         | 18,850       |     |
| ヤマダホールディングス        | 592.4       | 475.7       | 211,591         | 山梨中央銀行                     | 13.7          | 16.1            | SOMPOホールディングス               | 230.7         | 216.6           | ソムポホールディングス           | 230.7       | 216.6       | 1,666,737    |     |
| アークランズ             | 21.2        | 46          | 76,728          | 大垣共立銀行                     | 25.7          | 27.4            | アニコ・ホールディングス                | 45.7          | 48.9            | アニコ・ホールディングス          | 45.7        | 48.9        | 28,508       |     |
| ニトリホールディングス        | 58.4        | 56.3        | 1,108,828       | 福井銀行                       | 12            | 12.9            | MS&ADインシュアنس・ホールディングス       | 273.6         | 322.4           | MS&ADインシュアنس・ホールディングス | 273.6       | 322.4       | 1,931,498    |     |
| グレメ杵屋              | 11.8        | 12.6        | 13,595          | 清水銀行                       | 5.4           | 5.7             | 第一生命ホールディングス                | 684.5         | 703.6           | 第一生命ホールディングス          | 684.5       | 703.6       | 2,156,534    |     |
| 愛眼                 | 7.6         | 5           | 915             | 富山銀行                       | 1.9           | 1.1             | 東京海上ホールディングス                | 1,353.8       | 1,423.4         | 東京海上ホールディングス          | 1,353.8     | 1,423.4     | 5,159,945    |     |
| ケーユー・ホールディングス      | 8.5         | 7.3         | 8,752           | 滋賀銀行                       | 22.4          | 24              | T & Dホールディングス               | 360.9         | 386.7           | T & Dホールディングス         | 360.9       | 386.7       | 902,751      |     |
| 吉野家ホールディングス        | 56.4        | 57          | 187,074         | 南都銀行                       | 20.2          | 21.7            | アドバンスクリエイト                  | 7.8           | 8.3             | アドバンスクリエイト            | 7.8         | 8.3         | 8,540        |     |
| 松屋フーズホールディングス      | 6.8         | 7.3         | 40,953          | 百五銀行                       | 126.6         | 135.5           | その他金融業(1.2%)                | 35.2          | 37.7            | その他金融業(1.2%)          | 35.2        | 37.7        | 206,633      |     |
| サガミホールディングス        | 23.2        | 23.2        | 35,867          | 京都銀行                       | 42.6          | —               | 全国保証                        | 6             | 2.9             | 全国保証                  | 6           | 2.9         | 725          |     |
| 関西フードマーケット         | 13          | 10.5        | 16,054          | 紀陽銀行                       | 48.1          | 51.5            | あんしん保証                      | 4             | 4.3             | ジェイリース                | 4           | 4.3         | 10,023       |     |
| 王将フードサービス          | 9.5         | 11.5        | 89,470          | ほくほくフィナンシャルグループ            | 85.4          | 89.1            | ソムポ生命保険                     | 4.5           | 4.5             | ソムポ生命保険               | 4.5         | 4.5         | 12,544       |     |
| ミニストップ             | 10.4        | 11.2        | 18,065          | 山陰合同銀行                     | 84            | 90.2            | SB I アルビ                    | 22.6          | 24.3            | プレミアグループ              | 22.6        | 24.3        | 40,969       |     |
| アーツ                | 26.5        | 28.4        | 82,757          | 鳥取銀行                       | 3.9           | 2.2             | ネットドクションズ・ホールディングス          | 44.4          | 47.7            | ネットドクションズ・ホールディングス    | 44.4        | 47.7        | 7,441        |     |
| パローホールディングス        | 27.6        | 29.5        | 74,576          | 百十四銀行                      | 12.2          | 14.2            | クレディセゾン                     | 85.1          | 91.3            | クレディセゾン               | 85.1        | 91.3        | 248,427      |     |
| ベルク                | 7.2         | 7.7         | 50,358          | 四国銀行                       | 21.2          | 21.2            | 芙蓉総合リース                     | 12.4          | 13.3            | 芙蓉総合リース               | 12.4        | 13.3        | 179,882      |     |
| 大庄                 | 6.9         | 7.4         | 9,916           | 阿波銀行                       | 19.9          | 20.2            | みずほリース                      | 20            | 24.1            | みずほリース                | 20          | 24.1        | 132,068      |     |
| ファーストリテイリング        | 21.7        | 69.6        | 2,697,000       | 大分銀行                       | 8             | 8.7             | 東京センチュリー                    | 25.1          | 107.6           | 東京センチュリー              | 25.1        | 107.6       | 175,495      |     |
| サンドラッグ             | 54.8        | 52.2        | 233,803         | 宮崎銀行                       | 8.8           | 8.7             | 日本証券金融                      | 54            | 52.9            | 日本証券金融                | 54          | 52.9        | 82,629       |     |
| サックスバー・ホールディングス    | 13.7        | 13.1        | 11,056          | 佐賀銀行                       | 7.8           | 8.5             | アイフル                        | 22.6          | 212             | アイフル                  | 22.6        | 212         | 81,408       |     |
| ヤマダワフ              | 2.3         | 1.4         | 1,769           | 琉球銀行                       | 30.5          | 30.7            | リコリース                       | 12.7          | 13.7            | リコリース                 | 12.7        | 13.7        | 69,185       |     |
| やまや                | 2.8         | 1.5         | 4,942           | セブン銀行                      | 481.4         | 451.4           | イオフィナンシャルサービス               | 77.1          | 82.7            | イオフィナンシャルサービス         | 77.1        | 82.7        | 110,693      |     |
| ペルーナ               | 33.8        | 37.2        | 22,952          | みずほフィナンシャルグループ             | 1,944.5       | 1,943.7         | アコム                         | 240.2         | 257.1           | アコム                   | 240.2       | 257.1       | 93,275       |     |
| 銀行業(7.1%)          | 160.1       | 171.4       | 174,656         | 高知銀行                       | 4.1           | 2.2             | ジャックス                       | 14.3          | 15.3            | ジャックス                 | 14.3        | 15.3        | 84,456       |     |
| いよぎんホールディングス       | 303.9       | 320         | 449,440         | 山口フィナンシャルグループ              | 148.5         | 141.2           | オリエントコーポレーション               | 35.1          | 47              | オリエントコーポレーション         | 35.1        | 47          | 50,055       |     |
| じょおカフィナンシャルグループ    | 113.2       | 121.3       | 130,700         | 長野銀行                       | 3.7           | —               | オリックス                       | 899.2         | 877.7           | オリックス                 | 899.2       | 877.7       | 2,525,142    |     |
| 楽天銀行               | —           | 50.1        | 116,883         | 名古屋銀行                      | 8.9           | 9.3             | 三菱HCキャピタル                   | 523.8         | 641.6           | 三菱HCキャピタル             | 523.8       | 641.6       | 670,792      |     |
| 京都イナーシャルグループ       | —           | 182.5       | 444,570         | 北洋銀行                       | 204.1         | 218.2           | 九州リースサービス                   | 5.6           | 2.6             | 九州リースサービス             | 5.6         | 2.6         | 3,112        |     |
| 島根銀行               | 4.2         | 1.9         | 984             | 大光銀行                       | 3.5           | 2.1             | 日本取引所グループ                   | 377.7         | 375.7           | 日本取引所グループ             | 377.7       | 375.7       | 1,249,202    |     |
| じもとホールディングス        | 7.9         | 5.6         | 3,152           | 愛媛銀行                       | 18.1          | 19.4            | イー・ギャランティ                   | 21.7          | 23.4            | イー・ギャランティ             | 21.7        | 23.4        | 43,266       |     |
| めぐみフィナンシャルグループ     | 666.7       | 714.5       | 309,449         | トマト銀行                      | 4             | 2.3             | アサックス                       | 5.5           | 3               | アサックス                 | 5.5         | 3           | 2,157        |     |
| 東京きらしフィナンシャルグループ   | 17.2        | 18.4        | 76,912          | 京葉銀行                       | 62.5          | 60.4            | NECキャピタルリユーション              | 6.7           | 7.1             | NECキャピタルリユーション        | 6.7         | 7.1         | 25,595       |     |
| 九州イナーシャルグループ       | 236.8       | 278.7       | 267,133         | 栃木銀行                       | 61.6          | 71.9            | 不動産業(2.0%)                  | 32.7          | 39.9            | 不動産業(2.0%)            | 32.7        | 39.9        | 6,783        |     |
| ゆうちょ銀行             | 382.9       | 1,582.4     | 2,379,138       | 北日本銀行                      | 4.7           | 4.7             | Robot Home                  | 49.2          | 52.8            | Robot Home            | 49.2        | 52.8        | 896,808      |     |
| 富山第一銀行             | 33.4        | 45.7        | 38,799          | 東和銀行                       | 24.9          | 26.4            | 大建託                         | 154.8         | 165.9           | 大建託                   | 154.8       | 165.9       | 64,037       |     |
| コンコディア・フィナンシャルグループ | 740.9       | 772.7       | 540,658         | 福島銀行                       | 12.8          | 6.6             | いちご                         | 160.1         | 152.4           | いちご                   | 160.1       | 152.4       | 27,279       |     |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 85          | 81.3        | 138,860         | 大東銀行                       | 4.6           | 2.7             | 日本駐車場開発                     | 12.2          | 16.7            | 日本駐車場開発               | 12.2        | 16.7        | 9,101        |     |
| 三十三フィナンシャルグループ     | 12.1        | 12.9        | 24,600          | トモニホールディングス                | 109           | 136.3           | スター・マイカ・ホールディングス            | 6.6           | 6.2             | S R E ホールディングス        | 6.6         | 6.2         | 20,584       |     |
| 菊池越フィナンシャルグループ     | 21.2        | 22.6        | 91,417          | フィアドホールディングス               | 13.8          | 14.9            | マキタ・ホールディングス                | 30            | 16.1            | ADワールズグループ            | 30          | 16.1        | 3,767        |     |
| ひろざんホールディングス       | 175.5       | 205         | 201,515         | 池田泉州ホールディングス               | 170.8         | 199.7           | ヒューリック                      | 313.4         | 335.9           | ヒューリック                | 313.4       | 335.9       | 535,424      |     |
| おきなわフィナンシャルグループ    | 12.8        | 12.3        | 30,528          | 証券・商品先物取引業(0.9%)           | 1,115.5       | 1,123,866       | 三栄建築設計                      | 6.5           | —               | 三栄建築設計                | 6.5         | —           | —            |     |
| 十六フィナンシャルグループ      | 17.4        | 18.7        | 78,072          | F P G                      | 54.5          | 48.7            | 野村ホールディングス                  | 2,476.6       | 2,421.5         | 野村ホールディングス            | 2,476.6     | 2,421.5     | 1,955,845    |     |
| 進徳・フィナンシャルホールディングス | 11.4        | 15.2        | 64,600          | ジャパンペイメントメントアドバイザー         | 10.9          | 23.4            | 岡三証券グループ                    | 118.4         | 126.5           | 岡三証券グループ              | 118.4       | 126.5       | 89,182       |     |
| プロアドレーフ・ホールディングス   | 16.6        | 16.5        | 30,376          | マキタ・ホールディングス               | 7.1           | 3.3             | 丸三証券                        | 44.7          | 47.9            | 丸三証券                  | 44.7        | 47.9        | 44,163       |     |
| あいちフィナンシャルグループ     | 18.8        | 22.2        | 57,653          | S B I ホールディングス             | 194.6         | 211             | 新東京銀行                       | 9.6           | 4.7             | 新東京銀行                 | 9.6         | 4.7         | 3,767        |     |
| S B I 新生銀行         | 39.7        | —           | —               | 日本アジア投資                    | 9.6           | 4.7             | あおぞら銀行                      | 44.9          | 42.9            | あおぞら銀行                | 44.9        | 42.9        | 3,767        |     |
| あおぞら銀行             | 84.4        | 103.5       | 225,992         | ジャフコ・グループ                  | 961.3         | 1,115.5         | 三井UFJフィナンシャル・グループ           | 961.3         | 1,123,866       | 三井UFJフィナンシャル・グループ     | 961.3       | 1,123,866   | —            |     |
| 三井UFJフィナンシャル・グループ  | 8,536.5     | 8,769.7     | 12,312,658      | 大和証券グループ本社                 | —             | —               | —                           | —             | —               | —                     | —           | —           | —            |     |

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

| 銘柄                 | 期首(前期末)    |            |              | 当期末                |            |         | 銘柄                 | 期首(前期末)         |                |                   | 当期末                     |           |             | 銘柄                 | 期首(前期末)    |               |                    | 当期末          |                  |     |
|--------------------|------------|------------|--------------|--------------------|------------|---------|--------------------|-----------------|----------------|-------------------|-------------------------|-----------|-------------|--------------------|------------|---------------|--------------------|--------------|------------------|-----|
|                    | 株数         | 株数         | 評価額          | 株数                 | 株数         | 評価額     |                    | 株数              | 株数             | 評価額               | 株数                      | 株数        | 評価額         |                    | 株数         | 株数            | 評価額                | 株数           | 株数               | 評価額 |
| バリューHR             | 千株<br>12.3 | 千株<br>13.1 | 千円<br>18,222 | 日総工産               | 千株<br>10.5 | 千円<br>- | タナベコンサルティンググループ    | 千株<br>5         | 千株<br>5.2      | 千円<br>5,610       | ナガワ                     | 株数<br>3.7 | 評価額<br>4.7  | ナガワ                | 株数<br>3.7  | 評価額<br>4.7    | ナガワ                | 株数<br>33,793 | 評価額<br>33,793    |     |
| M&キャピタルパートナーズ      | 13         | 12.2       | 29,206       | キューネットホールディングス     | 6.6        | 8.6     | 東京都競馬              | 株数<br>11.8      | 評価額<br>12.6    | 千円<br>57,708      | RPAホールディングス             | 株数<br>19  | 評価額<br>20.4 | 常磐興産               | 株数<br>4.3  | 評価額<br>2.5    | 常磐興産               | 株数<br>4.3    | 評価額<br>3,092     |     |
| ライオングラフスホールディングス   | 5.1        | 6          | 6,222        | スプリックス             | 4.3        | 1.9     | カナモト               | 株数<br>25.7      | 評価額<br>23.3    | 千円<br>67,104      | マネジメントソリューションズ          | 7.7       | 6.4         | ニシオホールディングス        | 株数<br>13   | 評価額<br>14     | ニシオホールディングス        | 株数<br>13     | 評価額<br>55,090    |     |
| ERIホールディングス        | 3.2        | 1.9        | 3,562        | プロレド・パートナーズ        | 3.3        | 3.5     | アゴーラ ホスピリティ・グループ   | 株数<br>70.2      | 評価額<br>43.4    | 千円<br>998         | and factory             | 3.6       | 2           | トランス・コスマス          | 株数<br>17.4 | 評価額<br>18.7   | トランス・コスマス          | 株数<br>17.4   | 評価額<br>55,165    |     |
| アビスト               | 2          | 1          | 3,115        | テノホールディングス         | 1.5        | 0.8     | 乃村工藝社              | 株数<br>61.2      | 評価額<br>65.6    | 千円<br>56,940      | シグマクシス・ホールディングス         | 4.7       | 3.8         | 藤田観光               | 株数<br>6.2  | 評価額<br>6      | 藤田観光               | 株数<br>6.2    | 評価額<br>40,200    |     |
| エスエー・エージェン・ジャパン    | 21.3       | 20.3       | 34,185       | プロティア・マネジメント       | 4.7        | 5,909   | KNT-Cホールディングス      | 株数<br>8.4       | 評価額<br>9       | 千円<br>11,763      | メドピア                    | 2         | 1.2         | 白洋舎                | 株数<br>14.8 | 評価額<br>-      | 白洋舎                | 株数<br>14.8   | 評価額<br>-         |     |
| アベリア               | 11         | 13.2       | 9,081        | ピアラ                | 2          | 376     | セコム                | 株数<br>12.5      | 評価額<br>13.3    | 千円<br>28,209      | アエロジョブ                  | 1.3       | 3,577       | セントラル警備保障          | 株数<br>1.1  | 評価額<br>1      | セントラル警備保障          | 株数<br>1.1    | 評価額<br>2,736     |     |
| リクルートホールディングス      | 2.4        | 1.3        | 1,186        | コプロ・ホールディングス       | 2.1        | 2.2     | 丹青社                | 株数<br>142.9     | 評価額<br>153.1   | 千円<br>1,639,701   | エラン                     | 1.8       | 0.9         | 丹青社                | 株数<br>7.5  | 評価額<br>8.1    | 丹青社                | 株数<br>7.5    | 評価額<br>20,841    |     |
| 土木管理総合試験所          | 5.3        | 3.1        | 1,010        | ギークス               | 1.8        | 0.9     | マイテックグループホールディングス  | 株数<br>27        | 評価額<br>29.1    | 千円<br>23,483      | 日本郵政                    | 1,839.2   | 2,500,939   | カーブスホールディングス       | 株数<br>16.1 | 評価額<br>44,355 | カーブスホールディングス       | 株数<br>16.1   | 評価額<br>30,866    |     |
| 日本郵政               | 1,039      | 1,112.8    | 6,435,322    | アンビスホールディングス       | —          | 16.1    | 船井総研ホールディングス       | 株数<br>8.3       | 評価額<br>20.5    | 千円<br>77,373      | ペシシステム24ホールディングス        | 43.1      | 41.1        | フォーラムエンジニアリング      | 株数<br>4.7  | 評価額<br>5.1    | フォーラムエンジニアリング      | 株数<br>4.7    | 評価額<br>16,338    |     |
| 鎌倉新書               | 18.6       | 19.9       | 21,074       | カーブスホールディングス       | 43.1       | 30,866  | FAST FITNESS JAPAN | 株数<br>16.8      | 評価額<br>15.5    | 千円<br>43,348      | 一蔵                      | 15.9      | 12.8        | FAST FITNESS JAPAN | 株数<br>16.8 | 評価額<br>5,651  | FAST FITNESS JAPAN | 株数<br>16.8   | 評価額<br>5,651     |     |
| SMN                | 3.2        | 1.3        | 421          | ポピングズ              | 2.1        | 2.2     | トーカイ               | 株数<br>2.1       | 評価額<br>3,000   | 千円<br>13.1        | 一蔵                      | 1.5       | 0.8         | トーカイ               | 株数<br>1.1  | 評価額<br>1      | トーカイ               | 株数<br>1.1    | 評価額<br>2,736     |     |
| セラフ                | 6.9        | 4.4        | 494          | LITALICO           | 10.9       | 11.7    | 白洋舎                | 株数<br>10.9      | 評価額<br>25,353  | 千円<br>1,164,680   | ローバルキッズCOMP ANY         | —         | —           | セコム                | 株数<br>14.2 | 評価額<br>153.1  | セコム                | 株数<br>14.2   | 評価額<br>1,639,701 |     |
| アエトリー              | 1.9        | 1.2        | 786          | コフティン・インターワークス     | —          | 0.6     | セントラル警備保障          | 株数<br>5.7       | 評価額<br>1,547   | 千円<br>433         | アトラエ                    | 9.1       | 20,009      | アドバンティッシュマネジメント    | 株数<br>5.7  | 評価額<br>3,4    | アドバンティッシュマネジメント    | 株数<br>5.7    | 評価額<br>1,547     |     |
| ストライク              | 9.1        | 11         | 5,918        | リログループ             | 78.1       | 75.3    | 丹青社                | 株数<br>78.1      | 評価額<br>118,635 | 千円<br>30,184      | ソラスト                    | 6.9       | 6,4         | リログループ             | 株数<br>9.8  | 評価額<br>10.5   | リログループ             | 株数<br>9.8    | 評価額<br>8,158     |     |
| セラフ                | 3.2        | 3.7        | 3,168        | 東祥                 | —          | 9.1     | オオバ                | 株数<br>—         | 評価額<br>33,488  | 千円<br>30,184      | インソース                   | 38.7      | 41.4        | TD&E ホールディングス      | 株数<br>9.1  | 評価額<br>33,488 | TD&E ホールディングス      | 株数<br>9.1    | 評価額<br>33,488    |     |
| インソース              | 4.1        | 5.5        | 5,147        | ビーウィズ              | 2.7        | 3.1     | 学究社                | 株数<br>2.7       | 評価額<br>5,614   | 千円<br>433         | バイガント・コンサルティング          | 34.8      | 32.6        | TREホールディングス        | 株数<br>2.7  | 評価額<br>5,614  | バイガント・コンサルティング     | 株数<br>2.7    | 評価額<br>5,614     |     |
| Orchestra Holdings | 3          | 3.2        | 3,168        | FAST FITNESS JAPAN | 6.3        | 5.7     | 学究社                | 株数<br>6.3       | 評価額<br>10,647  | 千円<br>12,486      | アイモバイル                  | 4.2       | 20.1        | 人・夢・技術グループ         | 株数<br>—    | 評価額<br>10,647 | 人・夢・技術グループ         | 株数<br>—      | 評価額<br>10,647    |     |
| キャリアインデックス         | 4.2        | 2.3        | 457          | 大栄環境               | 26.7       | 27.3    | ベネッセホールディングス       | 株数<br>26.7      | 評価額<br>68,058  | 千円<br>131,249     | MS-Japan                | 4.1       | 5.5         | 日本電気ホールディングス       | 株数<br>—    | 評価額<br>40,416 | 日本電気ホールディングス       | 株数<br>—      | 評価額<br>40,416    |     |
| 船場                 | 1.5        | 1.4        | 1,379        | M&A総研ホールディングス      | —          | 7.2     | オオンデイライト           | 株数<br>—         | 評価額<br>42,840  | 千円<br>60,455      | ジヤンクルレーティングサービスホールディングス | 50        | 48.7        | エイチ・アイ・エス          | 株数<br>36.7 | 評価額<br>43.7   | エイチ・アイ・エス          | 株数<br>36.7   | 評価額<br>43.7      |     |
| フルテック              | 1.7        | 1          | 1,128        | ラックランド             | 4.4        | 6.8     | オオバ                | 株数<br>4.4       | 評価額<br>17,761  | 千円<br>6,937       | グリーンズ                   | 4.2       | 2.4         | ニシオホールディングス        | 株数<br>24   | 評価額<br>23.6   | ニシオホールディングス        | 株数<br>24     | 評価額<br>145,706   |     |
| ツナグループ・ホールディングス    | 3.5        | 1.9        | 1,649        | 共立メンテナンス           | 15         | 16      | ダイセキ               | 株数<br>15        | 評価額<br>25,536  | 千円<br>123,874     | GAMEWITH                | 3.7       | 2.8         | イチニシホールディングス       | 株数<br>7.2  | 評価額<br>7.7    | イチニシホールディングス       | 株数<br>7.2    | 評価額<br>46,893    |     |
| MS&Consulting      | 1.4        | 1          | 590          | 建設技術研究所            | 10         | 9.8     | ステップ               | 株数<br>10        | 評価額<br>9,261   | 千円<br>11,088      | ウェルビー                   | 10.3      | 7.5         | スペース               | 株数<br>6    | 評価額<br>14.1   | スペース               | 株数<br>6      | 評価額<br>14.1      |     |
| エル・ティー・エス          | 1.9        | 1.7        | 4,867        | 燐ホールディングス          | 6          | 15,777  | 合計                 | 株数<br>159,799.8 | 評価額<br>226,079 | 千円<br>528,947,749 | ミダックホールディングス            | 8.6       | 9.1         | スバル興業              | 株数<br>0.6  | 評価額<br>3      | スバル興業              | 株数<br>0.6    | 評価額<br>9,420     |     |
|                    |            |            | 15,388       | 東京テアトル             | 4.6        | 2.4     | 銘柄数<br><比率>        | 2,161銘柄         | 評価額<br><比率>    | 千円<br>528,947,749 |                         |           |             |                    |            |               |                    |              |                  |     |

(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<br>柄<br>別  | 当<br>期 |   |               |   |   | 末        |
|--------------|--------|---|---------------|---|---|----------|
|              | 買      | 建 | 額             | 売 | 建 | 額        |
| 国内 T O P I X |        |   | 百万円<br>13,328 |   |   | 百万円<br>- |

■投資信託財産の構成

2024年2月7日現在

| 項<br>目       | 当<br>期            |        | 末     |
|--------------|-------------------|--------|-------|
|              | 評<br>価<br>額       | 比<br>率 | %     |
| 株式           | 千円<br>528,947,749 |        | 97.5  |
| コール・ローン等、その他 | 13,775,214        |        | 2.5   |
| 投資信託財産総額     | 542,722,964       |        | 100.0 |

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



## ■損益の状況

当期 自2023年2月8日 至2024年2月7日

| 項                         | 目   | 当 期  |
|---------------------------|---|--|
| (A) 配<br>受<br>受<br>そ<br>支 | 当 等 収 益<br>取 配 当 金<br>取 利 息<br>の 他 収 益 金<br>払 利 息 | 10,425,561,919円<br>10,381,192,543<br>112,936<br>47,949,906<br>△3,693,466 |
| (B) 有<br>売<br>売           | 価 証 券 売 買 損 益<br>買 益<br>買 損                       | 111,503,767,553<br>123,369,784,497<br>△11,866,016,944                    |
| (C) 先<br>取<br>取           | 物 取 引 等 取 引 損 益<br>引<br>引                         | 3,953,117,580<br>4,399,997,660<br>△446,880,080                           |
| (D) そ<br>の<br>の           | 他 費 用   | △2,081,296   |
| (E) 当                     | 期 損 益 金(A + B + C + D)                            | 125,880,365,756  |
| (F) 前                     | 期 繰 越 損 益 金                                       | 279,360,210,690  |
| (G) 解                     | 約 差 損 益 金   | △154,955,776,199   |
| (H) 追                     | 加 信 託 差 損 益 金                                     | 170,003,218,620  |
| (I) 合                     | 計(E + F + G + H)                                  | 420,288,018,867  |
| 次<br>期                    | 繰 越 損 益 金(I)                                      | 420,288,018,867  |

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

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

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

## 《お知らせ》

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

(2023年12月20日)

# 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第17期（決算日 2024年6月24日）

(計算期間 2023年6月23日～2024年6月24日)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2008年1月16日から無期限です。  |
| 運用方針   | 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」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     | FTSE世界国債インデックス<br>(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)<br>(ベンチマーク) |             | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額        |
|-----------------|----------|---|-------------|--------|--------|-------------|
|                 |          | 期騰落率  | 中騰落率        |        |        |             |
| 13期（2020年6月22日） | 円 14,658 | % 5.5   | ポイント 424.77 | % 6.0  | 100.6  | % — 337,333 |
| 14期（2021年6月22日） | 14,333   | △2.2  | 415.85      | △2.1   | 97.9   | — 573,974   |
| 15期（2022年6月22日） | 12,469   | △13.0   | 361.76      | △13.0  | 104.3  | — 375,850   |
| 16期（2023年6月22日） | 11,893   | △4.6  | 345.85      | △4.4   | 104.0  | — 101,286   |
| 17期（2024年6月24日） | 11,557   | △2.8  | 337.19      | △2.5   | 100.3  | — 245,015   |

(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、為替ヘッジあり）です（以下同じ）。

(注3) FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）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の一切の権利は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）。

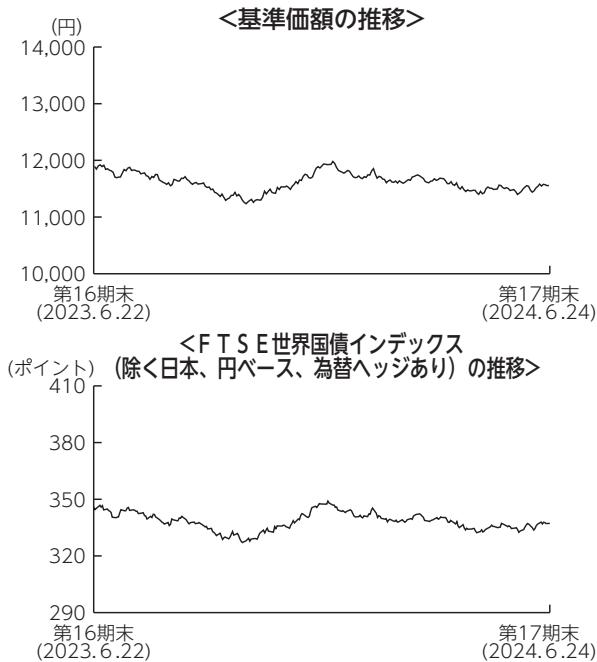
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額     | 騰 落 率  | F T S E 世 界 国 債<br>イ ン デ ッ ク ス | 騰 落 率  | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|--------------------------|-------------|--------|--------------------------------|--------|-------------|-------------|
|                          |             |        | (除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)(ベンチマーク)    |        |             |             |
| (期 首)<br>2023 年 6 月 22 日 | 円<br>11,893 | %<br>— | ポイント<br>345.85                 | %<br>— | %<br>104.0  | %<br>—      |
| 6 月 末                    | 11,840      | △0.4   | 344.37                         | △0.4   | 102.6       | —           |
| 7 月 末                    | 11,772      | △1.0   | 342.72                         | △0.9   | 98.8        | —           |
| 8 月 末                    | 11,680      | △1.8   | 339.97                         | △1.7   | 101.2       | —           |
| 9 月 末                    | 11,363      | △4.5   | 330.75                         | △4.4   | 100.7       | —           |
| 10 月 末                   | 11,301      | △5.0   | 329.05                         | △4.9   | 99.1        | —           |
| 11 月 末                   | 11,625      | △2.3   | 338.66                         | △2.1   | 98.2        | —           |
| 12 月 末                   | 11,948      | 0.5    | 347.97                         | 0.6    | 95.8        | —           |
| 2024 年 1 月 末             | 11,741      | △1.3   | 342.04                         | △1.1   | 103.0       | —           |
| 2 月 末                    | 11,611      | △2.4   | 338.30                         | △2.2   | 102.7       | —           |
| 3 月 末                    | 11,681      | △1.8   | 340.37                         | △1.6   | 98.7        | —           |
| 4 月 末                    | 11,454      | △3.7   | 333.82                         | △3.5   | 103.1       | —           |
| 5 月 末                    | 11,422      | △4.0   | 333.16                         | △3.7   | 99.5        | —           |
| (期 末)<br>2024 年 6 月 24 日 | 11,557      | △2.8   | 337.19                         | △2.5   | 100.3       | —           |

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、賃建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は11,557円となり、前期末比で2.8%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。ドイツ債の利回りは低下（価格は上昇）しました。米国債は、パウエルF R B（米連邦準備理事会）議長の発言などから利回りが低下する局面もありましたが、インフレ圧力の根強さが意識され利回りは上昇しました。ドイツ債はE C B（欧洲中央銀行）による利下げが開始されたことから利回りは低下しました。ドイツ債はプラス要因だったものの、米国債のマイナス要因の方が大きかったことから基準価額は下落しました。

### 投資環境

米国債の利回りは、上昇しました。ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、パウエルF R B議長の発言などから利回りが低下する局面もありインフレ圧力の根強さが意識されたことから利回りは上昇しました。ドイツ債はE C Bによる利下げが開始されたことから利回りは低下しました。

ましたが、米労働市場の底堅さが意識されたことや、インフレ圧力の根強さが意識されたことから利回りは上昇しました。ドイツ債はE C Bによる利下げが開始されたことから利回りは低下しました。

### 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、為替ヘッジあり）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.5%下落しました。  
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<br>(保管費用)<br>(その他) | 4円<br>(3)<br>(0) | 0.033%<br>(0.029)<br>(0.004) | (a) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計                           | 4                | 0.033                        |   |
| 期中の平均基準価額は11,611円です。         |                  |                              |   |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## ■売買及び取引の状況 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

### 公社債

|        |          | 買付額                     | 売付額                           |
|--------|----------|-------------------------|-------------------------------|
| 外<br>国 | アメリカ     | 千アメリカ・ドル<br>2,830,677   | 千アメリカ・ドル<br>2,437,959<br>(-)  |
|        | カナダ      | 千カナダ・ドル<br>165,614      | 千カナダ・ドル<br>142,389<br>(-)     |
|        | オーストラリア  | 千オーストラリア・ドル<br>126,070  | 千オーストラリア・ドル<br>112,537<br>(-) |
|        | シンガポール   | 千シンガポール・ドル<br>33,517    | 千シンガポール・ドル<br>28,731<br>(-)   |
|        | ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル<br>21,023  | 千ニュージーランド・ドル<br>17,298<br>(-) |
|        | イギリス     | 千イギリス・ポンド<br>237,338    | 千イギリス・ポンド<br>201,124<br>(-)   |
|        | イスラエル    | 千イスラエル・シェケル<br>67,207   | 千イスラエル・シェケル<br>55,560<br>(-)  |
|        | デンマーク    | 千デンマーク・クローネ<br>110,662  | 千デンマーク・クローネ<br>97,440<br>(-)  |
|        | ノルウェー    | 千ノルウェー・クローネ<br>96,961   | 千ノルウェー・クローネ<br>82,423<br>(-)  |
|        | スウェーデン   | 千スウェーデン・クローネ<br>112,293 | 千スウェーデン・クローネ<br>99,786<br>(-) |

|                  |        |      | 買付額                     | 売付額                            |
|------------------|--------|------|-------------------------|--------------------------------|
| 外                | メキシコ   | 国債証券 | 千メキシコ・ペソ<br>912,590     | 千メキシコ・ペソ<br>800,083<br>(-)     |
|                  | 中国     | 国債証券 | 千オフショア・人民元<br>3,374,158 | 千オフショア・人民元<br>2,578,003<br>(-) |
|                  | マレーシア  | 国債証券 | 千マレーシア・リンギット<br>133,053 | 千マレーシア・リンギット<br>114,987<br>(-) |
|                  | ポーランド  | 国債証券 | 千ポーランド・ズロチ<br>123,374   | 千ポーランド・ズロチ<br>104,515<br>(-)   |
| ユ<br>イ<br>国<br>ロ | アイルランド | 国債証券 | 千ユーロ<br>30,459          | 千ユーロ<br>27,228<br>(-)          |
|                  | オランダ   | 国債証券 | 82,341                  | 71,905<br>(-)                  |
|                  | ベルギー   | 国債証券 | 99,505                  | 87,571<br>(-)                  |
|                  | フランス   | 国債証券 | 445,358                 | 389,308<br>(-)                 |
|                  | ドイツ    | 国債証券 | 349,741                 | 304,832<br>(-)                 |
|                  | スペイン   | 国債証券 | 270,430                 | 237,003<br>(-)                 |
|                  | イタリア   | 国債証券 | 407,659                 | 356,709<br>(-)                 |
|                  | フィンランド | 国債証券 | 27,907                  | 23,579<br>(-)                  |
|                  | オーストリア | 国債証券 | 66,159                  | 58,221<br>(-)                  |

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年6月23日から2024年6月24日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

| 区分       | 当期末                     |                         |                   |           |            |           | 残存期間別組入比率 |          |
|----------|-------------------------|-------------------------|-------------------|-----------|------------|-----------|-----------|----------|
|          | 額面金額                    | 評価額                     |                   | 組入比率      | うちB級以下組入比率 | 5年以上      | 2年以上      | 2年末満     |
|          | 外貨建金額                   | 邦貨換算金額                  |                   |           |            |           |           |          |
| アメリカ     | 千アメリカ・ドル<br>803,782     | 千アメリカ・ドル<br>728,330     | 千円<br>116,445,459 | %<br>47.5 | %<br>-     | %<br>20.1 | %<br>19.4 | %<br>8.1 |
| カナダ      | 千カナダ・ドル<br>45,560       | 千カナダ・ドル<br>42,777       | 千円<br>4,993,362   | 2.0       | -          | 1.1       | 0.5       | 0.4      |
| オーストラリア  | 千オーストラリア・ドル<br>33,370   | 千オーストラリア・ドル<br>29,895   | 千円<br>3,173,758   | 1.3       | -          | 0.9       | 0.4       | 0.1      |
| シンガポール   | 千シンガポール・ドル<br>9,145     | 千シンガポール・ドル<br>8,660     | 千円<br>1,021,658   | 0.4       | -          | 0.2       | 0.1       | 0.1      |
| ニュージーランド | 千ニュージーランド・ドル<br>6,960   | 千ニュージーランド・ドル<br>6,082   | 千円<br>594,820     | 0.2       | -          | 0.2       | 0.1       | 0.0      |
| イギリス     | 千イギリス・ポンド<br>75,850     | 千イギリス・ポンド<br>63,681     | 千円<br>12,874,413  | 5.3       | -          | 3.7       | 1.2       | 0.3      |
| イスラエル    | 千イスラエル・シュケル<br>20,220   | 千イスラエル・シュケル<br>17,545   | 千円<br>746,980     | 0.3       | -          | 0.2       | 0.1       | 0.0      |
| デンマーク    | 千デンマーク・クローネ<br>28,740   | 千デンマーク・クローネ<br>27,231   | 千円<br>624,139     | 0.3       | -          | 0.2       | 0.0       | 0.0      |
| ノルウェー    | 千ノルウェー・クローネ<br>28,360   | 千ノルウェー・クローネ<br>26,471   | 千円<br>400,247     | 0.2       | -          | 0.1       | 0.0       | 0.0      |
| スウェーデン   | 千スウェーデン・クローナ<br>27,380  | 千スウェーデン・クローナ<br>26,395  | 千円<br>401,481     | 0.2       | -          | 0.1       | 0.1       | -        |
| メキシコ     | 千メキシコ・ペソ<br>248,798     | 千メキシコ・ペソ<br>219,876     | 千円<br>1,942,239   | 0.8       | -          | 0.4       | 0.3       | 0.1      |
| 中国       | 千オフショア・人民元<br>1,063,000 | 千オフショア・人民元<br>1,106,167 | 千円<br>24,254,822  | 9.9       | -          | 4.3       | 4.2       | 1.4      |
| マレーシア    | 千マレーシア・リンギット<br>34,000  | 千マレーシア・リンギット<br>34,790  | 千円<br>1,179,711   | 0.5       | -          | 0.3       | 0.1       | 0.0      |
| ポーランド    | 千ポーランド・ズロチ<br>35,360    | 千ポーランド・ズロチ<br>33,043    | 千円<br>1,305,589   | 0.5       | -          | 0.2       | 0.3       | 0.1      |
| ユーロ      | 千ユーロ                    | 千ユーロ                    | 千円                |           |            |           |           |          |
| アイルランド   | 8,105                   | 7,109                   | 1,215,416         | 0.5       | -          | 0.3       | 0.1       | 0.0      |
| オランダ     | 23,080                  | 20,985                  | 3,587,708         | 1.5       | -          | 0.9       | 0.5       | 0.1      |
| ベルギー     | 26,770                  | 24,539                  | 4,195,262         | 1.7       | -          | 1.1       | 0.4       | 0.2      |
| フランス     | 120,310                 | 109,039                 | 18,641,364        | 7.6       | -          | 4.3       | 2.6       | 0.7      |
| ドイツ      | 94,680                  | 88,576                  | 15,143,105        | 6.2       | -          | 3.4       | 2.0       | 0.8      |
| スペイン     | 72,150                  | 67,478                  | 11,536,070        | 4.7       | -          | 2.6       | 1.6       | 0.5      |
| イタリア     | 106,960                 | 101,928                 | 17,425,671        | 7.1       | -          | 4.2       | 2.1       | 0.8      |
| フィンランド   | 8,720                   | 7,644                   | 1,306,951         | 0.5       | -          | 0.3       | 0.2       | 0.1      |
| オーストリア   | 18,510                  | 16,380                  | 2,800,360         | 1.1       | -          | 0.7       | 0.4       | 0.1      |
| 合計       | -                       | -                       | 千円<br>245,810,597 | 100.3     | -          | 49.7      | 36.6      | 14.0     |

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

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

## (B) 個別銘柄開示

## 外国(外貨建)公社債銘柄別

| 銘 柄                     | 種 類     | 利 率    | 額 面 金 額  | 期 期       |           | 償還年月日      |
|-------------------------|---------|--------|----------|-----------|-----------|------------|
|                         |         |        |          | 外 貨 建 金 額 | 評 価 額     |            |
| (アメリカ)                  |         | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル  | 千円        |            |
| US T N/B 2.625 01/31/26 | 国 債 証 券 | 2.6250 | 780      | 753       | 120,468   | 2026/01/31 |
| US T N/B 1.5 01/31/27   | 国 債 証 券 | 1.5000 | 4,900    | 4,538     | 725,635   | 2027/01/31 |
| US T N/B 1.75 01/31/29  | 国 債 証 券 | 1.7500 | 3,600    | 3,219     | 514,762   | 2029/01/31 |
| US T N/B 0.75 01/31/28  | 国 債 証 券 | 0.7500 | 4,070    | 3,580     | 572,448   | 2028/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/31/30   | 国 債 証 券 | 3.5000 | 2,500    | 2,404     | 384,398   | 2030/01/31 |
| US T N/B 4.0 01/31/31   | 国 債 証 券 | 4.0000 | 2,000    | 1,970     | 314,976   | 2031/01/31 |
| US T N/B 0.375 01/31/26 | 国 債 証 券 | 0.3750 | 1,000    | 931       | 148,956   | 2026/01/31 |
| US T N/B 3.5 01/31/28   | 国 債 証 券 | 3.5000 | 2,900    | 2,814     | 450,005   | 2028/01/31 |
| US T N/B 4.0 01/15/27   | 国 債 証 券 | 4.0000 | 4,630    | 4,568     | 730,384   | 2027/01/15 |
| US T N/B 4.0 01/31/29   | 国 債 証 券 | 4.0000 | 4,600    | 4,543     | 726,384   | 2029/01/31 |
| US T N/B 3.875 01/15/26 | 国 債 証 券 | 3.8750 | 1,600    | 1,576     | 252,035   | 2026/01/15 |
| US T N/B 4.25 01/31/26  | 国 債 証 券 | 4.2500 | 3,700    | 3,665     | 586,102   | 2026/01/31 |
| US T N/B 6.0 02/15/26   | 国 債 証 券 | 6.0000 | 2,810    | 2,869     | 458,756   | 2026/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/42 | 国 債 証 券 | 3.1250 | 1,000    | 836       | 133,812   | 2042/02/15 |
| US T N/B 3.125 02/15/43 | 国 債 証 券 | 3.1250 | 1,260    | 1,039     | 166,242   | 2043/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/46   | 国 債 証 券 | 2.5000 | 2,000    | 1,440     | 230,289   | 2046/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/39   | 国 債 証 券 | 3.5000 | 300      | 274       | 43,864    | 2039/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/36   | 国 債 証 券 | 4.5000 | 430      | 443       | 70,856    | 2036/02/15 |
| US T N/B 4.75 02/15/41  | 国 債 証 券 | 4.7500 | 1,500    | 1,566     | 250,405   | 2041/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/44 | 国 債 証 券 | 3.6250 | 1,000    | 882       | 141,106   | 2044/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/49   | 国 債 証 券 | 3.0000 | 2,300    | 1,784     | 285,273   | 2049/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/52  | 国 傾 証 券 | 2.2500 | 3,070    | 2,007     | 320,938   | 2052/02/15 |
| US T N/B 4.375 02/15/38 | 国 傾 証 券 | 4.3750 | 300      | 303       | 48,563    | 2038/02/15 |
| US T N/B 3.625 02/15/53 | 国 傾 証 券 | 3.6250 | 2,850    | 2,485     | 397,312   | 2053/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/15/40 | 国 傾 証 券 | 4.6250 | 1,000    | 1,033     | 165,169   | 2040/02/15 |
| US T N/B 2.375 02/15/42 | 国 傾 証 券 | 2.3750 | 3,100    | 2,302     | 368,100   | 2042/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/51 | 国 傾 証 券 | 1.8750 | 5,450    | 3,268     | 522,569   | 2051/02/15 |
| US T N/B 4.25 02/15/54  | 国 傾 証 券 | 4.2500 | 4,900    | 4,781     | 764,438   | 2054/02/15 |
| US T N/B 1.625 02/15/26 | 国 傾 証 券 | 1.6250 | 2,300    | 2,184     | 349,265   | 2026/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/15/45   | 国 傾 証 券 | 2.5000 | 2,110    | 1,536     | 245,604   | 2045/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/47   | 国 傾 証 券 | 3.0000 | 1,590    | 1,245     | 199,077   | 2047/02/15 |
| US T N/B 3.0 02/15/48   | 国 傾 証 券 | 3.0000 | 2,200    | 1,712     | 273,797   | 2048/02/15 |
| US T N/B 2.625 02/15/29 | 国 傾 証 券 | 2.6250 | 3,000    | 2,789     | 445,962   | 2029/02/15 |
| US T N/B 2.75 02/15/28  | 国 傾 証 券 | 2.7500 | 3,900    | 3,685     | 589,164   | 2028/02/15 |
| US T N/B 2.25 02/15/27  | 国 傾 証 券 | 2.2500 | 3,900    | 3,680     | 588,507   | 2027/02/15 |
| US T N/B 2.5 02/28/26   | 国 傾 証 券 | 2.5000 | 1,000    | 962       | 153,928   | 2026/02/28 |
| US T N/B 4.0 02/15/34   | 国 傾 証 券 | 4.0000 | 6,400    | 6,271     | 1,002,687 | 2034/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/15/31 | 国 傾 証 券 | 1.1250 | 5,500    | 4,524     | 723,428   | 2031/02/15 |
| US T N/B 4.25 02/28/31  | 国 傾 証 券 | 4.2500 | 2,400    | 2,398     | 383,532   | 2031/02/28 |
| US T N/B 3.875 02/15/43 | 国 傾 証 券 | 3.8750 | 2,200    | 2,023     | 323,590   | 2043/02/15 |
| US T N/B 4.5 02/15/44   | 国 傾 証 券 | 4.5000 | 2,500    | 2,496     | 399,075   | 2044/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/41 | 国 傾 証 券 | 1.8750 | 4,400    | 3,073     | 491,344   | 2041/02/15 |
| US T N/B 2.0 02/15/50   | 国 傾 証 券 | 2.0000 | 3,500    | 2,181     | 348,753   | 2050/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/15/32 | 国 傾 証 券 | 1.8750 | 6,480    | 5,481     | 876,349   | 2032/02/15 |
| US T N/B 3.5 02/15/33   | 国 傾 証 券 | 3.5000 | 5,400    | 5,104     | 816,086   | 2033/02/15 |
| US T N/B 1.125 02/28/27 | 国 傾 証 券 | 1.1250 | 1,100    | 1,006     | 160,953   | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.5 02/15/30   | 国 傾 証 券 | 1.5000 | 4,000    | 3,450     | 551,610   | 2030/02/15 |
| US T N/B 1.875 02/28/27 | 国 傾 証 券 | 1.8750 | 4,000    | 3,735     | 597,151   | 2027/02/28 |
| US T N/B 1.125 02/29/28 | 国 傾 証 券 | 1.1250 | 3,720    | 3,311     | 529,400   | 2028/02/29 |
| US T N/B 1.875 02/28/29 | 国 傾 証 券 | 1.8750 | 2,700    | 2,424     | 387,682   | 2029/02/28 |
| US T N/B 0.5 02/28/26   | 国 傾 証 券 | 0.5000 | 3,900    | 3,630     | 580,518   | 2026/02/28 |

| 銘柄                      | 当期   |        |          |          | 期末        |            |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                         | 種類   | 利 率    | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 4.125 02/15/27 | 国債証券 | 4.1250 | 4,190    | 4,147    | 663,172   | 2027/02/15 |
| US T N/B 4.0 02/28/30   | 国債証券 | 4.0000 | 2,200    | 2,169    | 346,920   | 2030/02/28 |
| US T N/B 4.0 02/29/28   | 国債証券 | 4.0000 | 2,200    | 2,171    | 347,174   | 2028/02/29 |
| US T N/B 4.0 02/15/26   | 国債証券 | 4.0000 | 2,400    | 2,368    | 378,675   | 2026/02/15 |
| US T N/B 4.625 02/28/26 | 国債証券 | 4.6250 | 4,000    | 3,987    | 637,521   | 2026/02/28 |
| US T N/B 4.25 02/28/29  | 国債証券 | 4.2500 | 3,700    | 3,694    | 590,747   | 2029/02/28 |
| US T N/B 2.25 03/31/26  | 国債証券 | 2.2500 | 6,000    | 5,745    | 918,548   | 2026/03/31 |
| US T N/B 0.625 03/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 3,000    | 2,700    | 431,807   | 2027/03/31 |
| US T N/B 1.25 03/31/28  | 国債証券 | 1.2500 | 3,500    | 3,123    | 499,326   | 2028/03/31 |
| US T N/B 0.75 03/31/26  | 国債証券 | 0.7500 | 6,530    | 6,089    | 973,545   | 2026/03/31 |
| US T N/B 2.375 03/31/29 | 国債証券 | 2.3750 | 2,200    | 2,019    | 322,813   | 2029/03/31 |
| US T N/B 2.5 03/31/27   | 国債証券 | 2.5000 | 3,900    | 3,700    | 591,709   | 2027/03/31 |
| US T N/B 4.125 03/31/31 | 国債証券 | 4.1250 | 2,500    | 2,481    | 396,702   | 2031/03/31 |
| US T N/B 3.625 03/31/30 | 国債証券 | 3.6250 | 1,800    | 1,741    | 278,352   | 2030/03/31 |
| US T N/B 3.625 03/31/28 | 国債証券 | 3.6250 | 3,000    | 2,922    | 467,274   | 2028/03/31 |
| US T N/B 4.625 03/15/26 | 国債証券 | 4.6250 | 8,532    | 8,506    | 1,359,939 | 2026/03/15 |
| US T N/B 4.25 03/15/27  | 国債証券 | 4.2500 | 5,000    | 4,966    | 794,107   | 2027/03/15 |
| US T N/B 4.5 03/31/26   | 国債証券 | 4.5000 | 5,000    | 4,975    | 795,512   | 2026/03/31 |
| US T N/B 4.125 03/31/29 | 国債証券 | 4.1250 | 4,500    | 4,468    | 714,457   | 2029/03/31 |
| US T N/B 2.375 04/30/26 | 国債証券 | 2.3750 | 6,800    | 6,515    | 1,041,743 | 2026/04/30 |
| US T N/B 1.25 04/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 4,000    | 3,561    | 569,385   | 2028/04/30 |
| US T N/B 4.625 04/30/31 | 国債証券 | 4.6250 | 4,000    | 4,088    | 653,609   | 2031/04/30 |
| US T N/B 0.5 04/30/27   | 国債証券 | 0.5000 | 3,400    | 3,041    | 486,238   | 2027/04/30 |
| US T N/B 2.875 04/30/29 | 国債証券 | 2.8750 | 3,150    | 2,955    | 472,568   | 2029/04/30 |
| US T N/B 0.75 04/30/26  | 国債証券 | 0.7500 | 4,862    | 4,521    | 722,892   | 2026/04/30 |
| US T N/B 3.5 04/30/28   | 国債証券 | 3.5000 | 2,800    | 2,714    | 434,050   | 2028/04/30 |
| US T N/B 2.75 04/30/27  | 国債証券 | 2.7500 | 4,000    | 3,815    | 610,042   | 2027/04/30 |
| US T N/B 3.5 04/30/30   | 国債証券 | 3.5000 | 2,200    | 2,113    | 337,831   | 2030/04/30 |
| US T N/B 3.75 04/15/26  | 国債証券 | 3.7500 | 3,650    | 3,586    | 573,338   | 2026/04/15 |
| US T N/B 4.875 04/30/26 | 国債証券 | 4.8750 | 4,500    | 4,509    | 720,949   | 2026/04/30 |
| US T N/B 4.5 04/15/27   | 国債証券 | 4.5000 | 3,700    | 3,700    | 591,579   | 2027/04/15 |
| US T N/B 4.625 04/30/29 | 国債証券 | 4.6250 | 4,000    | 4,059    | 648,962   | 2029/04/30 |
| US T N/B 4.375 05/15/40 | 国債証券 | 4.3750 | 800      | 802      | 128,323   | 2040/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/41 | 国債証券 | 4.3750 | 500      | 498      | 79,755    | 2041/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/42   | 国債証券 | 3,0000 | 1,500    | 1,226    | 196,127   | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/15/39  | 国債証券 | 4.2500 | 900      | 893      | 142,857   | 2039/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/43 | 国債証券 | 2.8750 | 1,590    | 1,258    | 201,242   | 2043/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/51 | 国債証券 | 2.3750 | 3,580    | 2,418    | 386,718   | 2051/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/44 | 国債証券 | 3.3750 | 3,000    | 2,545    | 407,019   | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/45   | 国債証券 | 3,0000 | 800      | 634      | 101,458   | 2045/05/15 |
| US T N/B 3.0 05/15/47   | 国債証券 | 3,0000 | 2,000    | 1,563    | 249,968   | 2047/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/52 | 国債証券 | 2.8750 | 4,300    | 3,232    | 516,875   | 2052/05/15 |
| US T N/B 2.5 05/15/46   | 国債証券 | 2.5000 | 1,800    | 1,292    | 206,715   | 2046/05/15 |
| US T N/B 3.125 05/15/48 | 国債証券 | 3.1250 | 2,520    | 2,004    | 320,539   | 2048/05/15 |
| US T N/B 1.125 05/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 3,000    | 1,884    | 301,320   | 2040/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/49 | 国債証券 | 2.8750 | 2,500    | 1,891    | 302,382   | 2049/05/15 |
| US T N/B 3.625 05/15/53 | 国債証券 | 3.6250 | 2,880    | 2,511    | 401,557   | 2053/05/15 |
| US T N/B 4.5 05/15/38   | 国債証券 | 4.5000 | 600      | 614      | 98,271    | 2038/05/15 |
| US T N/B 2.25 05/15/41  | 国債証券 | 2.2500 | 2,600    | 1,919    | 306,837   | 2041/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 3,440    | 3,257    | 520,736   | 2028/05/15 |
| US T N/B 4.625 05/15/54 | 国債証券 | 4.6250 | 2,300    | 2,388    | 381,887   | 2054/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/29 | 国債証券 | 2.3750 | 2,820    | 2,583    | 413,093   | 2029/05/15 |
| US T N/B 2.375 05/15/27 | 国債証券 | 2.3750 | 3,000    | 2,829    | 452,323   | 2027/05/15 |
| US T N/B 5.0 05/15/37   | 国債証券 | 5.0000 | 600      | 645      | 103,227   | 2037/05/15 |

| 銘柄                      | 当期   |        |          |          | 末         |            |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                         | 種類   | 利 率    | 額面金額     | 評価額      |           | 償還年月日      |
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 1.625 05/15/26 | 国債証券 | 1.6250 | 5,422    | 5,119    | 818,480   | 2026/05/15 |
| US T N/B 1.25 05/15/50  | 国債証券 | 1.2500 | 4,100    | 2,091    | 334,398   | 2050/05/15 |
| US T N/B 2.125 05/31/26 | 国債証券 | 2.1250 | 2,200    | 2,095    | 335,042   | 2026/05/31 |
| US T N/B 1.625 05/15/31 | 国債証券 | 1.6250 | 5,850    | 4,940    | 789,851   | 2031/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 800      | 783      | 125,257   | 2025/05/31 |
| US T N/B 3.25 05/15/42  | 国債証券 | 3.2500 | 2,650    | 2,245    | 359,037   | 2042/05/15 |
| US T N/B 4.625 05/15/44 | 国債証券 | 4.6250 | 1,000    | 1,016    | 162,528   | 2044/05/15 |
| US T N/B 3.875 05/15/43 | 国債証券 | 3.8750 | 2,200    | 2,020    | 323,033   | 2043/05/15 |
| US T N/B 2.875 05/15/32 | 国債証券 | 2.8750 | 7,400    | 6,719    | 1,074,321 | 2032/05/15 |
| US T N/B 3.375 05/15/33 | 国債証券 | 3.3750 | 7,100    | 6,638    | 1,061,429 | 2033/05/15 |
| US T N/B 0.5 05/31/27   | 国債証券 | 0.5000 | 2,600    | 2,318    | 370,717   | 2027/05/31 |
| US T N/B 1.25 05/31/28  | 国債証券 | 1.2500 | 4,640    | 4,122    | 659,139   | 2028/05/31 |
| US T N/B 0.625 05/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 5,190    | 4,214    | 673,788   | 2030/05/15 |
| US T N/B 4.375 05/15/34 | 国債証券 | 4.3750 | 4,000    | 4,039    | 645,765   | 2034/05/15 |
| US T N/B 2.625 05/31/27 | 国債証券 | 2.6250 | 3,800    | 3,607    | 576,810   | 2027/05/31 |
| US T N/B 2.75 05/31/29  | 国債証券 | 2.7500 | 2,900    | 2,702    | 432,138   | 2029/05/31 |
| US T N/B 0.75 05/31/26  | 国債証券 | 0.7500 | 4,890    | 4,534    | 725,009   | 2026/05/31 |
| US T N/B 3.625 05/31/28 | 国債証券 | 3.6250 | 2,150    | 2,093    | 334,772   | 2028/05/31 |
| US T N/B 0.25 05/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,500    | 1,433    | 229,202   | 2025/05/31 |
| US T N/B 3.75 05/31/30  | 国債証券 | 3.7500 | 2,700    | 2,626    | 419,973   | 2030/05/31 |
| US T N/B 4.5 05/15/27   | 国債証券 | 4.5000 | 5,000    | 5,001    | 799,618   | 2027/05/15 |
| US T N/B 3.625 05/15/26 | 国債証券 | 3.6250 | 2,800    | 2,744    | 438,736   | 2026/05/15 |
| US T N/B 4.25 05/31/25  | 国債証券 | 4.2500 | 1,500    | 1,487    | 237,825   | 2025/05/31 |
| US T N/B 2.75 06/30/25  | 国債証券 | 2.7500 | 1,500    | 1,465    | 234,307   | 2025/06/30 |
| US T N/B 1.875 06/30/26 | 国債証券 | 1.8750 | 2,000    | 1,892    | 302,597   | 2026/06/30 |
| US T N/B 0.5 06/30/27   | 国債証券 | 0.5000 | 2,500    | 2,223    | 355,522   | 2027/06/30 |
| US T N/B 1.25 06/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 3,070    | 2,722    | 435,200   | 2028/06/30 |
| US T N/B 3.25 06/30/27  | 国債証券 | 3.2500 | 2,890    | 2,792    | 446,531   | 2027/06/30 |
| US T N/B 0.875 06/30/26 | 国債証券 | 0.8750 | 4,716    | 4,375    | 699,491   | 2026/06/30 |
| US T N/B 3.25 06/30/29  | 国債証券 | 3.2500 | 3,000    | 2,860    | 457,306   | 2029/06/30 |
| US T N/B 2.875 06/15/25 | 国債証券 | 2.8750 | 2,000    | 1,957    | 312,988   | 2025/06/15 |
| US T N/B 4.0 06/30/28   | 国債証券 | 4.0000 | 2,800    | 2,764    | 441,980   | 2028/06/30 |
| US T N/B 4.125 06/15/26 | 国債証券 | 4.1250 | 2,500    | 2,472    | 395,367   | 2026/06/15 |
| US T N/B 4.625 06/30/25 | 国債証券 | 4.6250 | 1,000    | 995      | 159,132   | 2025/06/30 |
| US T N/B 3.75 06/30/30  | 国債証券 | 3.7500 | 2,500    | 2,431    | 388,723   | 2030/06/30 |
| US T N/B 2.875 07/31/25 | 国債証券 | 2.8750 | 1,270    | 1,240    | 198,383   | 2025/07/31 |
| US T N/B 1.875 07/31/26 | 国債証券 | 1.8750 | 2,000    | 1,889    | 302,054   | 2026/07/31 |
| US T N/B 1.0 07/31/28   | 国債証券 | 1,0000 | 4,470    | 3,913    | 625,707   | 2028/07/31 |
| US T N/B 0.375 07/31/27 | 国債証券 | 0.3750 | 3,100    | 2,737    | 437,682   | 2027/07/31 |
| US T N/B 4.0 07/31/30   | 国債証券 | 4,0000 | 1,500    | 1,478    | 236,372   | 2030/07/31 |
| US T N/B 0.25 07/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,500    | 1,424    | 227,674   | 2025/07/31 |
| US T N/B 2.625 07/31/29 | 国債証券 | 2.6250 | 3,100    | 2,866    | 458,281   | 2029/07/31 |
| US T N/B 4.125 07/31/28 | 国債証券 | 4.1250 | 3,300    | 3,273    | 523,368   | 2028/07/31 |
| US T N/B 0.625 07/31/26 | 国債証券 | 0.6250 | 4,180    | 3,845    | 614,834   | 2026/07/31 |
| US T N/B 2.75 07/31/27  | 国債証券 | 2.7500 | 2,650    | 2,520    | 402,919   | 2027/07/31 |
| US T N/B 4.5 07/15/26   | 国債証券 | 4,5000 | 3,400    | 3,387    | 541,585   | 2026/07/15 |
| US T N/B 4.75 07/31/25  | 国債証券 | 4.7500 | 1,400    | 1,395    | 223,150   | 2025/07/31 |
| US T N/B 3.75 08/15/41  | 国債証券 | 3.7500 | 1,500    | 1,379    | 220,503   | 2041/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/40 | 国債証券 | 3.8750 | 700      | 660      | 105,568   | 2040/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 1,480    | 1,160    | 185,480   | 2042/08/15 |
| US T N/B 3.125 08/15/44 | 国債証券 | 3.1250 | 2,000    | 1,629    | 260,454   | 2044/08/15 |
| US T N/B 4.5 08/15/39   | 国債証券 | 4,5000 | 530      | 540      | 86,434    | 2039/08/15 |
| US T N/B 3.625 08/15/43 | 国債証券 | 3.6250 | 800      | 708      | 113,212   | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/51   | 国債証券 | 2,0000 | 3,800    | 2,343    | 374,636   | 2051/08/15 |

| 銘柄                      | 種類   | 利 率    | 額面金額     | 期        |           | 末償還年月日     |
|-------------------------|------|--------|----------|----------|-----------|------------|
|                         |      |        |          | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千アメリカ・ドル | 千円        |            |
| US T N/B 4.125 08/15/53 | 国債証券 | 4.1250 | 3,950    | 3,769    | 602,712   | 2053/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/45 | 国債証券 | 2.8750 | 1,500    | 1,161    | 185,766   | 2045/08/15 |
| US T N/B 2.0 08/15/25   | 国債証券 | 2.0000 | 1,800    | 1,740    | 278,228   | 2025/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/47  | 国債証券 | 2.7500 | 2,700    | 2,011    | 321,564   | 2047/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/49  | 国債証券 | 2.2500 | 2,790    | 1,850    | 295,796   | 2049/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/52   | 国債証券 | 3.0000 | 2,600    | 2,006    | 320,761   | 2052/08/15 |
| US T N/B 4.375 08/15/43 | 国債証券 | 4.3750 | 2,700    | 2,651    | 423,995   | 2043/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/46  | 国債証券 | 2.2500 | 2,100    | 1,432    | 229,003   | 2046/08/15 |
| US T N/B 3.0 08/15/48   | 国債証券 | 3,0000 | 2,210    | 1,716    | 274,407   | 2048/08/15 |
| US T N/B 2.25 08/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 2,600    | 2,433    | 389,025   | 2027/08/15 |
| US T N/B 1.5 08/15/26   | 国債証券 | 1.5000 | 3,730    | 3,491    | 558,299   | 2026/08/15 |
| US T N/B 2.875 08/15/28 | 国債証券 | 2.8750 | 5,400    | 5,099    | 815,260   | 2028/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/31/25  | 国債証券 | 2.7500 | 1,000    | 973      | 155,714   | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.625 08/15/29 | 国債証券 | 1.6250 | 2,800    | 2,463    | 393,786   | 2029/08/15 |
| US T N/B 3.375 08/15/42 | 国債証券 | 3.3750 | 2,800    | 2,409    | 385,165   | 2042/08/15 |
| US T N/B 1.75 08/15/41  | 国債証券 | 1.7500 | 3,700    | 2,498    | 399,381   | 2041/08/15 |
| US T N/B 1.125 08/15/40 | 国債証券 | 1.1250 | 3,260    | 2,028    | 324,360   | 2040/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/15/50 | 国債証券 | 1.3750 | 3,500    | 1,842    | 294,544   | 2050/08/15 |
| US T N/B 2.75 08/15/32  | 国債証券 | 2.7500 | 7,580    | 6,800    | 1,087,269 | 2032/08/15 |
| US T N/B 3.875 08/15/33 | 国債証券 | 3.8750 | 5,400    | 5,242    | 838,193   | 2033/08/15 |
| US T N/B 1.25 08/15/31  | 国債証券 | 1.2500 | 6,000    | 4,898    | 783,199   | 2031/08/15 |
| US T N/B 0.625 08/15/30 | 国債証券 | 0.6250 | 6,090    | 4,904    | 784,184   | 2030/08/15 |
| US T N/B 1.375 08/31/26 | 国債証券 | 1.3750 | 1,750    | 1,632    | 260,958   | 2026/08/31 |
| US T N/B 0.25 08/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,500    | 1,418    | 226,789   | 2025/08/31 |
| US T N/B 1.125 08/31/28 | 国債証券 | 1.1250 | 3,770    | 3,310    | 529,323   | 2028/08/31 |
| US T N/B 0.5 08/31/27   | 国債証券 | 0.5000 | 2,900    | 2,563    | 409,924   | 2027/08/31 |
| US T N/B 0.75 08/31/26  | 国債証券 | 0.7500 | 3,680    | 3,385    | 541,266   | 2026/08/31 |
| US T N/B 3.125 08/31/29 | 国債証券 | 3.1250 | 2,700    | 2,555    | 408,625   | 2029/08/31 |
| US T N/B 4.125 08/31/30 | 国債証券 | 4.1250 | 2,500    | 2,480    | 396,530   | 2030/08/31 |
| US T N/B 3.125 08/31/27 | 国債証券 | 3.1250 | 3,000    | 2,883    | 460,979   | 2027/08/31 |
| US T N/B 4.375 08/31/28 | 国債証券 | 4.3750 | 3,500    | 3,505    | 560,399   | 2028/08/31 |
| US T N/B 4.375 08/15/26 | 国債証券 | 4.3750 | 3,700    | 3,678    | 588,066   | 2026/08/15 |
| US T N/B 3.0 09/30/25   | 国債証券 | 3,0000 | 2,000    | 1,951    | 312,053   | 2025/09/30 |
| US T N/B 0.375 09/30/27 | 国債証券 | 0.3750 | 2,820    | 2,475    | 395,860   | 2027/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/30/30 | 国債証券 | 4.6250 | 2,500    | 2,547    | 407,373   | 2030/09/30 |
| US T N/B 1.625 09/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 4,000    | 3,745    | 598,800   | 2026/09/30 |
| US T N/B 1.25 09/30/28  | 国債証券 | 1.2500 | 4,250    | 3,744    | 598,747   | 2028/09/30 |
| US T N/B 0.25 09/30/25  | 国債証券 | 0.2500 | 1,300    | 1,225    | 195,876   | 2025/09/30 |
| US T N/B 4.125 09/30/27 | 国債証券 | 4.1250 | 2,380    | 2,358    | 377,006   | 2027/09/30 |
| US T N/B 0.875 09/30/26 | 国債証券 | 0.8750 | 3,310    | 3,047    | 487,259   | 2026/09/30 |
| US T N/B 3.5 09/15/25   | 国債証券 | 3,5000 | 2,500    | 2,455    | 392,549   | 2025/09/15 |
| US T N/B 3.875 09/30/29 | 国債証券 | 3.8750 | 3,000    | 2,942    | 470,459   | 2029/09/30 |
| US T N/B 5.0 09/30/25   | 国債証券 | 5,0000 | 2,500    | 2,500    | 399,731   | 2025/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/30/28 | 国債証券 | 4.6250 | 3,000    | 3,034    | 485,120   | 2028/09/30 |
| US T N/B 4.625 09/15/26 | 国債証券 | 4.6250 | 3,500    | 3,498    | 559,339   | 2026/09/15 |
| US T N/B 3.0 10/31/25   | 国債証券 | 3,0000 | 500      | 487      | 77,925    | 2025/10/31 |
| US T N/B 1.625 10/31/26 | 国債証券 | 1.6250 | 1,330    | 1,242    | 198,685   | 2026/10/31 |
| US T N/B 1.375 10/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 3,600    | 3,183    | 508,916   | 2028/10/31 |
| US T N/B 4.875 10/31/30 | 国債証券 | 4.8750 | 2,500    | 2,583    | 413,064   | 2030/10/31 |
| US T N/B 0.5 10/31/27   | 国債証券 | 0.5000 | 3,000    | 2,637    | 421,624   | 2027/10/31 |
| US T N/B 1.125 10/31/26 | 国債証券 | 1.1250 | 3,270    | 3,019    | 482,780   | 2026/10/31 |
| US T N/B 4.875 10/31/28 | 国債証券 | 4.8750 | 3,500    | 3,576    | 571,755   | 2028/10/31 |
| US T N/B 4.0 10/31/29   | 国債証券 | 4,0000 | 2,900    | 2,861    | 457,476   | 2029/10/31 |
| US T N/B 4.125 10/31/27 | 国債証券 | 4.1250 | 1,500    | 1,485    | 237,576   | 2027/10/31 |

| 銘柄                      | 種類   | 利 率    | 額面金額     | 期     |           | 末償還年月日     |
|-------------------------|------|--------|----------|-------|-----------|------------|
|                         |      |        |          | 外貨建金額 | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千円    |           |            |
| US T N/B 0.25 10/31/25  | 国債証券 | 0.2500 | 2,000    | 1,878 | 300,362   | 2025/10/31 |
| US T N/B 4.625 10/15/26 | 国債証券 | 4.6250 | 4,000    | 4,000 | 639,607   | 2026/10/15 |
| US T N/B 4.25 10/15/25  | 国債証券 | 4.2500 | 570      | 564   | 90,307    | 2025/10/15 |
| US T N/B 5.0 10/31/25   | 国債証券 | 5,0000 | 1,000    | 1,000 | 159,973   | 2025/10/31 |
| US T N/B 3.0 11/15/44   | 国債証券 | 3,0000 | 1,500    | 1,194 | 190,961   | 2044/11/15 |
| US T N/B 4.25 11/15/40  | 国債証券 | 4.2500 | 300      | 295   | 47,252    | 2040/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/42  | 国債証券 | 2.7500 | 1,500    | 1,171 | 187,350   | 2042/11/15 |
| US T N/B 4.75 11/15/53  | 国債証券 | 4.7500 | 4,830    | 5,116 | 818,070   | 2053/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/41 | 国債証券 | 3.1250 | 580      | 486   | 77,857    | 2041/11/15 |
| US T N/B 3.75 11/15/43  | 国債証券 | 3.7500 | 2,000    | 1,800 | 287,858   | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.75 11/15/47  | 国債証券 | 2.7500 | 1,700    | 1,264 | 202,148   | 2047/11/15 |
| US T N/B 1.625 11/15/50 | 国債証券 | 1.6250 | 4,300    | 2,419 | 386,897   | 2050/11/15 |
| US T N/B 1.875 11/15/51 | 国債証券 | 1.8750 | 4,400    | 2,624 | 419,582   | 2051/11/15 |
| US T N/B 4.0 11/15/52   | 国債証券 | 4,0000 | 4,170    | 3,892 | 622,283   | 2052/11/15 |
| US T N/B 3.0 11/15/45   | 国債証券 | 3,0000 | 1,000    | 790   | 126,336   | 2045/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/15/46 | 国債証券 | 2.8750 | 1,650    | 1,266 | 202,447   | 2046/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/15/39 | 国債証券 | 4.3750 | 700      | 703   | 112,517   | 2039/11/15 |
| US T N/B 3.375 11/15/48 | 国債証券 | 3.3750 | 2,350    | 1,952 | 312,234   | 2048/11/15 |
| US T N/B 2.375 11/15/49 | 国債証券 | 2.3750 | 2,880    | 1,961 | 313,594   | 2049/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/25  | 国債証券 | 2.2500 | 1,500    | 1,446 | 231,295   | 2025/11/15 |
| US T N/B 3.125 11/15/28 | 国債証券 | 3.1250 | 3,710    | 3,532 | 564,829   | 2028/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/26   | 国債証券 | 2,0000 | 3,900    | 3,673 | 587,240   | 2026/11/15 |
| US T N/B 2.25 11/15/27  | 国債証券 | 2.2500 | 2,440    | 2,274 | 363,599   | 2027/11/15 |
| US T N/B 2.875 11/30/25 | 国債証券 | 2.8750 | 1,140    | 1,108 | 177,161   | 2025/11/30 |
| US T N/B 4.0 11/15/42   | 国債証券 | 4,0000 | 2,000    | 1,875 | 299,849   | 2042/11/15 |
| US T N/B 1.375 11/15/40 | 国債証券 | 1.3750 | 3,930    | 2,532 | 404,879   | 2040/11/15 |
| US T N/B 4.75 11/15/43  | 国債証券 | 4.7500 | 2,500    | 2,578 | 412,190   | 2043/11/15 |
| US T N/B 2.0 11/15/41   | 国債証券 | 2,0000 | 3,200    | 2,243 | 358,750   | 2041/11/15 |
| US T N/B 1.625 11/30/26 | 国債証券 | 1.6250 | 1,600    | 1,492 | 238,610   | 2026/11/30 |
| US T N/B 4.125 11/15/32 | 国債証券 | 4.1250 | 7,700    | 7,631 | 1,220,135 | 2032/11/15 |
| US T N/B 1.75 11/15/29  | 国債証券 | 1.7500 | 2,000    | 1,762 | 281,863   | 2029/11/15 |
| US T N/B 4.5 11/15/33   | 国債証券 | 4.5000 | 7,800    | 7,944 | 1,270,154 | 2033/11/15 |
| US T N/B 1.375 11/15/31 | 国債証券 | 1.3750 | 6,000    | 4,912 | 785,354   | 2031/11/15 |
| US T N/B 0.875 11/15/30 | 国債証券 | 0.8750 | 6,890    | 5,602 | 895,716   | 2030/11/15 |
| US T N/B 0.625 11/30/27 | 国債証券 | 0.6250 | 4,300    | 3,786 | 605,429   | 2027/11/30 |
| US T N/B 1.25 11/30/26  | 国債証券 | 1.2500 | 5,150    | 4,759 | 761,017   | 2026/11/30 |
| US T N/B 1.5 11/30/28   | 国債証券 | 1.5000 | 4,340    | 3,851 | 615,831   | 2028/11/30 |
| US T N/B 4.375 11/30/30 | 国債証券 | 4.3750 | 2,700    | 2,716 | 434,281   | 2030/11/30 |
| US T N/B 3.875 11/30/29 | 国債証券 | 3.8750 | 2,600    | 2,549 | 407,650   | 2029/11/30 |
| US T N/B 3.875 11/30/27 | 国債証券 | 3.8750 | 2,900    | 2,850 | 455,755   | 2027/11/30 |
| US T N/B 4.5 11/15/25   | 国債証券 | 4,5000 | 1,700    | 1,690 | 270,224   | 2025/11/15 |
| US T N/B 4.375 11/30/28 | 国債証券 | 4.3750 | 4,300    | 4,312 | 689,417   | 2028/11/30 |
| US T N/B 4.625 11/15/26 | 国債証券 | 4.6250 | 4,010    | 4,013 | 641,657   | 2026/11/15 |
| US T N/B 4.875 11/30/25 | 国債証券 | 4.8750 | 2,000    | 1,998 | 319,572   | 2025/11/30 |
| US T N/B 2.625 12/31/25 | 国債証券 | 2.6250 | 1,400    | 1,354 | 216,522   | 2025/12/31 |
| US T N/B 1.75 12/31/26  | 国債証券 | 1.7500 | 900      | 840   | 134,426   | 2026/12/31 |
| US T N/B 3.75 12/31/30  | 国債証券 | 3.7500 | 2,390    | 2,320 | 371,067   | 2030/12/31 |
| US T N/B 1.25 12/31/26  | 国債証券 | 1.2500 | 3,830    | 3,533 | 565,003   | 2026/12/31 |
| US T N/B 1.375 12/31/28 | 国債証券 | 1.3750 | 3,300    | 2,906 | 464,652   | 2028/12/31 |
| US T N/B 0.375 12/31/25 | 国債証券 | 0.3750 | 1,080    | 1,009 | 161,413   | 2025/12/31 |
| US T N/B 3.875 12/31/29 | 国債証券 | 3.8750 | 2,500    | 2,451 | 391,893   | 2029/12/31 |
| US T N/B 0.625 12/31/27 | 国債証券 | 0.6250 | 3,360    | 2,950 | 471,683   | 2027/12/31 |
| US T N/B 4.375 12/15/26 | 国債証券 | 4.3750 | 3,970    | 3,952 | 631,859   | 2026/12/15 |
| US T N/B 4.0 12/15/25   | 国債証券 | 4,0000 | 1,900    | 1,875 | 299,915   | 2025/12/15 |

| 銘柄                       | 種類   | 利 率    | 額面金額        | 当期      |             | 末償還年月日     |
|--------------------------|------|--------|-------------|---------|-------------|------------|
|                          |      |        |             | 外貨建金額   | 邦貨換算金額      |            |
| (アメリカ)                   |      | %      | 千アメリカ・ドル    | 千円      |             |            |
| US T N/B 3.875 12/31/27  | 国債証券 | 3.8750 | 2,800       | 2,752   | 440,039     | 2027/12/31 |
| US T N/B 4.25 12/31/25   | 国債証券 | 4.2500 | 1,000       | 990     | 158,399     | 2025/12/31 |
| US T N/B 3.75 12/31/28   | 国債証券 | 3.7500 | 3,700       | 3,616   | 578,188     | 2028/12/31 |
| 小計                       | -    | -      | 803,782     | 728,330 | 116,445,459 | -          |
| (カナダ)                    |      | %      | 千カナダ・ドル     | 千円      |             |            |
| CANADA 4.5 02/01/26      | 国債証券 | 4.5000 | 2,300       | 2,317   | 270,474     | 2026/02/01 |
| CANADA 0.25 03/01/26     | 国債証券 | 0.2500 | 1,550       | 1,458   | 170,267     | 2026/03/01 |
| CANADA 1.25 03/01/27     | 国債証券 | 1.2500 | 1,850       | 1,739   | 203,033     | 2027/03/01 |
| CANADA 3.5 03/01/34      | 国債証券 | 3.5000 | 400         | 406     | 47,399      | 2034/03/01 |
| CANADA 3.5 03/01/28      | 国債証券 | 3.5000 | 1,100       | 1,102   | 128,643     | 2028/03/01 |
| CANADA 4.0 03/01/29      | 国債証券 | 4.0000 | 1,700       | 1,746   | 203,877     | 2029/03/01 |
| CANADA 3.0 04/01/26      | 国債証券 | 3.0000 | 650         | 640     | 74,713      | 2026/04/01 |
| CANADA 4.0 05/01/26      | 国債証券 | 4.0000 | 1,920       | 1,923   | 224,519     | 2026/05/01 |
| CANADA 1.5 06/01/26      | 国債証券 | 1.5000 | 600         | 574     | 67,070      | 2026/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/29     | 国債証券 | 5.7500 | 550         | 611     | 71,358      | 2029/06/01 |
| CANADA 5.75 06/01/33     | 国債証券 | 5.7500 | 1,000       | 1,185   | 138,331     | 2033/06/01 |
| CANADA 5.0 06/01/37      | 国債証券 | 5.0000 | 500         | 585     | 68,353      | 2037/06/01 |
| CANADA 4.0 06/01/41      | 国債証券 | 4.0000 | 450         | 487     | 56,958      | 2041/06/01 |
| CANADA 2.0 06/01/28      | 国債証券 | 2.0000 | 380         | 361     | 42,155      | 2028/06/01 |
| CANADA 1.0 06/01/27      | 国債証券 | 1.0000 | 710         | 660     | 77,134      | 2027/06/01 |
| CANADA 2.25 06/01/29     | 国債証券 | 2.2500 | 260         | 248     | 28,969      | 2029/06/01 |
| CANADA 1.25 06/01/30     | 国債証券 | 1.2500 | 2,320       | 2,064   | 241,013     | 2030/06/01 |
| CANADA 2.75 06/01/33     | 国債証券 | 2.7500 | 1,000       | 955     | 111,517     | 2033/06/01 |
| CANADA 3.0 06/01/34      | 国債証券 | 3.0000 | 1,650       | 1,603   | 187,150     | 2034/06/01 |
| CANADA 1.5 06/01/31      | 国債証券 | 1.5000 | 2,550       | 2,264   | 264,283     | 2031/06/01 |
| CANADA 2.0 06/01/32      | 国債証券 | 2.0000 | 1,300       | 1,180   | 137,766     | 2032/06/01 |
| CANADA 3.5 08/01/25      | 国債証券 | 3.5000 | 1,000       | 991     | 115,785     | 2025/08/01 |
| CANADA 4.0 08/01/26      | 国債証券 | 4.0000 | 1,500       | 1,506   | 175,812     | 2026/08/01 |
| CANADA 0.5 09/01/25      | 国債証券 | 0.5000 | 1,000       | 958     | 111,880     | 2025/09/01 |
| CANADA 2.75 09/01/27     | 国債証券 | 2.7500 | 1,100       | 1,075   | 125,542     | 2027/09/01 |
| CANADA 1.0 09/01/26      | 国債証券 | 1.0000 | 1,010       | 952     | 111,150     | 2026/09/01 |
| CANADA 3.25 09/01/28     | 国債証券 | 3.2500 | 1,000       | 994     | 116,056     | 2028/09/01 |
| CANADA 3.5 09/01/29      | 国債証券 | 3.5000 | 300         | 302     | 35,272      | 2029/09/01 |
| CANADA 4.5 11/01/25      | 国債証券 | 4.5000 | 200         | 200     | 23,459      | 2025/11/01 |
| CANADA 3.5 12/01/45      | 国債証券 | 3.5000 | 660         | 678     | 79,188      | 2045/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/48     | 国債証券 | 2.7500 | 550         | 500     | 58,398      | 2048/12/01 |
| CANADA 2.0 12/01/51      | 国債証券 | 2.0000 | 2,520       | 1,935   | 225,962     | 2051/12/01 |
| CANADA 1.75 12/01/53     | 国債証券 | 1.7500 | 2,450       | 1,749   | 204,166     | 2053/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/64     | 国債証券 | 2.7500 | 340         | 305     | 35,619      | 2064/12/01 |
| CANADA 2.75 12/01/55     | 国債証券 | 2.7500 | 900         | 810     | 94,581      | 2055/12/01 |
| CANADA 3.25 12/01/33     | 国債証券 | 3.2500 | 1,200       | 1,191   | 139,098     | 2033/12/01 |
| CANADA 0.5 12/01/30      | 国債証券 | 0.5000 | 1,770       | 1,484   | 173,307     | 2030/12/01 |
| CANADA 1.5 12/01/31      | 国債証券 | 1.5000 | 1,700       | 1,496   | 174,718     | 2031/12/01 |
| CANADA 2.5 12/01/32      | 国債証券 | 2.5000 | 1,120       | 1,052   | 122,837     | 2032/12/01 |
| CANADA 2.25 12/01/29     | 国債証券 | 2.2500 | 500         | 475     | 55,529      | 2029/12/01 |
| 小計                       | -    | -      | 45,560      | 42,777  | 4,993,362   | -          |
| (オーストラリア)                |      | %      | 千オーストラリア・ドル | 千円      |             |            |
| AUSTRALIAN 3.0 03/21/47  | 国債証券 | 3.0000 | 1,030       | 797     | 84,709      | 2047/03/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 04/21/27 | 国債証券 | 4.7500 | 1,640       | 1,676   | 177,953     | 2027/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.25 04/21/26 | 国債証券 | 4.2500 | 1,280       | 1,285   | 136,447     | 2026/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 04/21/29 | 国債証券 | 3.2500 | 1,250       | 1,212   | 128,734     | 2029/04/21 |
| AUSTRALIAN 4.5 04/21/33  | 国債証券 | 4.5000 | 1,310       | 1,340   | 142,351     | 2033/04/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 04/21/37 | 国債証券 | 3.7500 | 830         | 784     | 83,296      | 2037/04/21 |
| AUSTRALIAN 2.25 05/21/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,200       | 1,128   | 119,795     | 2028/05/21 |

| 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 |           |            |
| (オーストラリア)                 |      | %      | 千オーストラリア・ドル  | 千円     |           |            |
| AUSTRALIAN 2.5 05/21/30   | 国債証券 | 2.5000 | 1,940        | 1,788  | 189,881   | 2030/05/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 05/21/41  | 国債証券 | 2.7500 | 650          | 515    | 54,763    | 2041/05/21 |
| AUSTRALIAN 1.25 05/21/32  | 国債証券 | 1.2500 | 2,050        | 1,654  | 175,618   | 2032/05/21 |
| AUSTRALIAN 3.75 05/21/34  | 国債証券 | 3.7500 | 1,800        | 1,733  | 184,021   | 2034/05/21 |
| AUSTRALIAN 4.75 06/21/54  | 国債証券 | 4.7500 | 470          | 482    | 51,197    | 2054/06/21 |
| AUSTRALIAN 3.25 06/21/39  | 国債証券 | 3.2500 | 930          | 812    | 86,273    | 2039/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.5 06/21/31   | 国債証券 | 1.5000 | 1,170        | 988    | 104,939   | 2031/06/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 06/21/35  | 国債証券 | 2.7500 | 1,100        | 956    | 101,503   | 2035/06/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 06/21/51  | 国債証券 | 1.7500 | 1,280        | 716    | 76,092    | 2051/06/21 |
| AUSTRALIAN 0.5 09/21/26   | 国債証券 | 0.5000 | 2,220        | 2,057  | 218,393   | 2026/09/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/28  | 国債証券 | 2.7500 | 1,050        | 1,001  | 106,276   | 2028/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/27  | 国債証券 | 2.7500 | 1,220        | 1,175  | 124,775   | 2027/11/21 |
| AUSTRALIAN 2.75 11/21/29  | 国債証券 | 2.7500 | 1,090        | 1,026  | 108,966   | 2029/11/21 |
| AUSTRALIAN 3.0 11/21/33   | 国債証券 | 3.0000 | 1,200        | 1,089  | 115,641   | 2033/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.75 11/21/32  | 国債証券 | 1.7500 | 1,800        | 1,493  | 158,577   | 2032/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 11/21/31   | 国債証券 | 1.0000 | 1,970        | 1,582  | 168,042   | 2031/11/21 |
| AUSTRALIAN 0.25 11/21/25  | 国債証券 | 0.2500 | 600          | 568    | 60,328    | 2025/11/21 |
| AUSTRALIAN 1.0 12/21/30   | 国債証券 | 1.0000 | 1,110        | 919    | 97,604    | 2030/12/21 |
| AUSTRALIAN 3.5 12/21/34   | 国債証券 | 3.5000 | 1,180        | 1,107  | 117,572   | 2034/12/21 |
| 小計                        | —    | —      | 33,370       | 29,895 | 3,173,758 | —          |
| (シンガポール)                  |      | %      | 千シンガポール・ドル   | 千円     |           |            |
| SINGAPORE 3.5 03/01/27    | 国債証券 | 3.5000 | 800          | 804    | 94,942    | 2027/03/01 |
| SINGAPORE 2.75 03/01/46   | 国債証券 | 2.7500 | 560          | 527    | 62,180    | 2046/03/01 |
| SINGAPORE 1.875 03/01/50  | 国債証券 | 1.8750 | 400          | 313    | 36,948    | 2050/03/01 |
| SINGAPORE 3.0 04/01/29    | 国債証券 | 3.0000 | 200          | 198    | 23,416    | 2029/04/01 |
| SINGAPORE 2.625 05/01/28  | 国債証券 | 2.6250 | 560          | 548    | 64,669    | 2028/05/01 |
| SINGAPORE 2.375 06/01/25  | 国債証券 | 2.3750 | 448          | 442    | 52,258    | 2025/06/01 |
| SINGAPORE 2.125 06/01/26  | 国債証券 | 2.1250 | 860          | 839    | 99,019    | 2026/06/01 |
| SINGAPORE 2.875 07/01/29  | 国債証券 | 2.8750 | 310          | 305    | 36,066    | 2029/07/01 |
| SINGAPORE 2.375 07/01/39  | 国債証券 | 2.3750 | 390          | 352    | 41,612    | 2039/07/01 |
| SINGAPORE 1.625 07/01/31  | 国債証券 | 1.6250 | 750          | 677    | 79,895    | 2031/07/01 |
| SINGAPORE 3.0 08/01/72    | 国債証券 | 3.0000 | 427          | 419    | 49,466    | 2072/08/01 |
| SINGAPORE 2.25 08/01/36   | 国債証券 | 2.2500 | 420          | 381    | 45,063    | 2036/08/01 |
| SINGAPORE 2.625 08/01/32  | 国債証券 | 2.6250 | 350          | 336    | 39,675    | 2032/08/01 |
| SINGAPORE 2.875 08/01/28  | 国債証券 | 2.8750 | 100          | 98     | 11,655    | 2028/08/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/30  | 国債証券 | 2.8750 | 450          | 442    | 52,173    | 2030/09/01 |
| SINGAPORE 3.375 09/01/33  | 国債証券 | 3.3750 | 600          | 609    | 71,949    | 2033/09/01 |
| SINGAPORE 2.875 09/01/27  | 国債証券 | 2.8750 | 200          | 197    | 23,339    | 2027/09/01 |
| SINGAPORE 1.875 10/01/51  | 国債証券 | 1.8750 | 530          | 410    | 48,396    | 2051/10/01 |
| SINGAPORE 1.25 11/01/26   | 国債証券 | 1.2500 | 650          | 619    | 73,073    | 2026/11/01 |
| SINGAPORE 0.5 11/01/25    | 国債証券 | 0.5000 | 140          | 134    | 15,856    | 2025/11/01 |
| 小計                        | —    | —      | 9,145        | 8,660  | 1,021,658 | —          |
| (ニュージーランド)                |      | %      | 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 | 550          | 548    | 53,639    | 2027/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.5 04/14/33  | 国債証券 | 3.5000 | 770          | 710    | 69,464    | 2033/04/14 |
| NEW ZEALAND 2.75 04/15/37 | 国債証券 | 2.7500 | 410          | 330    | 32,325    | 2037/04/15 |
| NEW ZEALAND 3.0 04/20/29  | 国債証券 | 3.0000 | 430          | 403    | 39,415    | 2029/04/20 |
| NEW ZEALAND 2.75 05/15/51 | 国債証券 | 2.7500 | 540          | 364    | 35,686    | 2051/05/15 |
| NEW ZEALAND 5.0 05/15/54  | 国債証券 | 5.0000 | 220          | 221    | 21,614    | 2054/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.75 05/15/41 | 国債証券 | 1.7500 | 420          | 268    | 26,229    | 2041/05/15 |
| NEW ZEALAND 1.5 05/15/31  | 国債証券 | 1.5000 | 500          | 411    | 40,222    | 2031/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.25 05/15/34 | 国債証券 | 4.2500 | 450          | 436    | 42,727    | 2034/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.5 05/15/35  | 国債証券 | 4.5000 | 280          | 275    | 26,971    | 2035/05/15 |
| NEW ZEALAND 2.0 05/15/32  | 国債証券 | 2.0000 | 740          | 616    | 60,252    | 2032/05/15 |

| 銘柄                         | 当期   |        |              |        | 末       |            |
|----------------------------|------|--------|--------------|--------|---------|------------|
|                            | 種類   | 利率     | 額面金額         | 評価額    | 償還年月日   |            |
|                            |      |        | 外貨建金額        | 邦貨換算金額 |         |            |
| (ニュージーランド)                 |      | %      | 千ニュージーランド・ドル | 千円     |         |            |
| NEW ZEALAND 0.25 05/15/28  | 国債証券 | 0.2500 | 740          | 628    | 61,504  | 2028/05/15 |
| NEW ZEALAND 0.5 05/15/26   | 国債証券 | 0.5000 | 570          | 526    | 51,459  | 2026/05/15 |
| NEW ZEALAND 4.5 05/15/30   | 国債証券 | 4.5000 | 340          | 340    | 33,305  | 2030/05/15 |
| 小計                         | -    | -      | 6,960        | 6,082  | 594,820 | -          |
| (イギリス)                     |      | %      | 千イギリス・ポンド    | 千円     |         |            |
| UK TREASURY 3.25 01/22/44  | 国債証券 | 3.2500 | 1,050        | 877    | 177,316 | 2044/01/22 |
| UK TREASURY 3.5 01/22/45   | 国債証券 | 3.5000 | 1,320        | 1,136  | 229,770 | 2045/01/22 |
| UK TREASURY 4.0 01/22/60   | 国債証券 | 4.0000 | 1,000        | 911    | 184,237 | 2060/01/22 |
| UK TREASURY 1.75 01/22/49  | 国債証券 | 1.7500 | 530          | 312    | 63,164  | 2049/01/22 |
| UK TREASURY 3.75 01/29/38  | 国債証券 | 3.7500 | 1,800        | 1,697  | 343,199 | 2038/01/29 |
| UK TREASURY 0.875 01/31/46 | 国債証券 | 0.8750 | 810          | 405    | 82,065  | 2046/01/31 |
| UK TREASURY 1.125 01/31/39 | 国債証券 | 1.1250 | 1,600        | 1,045  | 211,453 | 2039/01/31 |
| UK TREASURY 4.625 01/31/34 | 国債証券 | 4.6250 | 1,850        | 1,930  | 390,228 | 2034/01/31 |
| UK TREASURY 1.0 01/31/32   | 国債証券 | 1,0000 | 1,800        | 1,453  | 293,856 | 2032/01/31 |
| UK TREASURY 3.25 01/31/33  | 国債証券 | 3.2500 | 2,250        | 2,125  | 429,654 | 2033/01/31 |
| UK TREASURY 0.5 01/31/29   | 国債証券 | 0.5000 | 1,850        | 1,586  | 320,652 | 2029/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/31/28 | 国債証券 | 0.1250 | 1,180        | 1,029  | 208,085 | 2028/01/31 |
| UK TREASURY 0.125 01/30/26 | 国債証券 | 0.1250 | 1,000        | 938    | 189,688 | 2026/01/30 |
| UK TREASURY 4.125 01/29/27 | 国債証券 | 4.1250 | 2,350        | 2,340  | 473,208 | 2027/01/29 |
| UK TREASURY 4.25 03/07/36  | 国債証券 | 4.2500 | 1,050        | 1,057  | 213,695 | 2036/03/07 |
| UK TREASURY 3.75 03/07/27  | 国債証券 | 3.7500 | 1,000        | 985    | 199,277 | 2027/03/07 |
| UK TREASURY 4.25 06/07/32  | 国債証券 | 4.2500 | 1,400        | 1,429  | 288,976 | 2032/06/07 |
| UK TREASURY 0.625 06/07/25 | 国債証券 | 0.6250 | 700          | 674    | 136,332 | 2025/06/07 |
| UK TREASURY 4.5 06/07/28   | 国債証券 | 4.5000 | 1,930        | 1,959  | 396,202 | 2028/06/07 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/47   | 国債証券 | 1,5000 | 1,500        | 851    | 172,157 | 2047/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/31/51  | 国債証券 | 1.2500 | 1,330        | 653    | 132,184 | 2051/07/31 |
| UK TREASURY 3.75 07/22/52  | 国債証券 | 3.7500 | 970          | 846    | 171,179 | 2052/07/22 |
| UK TREASURY 1.5 07/31/53   | 国債証券 | 1,5000 | 1,490        | 763    | 154,382 | 2053/07/31 |
| UK TREASURY 1.75 07/22/57  | 国債証券 | 1.7500 | 1,000        | 533    | 107,835 | 2057/07/22 |
| UK TREASURY 2.5 07/22/65   | 国債証券 | 2.5000 | 870          | 554    | 112,075 | 2065/07/22 |
| UK TREASURY 3.5 07/22/68   | 国債証券 | 3.5000 | 1,000        | 822    | 166,244 | 2068/07/22 |
| UK TREASURY 4.375 07/31/54 | 国債証券 | 4.3750 | 1,000        | 966    | 195,457 | 2054/07/31 |
| UK TREASURY 1.5 07/22/26   | 国債証券 | 1,5000 | 1,840        | 1,742  | 352,202 | 2026/07/22 |
| UK TREASURY 1.25 07/22/27  | 国債証券 | 1.2500 | 910          | 837    | 169,396 | 2027/07/22 |
| UK TREASURY 0.875 07/31/33 | 国債証券 | 0.8750 | 2,000        | 1,521  | 307,686 | 2033/07/31 |
| UK TREASURY 0.25 07/31/31  | 国債証券 | 0.2500 | 1,850        | 1,433  | 289,763 | 2031/07/31 |
| UK TREASURY 0.625 07/31/35 | 国債証券 | 0.6250 | 1,500        | 1,035  | 209,274 | 2035/07/31 |
| UK TREASURY 4.125 07/22/29 | 国債証券 | 4.1250 | 500          | 502    | 101,626 | 2029/07/22 |
| UK TREASURY 4.25 09/07/39  | 国債証券 | 4.2500 | 920          | 906    | 183,169 | 2039/09/07 |
| UK TREASURY 2.0 09/07/25   | 国債証券 | 2,0000 | 670          | 649    | 131,350 | 2025/09/07 |
| UK TREASURY 4.5 09/07/34   | 国債証券 | 4.5000 | 1,000        | 1,032  | 208,760 | 2034/09/07 |
| UK TREASURY 1.75 09/07/37  | 国債証券 | 1.7500 | 1,200        | 898    | 181,637 | 2037/09/07 |
| UK TREASURY 3.75 10/22/53  | 国債証券 | 3.7500 | 1,920        | 1,666  | 336,928 | 2053/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/54 | 国債証券 | 1.6250 | 1,100        | 577    | 116,753 | 2054/10/22 |
| UK TREASURY 0.5 10/22/61   | 国債証券 | 0.5000 | 670          | 203    | 41,148  | 2061/10/22 |
| UK TREASURY 4.0 10/22/63   | 国債証券 | 4.0000 | 850          | 770    | 155,862 | 2063/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/71 | 国債証券 | 1.6250 | 1,350        | 625    | 126,502 | 2071/10/22 |
| UK TREASURY 1.125 10/22/73 | 国債証券 | 1.1250 | 920          | 339    | 68,576  | 2073/10/22 |
| UK TREASURY 1.25 10/22/41  | 国債証券 | 1.2500 | 1,530        | 945    | 191,128 | 2041/10/22 |
| UK TREASURY 0.625 10/22/50 | 国債証券 | 0.6250 | 1,350        | 549    | 111,019 | 2050/10/22 |
| UK TREASURY 4.75 10/22/43  | 国債証券 | 4.7500 | 900          | 925    | 187,193 | 2043/10/22 |
| UK TREASURY 1.625 10/22/28 | 国債証券 | 1.6250 | 800          | 728    | 147,268 | 2028/10/22 |
| UK TREASURY 0.875 10/22/29 | 国債証券 | 0.8750 | 900          | 772    | 156,103 | 2029/10/22 |
| UK TREASURY 4.0 10/22/31   | 国債証券 | 4.0000 | 800          | 800    | 161,788 | 2031/10/22 |

| 銘柄                              | 当期   |        |              |        | 末          |            |
|---------------------------------|------|--------|--------------|--------|------------|------------|
|                                 | 種類   | 利率     | 額面金額         | 評価額    | 償還年月日      |            |
|                                 |      |        | 外貨建金額        | 邦貨換算金額 |            |            |
| (イギリス)                          |      | %      | 千イギリス・ポンド    | 千円     |            |            |
| UK TREASURY 0.375 10/22/30      | 国債証券 | 0.3750 | 1,250        | 1,006  | 203,542    | 2030/10/22 |
| UK TREASURY 0.375 10/22/26      | 国債証券 | 0.3750 | 2,050        | 1,878  | 379,762    | 2026/10/22 |
| UK TREASURY 3.5 10/22/25        | 国債証券 | 3.5000 | 1,350        | 1,329  | 268,802    | 2025/10/22 |
| UK TREASURY 6.0 12/07/28        | 国債証券 | 6,0000 | 900          | 975    | 197,167    | 2028/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/38       | 国債証券 | 4.7500 | 960          | 1,002  | 202,735    | 2038/12/07 |
| UK TREASURY 4.5 12/07/42        | 国債証券 | 4.5000 | 1,420        | 1,421  | 287,425    | 2042/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/46       | 国債証券 | 4.2500 | 1,260        | 1,206  | 243,823    | 2046/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/55       | 国債証券 | 4.2500 | 800          | 759    | 153,605    | 2055/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/27       | 国債証券 | 4.2500 | 1,000        | 1,007  | 203,682    | 2027/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/40       | 国債証券 | 4.2500 | 1,300        | 1,272  | 257,249    | 2040/12/07 |
| UK TREASURY 4.75 12/07/30       | 国債証券 | 4.7500 | 1,400        | 1,466  | 296,534    | 2030/12/07 |
| UK TREASURY 4.25 12/07/49       | 国債証券 | 4.2500 | 1,050        | 1,000  | 202,352    | 2049/12/07 |
| 小計                              | —    | —      | 75,850       | 63,681 | 12,874,413 | —          |
| (イスラエル)                         |      | %      | 千イスラエル・シェケル  | 千円     |            |            |
| ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42  | 国債証券 | 5.5000 | 1,155        | 1,210  | 51,526     | 2042/01/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26  | 国債証券 | 0.5000 | 2,300        | 2,159  | 91,921     | 2026/02/27 |
| ISRAEL FIXED BOND 02/28/29      | 国債証券 | 3.7500 | 1,050        | 1,015  | 43,217     | 2029/02/28 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47 | 国債証券 | 3.7500 | 1,780        | 1,432  | 60,980     | 2047/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 03/30/35      | 国債証券 | 4.0000 | 620          | 576    | 24,539     | 2035/03/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27  | 国債証券 | 2.0000 | 1,800        | 1,689  | 71,916     | 2027/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30  | 国債証券 | 1.0000 | 2,410        | 1,977  | 84,201     | 2030/03/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32  | 国債証券 | 1.3000 | 1,870        | 1,456  | 61,988     | 2032/04/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37  | 国債証券 | 1.5000 | 1,985        | 1,338  | 56,965     | 2037/05/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25 | 国債証券 | 1.7500 | 530          | 514    | 21,922     | 2025/08/31 |
| ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28 | 国債証券 | 2.2500 | 1,800        | 1,644  | 70,022     | 2028/09/28 |
| ISRAEL FIXED BOND 3.75 09/30/27 | 国債証券 | 3.7500 | 1,000        | 977    | 41,617     | 2027/09/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26 | 国債証券 | 6,2500 | 830          | 864    | 36,794     | 2026/10/30 |
| ISRAEL FIXED BOND 11/29/52      | 国債証券 | 2.8000 | 1,090        | 689    | 29,365     | 2052/11/29 |
| 小計                              | —    | —      | 20,220       | 17,545 | 746,980    | —          |
| (デンマーク)                         |      | %      | 千デンマーク・クローネ  | 千円     |            |            |
| DENMARK 0.25 11/15/52           | 国債証券 | 0.2500 | 4,130        | 2,235  | 51,235     | 2052/11/15 |
| DENMARK 4.5 11/15/39            | 国債証券 | 4.5000 | 6,640        | 8,209  | 188,169    | 2039/11/15 |
| DENMARK 1.75 11/15/25           | 国債証券 | 1.7500 | 4,250        | 4,186  | 95,950     | 2025/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/27            | 国債証券 | 0.5000 | 3,620        | 3,392  | 77,745     | 2027/11/15 |
| DENMARK 0.5 11/15/29            | 国債証券 | 0.5000 | 3,540        | 3,214  | 73,680     | 2029/11/15 |
| DENMARK 0.0 11/15/31            | 国債証券 | 0.0000 | 3,310        | 2,791  | 63,981     | 2031/11/15 |
| DENMARK 2.25 11/15/33           | 国債証券 | 2.2500 | 3,250        | 3,201  | 73,377     | 2033/11/15 |
| 小計                              | —    | —      | 28,740       | 27,231 | 624,139    | —          |
| (ノルウェー)                         |      | %      | 千ノルウェー・クローネ  | 千円     |            |            |
| NORWAY 1.5 02/19/26             | 国債証券 | 1.5000 | 3,600        | 3,459  | 52,305     | 2026/02/19 |
| NORWAY 1.75 02/17/27            | 国債証券 | 1.7500 | 3,350        | 3,187  | 48,201     | 2027/02/17 |
| NORWAY 2.0 04/26/28             | 国債証券 | 2.0000 | 2,560        | 2,415  | 36,516     | 2028/04/26 |
| NORWAY 3.625 04/13/34           | 国債証券 | 3.6250 | 1,790        | 1,801  | 27,246     | 2034/04/13 |
| NORWAY 2.125 05/18/32           | 国債証券 | 2.1250 | 2,850        | 2,567  | 38,817     | 2032/05/18 |
| NORWAY 1.375 08/19/30           | 国債証券 | 1.3750 | 2,910        | 2,558  | 38,688     | 2030/08/19 |
| NORWAY 3.0 08/15/33             | 国債証券 | 3.0000 | 3,890        | 3,718  | 56,226     | 2033/08/15 |
| NORWAY 1.75 09/06/29            | 国債証券 | 1.7500 | 3,220        | 2,945  | 44,530     | 2029/09/06 |
| NORWAY 1.25 09/17/31            | 国債証券 | 1.2500 | 2,620        | 2,233  | 33,773     | 2031/09/17 |
| NORWAY 3.5 10/06/42             | 国債証券 | 3.5000 | 1,570        | 1,583  | 23,941     | 2042/10/06 |
| 小計                              | —    | —      | 28,360       | 26,471 | 400,247    | —          |
| (スウェーデン)                        |      | %      | 千スウェーデン・クローネ | 千円     |            |            |
| SWEDEN 3.5 03/30/39             | 国債証券 | 3.5000 | 2,740        | 3,139  | 47,756     | 2039/03/30 |
| SWEDEN 0.75 05/12/28            | 国債証券 | 0.7500 | 4,480        | 4,230  | 64,344     | 2028/05/12 |
| SWEDEN 0.125 05/12/31           | 国債証券 | 0.1250 | 4,200        | 3,650  | 55,528     | 2031/05/12 |

| 銘柄                                  | 種類   | 利 率     | 額面金額         | 当期         |           | 末償還年月日     |
|-------------------------------------|------|---------|--------------|------------|-----------|------------|
|                                     |      |         |              | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |            |
| (スウェーデン)                            |      | %       | 千スウェーデン・クローナ | 千円         |           |            |
| SWEDEN 2.25 06/01/32                | 国債証券 | 2.2500  | 2,600        | 2,606      | 39,642    | 2032/06/01 |
| SWEDEN 1.0 11/12/26                 | 国債証券 | 1.0000  | 5,100        | 4,938      | 75,121    | 2026/11/12 |
| SWEDEN 0.75 11/12/29                | 国債証券 | 0.7500  | 4,090        | 3,820      | 58,112    | 2029/11/12 |
| SWEDEN 1.75 11/11/33                | 国債証券 | 1.7500  | 4,170        | 4,008      | 60,975    | 2033/11/11 |
| 小計                                  | —    | —       | 27,380       | 26,395     | 401,481   | —          |
| (メキシコ)                              |      | %       | 千メキシコ・ペソ     | 千円         |           |            |
| MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26         | 国債証券 | 5.7500  | 24,150       | 22,316     | 197,128   | 2026/03/05 |
| MEXICAN BONDS 03/04/27              | 国債証券 | 5.5000  | 27,200       | 24,190     | 213,680   | 2027/03/04 |
| MEXICAN BONDS 03/01/29              | 国債証券 | 8.5000  | 8,000        | 7,495      | 66,208    | 2029/03/01 |
| MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29          | 国債証券 | 8.5000  | 19,201       | 18,016     | 159,143   | 2029/05/31 |
| MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31         | 国債証券 | 7.7500  | 25,080       | 22,248     | 196,527   | 2031/05/29 |
| MEXICAN BONDS 05/24/35              | 国債証券 | 8.0000  | 2,000        | 1,747      | 15,439    | 2035/05/24 |
| MEXICAN BONDS 05/26/33              | 国債証券 | 7.5000  | 18,780       | 16,061     | 141,876   | 2033/05/26 |
| MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27          | 国債証券 | 7.5000  | 24,730       | 22,958     | 202,797   | 2027/06/03 |
| MEXICAN BONDS 07/31/53              | 国債証券 | 8.0000  | 18,650       | 15,041     | 132,862   | 2053/07/31 |
| MEXICAN BONDS 09/03/26              | 国債証券 | 7.0000  | 15,000       | 13,919     | 122,958   | 2026/09/03 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42         | 国債証券 | 7.7500  | 20,220       | 16,300     | 143,984   | 2042/11/13 |
| MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47          | 国債証券 | 8.0000  | 18,596       | 15,153     | 133,858   | 2047/11/07 |
| MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38          | 国債証券 | 8.5000  | 16,300       | 14,401     | 127,208   | 2038/11/18 |
| MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36         | 国債証券 | 10.0000 | 4,700        | 4,710      | 41,613    | 2036/11/20 |
| MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34         | 国債証券 | 7.7500  | 6,191        | 5,315      | 46,951    | 2034/11/23 |
| 小計                                  | —    | —       | 248,798      | 219,876    | 1,942,239 | —          |
| (中国)                                |      | %       | 千オフショア・人民元   | 千オフショア・人民元 | 千円        |            |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27 | 国債証券 | 2.3700  | 5,000        | 5,061      | 110,991   | 2027/01/20 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/15/29 | 国債証券 | 2.3700  | 50,000       | 50,765     | 1,113,127 | 2029/01/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.35 02/25/34 | 国債証券 | 2.3500  | 58,500       | 58,881     | 1,291,078 | 2034/02/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33 | 国債証券 | 2.8800  | 15,000       | 15,737     | 345,082   | 2033/02/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.04 02/25/27 | 国債証券 | 2.0400  | 79,500       | 79,859     | 1,751,065 | 2027/02/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 | 国債証券 | 3.0300  | 40,200       | 41,123     | 901,712   | 2026/03/11 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/25/31 | 国債証券 | 2.2800  | 15,000       | 15,101     | 331,136   | 2031/03/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30  | 国債証券 | 2.8000  | 58,000       | 60,127     | 1,318,419 | 2030/03/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 03/15/26 | 国債証券 | 1.9900  | 50,000       | 50,225     | 1,101,278 | 2026/03/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52 | 国債証券 | 3.3200  | 7,900        | 9,168      | 201,040   | 2052/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51 | 国債証券 | 3.7200  | 4,300        | 5,305      | 116,327   | 2051/04/12 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53 | 国債証券 | 3.1900  | 1,000        | 1,139      | 24,978    | 2053/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 04/15/28 | 国債証券 | 2.6200  | 4,500        | 4,602      | 100,922   | 2028/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27 | 国債証券 | 2.4800  | 4,400        | 4,473      | 98,082    | 2027/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.05 04/15/29 | 国債証券 | 2.0500  | 7,000        | 7,007      | 153,647   | 2029/04/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31 | 国債証券 | 3.0200  | 18,500       | 19,546     | 428,594   | 2031/05/27 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32 | 国債証券 | 2.7600  | 2,300        | 2,387      | 52,344    | 2032/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33 | 国債証券 | 2.6700  | 18,000       | 18,545     | 406,649   | 2033/05/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28 | 国債証券 | 3.0100  | 32,000       | 33,295     | 730,070   | 2028/05/13 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.69 05/17/28 | 国債証券 | 3.6900  | 30,000       | 32,212     | 706,329   | 2028/05/17 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30 | 国債証券 | 2.6800  | 34,500       | 35,539     | 779,265   | 2030/05/21 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26  | 国債証券 | 2.3000  | 42,500       | 42,925     | 941,232   | 2026/05/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27 | 国債証券 | 2.8500  | 58,000       | 59,642     | 1,307,769 | 2027/06/04 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29 | 国債証券 | 2.7500  | 6,100        | 6,302      | 138,201   | 2029/06/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26 | 国債証券 | 3.2500  | 6,700        | 6,904      | 151,400   | 2026/06/06 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49 | 国債証券 | 3.8600  | 29,500       | 36,892     | 808,931   | 2049/07/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28  | 国債証券 | 2.4000  | 15,000       | 15,226     | 333,859   | 2028/07/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27  | 国債証券 | 2.5000  | 30,500       | 31,044     | 680,711   | 2027/07/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32 | 国債証券 | 2.6900  | 10,500       | 10,845     | 237,813   | 2032/08/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.52 08/25/33 | 国債証券 | 2.5200  | 18,500       | 18,864     | 413,636   | 2033/08/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26 | 国債証券 | 2.6900  | 38,000       | 38,731     | 849,261   | 2026/08/12 |

| 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   | 千円           |            |            |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26 | 国債証券 | 2.1800 | 48,500       | 48,884       | 1,071,886  | 2026/08/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50 | 国債証券 | 3.8100 | 23,500       | 29,314       | 642,781    | 2050/09/14 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32  | 国債証券 | 2.6000 | 10,000       | 10,264       | 225,060    | 2032/09/01 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30  | 国債証券 | 2.6000 | 18,000       | 18,467       | 404,945    | 2030/09/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 09/25/28 | 国債証券 | 2.4800 | 2,500        | 2,546        | 55,842     | 2028/09/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29 | 国債証券 | 2.6200 | 12,000       | 12,321       | 270,183    | 2029/09/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.0 10/15/53  | 国債証券 | 3.0000 | 19,000       | 21,049       | 461,543    | 2053/10/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52 | 国債証券 | 3.1200 | 4,000        | 4,487        | 98,391     | 2052/10/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51 | 国債証券 | 3.5300 | 10,500       | 12,589       | 276,039    | 2051/10/18 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48 | 国債証券 | 4.0800 | 4,000        | 5,162        | 113,205    | 2048/10/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.55 10/15/28 | 国債証券 | 2.5500 | 10,000       | 10,220       | 224,100    | 2028/10/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25 | 国債証券 | 3.0200 | 11,500       | 11,711       | 256,806    | 2025/10/22 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31 | 国債証券 | 2.8900 | 7,000        | 7,339        | 160,927    | 2031/11/18 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 11/25/33 | 国債証券 | 2.6700 | 24,100       | 24,892       | 545,808    | 2033/11/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25 | 国債証券 | 2.2800 | 4,500        | 4,536        | 99,475     | 2025/11/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26 | 国債証券 | 2.3900 | 17,000       | 17,218       | 377,551    | 2026/11/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30 | 国債証券 | 2.5400 | 15,500       | 15,863       | 347,838    | 2030/12/25 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29 | 国債証券 | 2.7900 | 14,000       | 14,497       | 317,884    | 2029/12/15 |
| CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27 | 国債証券 | 3.2800 | 16,500       | 17,311       | 379,585    | 2027/12/03 |
| 小計                                  | -    | -      | 1,063,000    | 1,106,167    | 24,254,822 | -          |
| (マレーシア)                             |      | %      | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円         |            |
| MALAYSIA 3.892 03/15/27             | 国債証券 | 3.8920 | 870          | 878          | 29,776     | 2027/03/15 |
| MALAYSIA 4.457 03/31/53             | 国債証券 | 4.4570 | 900          | 933          | 31,662     | 2053/03/31 |
| MALAYSIA 4.736 03/15/46             | 国債証券 | 4.7360 | 700          | 754          | 25,575     | 2046/03/15 |
| MALAYSIA 4.392 04/15/26             | 国債証券 | 4.3920 | 500          | 508          | 17,238     | 2026/04/15 |
| MALAYSIA 4.498 04/15/30             | 国債証券 | 4.4980 | 2,100        | 2,184        | 74,059     | 2030/04/15 |
| MALAYSIA 3.844 04/15/33             | 国債証券 | 3.8440 | 710          | 708          | 24,032     | 2033/04/15 |
| MALAYSIA 4.762 04/07/37             | 国債証券 | 4.7620 | 1,200        | 1,291        | 43,791     | 2037/04/07 |
| MALAYSIA 4.054 04/18/39             | 国債証券 | 4.0540 | 700          | 702          | 23,837     | 2039/04/18 |
| MALAYSIA 2.632 04/15/31             | 国債証券 | 2.6320 | 1,300        | 1,209        | 41,029     | 2031/04/15 |
| MALAYSIA 3.519 04/20/28             | 国債証券 | 3.5190 | 500          | 498          | 16,900     | 2028/04/20 |
| MALAYSIA 4.504 04/30/29             | 国債証券 | 4.5040 | 520          | 539          | 18,301     | 2029/04/30 |
| MALAYSIA 3.502 05/31/27             | 国債証券 | 3.5020 | 1,900        | 1,897        | 64,357     | 2027/05/31 |
| MALAYSIA 3.757 05/22/40             | 国債証券 | 3.7570 | 1,500        | 1,446        | 49,038     | 2040/05/22 |
| MALAYSIA 4.254 05/31/35             | 国債証券 | 4.2540 | 1,050        | 1,078        | 36,560     | 2035/05/31 |
| MALAYSIA 3.733 06/15/28             | 国債証券 | 3.7330 | 1,400        | 1,406        | 47,684     | 2028/06/15 |
| MALAYSIA 4.232 06/30/31             | 国債証券 | 4.2320 | 800          | 821          | 27,845     | 2031/06/30 |
| MALAYSIA 4.893 06/08/38             | 国債証券 | 4.8930 | 1,330        | 1,455        | 49,342     | 2038/06/08 |
| MALAYSIA 4.065 06/15/50             | 国債証券 | 4.0650 | 1,430        | 1,395        | 47,312     | 2050/06/15 |
| MALAYSIA 4.921 07/06/48             | 国債証券 | 4.9210 | 1,180        | 1,306        | 44,289     | 2048/07/06 |
| MALAYSIA 3.906 07/15/26             | 国債証券 | 3.9060 | 970          | 978          | 33,194     | 2026/07/15 |
| MALAYSIA 3.828 07/05/34             | 国債証券 | 3.8280 | 2,000        | 1,994        | 67,619     | 2034/07/05 |
| MALAYSIA 3.582 07/15/32             | 国債証券 | 3.5820 | 900          | 883          | 29,965     | 2032/07/15 |
| MALAYSIA 3.885 08/15/29             | 国債証券 | 3.8850 | 1,630        | 1,647        | 55,872     | 2029/08/15 |
| MALAYSIA 3.955 09/15/25             | 国債証券 | 3.9550 | 500          | 503          | 17,086     | 2025/09/15 |
| MALAYSIA 4.935 09/30/43             | 国債証券 | 4.9350 | 700          | 772          | 26,185     | 2043/09/30 |
| MALAYSIA 4.696 10/15/42             | 国債証券 | 4.6960 | 1,600        | 1,719        | 58,297     | 2042/10/15 |
| MALAYSIA 3.9 11/30/26               | 国債証券 | 3.9000 | 1,590        | 1,606        | 54,466     | 2026/11/30 |
| MALAYSIA 3.899 11/16/27             | 国債証券 | 3.8990 | 1,300        | 1,314        | 44,580     | 2027/11/16 |
| MALAYSIA 4.642 11/07/33             | 国債証券 | 4.6420 | 2,220        | 2,353        | 79,804     | 2033/11/07 |
| 小計                                  | -    | -      | 34,000       | 34,790       | 1,179,711  | -          |
| (ポーランド)                             |      | %      | 千ポーランド・ズロチ   | 千円           |            |            |
| POLAND 5.75 04/25/29                | 国債証券 | 5.7500 | 2,700        | 2,724        | 107,655    | 2029/04/25 |
| POLAND 2.75 04/25/28                | 国債証券 | 2.7500 | 1,810        | 1,648        | 65,143     | 2028/04/25 |

| 銘柄                        | 種類   | 利 率    | 額面金額       | 期      |           | 末償還年月日     |
|---------------------------|------|--------|------------|--------|-----------|------------|
|                           |      |        |            | 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 | 千円     |           |            |
| POLAND 1.75 04/25/32      | 国債証券 | 1.7500 | 1,900      | 1,440  | 56,919    | 2032/04/25 |
| POLAND 04/25/26           | 国債証券 | 0.0000 | 1,700      | 1,553  | 61,378    | 2026/04/25 |
| POLAND 3.75 05/25/27      | 国債証券 | 3.7500 | 2,470      | 2,369  | 93,608    | 2027/05/25 |
| POLAND 2.5 07/25/26       | 国債証券 | 2.5000 | 2,690      | 2,551  | 100,830   | 2026/07/25 |
| POLAND 3.25 07/25/25      | 国債証券 | 3.2500 | 900        | 884    | 34,954    | 2025/07/25 |
| POLAND 2.5 07/25/27       | 国債証券 | 2.5000 | 3,250      | 2,994  | 118,307   | 2027/07/25 |
| POLAND 7.5 07/25/28       | 国債証券 | 7.5000 | 2,800      | 3,005  | 118,761   | 2028/07/25 |
| POLAND 4.75 07/25/29      | 国債証券 | 4.7500 | 2,200      | 2,124  | 83,928    | 2029/07/25 |
| POLAND 2.75 10/25/29      | 国債証券 | 2.7500 | 3,000      | 2,622  | 103,622   | 2029/10/25 |
| POLAND 6.0 10/25/33       | 国債証券 | 6.0000 | 3,660      | 3,742  | 147,867   | 2033/10/25 |
| POLAND 1.25 10/25/30      | 国債証券 | 1.2500 | 2,300      | 1,779  | 70,311    | 2030/10/25 |
| POLAND 0.25 10/25/26      | 国債証券 | 0.2500 | 2,980      | 2,663  | 105,233   | 2026/10/25 |
| POLAND 10/25/25           | 国債証券 | 0.0000 | 1,000      | 938    | 37,067    | 2025/10/25 |
| 小計                        | —    | —      | 35,360     | 33,043 | 1,305,589 | —          |
| (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 | 630        | 523    | 89,423    | 2045/02/18 |
| IRISH 1.35 03/18/31       | 国債証券 | 1.3500 | 300        | 275    | 47,074    | 2031/03/18 |
| IRISH 0.55 04/22/41       | 国債証券 | 0.5500 | 240        | 160    | 27,393    | 2041/04/22 |
| IRISH 1.5 05/15/50        | 国債証券 | 1.5000 | 565        | 400    | 68,460    | 2050/05/15 |
| IRISH 1.3 05/15/33        | 国債証券 | 1.3000 | 620        | 547    | 93,682    | 2033/05/15 |
| IRISH 2.4 05/15/30        | 国債証券 | 2.4000 | 730        | 717    | 122,714   | 2030/05/15 |
| IRISH 0.9 05/15/28        | 国債証券 | 0.9000 | 650        | 607    | 103,920   | 2028/05/15 |
| IRISH 1.1 05/15/29        | 国債証券 | 1.1000 | 500        | 464    | 79,356    | 2029/05/15 |
| IRISH 1.0 05/15/26        | 国債証券 | 1.0000 | 510        | 492    | 84,152    | 2026/05/15 |
| IRISH 1.7 05/15/37        | 国債証券 | 1.7000 | 350        | 301    | 51,530    | 2037/05/15 |
| IRISH 0.4 05/15/35        | 国債証券 | 0.4000 | 450        | 345    | 59,049    | 2035/05/15 |
| IRISH 0.2 05/15/27        | 国債証券 | 0.2000 | 650        | 604    | 103,348   | 2027/05/15 |
| IRISH 3.0 10/18/43        | 国債証券 | 3.0000 | 300        | 294    | 50,314    | 2043/10/18 |
| IRISH 0.0 10/18/31        | 国債証券 | 0.0000 | 430        | 352    | 60,269    | 2031/10/18 |
| IRISH 0.35 10/18/32       | 国債証券 | 0.3500 | 530        | 435    | 74,462    | 2032/10/18 |
| IRISH 2.6 10/18/34        | 国債証券 | 2.6000 | 250        | 243    | 41,671    | 2034/10/18 |
| IRISH 0.2 10/18/30        | 国債証券 | 0.2000 | 400        | 342    | 58,591    | 2030/10/18 |
| 小計                        | —    | —      | 8,105      | 7,109  | 1,215,416 | —          |
| (ユーロ…オランダ)                |      | %      | 千ユーロ       | 千ユーロ   | 千円        |            |
| NETHERLANDS 3.75 01/15/42 | 国債証券 | 3.7500 | 1,200      | 1,343  | 229,611   | 2042/01/15 |
| NETHERLANDS 2.75 01/15/47 | 国債証券 | 2.7500 | 1,330      | 1,312  | 224,387   | 2047/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/52  | 国債証券 | 0.0000 | 1,420      | 675    | 115,504   | 2052/01/15 |
| NETHERLANDS 5.5 01/15/28  | 国債証券 | 5.5000 | 1,020      | 1,119  | 191,468   | 2028/01/15 |
| NETHERLANDS 4.0 01/15/37  | 国債証券 | 4.0000 | 800        | 900    | 153,864   | 2037/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/33  | 国債証券 | 2.5000 | 820        | 809    | 138,370   | 2033/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/38  | 国債証券 | 0.0000 | 900        | 612    | 104,752   | 2038/01/15 |
| NETHERLANDS 0.5 01/15/40  | 国債証券 | 0.5000 | 970        | 685    | 117,221   | 2040/01/15 |
| NETHERLANDS 2.0 01/15/54  | 国債証券 | 2.0000 | 790        | 661    | 113,105   | 2054/01/15 |
| NETHERLANDS 3.25 01/15/44 | 国債証券 | 3.2500 | 350        | 369    | 63,105    | 2044/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/29  | 国債証券 | 0.0000 | 700        | 622    | 106,355   | 2029/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/27  | 国債証券 | 0.0000 | 1,540      | 1,437  | 245,786   | 2027/01/15 |
| NETHERLANDS 2.5 01/15/30  | 国債証券 | 2.5000 | 800        | 794    | 135,754   | 2030/01/15 |
| NETHERLANDS 0.0 01/15/26  | 国債証券 | 0.0000 | 500        | 478    | 81,728    | 2026/01/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/26  | 国債証券 | 0.5000 | 1,650      | 1,575  | 269,347   | 2026/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/25 | 国債証券 | 0.2500 | 900        | 873    | 149,343   | 2025/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/28 | 国債証券 | 0.7500 | 1,310      | 1,216  | 207,992   | 2028/07/15 |
| NETHERLANDS 0.75 07/15/27 | 国債証券 | 0.7500 | 1,000      | 944    | 161,475   | 2027/07/15 |
| NETHERLANDS 0.25 07/15/29 | 国債証券 | 0.2500 | 700        | 622    | 106,470   | 2029/07/15 |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/30  | 国債証券 | 0.0000 | 1,100      | 940    | 160,788   | 2030/07/15 |

| 銘柄                       | 種類   | 利 率    | 額面金額   | 当期     |           | 末償還年月日     |
|--------------------------|------|--------|--------|--------|-----------|------------|
|                          |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
| (ユーロ…オランダ)               |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| NETHERLANDS 0.0 07/15/31 | 国債証券 | 0.0000 | 880    | 732    | 125,305   | 2031/07/15 |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/33 | 国債証券 | 2.5000 | 1,000  | 982    | 167,998   | 2033/07/15 |
| NETHERLANDS 0.5 07/15/32 | 国債証券 | 0.5000 | 700    | 591    | 101,086   | 2032/07/15 |
| NETHERLANDS 2.5 07/15/34 | 国債証券 | 2.5000 | 700    | 683    | 116,883   | 2034/07/15 |
| 小計                       | -    | -      | 23,080 | 20,985 | 3,587,708 | -          |
| (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 | 1,360  | 1,488  | 254,442   | 2028/03/28 |
| BELGIUM 4.25 03/28/41    | 国債証券 | 4.2500 | 750    | 833    | 142,530   | 2041/03/28 |
| BELGIUM 4.5 03/28/26     | 国債証券 | 4.5000 | 1,580  | 1,618  | 276,676   | 2026/03/28 |
| BELGIUM 4.0 03/28/32     | 国債証券 | 4.0000 | 650    | 697    | 119,254   | 2032/03/28 |
| BELGIUM 5.0 03/28/35     | 国債証券 | 5.0000 | 1,380  | 1,614  | 275,956   | 2035/03/28 |
| BELGIUM 1.25 04/22/33    | 国債証券 | 1.2500 | 900    | 783    | 133,890   | 2033/04/22 |
| BELGIUM 2.75 04/22/39    | 国債証券 | 2.7500 | 400    | 374    | 63,998    | 2039/04/22 |
| BELGIUM 3.75 06/22/45    | 国債証券 | 3.7500 | 600    | 627    | 107,196   | 2045/06/22 |
| BELGIUM 1.6 06/22/47     | 国債証券 | 1.6000 | 500    | 354    | 60,544    | 2047/06/22 |
| BELGIUM 1.7 06/22/50     | 国債証券 | 1.7000 | 610    | 424    | 72,610    | 2050/06/22 |
| BELGIUM 1.4 06/22/53     | 国債証券 | 1.4000 | 580    | 359    | 61,489    | 2053/06/22 |
| BELGIUM 3.3 06/22/54     | 国債証券 | 3.3000 | 720    | 685    | 117,235   | 2054/06/22 |
| BELGIUM 2.25 06/22/57    | 国債証券 | 2.2500 | 450    | 340    | 58,202    | 2057/06/22 |
| BELGIUM 2.15 06/22/66    | 国債証券 | 2.1500 | 530    | 388    | 66,380    | 2066/06/22 |
| BELGIUM 0.65 06/22/71    | 国債証券 | 0.6500 | 520    | 214    | 36,685    | 2071/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/26     | 国債証券 | 1.0000 | 1,000  | 961    | 164,418   | 2026/06/22 |
| BELGIUM 3.5 06/22/55     | 国債証券 | 3.5000 | 450    | 442    | 75,673    | 2055/06/22 |
| BELGIUM 1.0 06/22/31     | 国債証券 | 1.0000 | 850    | 750    | 128,320   | 2031/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/28     | 国債証券 | 0.8000 | 1,000  | 922    | 157,710   | 2028/06/22 |
| BELGIUM 0.4 06/22/40     | 国債証券 | 0.4000 | 930    | 594    | 101,557   | 2040/06/22 |
| BELGIUM 0.9 06/22/29     | 国債証券 | 0.9000 | 1,150  | 1,049  | 179,498   | 2029/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/34     | 国債証券 | 3.0000 | 640    | 637    | 109,053   | 2034/06/22 |
| BELGIUM 1.9 06/22/38     | 国債証券 | 1.9000 | 700    | 592    | 101,369   | 2038/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/25     | 国債証券 | 0.8000 | 600    | 585    | 100,067   | 2025/06/22 |
| BELGIUM 0.8 06/22/27     | 国債証券 | 0.8000 | 1,170  | 1,101  | 188,352   | 2027/06/22 |
| BELGIUM 1.45 06/22/37    | 国債証券 | 1.4500 | 500    | 407    | 69,625    | 2037/06/22 |
| BELGIUM 3.45 06/22/43    | 国債証券 | 3.4500 | 500    | 501    | 85,797    | 2043/06/22 |
| BELGIUM 0.1 06/22/30     | 国債証券 | 0.1000 | 900    | 765    | 130,953   | 2030/06/22 |
| BELGIUM 3.0 06/22/33     | 国債証券 | 3.0000 | 1,300  | 1,301  | 222,495   | 2033/06/22 |
| BELGIUM 0.35 06/22/32    | 国債証券 | 0.3500 | 1,100  | 898    | 153,566   | 2032/06/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/31     | 国債証券 | 0.0000 | 800    | 649    | 110,990   | 2031/10/22 |
| BELGIUM 2.85 10/22/34    | 国債証券 | 2.8500 | 500    | 490    | 83,883    | 2034/10/22 |
| BELGIUM 0.0 10/22/27     | 国債証券 | 0.0000 | 750    | 683    | 116,852   | 2027/10/22 |
| BELGIUM 2.7 10/22/29     | 国債証券 | 2.7000 | 400    | 397    | 67,982    | 2029/10/22 |
| 小計                       | -    | -      | 26,770 | 24,539 | 4,195,262 | -          |
| (ユーロ…フランス)               |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |            |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/27  | 国債証券 | 0.0000 | 2,900  | 2,679  | 458,110   | 2027/02/25 |
| FRANCE OAT 0.0 02/25/26  | 国債証券 | 0.0000 | 3,300  | 3,133  | 535,763   | 2026/02/25 |
| FRANCE OAT 0.75 02/25/28 | 国債証券 | 0.7500 | 2,730  | 2,523  | 431,429   | 2028/02/25 |
| FRANCE OAT 2.75 02/25/29 | 国債証券 | 2.7500 | 2,700  | 2,675  | 457,460   | 2029/02/25 |
| FRANCE OAT 3.5 04/25/26  | 国債証券 | 3.5000 | 2,320  | 2,335  | 399,313   | 2026/04/25 |
| FRANCE OAT 4.5 04/25/41  | 国債証券 | 4.5000 | 2,510  | 2,842  | 485,900   | 2041/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/55  | 国債証券 | 4.0000 | 1,350  | 1,447  | 247,445   | 2055/04/25 |
| FRANCE OAT 4.0 04/25/60  | 国債証券 | 4.0000 | 1,200  | 1,300  | 222,252   | 2060/04/25 |
| FRANCE OAT 5.5 04/25/29  | 国債証券 | 5.5000 | 2,690  | 2,990  | 511,205   | 2029/04/25 |
| FRANCE OAT 4.75 04/25/35 | 国債証券 | 4.7500 | 1,680  | 1,912  | 326,993   | 2035/04/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/45 | 国債証券 | 3.2500 | 2,500  | 2,406  | 411,434   | 2045/05/25 |
| FRANCE OAT 2.0 05/25/48  | 国債証券 | 2.0000 | 1,650  | 1,243  | 212,612   | 2048/05/25 |

| 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 1.5 05/25/50    | 国債証券 | 1.5000 | 1,870   | 1,227   | 209,889    | 2050/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/52   | 国債証券 | 0.7500 | 2,000   | 1,024   | 175,072    | 2052/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/53   | 国債証券 | 0.7500 | 1,950   | 975     | 166,738    | 2053/05/25 |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/54    | 国債証券 | 3,0000 | 1,650   | 1,466   | 250,722    | 2054/05/25 |
| FRANCE OAT 3.25 05/25/55   | 国債証券 | 3,2500 | 800     | 743     | 127,085    | 2055/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 05/25/66   | 国債証券 | 1.7500 | 1,500   | 951     | 162,686    | 2066/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/72    | 国債証券 | 0.5000 | 530     | 193     | 33,136     | 2072/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/30    | 国債証券 | 2.5000 | 3,350   | 3,270   | 559,161    | 2030/05/25 |
| FRANCE OAT 0.75 05/25/28   | 国債証券 | 0.7500 | 4,200   | 3,863   | 660,481    | 2028/05/25 |
| FRANCE OAT 1.5 05/25/31    | 国債証券 | 1.5000 | 4,200   | 3,818   | 652,782    | 2031/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/29    | 国債証券 | 0.5000 | 3,980   | 3,542   | 605,635    | 2029/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/34   | 国債証券 | 1.2500 | 2,350   | 1,974   | 337,495    | 2034/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/26    | 国債証券 | 0.5000 | 3,530   | 3,362   | 574,906    | 2026/05/25 |
| FRANCE OAT 1.0 05/25/27    | 国債証券 | 1,0000 | 2,920   | 2,759   | 471,781    | 2027/05/25 |
| FRANCE OAT 0.5 05/25/40    | 国債証券 | 0.5000 | 1,610   | 1,038   | 177,589    | 2040/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/36   | 国債証券 | 1.2500 | 2,790   | 2,236   | 382,393    | 2036/05/25 |
| FRANCE OAT 1.25 05/25/38   | 国債証券 | 1.2500 | 1,550   | 1,185   | 202,715    | 2038/05/25 |
| FRANCE OAT 2.5 05/25/43    | 国債証券 | 2,5000 | 1,300   | 1,119   | 191,338    | 2043/05/25 |
| FRANCE OAT 3.0 05/25/33    | 国債証券 | 3,0000 | 2,100   | 2,082   | 356,072    | 2033/05/25 |
| FRANCE OAT 0.0 05/25/32    | 国債証券 | 0,0000 | 3,150   | 2,485   | 425,003    | 2032/05/25 |
| FRANCE OAT 1.75 06/25/39   | 国債証券 | 1.7500 | 2,110   | 1,712   | 292,749    | 2039/06/25 |
| FRANCE OAT 0.5 06/25/44    | 国債証券 | 0.5000 | 1,320   | 760     | 130,075    | 2044/06/25 |
| FRANCE OAT 3.0 06/25/49    | 国債証券 | 3,0000 | 800     | 730     | 124,852    | 2049/06/25 |
| FRANCE OAT 2.5 09/24/26    | 国債証券 | 2,5000 | 4,500   | 4,444   | 759,769    | 2026/09/24 |
| FRANCE OAT 2.5 09/24/27    | 国債証券 | 2,5000 | 2,500   | 2,462   | 420,947    | 2027/09/24 |
| FRANCE OAT 6.0 10/25/25    | 国債証券 | 6,0000 | 1,070   | 1,107   | 189,325    | 2025/10/25 |
| FRANCE OAT 2.75 10/25/27   | 国債証券 | 2,7500 | 3,790   | 3,760   | 642,935    | 2027/10/25 |
| FRANCE OAT 4.0 10/25/38    | 国債証券 | 4,0000 | 1,900   | 2,034   | 347,735    | 2038/10/25 |
| FRANCE OAT 5.75 10/25/32   | 国債証券 | 5,7500 | 1,710   | 2,040   | 348,797    | 2032/10/25 |
| FRANCE OAT 1.0 11/25/25    | 国債証券 | 1,0000 | 800     | 775     | 132,598    | 2025/11/25 |
| FRANCE OAT 0.25 11/25/26   | 国債証券 | 0,2500 | 2,930   | 2,742   | 468,817    | 2026/11/25 |
| FRANCE OAT 0.75 11/25/28   | 国債証券 | 0,7500 | 3,040   | 2,767   | 473,198    | 2028/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/31    | 国債証券 | 0,0000 | 3,300   | 2,650   | 453,090    | 2031/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/30    | 国債証券 | 0,0000 | 4,180   | 3,466   | 592,676    | 2030/11/25 |
| FRANCE OAT 2.0 11/25/32    | 国債証券 | 2,0000 | 3,600   | 3,318   | 567,336    | 2032/11/25 |
| FRANCE OAT 0.0 11/25/29    | 国債証券 | 0,0000 | 3,900   | 3,337   | 570,503    | 2029/11/25 |
| FRANCE OAT 3.5 11/25/33    | 国債証券 | 3,5000 | 4,000   | 4,114   | 703,344    | 2033/11/25 |
| 小計                         | —    | —      | 120,310 | 109,039 | 18,641,364 | —          |
| (ユーロ…ドイツ)                  |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ    | 千円         |            |
| DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28 | 国債証券 | 5,6250 | 1,500   | 1,654   | 282,773    | 2028/01/04 |
| DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30  | 国債証券 | 6,2500 | 800     | 955     | 163,435    | 2030/01/04 |
| DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31   | 国債証券 | 5,5000 | 1,290   | 1,526   | 260,963    | 2031/01/04 |
| DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37   | 国債証券 | 4,0000 | 2,050   | 2,373   | 405,781    | 2037/01/04 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26   | 国債証券 | 0,5000 | 3,100   | 2,984   | 510,207    | 2026/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29  | 国債証券 | 0,2500 | 1,550   | 1,407   | 240,685    | 2029/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28   | 国債証券 | 0,5000 | 1,710   | 1,595   | 272,795    | 2028/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27  | 国債証券 | 0,2500 | 2,200   | 2,071   | 354,147    | 2027/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.2 02/15/34   | 国債証券 | 2,2000 | 2,100   | 2,062   | 352,618    | 2034/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31   | 国債証券 | 0,0000 | 1,600   | 1,374   | 235,016    | 2031/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33   | 国債証券 | 2,3000 | 2,560   | 2,546   | 435,311    | 2033/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32   | 国債証券 | 0,0000 | 2,080   | 1,745   | 298,401    | 2032/02/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30   | 国債証券 | 0,0000 | 1,600   | 1,404   | 240,107    | 2030/02/15 |
| DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33   | 国債証券 | 2,3000 | 500     | 497     | 85,044     | 2033/02/15 |
| BUNDESSCHATZ 2.5 03/19/26  | 国債証券 | 2,5000 | 2,200   | 2,186   | 373,780    | 2026/03/19 |

| 銘柄                        | 当期   |        |        |        | 期末         |            |
|---------------------------|------|--------|--------|--------|------------|------------|
|                           | 種類   | 利率     | 額面金額   | 評価額    | 償還年月日      |            |
|                           |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| (ユーロ…ドイツ)                 |      |        |        |        |            |            |
| BUNDESOBL 2.2 04/13/28    | 国債証券 | 2.2000 | 1,240  | 1,228  | 209,965    | 2028/04/13 |
| BUNDESOBL 0.0 04/10/26    | 国債証券 | 0.0000 | 2,180  | 2,074  | 354,729    | 2026/04/10 |
| BUNDESOBL 0.0 04/16/27    | 国債証券 | 0.0000 | 1,290  | 1,201  | 205,433    | 2027/04/16 |
| BUNDESOBL 2.1 04/12/29    | 国債証券 | 2.1000 | 1,300  | 1,281  | 219,096    | 2029/04/12 |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35  | 国債証券 | 0.0000 | 1,520  | 1,166  | 199,402    | 2035/05/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38  | 国債証券 | 1.0000 | 1,850  | 1,514  | 258,846    | 2038/05/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36  | 国債証券 | 0.0000 | 1,700  | 1,267  | 216,639    | 2036/05/15 |
| BUNDESSCHAT 2.8 06/12/25  | 国債証券 | 2.8000 | 600    | 597    | 102,186    | 2025/06/12 |
| BUNDESSCHAT 2.9 06/18/26  | 国債証券 | 2.9000 | 1,000  | 1,001  | 171,284    | 2026/06/18 |
| DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27  | 国債証券 | 6.5000 | 970    | 1,078  | 184,454    | 2027/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,000  | 1,086  | 185,718    | 2028/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39 | 国債証券 | 4.2500 | 1,390  | 1,674  | 286,218    | 2039/07/04 |
| DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42 | 国債証券 | 3.2500 | 1,200  | 1,307  | 223,498    | 2042/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44  | 国債証券 | 2.5000 | 1,900  | 1,863  | 318,626    | 2044/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40 | 国債証券 | 4.7500 | 1,420  | 1,817  | 310,724    | 2040/07/04 |
| DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34 | 国債証券 | 4.7500 | 1,180  | 1,420  | 242,805    | 2034/07/04 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46  | 国債証券 | 2.5000 | 2,200  | 2,160  | 369,371    | 2046/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52  | 国債証券 | 0.0000 | 2,360  | 1,164  | 199,094    | 2052/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53  | 国債証券 | 1.8000 | 2,120  | 1,781  | 304,536    | 2053/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48 | 国債証券 | 1.2500 | 2,020  | 1,539  | 263,259    | 2048/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53  | 国債証券 | 1.8000 | 500    | 420    | 71,968     | 2053/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25  | 国債証券 | 1.0000 | 830    | 810    | 138,548    | 2025/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27  | 国債証券 | 0.5000 | 2,500  | 2,351  | 401,941    | 2027/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.5 08/15/54  | 国債証券 | 2.5000 | 600    | 588    | 100,594    | 2054/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/26      | 国債証券 | 0.0000 | 2,750  | 2,599  | 444,394    | 2026/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,750  | 1,603  | 274,153    | 2028/08/15 |
| DEUTSCHLAND 08/15/29      | 国債証券 | 0.0000 | 1,750  | 1,553  | 265,577    | 2029/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50  | 国債証券 | 0.0000 | 1,920  | 994    | 170,004    | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32  | 国債証券 | 1.7000 | 1,800  | 1,715  | 293,277    | 2032/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31  | 国債証券 | 0.0000 | 1,500  | 1,274  | 217,899    | 2031/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50  | 国債証券 | 0.0000 | 760    | 394    | 67,412     | 2050/08/15 |
| DEUTSCHLAND 2.6 08/15/33  | 国債証券 | 2.6000 | 2,210  | 2,248  | 384,339    | 2033/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30  | 国債証券 | 0.0000 | 2,350  | 2,042  | 349,105    | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30  | 国債証券 | 0.0000 | 820    | 712    | 121,840    | 2030/08/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31  | 国債証券 | 0.0000 | 800    | 680    | 116,304    | 2031/08/15 |
| BUNDESOBL 0.10/09/26      | 国債証券 | 0.0000 | 2,000  | 1,883  | 321,917    | 2026/10/09 |
| BUNDESOBL 2.4 10/19/28    | 国債証券 | 2.4000 | 1,650  | 1,646  | 281,567    | 2028/10/19 |
| BUNDESOBL 0.0 10/10/25    | 国債証券 | 0.0000 | 800    | 769    | 131,598    | 2025/10/10 |
| BUNDESOBL 1.3 10/15/27    | 国債証券 | 1.3000 | 1,960  | 1,886  | 322,562    | 2027/10/15 |
| BUNDESOBL 1.3 10/15/27    | 国債証券 | 1.3000 | 700    | 673    | 115,174    | 2027/10/15 |
| BUNDESOBL 0.0 10/10/25    | 国債証券 | 0.0000 | 500    | 481    | 82,240     | 2025/10/10 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27  | 国債証券 | 0.0000 | 1,300  | 1,195  | 204,448    | 2027/11/15 |
| DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28  | 国債証券 | 0.0000 | 1,950  | 1,758  | 300,630    | 2028/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30  | 国債証券 | 2.4000 | 1,200  | 1,201  | 205,381    | 2030/11/15 |
| DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29  | 国債証券 | 2.1000 | 1,700  | 1,674  | 286,284    | 2029/11/15 |
| BUNDESSCHAT 3.1 12/12/25  | 国債証券 | 3.1000 | 800    | 801    | 136,973    | 2025/12/12 |
| 小計                        | —    | —      | 94,680 | 88,576 | 15,143,105 | —          |
| (ユーロ…スペイン)                |      |        |        |        |            |            |
| SPAIN 6.0 01/31/29        | 国債証券 | 6.0000 | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円         |            |
| SPAIN 4.2 01/31/37        | 国債証券 | 4.2000 | 1,800  | 2,036  | 348,076    | 2029/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/27        | 国債証券 | 0.0000 | 1,080  | 1,162  | 198,794    | 2037/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/28        | 国債証券 | 0.0000 | 2,400  | 2,219  | 379,408    | 2027/01/31 |
| SPAIN 0.0 01/31/26        | 国債証券 | 0.0000 | 1,950  | 1,752  | 299,651    | 2028/01/31 |
| SPAIN 1.5 04/30/27        | 国債証券 | 1.5000 | 400    | 380    | 65,074     | 2026/01/31 |
|                           |      |        | 2,440  | 2,340  | 400,081    | 2027/04/30 |

| 銘<br>柄                   | 当<br>期 |        |                  |                       | 末                          |                       |
|--------------------------|--------|--------|------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|
|                          | 種<br>類 | 利<br>率 | 額<br>面<br>金<br>額 | 評<br>価<br>額           |                            | 償<br>還<br>年<br>月<br>日 |
|                          |        |        |                  | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |                       |
| (ユーロ…スペイン)               |        | %      | 千ユーロ             | 千ユーロ                  | 千円                         |                       |
| SPAIN 1.95 04/30/26      | 国債証券   | 1.9500 | 1,940            | 1,900                 | 324,841                    | 2026/04/30            |
| SPAIN 1.4 04/30/28       | 国債証券   | 1.4000 | 2,050            | 1,936                 | 331,080                    | 2028/04/30            |
| SPAIN 1.45 04/30/29      | 国債証券   | 1.4500 | 1,230            | 1,148                 | 196,377                    | 2029/04/30            |
| SPAIN 0.7 04/30/32       | 国債証券   | 0.7000 | 1,350            | 1,127                 | 192,817                    | 2032/04/30            |
| SPAIN 3.15 04/30/33      | 国債証券   | 3.1500 | 2,000            | 1,993                 | 340,870                    | 2033/04/30            |
| SPAIN 0.5 04/30/30       | 国債証券   | 0.5000 | 1,400            | 1,217                 | 208,114                    | 2030/04/30            |
| SPAIN 0.1 04/30/31       | 国債証券   | 0.1000 | 1,790            | 1,460                 | 249,711                    | 2031/04/30            |
| SPAIN 3.25 04/30/34      | 国債証券   | 3.2500 | 1,700            | 1,695                 | 289,930                    | 2034/04/30            |
| SPAIN 3.5 05/31/29       | 国債証券   | 3.5000 | 1,000            | 1,024                 | 175,116                    | 2029/05/31            |
| SPAIN 2.5 05/31/27       | 国債証券   | 2.5000 | 700              | 689                   | 117,876                    | 2027/05/31            |
| SPAIN 2.8 05/31/26       | 国債証券   | 2.8000 | 2,600            | 2,583                 | 441,677                    | 2026/05/31            |
| SPAIN 0.0 05/31/25       | 国債証券   | 0.0000 | 800              | 775                   | 132,541                    | 2025/05/31            |
| SPAIN 5.9 07/30/26       | 国債証券   | 5.9000 | 1,600            | 1,689                 | 288,880                    | 2026/07/30            |
| SPAIN 4.9 07/30/40       | 国債証券   | 4.9000 | 930              | 1,064                 | 181,919                    | 2040/07/30            |
| SPAIN 4.7 07/30/41       | 国債証券   | 4.7000 | 1,800            | 2,036                 | 348,179                    | 2041/07/30            |
| SPAIN 3.45 07/30/66      | 国債証券   | 3.4500 | 690              | 625                   | 106,852                    | 2066/07/30            |
| SPAIN 4.65 07/30/25      | 国債証券   | 4.6500 | 400              | 405                   | 69,343                     | 2025/07/30            |
| SPAIN 1.95 07/30/30      | 国債証券   | 1.9500 | 1,560            | 1,472                 | 251,703                    | 2030/07/30            |
| SPAIN 5.75 07/30/32      | 国債証券   | 5.7500 | 2,000            | 2,374                 | 405,901                    | 2032/07/30            |
| SPAIN 2.35 07/30/33      | 国債証券   | 2.3500 | 1,610            | 1,493                 | 255,400                    | 2033/07/30            |
| SPAIN 3.45 07/30/43      | 国債証券   | 3.4500 | 1,100            | 1,054                 | 180,269                    | 2043/07/30            |
| SPAIN 1.4 07/30/28       | 国債証券   | 1.4000 | 1,400            | 1,316                 | 224,983                    | 2028/07/30            |
| SPAIN 1.85 07/30/35      | 国債証券   | 1.8500 | 1,100            | 948                   | 162,193                    | 2035/07/30            |
| SPAIN 0.85 07/30/37      | 国債証券   | 0.8500 | 1,460            | 1,057                 | 180,793                    | 2037/07/30            |
| SPAIN 3.9 07/30/39       | 国債証券   | 3.9000 | 1,100            | 1,135                 | 194,064                    | 2039/07/30            |
| SPAIN 1.0 07/30/42       | 国債証券   | 1.0000 | 600              | 389                   | 66,571                     | 2042/07/30            |
| SPAIN 0.8 07/30/27       | 国債証券   | 0.8000 | 1,800            | 1,682                 | 287,633                    | 2027/07/30            |
| SPAIN 0.8 07/30/29       | 国債証券   | 0.8000 | 2,200            | 1,971                 | 336,996                    | 2029/07/30            |
| SPAIN 5.15 10/31/28      | 国債証券   | 5.1500 | 1,000            | 1,087                 | 185,859                    | 2028/10/31            |
| SPAIN 5.15 10/31/44      | 国債証券   | 5.1500 | 900              | 1,079                 | 184,558                    | 2044/10/31            |
| SPAIN 2.9 10/31/46       | 国債証券   | 2.9000 | 1,270            | 1,106                 | 189,235                    | 2046/10/31            |
| SPAIN 2.7 10/31/48       | 国債証券   | 2.7000 | 1,200            | 995                   | 170,214                    | 2048/10/31            |
| SPAIN 1.9 10/31/52       | 国債証券   | 1.9000 | 1,580            | 1,057                 | 180,724                    | 2052/10/31            |
| SPAIN 1.45 10/31/71      | 国債証券   | 1.4500 | 550              | 269                   | 46,053                     | 2071/10/31            |
| SPAIN 1.0 10/31/50       | 国債証券   | 1.0000 | 1,830            | 992                   | 169,733                    | 2050/10/31            |
| SPAIN 4.0 10/31/54       | 国債証券   | 4.0000 | 300              | 304                   | 51,988                     | 2054/10/31            |
| SPAIN 2.15 10/31/25      | 国債証券   | 2.1500 | 550              | 542                   | 92,737                     | 2025/10/31            |
| SPAIN 1.45 10/31/27      | 国債証券   | 1.4500 | 1,800            | 1,714                 | 293,142                    | 2027/10/31            |
| SPAIN 1.3 10/31/26       | 国債証券   | 1.3000 | 2,690            | 2,586                 | 442,149                    | 2026/10/31            |
| SPAIN 0.6 10/31/29       | 国債証券   | 0.6000 | 1,780            | 1,575                 | 269,309                    | 2029/10/31            |
| SPAIN 0.5 10/31/31       | 国債証券   | 0.5000 | 1,300            | 1,084                 | 185,387                    | 2031/10/31            |
| SPAIN 2.55 10/31/32      | 国債証券   | 2.5500 | 1,300            | 1,244                 | 212,723                    | 2032/10/31            |
| SPAIN 1.2 10/31/40       | 国債証券   | 1.2000 | 900              | 630                   | 107,763                    | 2040/10/31            |
| SPAIN 1.25 10/31/30      | 国債証券   | 1.2500 | 2,000            | 1,796                 | 307,163                    | 2030/10/31            |
| SPAIN 3.55 10/31/33      | 国債証券   | 3.5500 | 1,220            | 1,249                 | 213,597                    | 2033/10/31            |
| 小計                       | -      | -      | 72,150           | 67,478                | 11,536,070                 | -                     |
| (ユーロ…イタリア)               |        | %      | 千ユーロ             | 千ユーロ                  | 千円                         |                       |
| ITALY BTPS 0.85 01/15/27 | 国債証券   | 0.8500 | 2,200            | 2,068                 | 353,582                    | 2027/01/15            |
| ITALY BTPS 3.5 01/15/26  | 国債証券   | 3.5000 | 700              | 700                   | 119,791                    | 2026/01/15            |
| ITALY BTPS 5.75 02/01/33 | 国債証券   | 5.7500 | 1,820            | 2,079                 | 355,579                    | 2033/02/01            |
| ITALY BTPS 4.0 02/01/37  | 国債証券   | 4.0000 | 2,250            | 2,252                 | 385,044                    | 2037/02/01            |
| ITALY BTPS 2.0 02/01/28  | 国債証券   | 2.0000 | 1,300            | 1,242                 | 212,386                    | 2028/02/01            |
| ITALY BTPS 3.5 02/15/31  | 国債証券   | 3.5000 | 1,200            | 1,192                 | 203,839                    | 2031/02/15            |
| ITALY BTPS 0.5 02/01/26  | 国債証券   | 0.5000 | 1,500            | 1,433                 | 244,989                    | 2026/02/01            |

| 銘柄                       | 種類   | 利 率    | 額面金額  | 当期    |         |            | 末償還年月日 |
|--------------------------|------|--------|-------|-------|---------|------------|--------|
|                          |      |        |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  | 評価額        |        |
| (ユーロ…イタリア)               |      | %      | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |        |
| ITALY BTPS 0.45 02/15/29 | 国債証券 | 0.4500 | 900   | 787   | 134,569 | 2029/02/15 |        |
| ITALY BTPS 2.95 02/15/27 | 国債証券 | 2.9500 | 1,050 | 1,039 | 177,784 | 2027/02/15 |        |
| ITALY BTPS 4.1 02/01/29  | 国債証券 | 4.1000 | 800   | 823   | 140,734 | 2029/02/01 |        |
| ITALY BTPS 2.7 03/01/47  | 国債証券 | 2.7000 | 1,180 | 913   | 156,121 | 2047/03/01 |        |
| ITALY BTPS 3.45 03/01/48 | 国債証券 | 3.4500 | 960   | 839   | 143,588 | 2048/03/01 |        |
| ITALY BTPS 2.8 03/01/67  | 国債証券 | 2.8000 | 750   | 540   | 92,369  | 2067/03/01 |        |
| ITALY BTPS 2.15 03/01/72 | 国債証券 | 2.1500 | 150   | 90    | 15,409  | 2072/03/01 |        |
| ITALY BTPS 4.5 03/01/26  | 国債証券 | 4.5000 | 1,500 | 1,526 | 260,953 | 2026/03/01 |        |
| ITALY BTPS 1.65 03/01/32 | 国債証券 | 1.6500 | 1,400 | 1,215 | 207,805 | 2032/03/01 |        |
| ITALY BTPS 3.1 03/01/40  | 国債証券 | 3.1000 | 800   | 699   | 119,612 | 2040/03/01 |        |
| ITALY BTPS 3.35 03/01/35 | 国債証券 | 3.3500 | 1,100 | 1,044 | 178,532 | 2035/03/01 |        |
| ITALY BTPS 3.5 03/01/30  | 国債証券 | 3.5000 | 1,940 | 1,943 | 332,304 | 2030/03/01 |        |
| ITALY BTPS 1.45 03/01/36 | 国債証券 | 1.4500 | 1,030 | 788   | 134,725 | 2036/03/01 |        |
| ITALY BTPS 1.8 03/01/41  | 国債証券 | 1.8000 | 900   | 643   | 109,981 | 2041/03/01 |        |
| ITALY BTPS 0.95 03/01/37 | 国債証券 | 0.9500 | 1,100 | 766   | 130,962 | 2037/03/01 |        |
| ITALY BTPS 3.25 03/01/38 | 国債証券 | 3.2500 | 1,030 | 935   | 159,906 | 2038/03/01 |        |
| ITALY BTPS 4.2 03/01/34  | 国債証券 | 4.2000 | 1,400 | 1,436 | 245,662 | 2034/03/01 |        |
| ITALY BTPS 0.25 03/15/28 | 国債証券 | 0.2500 | 1,230 | 1,098 | 187,843 | 2028/03/15 |        |
| ITALY BTPS 4.0 04/30/35  | 国債証券 | 4.0000 | 700   | 704   | 120,509 | 2035/04/30 |        |
| ITALY BTPS 1.5 04/30/45  | 国債証券 | 1.5000 | 840   | 523   | 89,524  | 2045/04/30 |        |
| ITALY BTPS 1.35 04/01/30 | 国債証券 | 1.3500 | 1,400 | 1,244 | 212,792 | 2030/04/01 |        |
| ITALY BTPS 0.9 04/01/31  | 国債証券 | 0.9000 | 1,750 | 1,470 | 251,393 | 2031/04/01 |        |
| ITALY BTPS 3.4 04/01/28  | 国債証券 | 3.4000 | 1,250 | 1,252 | 214,041 | 2028/04/01 |        |
| ITALY BTPS 0.0 04/01/26  | 国債証券 | 0.0000 | 1,450 | 1,368 | 233,910 | 2026/04/01 |        |
| ITALY BTPS 1.1 04/01/27  | 国債証券 | 1.1000 | 1,000 | 941   | 160,967 | 2027/04/01 |        |
| ITALY BTPS 3.8 04/15/26  | 国債証券 | 3.8000 | 1,700 | 1,712 | 292,717 | 2026/04/15 |        |
| ITALY BTPS 6.0 05/01/31  | 国債証券 | 6.0000 | 2,170 | 2,488 | 425,443 | 2031/05/01 |        |
| ITALY BTPS 4.4 05/01/33  | 国債証券 | 4.4000 | 1,440 | 1,507 | 257,703 | 2033/05/01 |        |
| ITALY BTPS 1.6 06/01/26  | 国債証券 | 1.6000 | 2,000 | 1,934 | 330,705 | 2026/06/01 |        |
| ITALY BTPS 1.5 06/01/25  | 国債証券 | 1.5000 | 900   | 883   | 151,075 | 2025/06/01 |        |
| ITALY BTPS 2.2 06/01/27  | 国債証券 | 2.2000 | 2,000 | 1,940 | 331,696 | 2027/06/01 |        |
| ITALY BTPS 0.95 06/01/32 | 国債証券 | 0.9500 | 1,350 | 1,099 | 187,960 | 2032/06/01 |        |
| ITALY BTPS 2.8 06/15/29  | 国債証券 | 2.8000 | 1,000 | 971   | 166,087 | 2029/06/15 |        |
| ITALY BTPS 3.7 06/15/30  | 国債証券 | 3.7000 | 1,110 | 1,119 | 191,378 | 2030/06/15 |        |
| ITALY BTPS 2.1 07/15/26  | 国債証券 | 2.1000 | 1,400 | 1,366 | 233,560 | 2026/07/15 |        |
| ITALY BTPS 0.5 07/15/28  | 国債証券 | 0.5000 | 1,300 | 1,161 | 198,489 | 2028/07/15 |        |
| ITALY BTPS 1.85 07/01/25 | 国債証券 | 1.8500 | 460   | 452   | 77,359  | 2025/07/01 |        |
| ITALY BTPS 3.35 07/01/29 | 国債証券 | 3.3500 | 900   | 895   | 153,125 | 2029/07/01 |        |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/34  | 国債証券 | 5.0000 | 1,930 | 2,109 | 360,572 | 2034/08/01 |        |
| ITALY BTPS 5.0 08/01/39  | 国債証券 | 5.0000 | 1,860 | 2,027 | 346,540 | 2039/08/01 |        |
| ITALY BTPS 2.05 08/01/27 | 国債証券 | 2.0500 | 900   | 867   | 148,236 | 2027/08/01 |        |
| ITALY BTPS 3.0 08/01/29  | 国債証券 | 3.0000 | 1,200 | 1,176 | 201,116 | 2029/08/01 |        |
| ITALY BTPS 0.6 08/01/31  | 国債証券 | 0.6000 | 1,700 | 1,383 | 236,440 | 2031/08/01 |        |
| ITALY BTPS 0.95 08/01/30 | 国債証券 | 0.9500 | 1,300 | 1,116 | 190,888 | 2030/08/01 |        |
| ITALY BTPS 1.2 08/15/25  | 国債証券 | 1.2000 | 600   | 584   | 99,921  | 2025/08/15 |        |
| ITALY BTPS 0.0 08/01/26  | 国債証券 | 0.0000 | 1,700 | 1,586 | 271,188 | 2026/08/01 |        |
| ITALY BTPS 3.8 08/01/28  | 国債証券 | 3.8000 | 1,400 | 1,422 | 243,269 | 2028/08/01 |        |
| ITALY BTPS 2.95 09/01/38 | 国債証券 | 2.9500 | 980   | 855   | 146,263 | 2038/09/01 |        |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/44 | 国債証券 | 4.7500 | 1,400 | 1,482 | 253,404 | 2044/09/01 |        |
| ITALY BTPS 3.25 09/01/46 | 国債証券 | 3.2500 | 1,200 | 1,024 | 175,107 | 2046/09/01 |        |
| ITALY BTPS 4.75 09/01/28 | 国債証券 | 4.7500 | 1,300 | 1,369 | 234,114 | 2028/09/01 |        |
| ITALY BTPS 5.0 09/01/40  | 国債証券 | 5.0000 | 1,890 | 2,054 | 351,289 | 2040/09/01 |        |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/50 | 国債証券 | 2.4500 | 840   | 599   | 102,534 | 2050/09/01 |        |
| ITALY BTPS 1.7 09/01/51  | 国債証券 | 1.7000 | 1,100 | 659   | 112,766 | 2051/09/01 |        |

| 銘柄                       | 種類   | 当期     |         |         | 期末         |            |
|--------------------------|------|--------|---------|---------|------------|------------|
|                          |      | 利 率    | 額面金額    | 評価額     |            | 償還年月日      |
|                          |      |        |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |            |
| (ユーロ…イタリア)               |      | %      | 千ユーロ    | 千ユーロ    | 千円         |            |
| ITALY BTPS 2.45 09/01/33 | 国債証券 | 2.4500 | 780     | 700     | 119,812    | 2033/09/01 |
| ITALY BTPS 2.15 09/01/52 | 国債証券 | 2.1500 | 1,000   | 654     | 111,893    | 2052/09/01 |
| ITALY BTPS 3.85 09/01/49 | 国債証券 | 3.8500 | 750     | 694     | 118,716    | 2049/09/01 |
| ITALY BTPS 2.25 09/01/36 | 国債証券 | 2.2500 | 1,200   | 996     | 170,317    | 2036/09/01 |
| ITALY BTPS 4.45 09/01/43 | 国債証券 | 4.4500 | 500     | 507     | 86,796     | 2043/09/01 |
| ITALY BTPS 0.95 09/15/27 | 国債証券 | 0.9500 | 1,600   | 1,486   | 254,060    | 2027/09/15 |
| ITALY BTPS 3.85 09/15/26 | 国債証券 | 3.8500 | 1,820   | 1,839   | 314,414    | 2026/09/15 |
| ITALY BTPS 4.5 10/01/53  | 国債証券 | 4.5000 | 900     | 911     | 155,895    | 2053/10/01 |
| ITALY BTPS 4.0 10/30/31  | 国債証券 | 4.0000 | 1,000   | 1,024   | 175,063    | 2031/10/30 |
| ITALY BTPS 4.05 10/30/37 | 国債証券 | 4.0500 | 1,000   | 996     | 170,361    | 2037/10/30 |
| ITALY BTPS 4.15 10/01/39 | 国債証券 | 4.1500 | 700     | 694     | 118,810    | 2039/10/01 |
| ITALY BTPS 7.25 11/01/26 | 国債証券 | 7.2500 | 1,500   | 1,632   | 279,109    | 2026/11/01 |
| ITALY BTPS 6.5 11/01/27  | 国債証券 | 6.5000 | 1,870   | 2,058   | 351,856    | 2027/11/01 |
| ITALY BTPS 5.25 11/01/29 | 国債証券 | 5.2500 | 1,390   | 1,513   | 258,688    | 2029/11/01 |
| ITALY BTPS 2.5 11/15/25  | 国債証券 | 2.5000 | 400     | 395     | 67,588     | 2025/11/15 |
| ITALY BTPS 4.35 11/01/33 | 国債証券 | 4.3500 | 1,430   | 1,489   | 254,716    | 2033/11/01 |
| ITALY BTPS 4.0 11/15/30  | 国債証券 | 4.0000 | 1,000   | 1,023   | 174,926    | 2030/11/15 |
| ITALY BTPS 2.0 12/01/25  | 国債証券 | 2.0000 | 500     | 490     | 83,861     | 2025/12/01 |
| ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | 国債証券 | 1.2500 | 1,660   | 1,581   | 270,385    | 2026/12/01 |
| ITALY BTPS 2.8 12/01/28  | 国債証券 | 2.8000 | 1,200   | 1,173   | 200,555    | 2028/12/01 |
| ITALY BTPS 0.95 12/01/31 | 国債証券 | 0.9500 | 1,400   | 1,157   | 197,970    | 2031/12/01 |
| ITALY BTPS 1.65 12/01/30 | 国債証券 | 1.6500 | 1,750   | 1,558   | 266,441    | 2030/12/01 |
| ITALY BTPS 2.5 12/01/32  | 国債証券 | 2.5000 | 1,300   | 1,186   | 202,867    | 2032/12/01 |
| ITALY BTPS 3.85 12/15/29 | 国債証券 | 3.8500 | 1,600   | 1,628   | 278,350    | 2029/12/15 |
| ITALY BTPS 2.65 12/01/27 | 国債証券 | 2.6500 | 1,100   | 1,076   | 184,031    | 2027/12/01 |
| 小計                       | -    | -      | 106,960 | 101,928 | 17,425,671 | -          |
| (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 | 370     | 168     | 28,889     | 2052/04/15 |
| FINLAND 0.75 04/15/31    | 国債証券 | 0.7500 | 300     | 261     | 44,713     | 2031/04/15 |
| FINLAND 1.375 04/15/47   | 国債証券 | 1.3750 | 320     | 228     | 39,053     | 2047/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/26     | 国債証券 | 0.5000 | 500     | 478     | 81,747     | 2026/04/15 |
| FINLAND 1.125 04/15/34   | 国債証券 | 1.1250 | 400     | 337     | 57,710     | 2034/04/15 |
| FINLAND 2.75 04/15/38    | 国債証券 | 2.7500 | 260     | 247     | 42,325     | 2038/04/15 |
| FINLAND 2.95 04/15/55    | 国債証券 | 2.9500 | 150     | 142     | 24,431     | 2055/04/15 |
| FINLAND 0.5 04/15/43     | 国債証券 | 0.5000 | 190     | 118     | 20,275     | 2043/04/15 |
| FINLAND 0.125 04/15/36   | 国債証券 | 0.1250 | 190     | 134     | 23,054     | 2036/04/15 |
| FINLAND 2.875 04/15/29   | 国債証券 | 2.8750 | 400     | 400     | 68,500     | 2029/04/15 |
| FINLAND 1.375 04/15/27   | 国債証券 | 1.3750 | 200     | 192     | 32,831     | 2027/04/15 |
| FINLAND 2.75 07/04/28    | 国債証券 | 2.7500 | 400     | 399     | 68,349     | 2028/07/04 |
| FINLAND 2.625 07/04/42   | 国債証券 | 2.6250 | 470     | 433     | 74,145     | 2042/07/04 |
| FINLAND 0.5 09/15/29     | 国債証券 | 0.5000 | 500     | 444     | 76,016     | 2029/09/15 |
| FINLAND 0.875 09/15/25   | 国債証券 | 0.8750 | 450     | 437     | 74,819     | 2025/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/28     | 国債証券 | 0.5000 | 520     | 472     | 80,766     | 2028/09/15 |
| FINLAND 0.5 09/15/27     | 国債証券 | 0.5000 | 350     | 325     | 55,661     | 2027/09/15 |
| FINLAND 0.25 09/15/40    | 国債証券 | 0.2500 | 400     | 253     | 43,269     | 2040/09/15 |
| FINLAND 3.0 09/15/33     | 国債証券 | 3.0000 | 420     | 420     | 71,951     | 2033/09/15 |
| FINLAND 1.5 09/15/32     | 国債証券 | 1.5000 | 500     | 448     | 76,693     | 2032/09/15 |
| FINLAND 0.125 09/15/31   | 国債証券 | 0.1250 | 300     | 246     | 42,203     | 2031/09/15 |
| FINLAND 3.0 09/15/34     | 国債証券 | 3.0000 | 300     | 299     | 51,220     | 2034/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/30     | 国債証券 | 0.0000 | 280     | 235     | 40,235     | 2030/09/15 |
| FINLAND 0.0 09/15/26     | 国債証券 | 0.0000 | 550     | 515     | 88,085     | 2026/09/15 |
| 小計                       | -    | -      | 8,720   | 7,644   | 1,306,951  | -          |
| (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 | 180     | 202     | 34,652     | 2062/01/26 |

| 銘柄                    | 種類   | 利 率    | 額面金額   | 当期     |             | 末償還年月日     |
|-----------------------|------|--------|--------|--------|-------------|------------|
|                       |      |        |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額      |            |
| (ユーロ…オーストリア)          |      | %      | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円          |            |
| AUSTRIA 1.5 02/20/47  | 国債証券 | 1.5000 | 640    | 465    | 79,636      | 2047/02/20 |
| AUSTRIA 0.5 02/20/29  | 国債証券 | 0.5000 | 600    | 540    | 92,412      | 2029/02/20 |
| AUSTRIA 0.75 02/20/28 | 国債証券 | 0.7500 | 950    | 882    | 150,852     | 2028/02/20 |
| AUSTRIA 2.9 02/20/34  | 国債証券 | 2.9000 | 580    | 574    | 98,224      | 2034/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/31  | 国債証券 | 0.0000 | 880    | 728    | 124,544     | 2031/02/20 |
| AUSTRIA 2.9 02/20/33  | 国債証券 | 2.9000 | 1,400  | 1,393  | 238,310     | 2033/02/20 |
| AUSTRIA 0.9 02/20/32  | 国債証券 | 0.9000 | 440    | 379    | 64,956      | 2032/02/20 |
| AUSTRIA 0.0 02/20/30  | 国債証券 | 0.0000 | 850    | 725    | 124,026     | 2030/02/20 |
| AUSTRIA 4.85 03/15/26 | 国債証券 | 4.8500 | 850    | 874    | 149,574     | 2026/03/15 |
| AUSTRIA 4.15 03/15/37 | 国債証券 | 4.1500 | 850    | 940    | 160,819     | 2037/03/15 |
| AUSTRIA 0.75 03/20/51 | 国債証券 | 0.7500 | 620    | 353    | 60,394      | 2051/03/20 |
| AUSTRIA 0.7 04/20/71  | 国債証券 | 0.7000 | 210    | 92     | 15,833      | 2071/04/20 |
| AUSTRIA 0.5 04/20/27  | 国債証券 | 0.5000 | 900    | 842    | 144,044     | 2027/04/20 |
| AUSTRIA 2.4 05/23/34  | 国債証券 | 2.4000 | 510    | 483    | 82,707      | 2034/05/23 |
| AUSTRIA 1.85 05/23/49 | 国債証券 | 1.8500 | 500    | 384    | 65,785      | 2049/05/23 |
| AUSTRIA 2.9 05/23/29  | 国債証券 | 2.9000 | 200    | 201    | 34,375      | 2029/05/23 |
| AUSTRIA 0.85 06/30/20 | 国債証券 | 0.8500 | 350    | 156    | 26,711      | 2120/06/30 |
| AUSTRIA 3.15 06/20/44 | 国債証券 | 3.1500 | 520    | 515    | 88,118      | 2044/06/20 |
| AUSTRIA 6.25 07/15/27 | 国債証券 | 6.2500 | 580    | 635    | 108,692     | 2027/07/15 |
| AUSTRIA 2.0 07/15/26  | 国債証券 | 2.0000 | 670    | 657    | 112,347     | 2026/07/15 |
| AUSTRIA 2.1 09/20/17  | 国債証券 | 2.1000 | 390    | 288    | 49,361      | 2117/09/20 |
| AUSTRIA 0.75 10/20/26 | 国債証券 | 0.7500 | 1,020  | 970    | 165,891     | 2026/10/20 |
| AUSTRIA 1.2 10/20/25  | 国債証券 | 1.2000 | 300    | 292    | 49,991      | 2025/10/20 |
| AUSTRIA 3.15 10/20/53 | 国債証券 | 3.1500 | 350    | 343    | 58,806      | 2053/10/20 |
| AUSTRIA 0.25 10/20/36 | 国債証券 | 0.2500 | 600    | 425    | 72,685      | 2036/10/20 |
| AUSTRIA 0.0 10/20/40  | 国債証券 | 0.0000 | 920    | 549    | 94,023      | 2040/10/20 |
| AUSTRIA 0.0 10/20/28  | 国債証券 | 0.0000 | 1,100  | 975    | 166,847     | 2028/10/20 |
| AUSTRIA 3.45 10/20/30 | 国債証券 | 3.4500 | 400    | 413    | 70,756      | 2030/10/20 |
| AUSTRIA 1.5 11/02/86  | 国債証券 | 1.5000 | 150    | 87     | 14,973      | 2086/11/02 |
| 小計                    |      | —      | 18,510 | 16,380 | 2,800,360   | —          |
| 合計                    |      | —      | —      | —      | 245,810,597 | —          |

## ■投資信託財産の構成

2024年6月24日現在

| 項目              | 当期          |   | 末率    |
|-----------------|-------------|---|-------|
|                 | 評価額         | 比 |       |
| 公 社 債           | 千円          | % |       |
| コール・ローン等、その他    | 245,810,597 |   | 98.7  |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 3,310,979   |   | 1.3   |
|                 | 249,121,577 |   | 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、248,476,163千円、99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シェケル=42.573円、1デンマーク・クローネ=22.92円、1ノルウェー・クローネ=15.12円、1スウェーデン・クローナ=15.21円、1メキシコ・ペソ=8.833円、1オフショア・人民元=21.926円、1マレーシア・リンギット=33.908円、1ポーランド・ズロチ=39.51円、1ユーロ=170.96円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

| 項                        | 目      | 当期末              |
|--------------------------|--------|------------------|
| (A) 資                    | 産      | 489,922,036,408円 |
| コ 一 ル ・ 口 一 シ 等          | 債(評価額) | 1,227,375,739    |
| 公 社                      |        | 245,810,597,750  |
| 未 収 入 金                  |        | 240,872,552,173  |
| 未 収 利 息                  |        | 733,415,869      |
| 前 払 費 用                  |        | 1,278,094,877    |
| (B) 負 債                  |        | 244,906,432,317  |
| 未 払 金                    |        | 244,899,907,317  |
| 未 払 約 金                  |        | 6,525,000        |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B)       |        | 245,015,604,091  |
| 元 本                      |        | 212,014,549,028  |
| 次 期 繰 越 損 益 金            |        | 33,001,055,063   |
| (D) 受 益 権 総 口 数          |        | 212,014,549,028口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) |        | 11,557円          |

(注1) 期首元本額 85,162,235,544円  
 追加設定元本額 733,571,383,611円  
 一部解約元本額 606,719,070,127円

(注2) 期末における元本の内訳

|                               |                 |
|-------------------------------|-----------------|
| たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>       | 13,731,083,796円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型）            | 1,615,230,628円  |
| たわらノーロード バランス（標準型）            | 5,031,700,203円  |
| たわらノーロード バランス（積極型）            | 2,778,705,865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）   | 49,339,643円     |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）   | 1,645,112,538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） | 1,732,599,283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）   | 195,178,856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）   | 173,393円        |
| たわらノーロード 最適化バランス（保守型）         | 2,551,347円      |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定型）         | 16,862,255円     |
| たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）       | 167,750,358円    |
| たわらノーロード 最適化バランス（成長型）         | 8,471,528円      |
| たわらノーロード 最適化バランス（積極型）         | 91,804円         |
| 投資のソムリエ                       | 64,059,067,492円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>                 | 6,807,913,472円  |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型           | 13,525,217,575円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド            | 41,429,806,015円 |
| ワールドアセットバランス（基本コース）           | 1,791,410,235円  |
| ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）        | 5,200,373,091円  |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）        | 531,865,344円    |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）        | 277,214,514円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）        | 125,647,393円    |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）        | 1,493,969,850円  |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド           | 15,409,752,966円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>          | 6,794,009,254円  |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）        | 539,288,750円    |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）        | 295,380,489円    |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）        | 187,345,574円    |
| 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）        | 45,895,640円     |
| Oneグローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>   | 10,673,926円     |
| 外国債券パッシブファンド2（為替フルヘッジ）        | 18,116,928,359円 |

|  |                  |
|--|------------------|
| 先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）        | 5,253,304,303円   |
| 投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）                    | 1,024,053,434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） | 36,581,791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）         | 352,277,290円     |
| DIAM世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）        | 30,956,415円      |
| DIAM世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）        | 278,739,539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）         | 577,293,986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）         | 844,730,834円     |
| 期末元本合計                                   | 212,014,549,028円 |

## ■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

| 項                        | 目               | 当期              |
|--------------------------|-----------------|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益            |                 | 5,934,646,685円  |
| 受 取 利 息                  |                 | 5,936,851,114   |
| そ の 他 収 益                |                 | 60,538          |
| 支 払 利 息                  |                 | △2,264,967      |
| (B) 有 價 証 券 売 買 損 益      | △16,744,309,500 |                 |
| 売 買 益                    |                 | 50,050,846,933  |
| 売 買 損                    |                 | △66,795,156,433 |
| (C) そ の 他 費 用            |                 | △70,896,343     |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) |                 | △10,880,559,158 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        |                 | 16,124,561,942  |
| (F) 解 約 差 損 益 金          |                 | △96,522,034,110 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金      |                 | 124,279,086,389 |
| (H) 合 計(D + E + F + G)   | 33,001,055,063  |                 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)         |                 | 33,001,055,063  |

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

# 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2024年2月15日）  
 (計算期間 2023年2月16日～2024年2月15日)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第22期の運用状況をご報告申し上げます。

**当ファンドの仕組みは次の通りです。**

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 2002年9月2日から無期限です。  |
| 運用方針   | 主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の株式を主要投資対象とします。  |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。<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     |        | MSCIコクサイ・インデックス<br>(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額             |
|-----------------|----------|--------|--|--------|--------|-------------------|
|                 | 期騰落率     | 中率     |  |        |        |                   |
| 18期(2020年2月17日) | 円 41,812 | % 21.5 | ポイント 1,354,548.25                                    | % 21.9 | % 94.7 | % 2.7 百万円 370,420 |
| 19期(2021年2月15日) | 47,083   | 12.6   | 1,529,401.79   | 12.9   | 95.5   | 2.5 477,565       |
| 20期(2022年2月15日) | 56,820   | 20.7   | 1,849,569.21   | 20.9   | 93.1   | 1.8 642,642       |
| 21期(2023年2月15日) | 62,397   | 9.8    | 2,036,206.59   | 10.1   | 95.5   | 2.4 856,221       |
| 22期(2024年2月15日) | 83,633   | 34.0   | 2,736,922.65   | 34.4   | 96.4   | 1.8 1,360,958     |

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

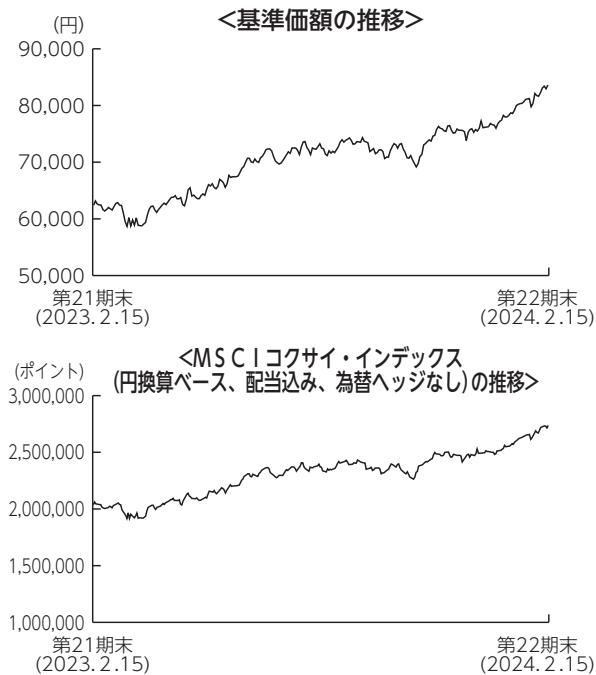
| 年 月 日                    | 基 準 価 額  | MSCIコクサイ・インデックス<br>(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |                   | 騰 落 率 | 株式組入比 率 | 株式先物比 率 |
|--------------------------|----------|--|-------------------|-------|---------|---------|
|                          |          | 騰 落 率  | 騰 落 率             |       |         |         |
| (期 首)<br>2023 年 2 月 15 日 | 円 62,397 | % —  | ポイント 2,036,206.59 | % —   | % 95.5  | % 2.4   |
| 2 月 末                    | 62,015   | △0.6   | 2,024,295.30      | △0.6  | 95.3    | 2.7     |
| 3 月 末                    | 61,720   | △1.1   | 2,015,006.82      | △1.0  | 94.3    | 3.6     |
| 4 月 末                    | 63,410   | 1.6  | 2,069,847.33      | 1.7   | 96.3    | 1.1     |
| 5 月 末                    | 66,369   | 6.4  | 2,168,855.48      | 6.5   | 96.0    | 2.0     |
| 6 月 末                    | 71,589   | 14.7   | 2,341,072.28      | 15.0  | 95.7    | 2.3     |
| 7 月 末                    | 72,676   | 16.5   | 2,377,166.85      | 16.7  | 96.3    | 1.7     |
| 8 月 末                    | 73,956   | 18.5   | 2,418,481.90      | 18.8  | 95.1    | 2.9     |
| 9 月 末                    | 72,169   | 15.7   | 2,360,275.52      | 15.9  | 96.8    | 1.3     |
| 10 月 末                   | 69,734   | 11.8   | 2,281,682.14      | 12.1  | 96.3    | 1.9     |
| 11 月 末                   | 75,211   | 20.5   | 2,460,561.81      | 20.8  | 96.5    | 1.6     |
| 12 月 末                   | 76,550   | 22.7   | 2,507,429.81      | 23.1  | 96.4    | 1.5     |
| 2024 年 1 月 末             | 81,230   | 30.2   | 2,657,966.51      | 30.5  | 95.7    | 2.7     |
| (期 末)<br>2024 年 2 月 15 日 | 83,633   | 34.0   | 2,736,922.65      | 34.4  | 96.4    | 1.8     |

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年2月16日から2024年2月15日まで）



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

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

### ポートフォリオについて

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

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は83,633円となり、前期末比で34.0%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

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

## 【運用状況】

### ○組入株式上位10業種

#### 期首（前期末）

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

#### 期末

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

(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

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

#### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で34.4%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを0.4%下回りました。配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

#### 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

## ■1万口当たりの費用明細

| 項目  | 当期                             |  | 項目の概要   |
|---|--------------------------------|--|---|
|   | 金額                             | 比率   |   |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物・オプション)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券) | 1円<br>(1)<br>(0)<br>(0)<br>(0) | 0.002%<br>(0.001)<br>(0.001)<br>(0.000)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<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              |
| (b) 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券)               | 10<br>(10)<br>(0)<br>(0)       | 0.015<br>(0.015)<br>(0.000)<br>(0.000)             | (b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<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            |
| (c) その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)                              | 17<br>(12)<br>(5)              | 0.024<br>(0.016)<br>(0.007)                        | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計  | 29                             | 0.041  |   |
| 期中の平均基準価額は70,616円です。                                      |                                |  |   |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

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

## ■売買及び取引の状況（2023年2月16日から2024年2月15日まで）

### (1) 株式

|   |          | 買付                              |                                 | 売付               |                       |
|---|----------|---------------------------------|---------------------------------|------------------|-----------------------|
|   |          | 株数                              | 金額                              | 株数               | 金額                    |
| 外 | アメリカ     | 百株<br>201,199.39<br>(8,428.59)  | 千アメリカ・ドル<br>2,176,298<br>(△375) | 百株<br>116,394.14 | 千アメリカ・ドル<br>1,154,025 |
|   | カナダ      | 百株<br>24,189.81<br>(387.18)     | 千カナダ・ドル<br>139,511<br>(-)       | 百株<br>13,131.73  | 千カナダ・ドル<br>71,369     |
|   | オーストラリア  | 百株<br>35,636.27<br>(△668.68)    | 千オーストラリア・ドル<br>95,709<br>(-)    | 百株<br>18,254.35  | 千オーストラリア・ドル<br>51,278 |
|   | 香港       | 百株<br>49,114<br>(-)             | 千香港・ドル<br>154,405<br>(-)        | 百株<br>29,493     | 千香港・ドル<br>76,166      |
| 国 | シンガポール   | 百株<br>60,335<br>(35,288.22)     | 千シンガポール・ドル<br>15,583<br>(△49)   | 百株<br>12,378     | 千シンガポール・ドル<br>7,120   |
|   | ニュージーランド | 百株<br>2,918.52<br>(-)           | 千ニュージーランド・ドル<br>2,741<br>(-)    | 百株<br>-          | 千ニュージーランド・ドル<br>-     |
|   | イギリス     | 百株<br>147,852.82<br>(△1,691.59) | 千イギリス・ポンド<br>111,828<br>(△638)  | 百株<br>80,572.83  | 千イギリス・ポンド<br>55,647   |
|   | イスラエル    | 百株<br>1,810.83<br>(-)           | 千イスラエル・シュケル<br>9,910<br>(-)     | 百株<br>3,689.04   | 千イスラエル・シュケル<br>7,214  |

|                  |         | 買付                             | 売付                             |                 |                         |
|------------------|---------|--------------------------------|--------------------------------|-----------------|-------------------------|
|                  |         | 株数                             | 金額                             | 株数              | 金額                      |
| 外<br>ユ<br>国<br>ロ | スイス     | 百株<br>9,308.82<br>(796.67)     | 千スイス・フラン<br>79,635<br>(△383)   | 百株<br>9,910.6   | 千スイス・フラン<br>42,987      |
|                  | デンマーク   | 百株<br>3,613.64<br>(2,397.1)    | 千デンマーク・クローネ<br>204,868<br>(-)  | 百株<br>2,066.9   | 千デンマーク・クローネ<br>114,086  |
|                  | ノルウェー   | 百株<br>3,294.23<br>(-)          | 千ノルウェー・クローネ<br>51,942<br>(△40) | 百株<br>1,342.07  | 千ノルウェー・クローネ<br>21,391   |
|                  | スウェーデン  | 百株<br>16,692.57<br>(546.4)     | 千スウェーデン・クローナ<br>288,680<br>(-) | 百株<br>15,731.31 | 千スウェーデン・クローナ<br>219,117 |
|                  | アイルランド  | 百株<br>1,955.04<br>(-)          | 千ユーロ<br>5,255<br>(-)           | 百株<br>1,811.3   | 千ユーロ<br>10,624          |
|                  | オランダ    | 百株<br>11,847.24<br>(2,024.76)  | 千ユーロ<br>49,648<br>(△57)        | 百株<br>9,609.12  | 千ユーロ<br>29,076          |
|                  | ベルギー    | 百株<br>880.49<br>(112.17)       | 千ユーロ<br>5,791<br>(-)           | 百株<br>490.21    | 千ユーロ<br>2,703           |
|                  | ルクセンブルグ | 百株<br>1,091.52<br>(-)          | 千ユーロ<br>2,425<br>(-)           | 百株<br>1,827.65  | 千ユーロ<br>1,572           |
|                  | フランス    | 百株<br>12,278.26<br>(129.1)     | 千ユーロ<br>91,329<br>(△81)        | 百株<br>7,834.61  | 千ユーロ<br>52,133          |
|                  | ドイツ     | 百株<br>15,631.14<br>(-)         | 千ユーロ<br>68,716<br>(△464)       | 百株<br>10,234.72 | 千ユーロ<br>35,105          |
|                  | スイス     | 百株<br>383.65<br>(-)            | 千ユーロ<br>4,036<br>(△39)         | 百株<br>95.19     | 千ユーロ<br>737             |
|                  | ポルトガル   | 百株<br>2,186.26<br>(-)          | 千ユーロ<br>1,421<br>(-)           | 百株<br>-         | 千ユーロ<br>-               |
|                  | スペイン    | 百株<br>23,314.77<br>(17,297.92) | 千ユーロ<br>20,669<br>(△4)         | 百株<br>30,997.66 | 千ユーロ<br>11,683          |
|                  | イタリア    | 百株<br>33,079.8<br>(-)          | 千ユーロ<br>14,241<br>(△1)         | 百株<br>12,925.86 | 千ユーロ<br>7,258           |
|                  | フィンランド  | 百株<br>10,192.13<br>(640.8)     | 千ユーロ<br>11,591<br>(-)          | 百株<br>2,298.9   | 千ユーロ<br>2,543           |
|                  | オーストリア  | 百株<br>277.66<br>(-)            | 千ユーロ<br>1,178<br>(-)           | 百株<br>-         | 千ユーロ<br>-               |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 新株予約権証券

|       | 買付                 |                     | 売付             |                     |
|-------|--------------------|---------------------|----------------|---------------------|
|       | 証券数                | 金額                  | 証券数            | 金額                  |
| 外国力ナダ | 証券<br>—<br>(2,968) | 千カナダ・ドル<br>—<br>(—) | 証券<br>—<br>(—) | 千カナダ・ドル<br>—<br>(—) |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(3) 投資信託受益証券、投資証券

|                              | 買付     |          | 売付     |          |
|------------------------------|--------|----------|--------|----------|
|                              | 口数     | 金額       | 口数     | 金額       |
| アメリカ                         | 千口     | 千アメリカ・ドル | 千口     | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 8,981  | 1,023    | 3,582  | 338      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 11,195 | 620      | 5,253  | 283      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT    | 38,286 | 711      | 17,066 | 274      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| PROLOGIS INC                 | 50,042 | 5,776    | 25,541 | 2,751    |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 11,994 | 2,086    | 7,408  | 1,265    |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 11,902 | 1,192    | 8,322  | 781      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| EQUINIX INC                  | 5,046  | 3,731    | 2,146  | 1,501    |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| CROWN CASTLE INC             | 29.18  | 3,127    | 18,278 | 1,754    |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 4,621  | 1,015    | 3,073  | 660      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 19,452 | 1,146    | 11,402 | 687      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 41,098 | 781      | 19,936 | 328      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 7,459  | 1,648    | 4,504  | 874      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| WELLTOWER INC                | 30,066 | 2,390    | 11,303 | 881      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| KIMCO REALTY                 | 33.13  | 608      | 17,597 | 289      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| IRON MOUNTAIN INC            | 9,102  | 513      | —      | —        |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 22,334 | 1,508    | 15,53  | 1,032    |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 40.57  | 664      | 21,932 | 343      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| MID AMERICA                  | 11,957 | 1,754    | 7,998  | 1,156    |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| REALTY INCOME CORP           | 61,574 | 3,413    | 8,304  | 409      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |
| REGENCY CENTERS CORP         | 12,938 | 788      | 10,342 | 607      |
|                              | (—)    | (—)      | (—)    | (—)      |

|                                   | 買付      |             | 売付      |             |
|-----------------------------------|---------|-------------|---------|-------------|
|                                   | 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    |
| UDR INC                           | 18,219  | 625         | 9,286   | 322         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| SIMON PROPERTY GROUP INC          | 11,263  | 1,305       | 3,256   | 342         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| PUBLIC STORAGE                    | 9,624   | 2,632       | 5,407   | 1,424       |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| SUN COMMUNITIES INC               | 12,875  | 1,666       | 9,06    | 1,158       |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| VENTAS INC                        | 30.71   | 1,365       | 18,045  | 750         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| WEYERHAEUSER CO                   | 39,178  | 1,222       | 14,307  | 429         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| EXTRA SPACE STORAGE INC           | 21,499  | 3,052       | 3,575   | 386         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| DIGITAL REALTY TRUST INC          | 13,283  | 1,584       | 3,934   | 461         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST          | -       | -           | 72,327  | 596         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| AMERICAN TOWER CORP               | 30,077  | 5,546       | 16,904  | 2,911       |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| WP CAREY INC                      | 24.66   | 1,518       | 15,328  | 825         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC       | 47,041  | 794         | 89,412  | 1,345       |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| AMERICAN HOMES 4 RENT             | 18,257  | 637         | 9,439   | 317         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| INVITATION HOMES INC              | 19,821  | 636         | -       | -           |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 11,157  | 547         | -       | -           |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES       | -       | -           | 2,199   | 26          |
| (2,199)                           | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| VICI PROPERTIES INC               | 32,109  | 994         | -       | -           |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| 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 |
| MIRVAC GROUP                      | 754,156 | 1,632       | 486,626 | 1,108       |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| GPT GROUP                         | 130,224 | 498         | -       | -           |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| STOCKLAND                         | 110,515 | 470         | -       | -           |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| GOODMAN GROUP                     | 83,445  | 1,701       | 42,152  | 851         |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| SCENTRE GROUP                     | 656,486 | 1,689       | 478,229 | 1,197       |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| 香港                                | 千口      | 千香港・ドル      | 千口      | 千香港・ドル      |
| LINK REIT DUMMY                   | 87      | 4,495       | -       | -           |
| (-)                               | (-)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| LINK REIT                         | 60.6    | 2,397       | -       | -           |
| (-)                               | (1)     | (-)         | (-)     | (-)         |
| LINK REIT-RTS                     | -       | -           | 52,503  | 209         |
| (52,503)                          | (△1)    | (-)         | (-)     | (-)         |

|  | 買付         |            | 売付          |            |
|--|------------|------------|-------------|------------|
|  | 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 |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | —          | —          | —           | —          |
| CAPLAND ASCENDAS REIT                  | (-) 628.1  | (△3) 1,689 | (-) 457.7   | (-) 1,188  |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | —          | —          | —           | —          |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST                | (-) —      | (△17)      | (-) 24.589  | (-) 25     |
| KEPPEL REIT                            | (24.589)   | (26)       | (-) 36.98   | (-) 29     |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL          | (36.98)    | (22)       | (-) —       | (-) —      |
| (-) —                                  | (△3)       | (-) —      | (-) —       | (-) —      |
| 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                    | —          | —          | 119.111     | 385        |
| LAND SECURITIES GROUP PLC              | (-) 235.62 | (-) 1,460  | (-) 191.367 | (-) 1,133  |
| ユーロ（ベルギー）                              | 千口         | 千ユーロ       | 千口          | 千ユーロ       |
| WAREHOUSES DE PAUW                     | 29.844     | 808        | 26.007      | 723        |
| (-) —                                  | (-) —      | (-) —      | (-) —       | (-) —      |
| ユーロ（フランス）                              | 千口         | 千ユーロ       | 千口          | 千ユーロ       |
| GECINA SA                              | 12.488     | 1,202      | 8.836       | 823        |
| KLEPIERRE                              | (-) 11.128 | (-) 266    | (-) —       | (-) —      |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 4.942      | (△21) 255  | (-) —       | (-) —      |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD              | (13.535)   | (-) —      | (-) —       | (-) —      |
| (△13.535)                              | (-) —      | (-) —      | (-) —       | (-) —      |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

#### (4) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建             |                | 売建       |          |
|-----------|----------------|----------------|----------|----------|
|           | 新規買付額          | 決済額            | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国 株式先物取引 | 百万円<br>255,616 | 百万円<br>257,547 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 金額は受渡代金です。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目                | 当期              |
|-------------------|-----------------|
| (a) 期中の株式売買金額     | 655,018,143千円   |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,026,729,929千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.63            |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等 (2023年2月16日から2024年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

| 銘 柏                                | 期 首(前期末)  | 当 期 末     |          |            |             | 業 種 等              |  |
|------------------------------------|-----------|-----------|----------|------------|-------------|--------------------|--|
|                                    |           | 株 数       | 株 数      | 評 價 額      |             |                    |  |
|                                    |           |           |          | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額 |                    |  |
| (アメリカ)                             | 百株        | 百株        | 千アメリカ・ドル | 千円         |             |                    |  |
| AMAZON.COM INC                     | 11,415.95 | 14,153.69 | 241,999  | 36,418,548 |             | 大規模小売業             |  |
| ABBOTT LABORATORIES                | 2,180.54  | 2,650.14  | 29,697   | 4,469,172  |             | ヘルスケア機器・用品         |  |
| AES CORP                           | 795.05    | 1,091.22  | 1,761    | 265,047    |             | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |  |
| INT'L BUSINESS MACHINES CORP       | 1,124.58  | 1,390.28  | 25,521   | 3,840,710  |             | 情報技術サービス           |  |
| ADVANCED MICRO DEVICES             | 2,016.32  | 2,466.44  | 44,075   | 6,632,889  |             | 半導体・半導体製造装置        |  |
| ADOBE INC                          | 584.05    | 694.37    | 41,985   | 6,318,439  |             | ソフトウェア             |  |
| CHUBB LTD                          | 521.17    | 628.23    | 15,587   | 2,345,784  |             | 保険                 |  |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC       | 277.73    | 342.61    | 7,434    | 1,118,890  |             | 化学                 |  |
| ALLSTATE CORP                      | 329.39    | 396.52    | 6,399    | 963,051    |             | 保険                 |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 837.7     | 1,013.35  | 19,747   | 2,971,748  |             | コングロマリット           |  |
| AMGEN INC                          | 666.76    | 815.06    | 23,642   | 3,557,951  |             | バイオテクノロジー          |  |
| HESS CORP                          | 352.71    | 414.96    | 5,922    | 891,310    |             | 石油・ガス・消耗燃料         |  |
| AMERICAN EXPRESS CO                | 795.36    | 954.49    | 20,130   | 3,029,392  |             | 消費者金融              |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER            | 626.53    | 773.42    | 6,094    | 917,168    |             | 電力                 |  |
| AFLAC INC                          | 726.73    | 847.3     | 6,686    | 1,006,310  |             | 保険                 |  |
| AMERICAN INT'L GROUP               | 938.43    | 1,081.5   | 7,480    | 1,125,775  |             | 保険                 |  |
| ANALOG DEVICES                     | 633.36    | 762.33    | 14,203   | 2,137,519  |             | 半導体・半導体製造装置        |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 864.52    | 1,024.32  | 5,845    | 879,733    |             | 建設関連製品             |  |
| VALERO ENERGY CORP                 | 484.9     | 540.42    | 7,622    | 1,147,047  |             | 石油・ガス・消耗燃料         |  |
| ANSYS INC                          | 108.31    | 132.52    | 4,373    | 658,116    |             | ソフトウェア             |  |
| APPLE INC                          | 20,001.34 | 23,826.92 | 438,772  | 66,030,908 |             | コンピュータ・周辺機器        |  |
| APPLIED MATERIALS INC              | 1,068.03  | 1,280.53  | 23,842   | 3,588,010  |             | 半導体・半導体製造装置        |  |
| ALBEMARLE CORP                     | 139.61    | 169.36    | 1,937    | 291,545    |             | 化学                 |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO          | 694.12    | 815.04    | 4,341    | 653,385    |             | 食品                 |  |
| AMEREN CORP                        | 316.21    | 406.44    | 2,788    | 419,654    |             | 総合公益事業             |  |
| ARROW ELECTRONICS INC              | 99.36     | —         | —        | —          |             | 電子装置・機器・部品         |  |
| AUTODESK INC                       | 269.07    | 320.74    | 8,408    | 1,265,446  |             | ソフトウェア             |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING          | 518.47    | 629.63    | 15,797   | 2,377,353  |             | 専門サービス             |  |
| AUTOZONE INC                       | 24.51     | 27.16     | 7,406    | 1,114,555  |             | 専門小売り              |  |
| AVERY DENNISON CORP                | 95.14     | 115.42    | 2,382    | 358,490    |             | 容器・包装              |  |
| BALL CORP                          | 402.23    | 462.88    | 2,869    | 431,884    |             | 容器・包装              |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B        | 1,619.51  | 1,993.18  | 79,464   | 11,958,552 |             | 金融サービス             |  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP       | 969.68    | 1,163.87  | 6,340    | 954,221    |             | 資本市場               |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC           | 631.74    | 802.19    | 3,179    | 478,540    |             | ヘルスケア機器・用品         |  |
| BECTON DICKINSON & CO              | 350.61    | 439.38    | 10,484   | 1,577,744  |             | ヘルスケア機器・用品         |  |
| AMETEK INC                         | 289.58    | 344.76    | 5,978    | 899,701    |             | 電気設備               |  |
| VERIZON COMM INC                   | 5,240.12  | 6,415.22  | 25,757   | 3,876,187  |             | 各種電気通信サービス         |  |
| WR BERKLEY CORP                    | 291.91    | 316.07    | 2,589    | 389,655    |             | 保険                 |  |
| BEST BUY CO INC                    | 254.05    | 305.68    | 2,280    | 343,173    |             | 専門小売り              |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-CL A          | 30.21     | 30.21     | 990      | 149,077    |             | ライフサイエンス・ツール／サービス  |  |
| YUM! BRANDS INC                    | 353.37    | 420.53    | 5,635    | 848,089    |             | ホテル・レストラン・レジャー     |  |
| FIRSTENERGY CORP                   | 672.13    | 836.97    | 3,090    | 465,154    |             | 電力                 |  |
| BOEING CO                          | 702.82    | 866.01    | 17,612   | 2,650,567  |             | 航空宇宙・防衛            |  |
| ROBERT HALF INC                    | 144.56    | 144.56    | 1,165    | 175,343    |             | 専門サービス             |  |
| BORGWARNER INC                     | 278       | 370.1     | 1,152    | 173,438    |             | 自動車用部品             |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 1,753.52  | 2,219.59  | 14,638   | 2,202,902  |             | ヘルスケア機器・用品         |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC        | 144.94    | 172.33    | 1,272    | 191,496    |             | 航空貨物・物流サービス        |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE      | 195.29    | 260.64    | 4,058    | 610,791    |             | 娯楽                 |  |

| 銘<br>柄                            | 期 首(前期末) | 当 期 末    |        |            |           | 業 種 等                   |
|-----------------------------------|----------|----------|--------|------------|-----------|-------------------------|
|                                   |          | 株 数      | 株 数    | 評 価 額      | 外 貨 建 金 額 |                         |
| (アメリカ)                            |          | 百株       | 百株     | 千アメリカ・ドル   | 千円        |                         |
| METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC  | 27.31    | 34.11    | 4,029  | 606,324    |           | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO           | 2,659.49 | 3,197.71 | 15,633 | 2,352,701  |           | 医薬品                     |
| ONEOK INC                         | 569.8    | 867.02   | 5,991  | 901,732    |           | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC      | 97.09    | 97.09    | 1,194  | 179,701    |           | 保険                      |
| UNITED RENTALS INC                | 88.83    | 107.88   | 7,055  | 1,061,824  |           | 商社・流通業                  |
| SEMPRA                            | 385.67   | 983.72   | 6,832  | 1,028,285  |           | 総合公益事業                  |
| FEDEX CORP                        | 309.91   | 367.46   | 8,702  | 1,309,647  |           | 航空貨物・物流サービス             |
| VERISIGN INC                      | 118.5    | 133.02   | 2,598  | 391,015    |           | 情報技術サービス                |
| AMPHENOL CORP                     | 743.44   | 915.2    | 9,528  | 1,433,890  |           | 電子装置・機器・部品              |
| BROWN-FORMAN CORP                 | 384.05   | 483.08   | 2,770  | 416,927    |           | 飲料                      |
| QUANTA SERVICES INC               | 175.6    | 232.71   | 4,948  | 744,676    |           | 建設・土木                   |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            | 1,017.65 | 1,017.65 | 489    | 73,663     |           | メディア                    |
| CSX CORP                          | 2,635.36 | 3,042.11 | 11,255 | 1,693,886  |           | 陸上運輸                    |
| COTERRA ENERGY INC                | 999.16   | 1,147.11 | 2,742  | 412,754    |           | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAMPBELL SOUP CO                  | 269.78   | 269.78   | 1,103  | 166,131    |           | 食品                      |
| CONSTELLATION BRANDS INC          | 193.43   | 246.29   | 5,999  | 902,883    |           | 飲料                      |
| CARDINAL HEALTH INC               | 344.21   | 382.98   | 3,965  | 596,806    |           | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARLISLE COS INC                  | 61.19    | 75.2     | 2,612  | 393,169    |           | 建設関連製品                  |
| CARNIVAL CORP COMMON PAIRED       | 1,322.91 | 1,484.08 | 2,266  | 341,038    |           | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CATERPILLAR INC                   | 658.5    | 779.69   | 24,693 | 3,716,134  |           | 機械                      |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES | 126.31   | 146.08   | 2,414  | 363,366    |           | ソフトウェア                  |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC            | 970.73   | —        | —      | —          |           | 各種電気通信サービス              |
| JPMORGAN CHASE & CO               | 3,650.43 | 4,423.91 | 77,874 | 11,719,271 |           | 銀行                      |
| CHURCH & DWIGHT CO INC            | 302.36   | 389.11   | 3,774  | 568,004    |           | 家庭用品                    |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP         | 198.78   | 228.76   | 2,537  | 381,923    |           | 保険                      |
| CINTAS CORP                       | 111.73   | 141.69   | 8,680  | 1,306,391  |           | 商業サービス・用品               |
| CISCO SYSTEMS INC                 | 5,161.36 | 6,184.56 | 31,095 | 4,679,632  |           | 通信機器                    |
| CLEVELAND-CLIFFS INC              | 693.71   | 835.13   | 1,631  | 245,450    |           | 金属・鉱業                   |
| CLOROX COMPANY                    | 157.94   | 183.05   | 2,786  | 419,295    |           | 家庭用品                    |
| COCA-COLA CO/THE                  | 5,108.54 | 6,273.48 | 37,195 | 5,597,545  |           | 飲料                      |
| COPART INC                        | 540.11   | 1,283.73 | 6,318  | 950,873    |           | 商業サービス・用品               |
| COGNEX CORP                       | 204.32   | —        | —      | —          |           | 電子装置・機器・部品              |
| COLGATE-PALMOLIVE CO              | 988.65   | 1,213.09 | 10,154 | 1,528,192  |           | 家庭用品                    |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A       | 345.46   | 383.76   | 9,033  | 1,359,425  |           | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MOLINA HEALTHCARE INC             | 74.34    | 89.28    | 3,570  | 537,376    |           | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| NRG ENERGY, INC.                  | 283.64   | 348.74   | 1,815  | 273,220    |           | 電力                      |
| COMCAST CORP-CL A                 | 5,492.1  | 6,281.71 | 26,395 | 3,972,295  |           | メディア                    |
| CONAGRA BRANDS INC                | 619.81   | 736.39   | 1,968  | 296,220    |           | 食品                      |
| CONSOLIDATED EDISON INC           | 438.55   | 517.36   | 4,492  | 676,114    |           | 総合公益事業                  |
| CMS ENERGY CORP                   | 366.03   | 441.28   | 2,489  | 374,675    |           | 総合公益事業                  |
| COOPER COS INC                    | 63.42    | 79.71    | 2,969  | 446,822    |           | ヘルスケア機器・用品              |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO          | 252.81   | 304.36   | 1,869  | 281,414    |           | 飲料                      |
| CORNING INC                       | 957.58   | 1,265.61 | 4,018  | 604,715    |           | 電子装置・機器・部品              |
| WOLFSPEED INC                     | 156.84   | —        | —      | —          |           | 半導体・半導体製造装置             |
| SEALED AIR CORP                   | 176.1    | —        | —      | —          |           | 容器・包装                   |
| HEICO CORP-CL A                   | 94.63    | 116.14   | 1,798  | 270,662    |           | 航空宇宙・防衛                 |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC          | —        | 94.42    | 2,349  | 353,526    |           | ソフトウェア                  |
| CUMMINS INC                       | 178.03   | 212.5    | 5,534  | 832,960    |           | 機械                      |
| DARLING INTERNATIONAL INC         | 200.32   | 238.06   | 995    | 149,822    |           | 食品                      |
| DR HORTON INC                     | 406.02   | 457.84   | 6,661  | 1,002,499  |           | 家庭用耐久財                  |
| DANAHER CORP                      | 861.23   | 1,070.45 | 26,546 | 3,994,921  |           | ライフサイエンス・ツール／サービス       |

| 銘柄                             | 期首(前期末)  | 当期末      |          |           |                   | 業種等 |
|--------------------------------|----------|----------|----------|-----------|-------------------|-----|
|                                |          | 株数       | 株数       | 評価額       | 邦貨換算金額            |     |
|                                |          | 外貨建金額    |          |           |                   |     |
| (アメリカ)                         | 百株       | 百株       | 千アメリカ・ドル | 千円        |                   |     |
| MOODY'S CORP                   | 206.82   | 245.21   | 8,986    | 1,352,371 | 資本市場              |     |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS | 629.06   | 759.97   | 5,832    | 877,659   | 情報技術サービス          |     |
| TARGET CORP                    | 577.14   | 711.89   | 10,324   | 1,553,740 | 生活必需品流通・小売業       |     |
| DEERE & CO                     | 362.03   | 413.61   | 15,914   | 2,395,031 | 機械                |     |
| MORGAN STANLEY                 | 1,604.05 | 1,898.13 | 15,944   | 2,399,456 | 資本市場              |     |
| REPUBLIC SERVICES INC          | 270.24   | 335.74   | 6,001    | 903,093   | 商業サービス・用品         |     |
| COSTAR GROUP INC               | 500.52   | 619.75   | 5,101    | 767,767   | 不動産管理・開発          |     |
| DECKERS OUTDOOR CORP           | —        | 41.74    | 3,539    | 532,729   | 織維・アパレル・贅沢品       |     |
| THE WALT DISNEY CO             | 2,274.04 | 2,794.06 | 31,170   | 4,690,853 | 娯楽                |     |
| DOLLAR TREE INC                | 281.49   | 317.56   | 4,442    | 668,480   | 生活必需品流通・小売業       |     |
| DOVER CORP                     | 178.42   | 225.99   | 3,635    | 547,174   | 機械                |     |
| OMNICOM GROUP                  | 265.7    | 305.86   | 2,623    | 394,881   | メディア              |     |
| DTE ENERGY CO                  | 237.92   | 337      | 3,549    | 534,182   | 総合公益事業            |     |
| DUKE ENERGY CORP               | 964.73   | 1,181.23 | 10,789   | 1,623,690 | 電力                |     |
| DARDEN RESTAURANTS INC         | 156.76   | 177.01   | 2,852    | 429,275   | ホテル・レストラン・レジャー    |     |
| EBAY INC                       | 676.67   | 842.27   | 3,552    | 534,645   | 大規模小売業            |     |
| BANK OF AMERICA CORP           | 9,008.68 | 10,908.1 | 36,138   | 5,438,488 | 銀行                |     |
| CITIGROUP INC                  | 2,418.65 | 2,941.7  | 15,879   | 2,389,675 | 銀行                |     |
| EASTMAN CHEMICAL CO            | 167.9    | 167.9    | 1,378    | 207,494   | 化学                |     |
| EATON CORP PLC                 | 496.76   | 611.13   | 16,843   | 2,534,848 | 電気設備              |     |
| CADENCE DESIGN SYS INC         | 343.37   | 417.15   | 12,545   | 1,887,952 | ソフトウェア            |     |
| DISH NETWORK CORP              | 244.16   | —        | —        | —         | メディア              |     |
| ECOLAB INC                     | 325.5    | 381.51   | 8,277    | 1,245,699 | 化学                |     |
| REVVTY INC                     | 156.49   | 179.72   | 1,861    | 280,089   | ライフサイエンス・ツール／サービス |     |
| ELECTRONIC ARTS INC            | 348.38   | 388.01   | 5,551    | 835,467   | 娯楽                |     |
| SALESFORCE INC                 | 1,248.76 | 1,483.57 | 42,897   | 6,455,633 | ソフトウェア            |     |
| ERIE INDEMNITY CO              | 33.72    | 33.72    | 1,186    | 178,531   | 保険                |     |
| EMERSON ELECTRIC CO            | 738.89   | 879.6    | 9,344    | 1,406,309 | 電気設備              |     |
| ATMOS ENERGY CORP              | 175.67   | 245.32   | 2,771    | 417,101   | ガス                |     |
| ENTERGY CORP                   | 260.97   | 307.36   | 3,014    | 453,665   | 電力                |     |
| EOG RESOURCES INC              | 734.98   | 903.94   | 10,034   | 1,510,112 | 石油・ガス・消耗燃料        |     |
| EQUIFAX INC                    | 151.56   | 187.3    | 4,688    | 705,627   | 専門サービス            |     |
| EQT CORP                       | 409.96   | 597.29   | 1,968    | 296,264   | 石油・ガス・消耗燃料        |     |
| ESTEE LAUDER COS INC/THE       | 289.95   | 358.46   | 5,113    | 769,520   | パーソナルケア用品         |     |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL       | 199.74   | 224.15   | 2,818    | 424,150   | 航空貨物・物流サービス       |     |
| EXXON MOBIL CORP               | 5,193.82 | 6,116.07 | 61,674   | 9,281,387 | 石油・ガス・消耗燃料        |     |
| FMC CORP                       | 155.34   | 177.11   | 905      | 136,278   | 化学                |     |
| NEXTERA ENERGY INC             | 2,449.25 | 3,099.21 | 17,358   | 2,612,307 | 電力                |     |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC   | 47.16    | 60.19    | 2,779    | 418,280   | 資本市場              |     |
| FAIR ISAAC CORP                | 29.62    | 37.75    | 4,884    | 735,030   | ソフトウェア            |     |
| ASSURANT INC                   | 58.23    | 87.66    | 1,505    | 226,611   | 保険                |     |
| FASTENAL CO                    | 729.41   | 856.03   | 6,003    | 903,442   | 商社・流通業            |     |
| FIFTH THIRD BANCORP            | 843.62   | 1,054.1  | 3,532    | 531,574   | 銀行                |     |
| M&T BANK CORP                  | 207.66   | 249.58   | 3,398    | 511,407   | 銀行                |     |
| FIRST HORIZON CORP             | 696.34   | —        | —        | —         | 銀行                |     |
| FISERV INC                     | 760.76   | 917.18   | 13,297   | 2,001,107 | 金融サービス            |     |
| FORD MOTOR CO                  | 4,943.79 | 5,859.08 | 7,359    | 1,107,456 | 自動車               |     |
| FRANKLIN RESOURCES INC         | 379.16   | 474.77   | 1,270    | 191,266   | 資本市場              |     |
| FREEPORT-MCMORAN INC           | 1,801.8  | 2,146.28 | 7,984    | 1,201,536 | 金属・鉱業             |     |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A     | 15.87    | 15.84    | 2,364    | 355,881   | 銀行                |     |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO        | 262.69   | 333.44   | 7,958    | 1,197,681 | 保険                |     |

| 銘<br>柄                         | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |                       | 業<br>種<br>等             |
|--------------------------------|-------------|-------------|---------|-------------|-----------------------|-------------------------|
|                                |             | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 |                         |
| (アメリカ)                         |             | 百株          | 百株      | 千アメリカ・ドル    | 千円                    |                         |
| DENTSPLY SIRONA INC            | 255.99      | —           | —       | —           | —                     | ヘルスケア機器・用品              |
| GENERAL DYNAMICS CORP          | 287.25      | 346.34      | 9,320   | 1,402,568   | —                     | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL MILLS INC              | 749.19      | 885.17      | 5,520   | 830,825     | —                     | 食品                      |
| GENUINE PARTS CO               | 173.74      | 207.69      | 2,991   | 450,200     | —                     | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC            | 1,563.88    | 1,900.11    | 13,878  | 2,088,560   | —                     | バイオテクノロジー               |
| GARTNER INC                    | 95.64       | 119.88      | 5,392   | 811,580     | —                     | 情報技術サービス                |
| MCKESSON CORP                  | 179.8       | 208.54      | 10,452  | 1,572,925   | —                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| NVIDIA CORP                    | 3,102.42    | 3,764.94    | 278,229 | 41,870,692  | —                     | 半導体・半導体製造装置             |
| GRACO INC                      | —           | 239.85      | 2,118   | 318,863     | —                     | 機械                      |
| GENERAL ELECTRIC CO            | 1,369.1     | 1,646.58    | 24,122  | 3,630,179   | —                     | コングロマリット                |
| WVW GRAINGER INC               | 54.66       | 67.77       | 6,400   | 963,165     | —                     | 商社・流通業                  |
| HALLIBURTON CO                 | 1,115.7     | 1,392.51    | 4,762   | 716,691     | —                     | エネルギー設備・サービス            |
| MONSTER BEVERAGE CORP          | 497.39      | 1,176.37    | 6,572   | 989,077     | —                     | 飲料                      |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC        | 424.3       | 503         | 19,015  | 2,861,629   | —                     | 資本市場                    |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC      | 243.2       | 287.28      | 6,038   | 908,666     | —                     | 航空宇宙・防衛                 |
| HASBRO INC                     | 154.37      | 163.59      | 861     | 129,715     | —                     | レジャー用品                  |
| HENRY SCHEIN INC               | 174.31      | 174.31      | 1,284   | 193,276     | —                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HEICO CORP                     | 51.85       | 68.78       | 1,329   | 200,151     | —                     | 航空宇宙・防衛                 |
| HERSHEY FOODS CORP             | 186.95      | 225         | 4,303   | 647,577     | —                     | 食品                      |
| HP INC                         | 1,259.55    | 1,341.36    | 3,833   | 576,919     | —                     | コンピュータ・周辺機器             |
| F5 INC                         | 69.24       | 89.81       | 1,654   | 249,036     | —                     | 通信機器                    |
| CROWN HOLDINGS INC NPR         | 153.22      | 181.25      | 1,331   | 200,399     | —                     | 容器・包装                   |
| UNITED THERAPEUTICS CORP       | —           | 76.15       | 1,632   | 245,732     | —                     | バイオテクノロジー               |
| JUNIPER NETWORKS INC           | 437.15      | 578.81      | 2,143   | 322,550     | —                     | 通信機器                    |
| HOLOGIC INC                    | 306.95      | 383.99      | 2,808   | 422,709     | —                     | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT INC                 | 1,275.83    | 1,527.31    | 54,712  | 8,233,733   | —                     | 専門小売り                   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC    | 228.8       | 296.68      | 2,551   | 384,012     | —                     | バイオテクノロジー               |
| HORMEL FOODS CORP              | 388.51      | 490.54      | 1,412   | 212,605     | —                     | 食品                      |
| CENTERPOINT ENERGY INC         | 787.91      | 977.76      | 2,674   | 402,436     | —                     | 総合公益事業                  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC       | 36.02       | 49.17       | 2,197   | 330,717     | —                     | 建設関連製品                  |
| HUBBELL INC                    | 69.03       | 78.2        | 2,812   | 423,294     | —                     | 電気設備                    |
| HUMANA INC                     | 158.44      | 186.41      | 6,753   | 1,016,326   | —                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 103.48      | 122.76      | 2,670   | 401,923     | —                     | 陸上運輸                    |
| HUNTINGTON Bancshares INC      | 1,814.91    | 2,153.85    | 2,739   | 412,297     | —                     | 銀行                      |
| BIOGEN INC                     | 176.03      | 219.1       | 4,836   | 727,831     | —                     | バイオテクノロジー               |
| IDEX CORP                      | 90.65       | 110.45      | 2,507   | 377,344     | —                     | 機械                      |
| ILLINOIS TOOL WORKS            | 387.9       | 464.63      | 11,807  | 1,776,862   | —                     | 機械                      |
| INTUIT INC                     | 335.01      | 427.34      | 28,081  | 4,226,029   | —                     | ソフトウェア                  |
| IDEXX LABORATORIES INC         | 101.62      | 125         | 7,007   | 1,054,483   | —                     | ヘルスケア機器・用品              |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC         | 292.93      | 351.54      | 9,590   | 1,443,253   | —                     | 建設関連製品                  |
| INTEL CORP                     | 5,124.32    | 6,392.05    | 28,246  | 4,250,811   | —                     | 半導体・半導体製造装置             |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES      | 319.79      | 409.93      | 3,254   | 489,698     | —                     | 化学                      |
| INTERNATIONAL PAPER CO         | 441.53      | 534.19      | 1,844   | 277,587     | —                     | 容器・包装                   |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC   | 456.79      | 540.63      | 1,714   | 258,072     | —                     | メディア                    |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC    | 95.06       | 118.57      | 2,078   | 312,726     | —                     | 金融サービス                  |
| JABIL CIRCUIT INC              | —           | 195.86      | 2,767   | 416,540     | —                     | 電子装置・機器・部品              |
| INCYTE CORP                    | 244.49      | 316.54      | 1,832   | 275,765     | —                     | バイオテクノロジー               |
| JOHNSON & JOHNSON              | 3,270.95    | 3,669.56    | 57,149  | 8,600,462   | —                     | 医薬品                     |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP    | 394.02      | 456.59      | 4,175   | 628,442     | —                     | 保険                      |
| KLA CORPORATION                | 177.34      | 204.32      | 13,359  | 2,010,434   | —                     | 半導体・半導体製造装置             |
| DEVON ENERGY CORP              | 783.84      | 969.85      | 4,057   | 610,666     | 石油・ガス・消耗燃料            |                         |

| 銘<br>柄                         | 期 首(前期末) | 当 期 末     |         |            |        | 業 種 等                   |
|--------------------------------|----------|-----------|---------|------------|--------|-------------------------|
|                                |          | 株 数       | 株 数     | 評 価 額      | 邦貨換算金額 |                         |
|                                |          |           |         | 外 貨 建 金 額  |        |                         |
| (アメリカ)                         |          |           |         |            |        |                         |
| KELLANOVA                      |          | 百株        | 百株      | 千アメリカ・ドル   | 千円     |                         |
| KEYCORP                        | 329.41   | 424.51    | 2,291   | 344,912    |        | 食品                      |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 1,189.55 | 1,440.72  | 1,996   | 300,504    |        | 銀行                      |
| BLACKROCK INC/NEW YORK         | 421.73   | 529.32    | 6,267   | 943,143    |        | 家庭用品                    |
| KROGER CO                      | 188.14   | 227.27    | 17,849  | 2,686,214  |        | 資本市場                    |
| LAM RESEARCH CORP              | 827.75   | 1,033.85  | 4,723   | 710,863    |        | 生活必需品流通・小売り             |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC      | 172.6    | 200.26    | 18,337  | 2,759,656  |        | 半導体・半導体製造装置             |
| PACKAGING CORP OF AMERICA      | 58.9     | 74.46     | 3,183   | 479,068    |        | 電子装置・機器・部品              |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP     | 110.29   | 134.51    | 2,224   | 334,809    |        | 容器・包装                   |
| AKAMAI TECHNOLOGIES            | —        | 202.6     | 1,545   | 232,511    |        | 半導体・半導体製造装置             |
| PLUG POWER INC                 | 200.36   | 233.13    | 2,676   | 402,761    |        | 情報技術サービス                |
| LENNAR CORP                    | 561.49   | —         | —       | —          |        | 電気設備                    |
| ELI LILLY & CO                 | 323.61   | 376.67    | 5,795   | 872,213    |        | 家庭用耐久財                  |
| BATH & BODY WORKS INC          | 1,006.41 | 1,230.21  | 93,165  | 14,020,405 |        | 医薬品                     |
| LINCOLN NATIONAL CORP          | 281.56   | 346.38    | 1,519   | 228,732    |        | 専門小売り                   |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B     | 179.37   | —         | —       | —          |        | 保険                      |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC       | 911.89   | 1,108.84  | 15,991  | 2,406,589  |        | 航空貨物・物流サービス             |
| LOCKHEED MARTIN CORP           | 371.89   | 448.25    | 5,927   | 892,053    |        | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| LOEWS CORP                     | 296.95   | 338.42    | 14,152  | 2,129,792  |        | 航空宇宙・防衛                 |
| LOWE'S COS INC                 | 235.3    | 302.89    | 2,226   | 335,118    |        | 保険                      |
| DOMINION ENERGY INC            | 774.78   | 884.86    | 20,080  | 3,021,858  |        | 専門小売り                   |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL      | 1,018.28 | 1,265.01  | 5,674   | 854,005    |        | 総合公益事業                  |
| MCCORMICK & CO INC             | 404.01   | 404.01    | 1,729   | 260,221    |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCDONALD'S CORPORATION         | 320.31   | 402.79    | 2,617   | 393,942    |        | 食品                      |
| S&P GLOBAL INC                 | 914.13   | 1,110.35  | 31,996  | 4,815,221  |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EVEREST GROUP LTD              | 425.05   | 495.71    | 20,879  | 3,142,201  |        | 資本市場                    |
| MARKEL GROUP INC               | 53.53    | 66.7      | 2,474   | 372,438    |        | 保険                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR  | 16.74    | 20.13     | 2,957   | 445,004    |        | 保険                      |
| MARSH & MCLENNAN COS           | 776.95   | 915.1     | 7,873   | 1,184,886  |        | ヘルスケア機器・用品              |
| MASCO CORP                     | 621.47   | 756.06    | 14,948  | 2,249,647  |        | 建設関連製品                  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS INC  | 289.37   | 345.61    | 2,539   | 382,123    |        | 建設資材                    |
| METLIFE INC                    | 77.36    | 93.65     | 5,052   | 760,281    |        | 保険                      |
| MEDTRONIC PLC                  | 847.99   | 974.05    | 6,657   | 1,001,907  |        | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC        | 1,660.79 | 2,021.17  | 16,913  | 2,545,260  |        | 娯楽                      |
| CVS HEALTH CORP                | 974.96   | —         | —       | —          |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MERCK & CO.INC.                | 1,636.16 | 1,973.56  | 15,079  | 2,269,384  |        |                         |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION   | 3,156.72 | 3,864.48  | 48,622  | 7,317,258  |        | 医薬品                     |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS   | 543.62   | 652.5     | 5,328   | 801,956    |        | 半導体・半導体製造装置             |
| MICROSOFT CORP                 | 114.55   | 128.76    | 2,937   | 442,010    |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MICRON TECH INC                | 8,819.04 | 10,756.09 | 440,451 | 66,283,490 |        | ソフトウェア                  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC       | 1,356.54 | 1,680.37  | 13,750  | 2,069,307  |        | 半導体・半導体製造装置             |
| 3M CO                          | 695.97   | 816.68    | 6,580   | 990,345    |        | 半導体・半導体製造装置             |
| MOHAWK INDUSTRIES INC          | 693.96   | 825.77    | 7,631   | 1,148,504  |        | コングロマリット                |
| ENTEGRIS INC                   | 63.11    | —         | —       | —          |        | 家庭用耐久財                  |
| CHARLES RIVER LABORATORIES INT | 177.09   | 236.75    | 3,105   | 467,339    |        | 半導体・半導体製造装置             |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC         | 64.45    | 76.74     | 1,881   | 283,079    |        | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| ILLUMINA INC                   | 205.78   | 248.47    | 7,935   | 1,194,271  |        | 通信機器                    |
| XCEL ENERGY INC                | 198.33   | 243.79    | 3,431   | 516,346    |        | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC     | 693.25   | 827.77    | 4,857   | 730,983    |        | 電力                      |
| NETAPP INC                     | 117.16   | 146.13    | 1,925   | 289,776    |        | バイオテクノロジー               |
| NEWELL BRANDS INC              | 282.65   | 327.85    | 2,877   | 432,991    |        | コンピュータ・周辺機器             |
|                                | 419.84   | —         | —       | —          |        | 家庭用耐久財                  |

| 銘<br>柄                       | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |                      | 業<br>種<br>等             |
|------------------------------|-------------|-------------|--------|----------------------|-------------------------|
|                              |             | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額<br>外貨建金額 |                         |
| (アメリカ)                       |             | 百株          | 百株     | 千アメリカ・ドル             | 千円                      |
| NEWMONT CORP                 | 992.87      | 1,736.08    | 5,576  | 839,175              | 金属・鉱業                   |
| NVR INC                      | 4.05        | 4.83        | 3,623  | 545,275              | 家庭用耐久財                  |
| NIKE INC-CL B                | 1,574.85    | 1,877.2     | 19,960 | 3,003,820            | 織維・アパレル・贅沢品             |
| NORDSON CORP                 | 64.47       | 75.48       | 1,990  | 299,559              | 機械                      |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 289.97      | 341.4       | 8,612  | 1,296,043            | 陸上運輸                    |
| EVERSOURCE ENERGY            | 430.42      | 518.61      | 2,959  | 445,328              | 電力                      |
| NISOURCE INC                 | 532.7       | 645.43      | 1,638  | 246,517              | 総合公益事業                  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 248.36      | 328.68      | 2,597  | 390,955              | 資本市場                    |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 183.61      | 220.98      | 9,863  | 1,484,415            | 航空宇宙・防衛                 |
| WELLS FARGO & CO             | 4,724.91    | 5,582.86    | 27,093 | 4,077,318            | 銀行                      |
| NUCOR CORP                   | 316.6       | 374.96      | 6,789  | 1,021,680            | 金属・鉱業                   |
| CHENIERE ENERGY INC          | 285.54      | 364.22      | 5,666  | 852,811              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 466.54      | 576.3       | 7,786  | 1,171,773            | 消費者金融                   |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 1,147.44    | 997.74      | 5,717  | 860,358              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 116.3       | 148.54      | 6,404  | 963,738              | 陸上運輸                    |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      | 77.57       | 90.84       | 9,531  | 1,434,446            | 専門小売り                   |
| ORACLE CORP                  | 1,992.12    | 2,507.07    | 28,645 | 4,310,903            | ソフトウェア                  |
| PACCAR INC                   | 648.01      | 777.44      | 8,292  | 1,248,006            | 機械                      |
| PTC INC                      | 136.65      | 180.85      | 3,268  | 491,931              | ソフトウェア                  |
| EXELON CORP                  | 1,216.64    | 1,571.97    | 5,363  | 807,162              | 電力                      |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 161.01      | 192.11      | 10,026 | 1,508,874            | 機械                      |
| PAYCHEX INC                  | 405.19      | 491.52      | 6,007  | 904,047              | 専門サービス                  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 96.51       | 114.52      | 3,467  | 521,762              | ヘルスケア機器・用品              |
| PPL CORPORATION              | 887.37      | 1,136.87    | 2,961  | 445,683              | 電力                      |
| PEPSICO INC                  | 1,714.95    | 2,105.84    | 35,277 | 5,308,840            | 飲料                      |
| PENTAIR PLC                  | 198.04      | 255.45      | 1,915  | 288,243              | 機械                      |
| PFIZER INC                   | 6,989.45    | 8,623.81    | 23,379 | 3,518,328            | 医薬品                     |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 327.96      | 403.19      | 1,428  | 214,975              | 水道                      |
| CONOCOPHILLIPS               | 1,591.69    | 1,839.94    | 20,261 | 3,049,140            | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PG&E CORP                    | 1,782.57    | 3,061.39    | 5,005  | 753,258              | 電力                      |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 284.45      | 362.19      | 8,161  | 1,228,292            | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ALTRIA GROUP INC             | 2,244.42    | 2,710.33    | 10,949 | 1,647,825            | タバコ                     |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 510.1       | 598.05      | 8,843  | 1,330,838            | 銀行                      |
| BROWN & BROWN INC            | 306.5       | 369.07      | 3,033  | 456,549              | 保険                      |
| GARMIN LTD                   | 199.11      | 232.81      | 2,859  | 430,341              | 家庭用耐久財                  |
| PPG INDUSTRIES INC           | 283.41      | 357.48      | 5,008  | 753,698              | 化学                      |
| COSTCO WHOLESALE CORP        | 551.82      | 676.03      | 48,821 | 7,347,152            | 生活必需品流通・小売り             |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 277.07      | 342.93      | 3,647  | 548,897              | 資本市場                    |
| QUEST DIAGNOSTICS            | 145.36      | 165.74      | 2,116  | 318,561              | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PROCTER & GAMBLE CO          | 2,967.79    | 3,594.41    | 55,939 | 8,418,380            | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CORP             | 731.78      | 898.08      | 16,879 | 2,540,182            | 保険                      |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 601         | 742.43      | 4,363  | 656,627              | 総合公益事業                  |
| PULTE GROUP INC              | 290.5       | 339.5       | 3,524  | 530,430              | 家庭用耐久財                  |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 336.53      | 400.68      | 5,568  | 838,026              | 金融サービス                  |
| QUALCOMM INC                 | 1,401.58    | 1,702.86    | 26,213 | 3,944,918            | 半導体・半導体製造装置             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 234.37      | 291.41      | 3,400  | 511,735              | 資本市場                    |
| EXACT SCIENCES CORP          | 233.86      | 260.45      | 1,617  | 243,362              | バイオテクノロジー               |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO | —           | 87.47       | 2,577  | 387,858              | 金属・鉱業                   |
| REGENERON PHARMACEUTICALS    | 133.97      | 160.52      | 15,214 | 2,289,616            | バイオテクノロジー               |
| REPLIGEN CORP                | 67.3        | 85.76       | 1,766  | 265,915              | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| RESMED INC                   | 186.28      | 228.99      | 4,134  | 622,188              | ヘルスケア機器・用品              |

| 銘柄                                       | 期首(前期末)  | 当期末       |          |           |             | 業種等                     |
|--|----------|-----------|----------|-----------|-------------|-------------------------|
|  |          | 株数        | 株数       | 評価額       | 外貨建金額邦貨換算金額 |                         |
| (アメリカ)                                   | 百株       | 百株        | 千アメリカ・ドル | 千円        |             |                         |
| US BANCORP                               | 1,766    | 2,292.27  | 9,283    | 1,397,103 |             | 銀行                      |
| SEAGEN INC                               | 168.6    | —         | —        | —         |             | バイオテクノロジー               |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                   | 458.51   | 563.09    | 4,778    | 719,183   |             | 保険                      |
| ROSS STORES INC                          | 441.71   | 508.78    | 7,351    | 1,106,306 |             | 専門小売り                   |
| ROLLINS INC                              | 259.2    | 457.08    | 2,022    | 304,377   |             | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC                   | 131.2    | 163.44    | 8,853    | 1,332,394 |             | ソフトウェア                  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC                  | 146.33   | 173.27    | 4,850    | 729,928   |             | 電気設備                    |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD              | 274.77   | 374.64    | 4,369    | 657,554   |             | ホテル・レストラン・レジャー          |
| RPM INTERNATIONAL INC                    | 164.67   | 192.58    | 2,082    | 313,404   |             | 化学                      |
| ACCENTURE PLC-CL A                       | 788.43   | 956.12    | 35,470   | 5,337,901 |             | 情報技術サービス                |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC               | 1,686.45 | 2,088.47  | 14,913   | 2,244,372 |             | 食品                      |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC                 | 132.32   | 162.17    | 4,462    | 671,526   |             | 保険                      |
| AXON ENTERPRISE INC                      | —        | 110.39    | 2,989    | 449,935   |             | 航空宇宙・防衛                 |
| THE TRAVELERS COMPANIES INC              | 295.95   | 348.35    | 7,545    | 1,135,591 |             | 保険                      |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION            | 750.43   | 893.54    | 5,597    | 842,312   |             | 金融サービス                  |
| BOOKING HOLDINGS INC                     | 49.56    | 54.52     | 20,381   | 3,067,176 |             | ホテル・レストラン・レジャー          |
| SCHLUMBERGER LTD                         | 1,774.1  | 2,179.9   | 10,409   | 1,566,453 |             | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP                    | 1,813.79 | 2,301.45  | 14,506   | 2,183,013 |             | 資本市場                    |
| POOL CORP                                | 46.6     | 63.05     | 2,413    | 363,196   |             | 販売                      |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC               | 261.44   | 321.14    | 3,912    | 588,832   |             | ヘルスケア機器・用品              |
| BUNGE LTD                                | 186.42   | —         | —        | —         |             | 食品                      |
| SEI INVESTMENTS CO                       | 144.77   | 144.77    | 953      | 143,485   |             | 資本市場                    |
| ELEVANCE HEALTH INC                      | 299.28   | 361.39    | 18,290   | 2,752,508 |             | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENCORA INC                              | 191.04   | 257.01    | 5,951    | 895,692   |             | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP                | 319.21   | 355.91    | 2,800    | 421,470   |             | 保険                      |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE                  | 304.76   | 375       | 11,663   | 1,755,258 |             | 化学                      |
| CENTENE CORP                             | 700.8    | 824.87    | 6,391    | 961,919   |             | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SVB FINANCIAL GROUP                      | 73.3     | —         | —        | —         |             | 銀行                      |
| SMITH (A.O.) CORP                        | 148.56   | 195.63    | 1,587    | 238,967   |             | 建設関連製品                  |
| SNAP-ON INC                              | 70.68    | 82.04     | 2,158    | 324,877   |             | 機械                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC                 | 467.76   | 543.92    | 5,787    | 870,932   |             | 保険                      |
| ADVANCE AUTO PARTS                       | 71.65    | —         | —        | —         |             | 専門小売り                   |
| EDISON INTERNATIONAL                     | 485.33   | 576.12    | 3,746    | 563,812   |             | 電力                      |
| SOUTHERN CO                              | 1,360.27 | 1,667.22  | 11,305   | 1,701,352 |             | 電力                      |
| TRUIST FINANCIAL CORP                    | 1,653.26 | 1,987.29  | 7,036    | 1,058,997 |             | 銀行                      |
| SOUTHWEST AIRLINES                       | 197      | 197       | 664      | 100,057   |             | 旅客航空輸送                  |
| AT&T INC                                 | 8,882.01 | 10,942.28 | 18,503   | 2,784,575 |             | 各種電気通信サービス              |
| CHEVRON CORP                             | 2,316.39 | 2,770.81  | 41,842   | 6,296,802 |             | 石油・ガス・消耗燃料              |
| STANLEY BLACK & DECKER INC               | 192.7    | 225.92    | 2,002    | 301,398   |             | 機械                      |
| STATE STREET CORP                        | 461.98   | 504.16    | 3,604    | 542,477   |             | 資本市場                    |
| STARBUCKS CORP                           | 1,428.19 | 1,751.61  | 16,477   | 2,479,683 |             | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STEEL DYNAMICS INC                       | 229.37   | 229.37    | 2,746    | 413,317   |             | 金属・鉱業                   |
| STRYKER CORP                             | 426.35   | 518.49    | 18,117   | 2,726,439 |             | ヘルスケア機器・用品              |
| NETFLIX INC                              | 554.71   | 676.48    | 39,190   | 5,897,780 |             | 娯楽                      |
| GEN DIGITAL INC                          | 730.86   | 925.83    | 1,973    | 297,047   |             | ソフトウェア                  |
| KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 203.18   | 274       | 1,619    | 243,735   |             | 陸上運輸                    |
| SYNOPSYS INC                             | 187.79   | 233.14    | 13,119   | 1,974,351 |             | ソフトウェア                  |
| SYSCO CORP                               | 625.21   | 764.19    | 6,037    | 908,523   |             | 生活必需品流通・小売り             |
| INTUITIVE SURGICAL INC                   | 446.32   | 534.63    | 20,410   | 3,071,506 |             | ヘルスケア機器・用品              |
| TELEFLEX INC                             | 55.32    | 69.85     | 1,739    | 261,815   |             | ヘルスケア機器・用品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES           | 1,347.81 | 1,692.5   | 2,229    | 335,445   |             | 医薬品                     |

| 銘<br>柄                        | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |          |                      | 業<br>種<br>等             |
|-------------------------------|-------------|-------------|----------|----------------------|-------------------------|
|                               |             | 株<br>数      | 株<br>数   | 評<br>価<br>額<br>外貨建金額 |                         |
| (アメリカ)                        | 百株          | 百株          | 千アメリカ・ドル | 千円                   |                         |
| TERADYNE INC                  | 185.12      | 220.66      | 2,241    | 337,284              | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXAS INSTRUMENTS INC         | 1,137.01    | 1,389.08    | 21,929   | 3,300,156            | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                   | 258.24      | 298.41      | 2,575    | 387,643              | 航空宇宙・防衛                 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  | 487.95      | 588.51      | 32,266   | 4,855,746            | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| GLOBE LIFE INC                | 121.53      | 149.73      | 1,876    | 282,449              | 保険                      |
| TORO CO                       | —           | 146.44      | 1,394    | 209,931              | 機械                      |
| DAVITA INC                    | 68.13       | 68.13       | 840      | 126,530              | ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |
| TRACTOR SUPPLY CO             | 136.9       | 168.08      | 3,958    | 595,656              | 専門小売り                   |
| BIO-TECHNE CORP               | 206.52      | 259.34      | 1,818    | 273,664              | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| TRIMBLE INC                   | 286.76      | 375.04      | 2,183    | 328,535              | 電子装置・機器・部品              |
| TYLER TECHNOLOGIES INC        | 53          | 61.75       | 2,717    | 409,002              | ソフトウェア                  |
| TYSON FOODS INC               | 356.84      | 413.16      | 2,147    | 323,193              | 食品                      |
| UGI CORP                      | 241.6       | —           | —        | —                    | ガス                      |
| MARATHON OIL CORP             | 840.59      | 929.52      | 2,081    | 313,199              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| UNION PACIFIC CORP            | 777.69      | 931.33      | 23,293   | 3,505,438            | 陸上運輸                    |
| RTX CORP                      | 1,830.61    | 2,234.86    | 20,424   | 3,073,665            | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC        | 1,165.09    | 1,413.9     | 73,090   | 10,999,336           | ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 80.96       | 99.03       | 1,601    | 240,996              | ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |
| VF CORP                       | 378.87      | 517.62      | 890      | 133,982              | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| PARAMOUNT GLOBAL              | 786.63      | 813.26      | 1,072    | 161,429              | メディア                    |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC    | 321.4       | 394.11      | 16,469   | 2,478,430            | バイオテクノロジー               |
| VULCAN MATERIALS CO           | 164.52      | 200.95      | 4,844    | 729,109              | 建設資材                    |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC  | 917.06      | 1,071.24    | 2,307    | 347,248              | 生活必需品流通・小売り             |
| WALMART INC                   | 1,878.96    | 2,261.8     | 38,133   | 5,738,777            | 生活必需品流通・小売り             |
| WASTE MANAGEMENT INC          | 505.78      | 621.22      | 12,372   | 1,861,895            | 商業サービス・用品               |
| WATERS CORP                   | 75.11       | 87.86       | 2,789    | 419,826              | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| WATSCO INC                    | —           | 48.89       | 1,895    | 285,292              | 商社・流通業                  |
| WEBSTER FINANCIAL CORP        | 222.85      | —           | —        | —                    | 銀行                      |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES  | 96.41       | 114.64      | 4,679    | 704,216              | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW         | 126.79      | 156.04      | 1,954    | 294,117              | 食品                      |
| VAIL RESORTS INC              | 52.35       | 65.23       | 1,462    | 220,085              | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESTERN DIGITAL CORP          | 407.23      | 494.51      | 2,773    | 417,340              | コンピュータ・周辺機器             |
| WABTEC CORP                   | 202.73      | 284         | 3,836    | 577,363              | 機械                      |
| WHIRLPOOL CORP                | 68.32       | —           | —        | —                    | 家庭用耐久財                  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        | 188.33      | 253.19      | 2,679    | 403,239              | 半導体・半導体製造装置             |
| WYNN RESORTS LTD              | 127.57      | 153.79      | 1,618    | 243,496              | ホテル・レストラン・レジャー          |
| NASDAQ INC                    | 415.96      | 529.69      | 2,956    | 444,878              | 資本市場                    |
| CME GROUP INC                 | 443.42      | 541.32      | 11,648   | 1,752,926            | 資本市場                    |
| WILLIAMS COS INC              | 1,518.9     | 1,807.81    | 5,974    | 899,149              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DICK'S SPORTING GOODS INC     | —           | 85.51       | 1,427    | 214,812              | 専門小売り                   |
| LKQ CORP                      | 315.04      | 438.82      | 2,143    | 322,595              | 販売                      |
| ALLIANT ENERGY CORP           | 339.66      | 405.24      | 1,930    | 290,469              | 電力                      |
| WEC ENERGY GROUP INC          | 383.18      | 478.82      | 3,670    | 552,321              | 総合公益事業                  |
| CARMAX INC                    | 186.73      | 224.14      | 1,630    | 245,425              | 専門小売り                   |
| TJX COMPANIES INC             | 1,452.28    | 1,724.69    | 16,758   | 2,522,033            | 専門小売り                   |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP       | 67.3        | 77.85       | 1,969    | 296,358              | 電子装置・機器・部品              |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD    | 1,560.49    | 1,560.49    | 497      | 74,913               | 不動産管理・開発                |
| JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD | 173.28      | 235.28      | 989      | 148,852              | コングロマリット                |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC   | 150.92      | 192.71      | 3,163    | 476,050              | バイオテクノロジー               |
| SIGNATURE BANK                | 79.96       | —           | —        | —                    | 銀行                      |
| CBRE GROUP INC                | 410.89      | 485.77      | 4,220    | 635,196              | 不動産管理・開発                |

| 銘<br>柄                            | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                       | 業<br>種<br>等    |
|-----------------------------------|-------------|-------------|--------|-------------|-----------------------|----------------|
|                                   |             | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 |                |
| (アメリカ)                            |             | 百株          | 百株     | 千アメリカ・ドル    | 千円                    |                |
| LIBERTY GLOBAL PLC                | 157.79      | —           | —      | —           | —                     | 各種電気通信サービス     |
| REGIONS FINANCIAL CORP            | 1,172.22    | 1,525.88    | 2,790  | 419,992     | —                     | 銀行             |
| DOMINO'S PIZZA INC                | 41.15       | 51.37       | 2,180  | 328,151     | —                     | ホテル・レストラン・レジャー |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC      | 53.87       | 71.27       | 5,310  | 799,237     | —                     | 半導体・半導体製造装置    |
| WESTLAKE CORP                     | 41.87       | 60.3        | 851    | 128,123     | —                     | 化学             |
| T-MOBILE US INC                   | 784.34      | 806.97      | 13,026 | 1,960,299   | —                     | 無線通信サービス       |
| LAS VEGAS SANDS CORP              | 429.72      | 594.74      | 3,240  | 487,609     | —                     | ホテル・レストラン・レジャー |
| MOSAIC CO/THE                     | 425.61      | 485.02      | 1,433  | 215,687     | —                     | 化学             |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC          | 48.71       | 61.26       | 1,324  | 199,324     | —                     | 資本市場           |
| CELANESE CORP                     | 138.41      | 162.73      | 2,410  | 362,808     | —                     | 化学             |
| DEXCOM INC                        | 487.1       | 585.53      | 6,836  | 1,028,759   | —                     | ヘルスケア機器・用品     |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC          | —           | 195.54      | 3,651  | 549,486     | —                     | 建設関連製品         |
| EXPEDIA GROUP INC                 | 191.86      | 219.78      | 2,963  | 445,913     | —                     | ホテル・レストラン・レジャー |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC        | 240.27      | 309.69      | 2,402  | 361,563     | —                     | 化学             |
| AMERIPRIZE FINANCIAL INC          | 131.23      | 155.36      | 6,080  | 915,004     | —                     | 資本市場           |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C       | 360.34      | —           | —      | —           | —                     | 各種電気通信サービス     |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC     | 698.96      | 873.85      | 11,942 | 1,797,156   | —                     | 資本市場           |
| LIVE NATION                       | 204.44      | 235.97      | 2,109  | 317,469     | —                     | 娯楽             |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC        | 34.74       | 42.26       | 11,072 | 1,666,364   | —                     | ホテル・レストラン・レジャー |
| TRANSDIGM GROUP INC               | 61.48       | 84.96       | 9,746  | 1,466,678   | —                     | 航空宇宙・防衛        |
| MASTERCARD INC                    | 1,074.66    | 1,282.61    | 59,665 | 8,979,096   | —                     | 金融サービス         |
| CELSIUS HOLDINGS INC              | —           | 236.23      | 1,477  | 222,402     | —                     | 飲料             |
| WESTERN UNION CO                  | 467.12      | —           | —      | —           | —                     | 金融サービス         |
| OWENS CORNING                     | 132.27      | 132.27      | 1,891  | 284,705     | —                     | 建設関連製品         |
| LEIDOS HOLDINGS INC               | 151.08      | 206.79      | 2,512  | 378,105     | —                     | 専門サービス         |
| AERCAP HOLDINGS NV                | 178.61      | 300.64      | 2,316  | 348,644     | —                     | 商社・流通業         |
| FIRST SOLAR INC                   | 119.03      | 155.79      | 2,465  | 370,991     | —                     | 半導体・半導体製造装置    |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS    | 153         | 183.98      | 3,614  | 543,969     | —                     | 専門サービス         |
| SUPER MICRO COMPUTER INC          | —           | 72.63       | 6,395  | 962,448     | —                     | コンピュータ・周辺機器    |
| AECOM TECHNOLOGY CORP             | —           | 210.94      | 1,895  | 285,191     | —                     | 建設・土木          |
| DELTA AIR LINES INC               | 215.92      | 215.92      | 881    | 132,704     | —                     | 旅客航空輸送         |
| INSULET CORP                      | 88.34       | 101.58      | 1,917  | 288,599     | —                     | ヘルスケア機器・用品     |
| DISCOVER FINANCIAL                | 332.36      | 391.88      | 4,275  | 643,465     | —                     | 消費者金融          |
| TE CONNECTIVITY LTD               | 387.62      | 470.54      | 6,719  | 1,011,189   | —                     | 電子装置・機器・部品     |
| MASIMO CORP                       | 56.88       | —           | —      | —           | —                     | ヘルスケア機器・用品     |
| LULULEMON ATHLETICA INC           | 145.47      | 172.55      | 7,949  | 1,196,327   | —                     | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| VMWARE INC                        | 266.9       | —           | —      | —           | —                     | ソフトウェア         |
| MERCADOLIBRE INC                  | 57.15       | 69.13       | 12,072 | 1,816,813   | —                     | 大規模小売り         |
| ULTA BEAUTY INC                   | 60.73       | 72.63       | 3,824  | 575,567     | —                     | 専門小売り          |
| INVESCO LTD                       | 385.3       | —           | —      | —           | —                     | 資本市場           |
| MSCI INC                          | 98.07       | 119.48      | 6,843  | 1,029,925   | —                     | 資本市場           |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL       | 1,930.16    | 2,367.46    | 21,122 | 3,178,721   | —                     | タバコ            |
| VISA INC                          | 2,035.26    | 2,448.21    | 67,952 | 10,226,174  | —                     | 金融サービス         |
| KEURIG DR PEPPER INC              | 928.16      | 1,607.6     | 4,999  | 752,395     | —                     | 飲料             |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC       | 228.09      | 317.51      | 3,825  | 575,678     | —                     | 水道             |
| MARATHON PETROLEUM CORP           | 631.37      | 615.28      | 10,452 | 1,572,978   | —                     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC    | 161.82      | 214.3       | 1,704  | 256,516     | —                     | 建設関連製品         |
| KINDER MORGAN INC/DELAWARE        | 2,578.77    | 2,983.12    | 4,943  | 743,876     | —                     | 石油・ガス・消耗燃料     |
| XYLEM INC                         | 228.48      | 368.91      | 4,580  | 689,302     | —                     | 機械             |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV      | 333.42      | 404.21      | 3,825  | 575,690     | —                     | 化学             |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | 47.13       | 64.81       | 1,816  | 273,393     | —                     | 航空宇宙・防衛        |

| 銘<br>柄                               | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |                       | 業<br>種<br>等             |
|--------------------------------------|-------------|-------------|---------|-------------|-----------------------|-------------------------|
|                                      |             | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 |                         |
| (アメリカ)                               |             | 百株          | 百株      | 千アメリカ・ドル    | 千円                    |                         |
| SPLUNK INC                           | 208.98      | 247.88      | 3,829   | 576,338     |                       | ソフトウェア                  |
| EPAM SYSTEMS INC                     | 70.9        | 81.62       | 2,270   | 341,639     |                       | 情報技術サービス                |
| HCA HEALTHCARE INC                   | 287.52      | 307.02      | 9,377   | 1,411,191   |                       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| VERISK ANALYTICS INC                 | 189.74      | 216.63      | 5,332   | 802,432     |                       | 専門サービス                  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC             | 77.92       | 107.06      | 1,308   | 196,946     |                       | 医薬品                     |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC            | 88.44       | 102.95      | 2,804   | 421,996     |                       | 金融サービス                  |
| FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA | 224.34      | —           | —       | —           |                       | 銀行                      |
| NXP SEMICONDUCTOR NV                 | 321.09      | 389.38      | 9,109   | 1,370,954   |                       | 半導体・半導体製造装置             |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP     | 163.43      | 192.42      | 2,792   | 420,257     |                       | 専門サービス                  |
| TARGA RESOURCES CORP                 | 258.3       | 332.63      | 2,938   | 442,207     |                       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| LEAR CORP                            | 69.11       | 93.98       | 1,267   | 190,775     |                       | 自動車用部品                  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC              | 127.09      | 156.08      | 2,883   | 433,973     |                       | 資本市場                    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC       | 310.59      | 342.95      | 2,162   | 325,507     |                       | 専門サービス                  |
| DOLLAR GENERAL CORP                  | 278.99      | 334.44      | 4,414   | 664,354     |                       | 生活必需品流通・小売り             |
| FORTINET INC                         | 811.66      | 1,005.99    | 7,130   | 1,073,062   |                       | ソフトウェア                  |
| HYATT HOTELS CORP                    | —           | 66.47       | 857     | 129,109     |                       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HORIZON PHARMA PLC                   | 276.13      | —           | —       | —           |                       | バイオテクノロジー               |
| TESLA INC                            | 3,319.53    | 4,357.58    | 82,231  | 12,375,077  |                       | 自動車                     |
| GENERAC HOLDINGS INC                 | 69.14       | —           | —       | —           |                       | 電気設備                    |
| ENPHASE ENERGY INC                   | 170.46      | 215.39      | 2,834   | 426,633     |                       | 半導体・半導体製造装置             |
| GENERAL MOTORS CO                    | 1,712.1     | 2,080.56    | 7,983   | 1,201,378   |                       | 自動車                     |
| ALLY FINANCIAL INC                   | 392.3       | 392.3       | 1,413   | 212,770     |                       | 消費者金融                   |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC           | 96.61       | 118.95      | 3,033   | 456,470     |                       | 資本市場                    |
| APTIV PLC                            | 343.1       | 430.97      | 3,410   | 513,275     |                       | 自動車用部品                  |
| PHILLIPS 66                          | 594.04      | 683.58      | 9,926   | 1,493,803   |                       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| META PLATFORMS INC                   | 2,845.33    | 3,387.66    | 160,331 | 24,128,238  |                       | インターラクティブ・メディアおよびサービス   |
| IQVIA HOLDINGS INC                   | 225.14      | 278.48      | 6,780   | 1,020,345   |                       | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| DIAMONDBACK ENERGY INC               | 200.87      | 248.5       | 4,221   | 635,221     |                       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SERVICENOW INC                       | 253.33      | 311.78      | 24,692  | 3,716,045   |                       | ソフトウェア                  |
| PALO ALTO NETWORKS INC               | 369.42      | 468.54      | 17,257  | 2,597,116   |                       | ソフトウェア                  |
| WORKDAY INC                          | 255.47      | 310.6       | 9,387   | 1,412,736   |                       | ソフトウェア                  |
| ABBVIE INC                           | 2,201.98    | 2,688.95    | 46,900  | 7,058,081   |                       | バイオテクノロジー               |
| ZOETIS INC                           | 587.56      | 702.24      | 12,926  | 1,945,359   |                       | 医薬品                     |
| NEWS CORP/NEW-CL A                   | 542.11      | 542.11      | 1,410   | 212,195     |                       | メディア                    |
| CDW CORP                             | 164.65      | 202.62      | 4,852   | 730,229     |                       | 電子装置・機器・部品              |
| HOWMET AEROSPACE INC                 | 475.9       | 631.1       | 3,999   | 601,946     |                       | 航空宇宙・防衛                 |
| TWILIO INC                           | 210.9       | 257.1       | 1,858   | 279,619     |                       | 情報技術サービス                |
| SNAP INC                             | 1,273.18    | 1,522.5     | 1,735   | 261,197     |                       | インターラクティブ・メディアおよびサービス   |
| TRADE DESK INC A                     | 532.3       | 668.55      | 4,967   | 747,633     |                       | メディア                    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C         | 224.66      | —           | —       | —           |                       | 娯楽                      |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A             | 88.45       | —           | —       | —           |                       | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C             | 198.71      | —           | —       | —           |                       | メディア                    |
| OKTA INC                             | 178.28      | 218.31      | 1,912   | 287,796     |                       | 情報技術サービス                |
| BLACK KNIGHT INC                     | 176.53      | —           | —       | —           |                       | ソフトウェア                  |
| BAKER HUGHES CO                      | 1,262.92    | 1,521.6     | 4,389   | 660,623     |                       | エネルギー設備・サービス            |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC             | 181.67      | 217.85      | 2,240   | 337,185     |                       | 食品                      |
| CNH INDUSTRIAL NV                    | —           | 1,619.62    | 2,032   | 305,889     |                       | 機械                      |
| BROADCOM INC                         | 502.59      | 676.79      | 85,425  | 12,855,726  |                       | 半導体・半導体製造装置             |
| ARES MANAGEMENT CORP                 | 195.34      | 231.61      | 3,166   | 476,502     |                       | 資本市場                    |
| MONGODB INC                          | 90.21       | 109.06      | 5,305   | 798,481     |                       | 情報技術サービス                |
| BURLINGTON STORES INC                | 84.53       | 105.65      | 2,062   | 310,369     |                       | 専門小売り                   |

| 銘<br>柄                               | 期首(前期末)  | 当<br>期<br>末 |        |             |                       | 業<br>種<br>等             |
|--------------------------------------|----------|-------------|--------|-------------|-----------------------|-------------------------|
|                                      |          | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 |                         |
| (アメリカ)                               |          | 百株          | 百株     | 千アメリカ・ドル    | 千円                    |                         |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC             | 613.21   | —           | —      | —           | —                     | 医薬品                     |
| VEEVA SYSTEMS INC                    | 168.56   | 232.73      | 5,135  | 772,864     | —                     | ヘルスケア・テクノロジー            |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC     | 242.12   | —           | —      | —           | —                     | 電気設備                    |
| EVERGY INC                           | 282.26   | 331.92      | 1,632  | 245,707     | —                     | 電力                      |
| ALLEGION PLC                         | 101.4    | 134.23      | 1,760  | 264,987     | —                     | 建設関連製品                  |
| DAYFORCE INC                         | 183.14   | 220.02      | 1,590  | 239,391     | —                     | 専門サービス                  |
| STERIS PLC                           | 125.24   | 155.4       | 3,537  | 532,292     | —                     | ヘルスケア機器・用品              |
| DOCUSIGN INC                         | 263.62   | 319.74      | 1,633  | 245,833     | —                     | ソフトウェア                  |
| WIX.COM LTD                          | 58.55    | 89.97       | 1,166  | 175,473     | —                     | 情報技術サービス                |
| DROPBOX INC                          | 304.79   | 418.01      | 1,354  | 203,879     | —                     | ソフトウェア                  |
| KKR & CO INC                         | 674.3    | 903.73      | 8,671  | 1,304,942   | —                     | 資本市場                    |
| FUTU HOLDINGS LTD ADR                | 50.5     | 50.5        | 252    | 37,975      | —                     | 資本市場                    |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC        | 279.21   | 338.57      | 2,171  | 326,802     | —                     | ソフトウェア                  |
| MODERNA INC                          | 416.26   | 500.06      | 4,298  | 646,808     | —                     | バイオテクノロジー               |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC        | 344.09   | 402.32      | 7,752  | 1,166,704   | —                     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARAMARK                              | 311.33   | —           | —      | —           | —                     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CIGNA GROUP                          | 382.14   | 451.63      | 15,292 | 2,301,389   | —                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DELL TECHNOLOGIES INC                | 327.7    | 386.69      | 3,327  | 500,692     | —                     | コンピュータ・周辺機器             |
| DOW INC                              | 876.67   | 1,060.37    | 5,681  | 855,003     | —                     | 化学                      |
| OVINTIV INC                          | 316.03   | 391.6       | 1,660  | 249,871     | —                     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AMCOR PLC                            | 1,887.89 | 2,233.48    | 1,998  | 300,824     | —                     | 容器・包装                   |
| PINTEREST INC                        | 697.46   | 909.36      | 3,257  | 490,195     | —                     | インターラクティブ・メディアおよびサービス   |
| FOX CORP-A                           | 365.01   | 365.01      | 1,104  | 166,164     | —                     | メディア                    |
| FOX CORP-B                           | 155.11   | 275.07      | 763    | 114,830     | —                     | メディア                    |
| CLARIVATE ANALYTICS PLC              | 425.86   | —           | —      | —           | —                     | 専門サービス                  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC             | 257.23   | 338.13      | 11,312 | 1,702,363   | —                     | ソフトウェア                  |
| CHEWY INC                            | 96.48    | —           | —      | —           | —                     | 専門小売り                   |
| AVANTOR INC                          | 782.14   | 971.57      | 2,370  | 356,756     | —                     | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| DYNATRACE INC                        | 254.29   | 393.62      | 2,076  | 312,528     | —                     | ソフトウェア                  |
| CLOUDFLARE INC                       | 297.7    | 432.84      | 4,517  | 679,846     | —                     | 情報技術サービス                |
| TRADEWEB MARKETS INC                 | 138      | 169.18      | 1,734  | 261,091     | —                     | 資本市場                    |
| CARRIER GLOBAL CORP                  | 1,018.98 | 1,243.79    | 6,840  | 1,029,478   | —                     | 建設関連製品                  |
| OTIS WORLDWIDE CORP                  | 528.55   | 626         | 5,685  | 855,679     | —                     | 機械                      |
| UBER TECHNOLOGIES INC                | 1,815.6  | 2,811.19    | 22,250 | 3,348,488   | —                     | 陸上運輸                    |
| CORTEVA INC                          | 905.9    | 1,080.01    | 5,840  | 878,966     | —                     | 化学                      |
| MATCH GROUP INC                      | 352.59   | 447.64      | 1,627  | 244,873     | —                     | インターラクティブ・メディアおよびサービス   |
| FERGUSON PLC                         | 257.02   | 308.68      | 5,974  | 899,102     | —                     | 商社・流通業                  |
| BILL HOLDINGS INC                    | 119.88   | 162.43      | 1,051  | 158,299     | —                     | ソフトウェア                  |
| BLACKSTONE INC                       | 880.26   | 1,085.46    | 13,888 | 2,090,074   | —                     | 資本市場                    |
| PAYLOCITY HOLDING CORP               | 53.22    | 58.09       | 999    | 150,361     | —                     | 専門サービス                  |
| CARLYLE GROUP INC                    | 245.3    | 348.47      | 1,534  | 230,898     | —                     | 資本市場                    |
| DATADOG INC                          | 291.79   | 386.35      | 5,260  | 791,600     | —                     | ソフトウェア                  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC      | 256.89   | 308.9       | 2,681  | 403,548     | —                     | コンピュータ・周辺機器             |
| VERTIV HOLDINGS CO                   | —        | 532.34      | 3,458  | 520,486     | —                     | 電気設備                    |
| INGERSOLL RAND INC                   | 514.79   | 619.76      | 5,360  | 806,672     | —                     | 機械                      |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC       | 441.35   | 623.73      | 5,187  | 780,676     | —                     | ヘルスケア機器・用品              |
| PAYCOM SOFTWARE INC                  | 63.41    | 89.41       | 1,692  | 254,641     | —                     | 専門サービス                  |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC                | 383.42   | 934.26      | 1,451  | 218,487     | —                     | 自動車                     |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD | 92.67    | —           | —      | —           | —                     | 海上運輸                    |
| DRAFTKINGS INC                       | —        | 639         | 2,803  | 421,963     | —                     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| UNITY SOFTWARE INC                   | 308.39   | 409.67      | 1,430  | 215,224     | —                     | ソフトウェア                  |

| 銘<br>柄                                 | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |        |             |                       | 業<br>種<br>等         |
|--|-------------|-------------|--------|-------------|-----------------------|---------------------|
|  |             | 株<br>数      | 株<br>数 | 評<br>価<br>額 | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 |                     |
| (アメリカ)                                 |             | 百株          | 百株     | 千アメリカ・ドル    | 千円                    |                     |
| AON PLC                                | 263.41      | 313.09      | 9,657  | 1,453,415   |                       | 保険                  |
| WARNER BROS DISCOVERY INC              | 2,917.78    | 3,514.21    | 3,419  | 514,574     |                       | 娯楽                  |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP                | 7.36        | 9.06        | 1,301  | 195,882     |                       | 石油・ガス・消耗燃料          |
| BENTLEY SYSTEMS INC                    | 225.66      | 336.34      | 1,734  | 260,975     |                       | ソフトウェア              |
| COINBASE GLOBAL INC                    | 130.94      | 263.05      | 4,218  | 634,886     |                       | 資本市場                |
| UIPATH INC                             | —           | 534.39      | 1,389  | 209,173     |                       | ソフトウェア              |
| AFFIRM HOLDINGS INC                    | 185.28      | —           | —      | —           |                       | 金融サービス              |
| AIRBNB INC                             | 471.77      | 644.56      | 9,552  | 1,437,537   |                       | ホテル・レストラン・レジャー      |
| CONSTELLATION ENERGY CORP              | 412.24      | 482.14      | 6,203  | 933,594     |                       | 電力                  |
| MONDAY.COM LTD                         | —           | 43.08       | 947    | 142,595     |                       | ソフトウェア              |
| ROYALTY PHARMA PLC                     | 417.75      | 621.73      | 1,821  | 274,142     |                       | 医薬品                 |
| ROBLOX CORP                            | 450.19      | 664.77      | 2,934  | 441,582     |                       | 娯楽                  |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC              | 296.56      | —           | —      | —           |                       | インターネット・メディアおよびサービス |
| VIATRIS INC                            | 1,508.26    | 1,841.48    | 2,222  | 334,489     |                       | 医薬品                 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC              | 264.44      | 346.04      | 1,478  | 222,518     |                       | ホテル・レストラン・レジャー      |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP                 | 126.87      | 158.46      | 1,201  | 180,876     |                       | 石油・ガス・消耗燃料          |
| HF SINCLAIR CORP                       | 202.99      | 255.6       | 1,521  | 228,945     |                       | 石油・ガス・消耗燃料          |
| SNOWFLAKE INC                          | 285.82      | 426.08      | 10,055 | 1,513,250   |                       | 情報技術サービス            |
| DOORDASH INC                           | 295.75      | 393.76      | 4,725  | 711,142     |                       | ホテル・レストラン・レジャー      |
| ARISTA NETWORKS INC                    | 293.67      | 392.38      | 10,424 | 1,568,761   |                       | 通信機器                |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC           | 504.82      | 595.48      | 6,703  | 1,008,782   |                       | 金融サービス              |
| GLOBAL-E ONLINE LTD                    | —           | 158.93      | 650    | 97,893      |                       | 大規模小売り              |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC              | 2,028.24    | 2,731.08    | 6,879  | 1,035,309   |                       | ソフトウェア              |
| FNF GROUP                              | 310.04      | 389.07      | 2,023  | 304,524     |                       | 保険                  |
| JACOBS SOLUTIONS INC                   | 166.15      | 187.23      | 2,701  | 406,555     |                       | 専門サービス              |
| MARVELL TECHNOLOGY INC                 | 1,079.89    | 1,291.01    | 8,902  | 1,339,783   |                       | 半導体・半導体製造装置         |
| APA CORP                               | 409.46      | 491.46      | 1,464  | 220,400     |                       | 石油・ガス・消耗燃料          |
| CONFLUENT INC                          | —           | 275.24      | 932    | 140,375     |                       | ソフトウェア              |
| LINDE PLC                              | —           | 744.54      | 31,151 | 4,687,997   |                       | 化学                  |
| ROBINHOOD MARKETS INC                  | —           | 735.66      | 984    | 148,129     |                       | 資本市場                |
| LUCID GROUP INC                        | 449.1       | 1,439.27    | 496    | 74,725      |                       | 自動車                 |
| U-HAUL HOLDING CO                      | 119.81      | 119.81      | 762    | 114,816     |                       | 陸上運輸                |
| ASPEN TECHNOLOGY INC                   | 37.21       | 37.21       | 671    | 101,002     |                       | ソフトウェア              |
| TOAST INC                              | 326.2       | 453.99      | 914    | 137,666     |                       | 金融サービス              |
| GRAB HOLDINGS LTD                      | 1,683.28    | 2,795.15    | 953    | 143,438     |                       | 陸上運輸                |
| CATALENT INC                           | 205.64      | 273.57      | 1,557  | 234,419     |                       | 医薬品                 |
| SYNCHRONY FINANCIAL                    | 611.18      | 687.01      | 2,702  | 406,625     |                       | 消費者金融               |
| VERALTO CORP                           | —           | 370.86      | 3,123  | 470,037     |                       | 商業サービス・用品           |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM    | —           | 198.71      | 596    | 89,711      |                       | メディア                |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE | —           | 281.91      | 1,882  | 283,354     |                       | 娯楽                  |
| BUNGE GLOBAL SA                        | —           | 217.15      | 1,943  | 292,541     |                       | 食品                  |
| KENVUE INC                             | —           | 2,640.38    | 5,040  | 758,542     |                       | パーソナルケア用品           |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP INC           | 633.78      | 730.13      | 2,286  | 344,025     |                       | 銀行                  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD                  | 52.37       | 67.99       | 1,792  | 269,823     |                       | ソフトウェア              |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC              | 222.09      | 277.13      | 4,292  | 645,973     |                       | 電子装置・機器・部品          |
| HUBSPOT INC                            | 58.02       | 73.6        | 4,634  | 697,393     |                       | ソフトウェア              |
| QORVO INC                              | 141.44      | 141.44      | 1,606  | 241,779     |                       | 半導体・半導体製造装置         |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I           | 153.35      | 184.44      | 1,099  | 165,483     |                       | メディア                |
| LIBERTY GLOBAL LTD                     | —           | 360.34      | 707    | 106,502     |                       | 各種電気通信サービス          |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC             | 67.28       | —           | —      | —           |                       | 半導体・半導体製造装置         |
| GODADDY INC                            | 197.13      | 197.13      | 2,199  | 330,984     |                       | 情報技術サービス            |

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

| 銘<br>柄                           | 期 首(前期末) | 当 期 末    |           |           |        | 業 種 等              |
|----------------------------------|----------|----------|-----------|-----------|--------|--------------------|
|                                  |          | 株 数      | 株 数       | 評 価 額     | 邦貨換算金額 |                    |
|                                  |          |          | 外 貨 建 金 額 |           |        |                    |
| (カナダ)                            |          | 百株       | 百株        | 千カナダ・ドル   | 千円     |                    |
| KINROSS GOLD CORP                | 2,199.14 | 1,927.37 | 1,302     | 144,804   |        | 金属・鉱業              |
| RB GLOBAL INC                    | 132.86   | 266.41   | 2,478     | 275,509   |        | 商業サービス・用品          |
| FORTIS INC                       | 604.84   | 720.78   | 3,792     | 421,525   |        | 電力                 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD       | 742.03   | 854.21   | 1,000     | 111,171   |        | 金属・鉱業              |
| TELUS CORP                       | 318.9    | 318.9    | 746       | 82,935    |        | 各種電気通信サービス         |
| GREAT WEST LIFECO INC            | 342.08   | 435.51   | 1,809     | 201,112   |        | 保険                 |
| IMPERIAL OIL LTD                 | 272.46   | 274.34   | 2,191     | 243,555   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ENBRIDGE INC                     | 2,517.28 | 3,261.9  | 14,724    | 1,636,449 |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| IGM FINANCIAL INC                | 124.78   | 124.78   | 447       | 49,703    |        | 資本市場               |
| MANULIFE FINANCIAL CORP          | 2,338.61 | 2,713.63 | 8,322     | 924,985   |        | 保険                 |
| LOBLAW CO LTD                    | 216      | 248.03   | 3,371     | 374,732   |        | 生活必需品流通・小売り        |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC     | 1,012.1  | 1,162.51 | 9,798     | 1,089,038 |        | 生活必需品流通・小売り        |
| MAGNA INTERNATIONAL INC          | 358.44   | 422.79   | 3,100     | 344,569   |        | 自動車用部品             |
| SUN LIFE FINANCIAL INC           | 758.84   | 903.24   | 6,433     | 715,050   |        | 保険                 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD      | 27.99    | 31.33    | 4,242     | 471,565   |        | 保険                 |
| METRO INC                        | 286.29   | 350.59   | 2,454     | 272,829   |        | 生活必需品流通・小売り        |
| EMERA INC                        | 369.98   | 446.43   | 2,090     | 232,303   |        | 電力                 |
| ONEX CORP                        | 101.57   | 101.57   | 1,045     | 116,248   |        | 資本市場               |
| PAN AMERICAN SILVER CORP         | 193.23   | 553.73   | 929       | 103,266   |        | 金属・鉱業              |
| POWER CORP OF CANADA             | 655      | 898.64   | 3,413     | 379,324   |        | 保険                 |
| QUEBECOR INC-B                   | 171.95   | 305.98   | 963       | 107,052   |        | 各種電気通信サービス         |
| ROYAL BANK OF CANADA             | 1,719.47 | 2,135.23 | 27,982    | 3,109,940 |        | 銀行                 |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD | 1,163.63 | 1,440.17 | 16,527    | 1,836,854 |        | 陸上運輸               |
| SHAW COMM INC-B                  | 598.77   | —        | —         | —         |        | メディア               |
| STANTEC INC                      | —        | 183.58   | 2,048     | 227,677   |        | 建設・土木              |
| SUNCOR ENERGY INC                | 1,718.98 | 1,984.39 | 8,473     | 941,727   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| LUNDIN MINING CORP               | 687.62   | 1,196.6  | 1,315     | 146,156   |        | 金属・鉱業              |
| TECK RESOURCES LTD-CL B          | 573.26   | 658.96   | 3,362     | 373,654   |        | 金属・鉱業              |
| THOMSON REUTERS CORP             | 199.79   | 248.37   | 5,279     | 586,747   |        | 専門サービス             |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD          | 96.65    | 130.97   | 1,620     | 180,057   |        | 商社・流通業             |
| TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$  | 2,251.61 | 2,795.45 | 22,215    | 2,469,024 |        | 銀行                 |
| TC ENERGY CORP                   | 1,237.53 | 1,571.54 | 7,989     | 887,976   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD        | 81.02    | 81.02    | 863       | 95,943    |        | 紙製品・林産品            |
| WESTON (GEORGE) LTD              | 98.39    | 98.39    | 1,685     | 187,361   |        | 生活必需品流通・小売り        |
| INTACT FINANCIAL CORP            | 215.66   | 267.58   | 5,979     | 664,544   |        | 保険                 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP     | 585.39   | 738.65   | 4,324     | 480,657   |        | 金属・鉱業              |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC       | 25.3     | 30.41    | 11,310    | 1,257,070 |        | ソフトウェア             |
| FRANCO-NEVADA CORP NPR           | 231.63   | 294.2    | 4,236     | 470,842   |        | 金属・鉱業              |
| TOURMALINE OIL CORP              | 392.98   | 490.85   | 2,650     | 294,532   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| KEYERA CORP                      | 245.71   | 399.97   | 1,275     | 141,759   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PARKLAND CORP                    | 156.65   | 241.29   | 1,094     | 121,668   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ALTAGAS LTD                      | 338.33   | 472.49   | 1,289     | 143,306   |        | ガス                 |
| PEMBINA PIPELINE CORP            | 681.79   | 821.64   | 3,725     | 414,031   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| DOLLARAMA INC                    | 362.04   | 415.08   | 4,268     | 474,375   |        | 大規模小売り             |
| MEG ENERGY CORP                  | —        | 471.81   | 1,165     | 129,519   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CENOVUS ENERGY INC W/I           | 1,677.15 | 2,267.67 | 4,982     | 553,707   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| ARC RESOURCES LTD                | 749.61   | 963.01   | 2,058     | 228,827   |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| NORTHLAND POWER INC              | 341.52   | 341.52   | 813       | 90,450    |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP    | 512.43   | 512.43   | 1,154     | 128,311   |        | 商業サービス・用品          |
| TMX GROUP LTD                    | 70.4     | 468.84   | 1,622     | 180,341   |        | 資本市場               |
| BRP INC                          | 43.07    | 43.07    | 382       | 42,516    |        | レジャー用品             |

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

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

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

| 銘柄                           | 期首(前期末)   | 当期末       |           |           |        | 業種等            |
|------------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|--------|----------------|
|                              |           | 株数        | 株数        | 評価額       | 邦貨換算金額 |                |
|                              |           |           | 外貨建金額     |           |        |                |
| (イギリス)                       | 百株        | 百株        | 千イギリス・ポンド | 千円        |        |                |
| NEXT PLC                     | 187.51    | 185.88    | 1,542     | 291,711   |        | 大規模小売り         |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 1,078.89  | 1,261.79  | 2,387     | 451,606   |        | タバコ            |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 199.76    | —         | —         | —         |        | 化学             |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 1,574.26  | 1,931.17  | 3,374     | 638,286   |        | 金属・鉱業          |
| COMPASS GROUP PLC            | 2,209.35  | 2,590.74  | 5,663     | 1,071,337 |        | ホテル・レストラン・レジャー |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 24,887.38 | 29,731    | 18,454    | 3,490,949 |        | 銀行             |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 7,381.79  | 8,563.99  | 2,014     | 381,035   |        | 保険             |
| CENTRICA PLC                 | —         | 7,937.76  | 1,066     | 201,813   |        | 総合公益事業         |
| UNILEVER PLC                 | 3,166.86  | 3,824.37  | 15,243    | 2,883,695 |        | パーソナルケア用品      |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 905.69    | 1,151.34  | 1,177     | 222,808   |        | 水道             |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 423.51    | 550.43    | 1,247     | 235,946   |        | 食品             |
| PEARSON PLC                  | 841.59    | 841.59    | 796       | 150,606   |        | 各種消費者サービス      |
| PERSIMMON PLC                | 352.52    | 569.89    | 799       | 151,305   |        | 家庭用耐久財         |
| PRUDENTIAL PLC               | 3,339.71  | 4,181.46  | 3,305     | 625,211   |        | 保険             |
| RIO TINTO PLC                | 1,408.39  | 1,730.77  | 9,188     | 1,738,218 |        | 金属・鉱業          |
| VODAFONE GROUP PLC           | 32,204.82 | 35,829.03 | 2,339     | 442,588   |        | 無線通信サービス       |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 886.53    | 1,070.96  | 6,095     | 1,153,162 |        | 家庭用品           |
| RELX PLC                     | 2,404.03  | 2,891.43  | 9,645     | 1,824,697 |        | 専門サービス         |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 3,121.14  | 3,748.45  | 1,527     | 288,955   |        | 商業サービス・用品      |
| ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC     | 11,219.24 | 13,032.32 | 4,068     | 769,674   |        | 航空宇宙・防衛        |
| NATWEST GROUP PLC            | 6,704.64  | 8,963.55  | 1,873     | 354,387   |        | 銀行             |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 674.48    | 890.82    | 554       | 104,850   |        | 資本市場           |
| SSE PLC                      | 1,315.74  | 1,689.22  | 2,652     | 501,693   |        | 電力             |
| BP PLC                       | 23,470.86 | 25,715.29 | 12,253    | 2,317,963 |        | 石油・ガス・消耗燃料     |
| SAGE GROUP PLC(THE)          | 1,288.93  | 1,521.96  | 1,776     | 335,990   |        | ソフトウェア         |
| SMITHS GROUP PLC             | 516.95    | 516.95    | 826       | 156,368   |        | コングロマリット       |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 89.36     | 107.51    | 1,092     | 206,630   |        | 機械             |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 3,198.02  | 3,625.28  | 2,088     | 395,017   |        | 銀行             |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 84,778.63 | 98,680.76 | 4,085     | 772,831   |        | 銀行             |
| TAYLOR WIMPLEY PLC           | 5,698.63  | 5,698.63  | 819       | 155,017   |        | 家庭用耐久財         |
| TESCO PLC                    | 9,342.47  | 10,307.35 | 2,857     | 540,496   |        | 生活必需品流通・小売り    |
| 3I GROUP PLC                 | 1,247.51  | 1,494.86  | 3,569     | 675,285   |        | 資本市場           |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 1,076.79  | 1,259.3   | 1,382     | 261,448   |        | ヘルスケア機器・用品     |
| GSK PLC                      | 4,995.5   | 6,260.67  | 10,442    | 1,975,464 |        | 医薬品            |
| LONDON STOCK EXCHANGE PLC    | 414.94    | 633.56    | 5,614     | 1,062,115 |        | 資本市場           |
| WPP PLC                      | 1,427.85  | 1,760.61  | 1,347     | 254,919   |        | メディア           |
| ASTRAZENECA PLC              | 1,930.29  | 2,365.72  | 23,004    | 4,351,716 |        | 医薬品            |
| WHITBREAD PLC                | 254.7     | 314.75    | 1,084     | 205,119   |        | ホテル・レストラン・レジャー |
| INTERTEK GROUP PLC           | 233.09    | 233.09    | 1,020     | 193,086   |        | 専門サービス         |
| BURBERRY GROUP PLC           | 522.29    | 522.29    | 677       | 128,096   |        | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| INTERCONTINENTAL HOTELS      | 217.52    | 268.74    | 2,053     | 388,398   |        | ホテル・レストラン・レジャー |
| SAINSBURY (J) PLC            | 1,920.97  | 2,658.07  | 666       | 126,109   |        | 生活必需品流通・小売り    |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 213.25    | 400.84    | 1,021     | 193,206   |        | 保険             |
| THE BERKELEY GROUP HOLDINGS  | 164.89    | 164.89    | 763       | 144,482   |        | 家庭用耐久財         |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 184.55    | 184.55    | 362       | 68,600    |        | 医薬品            |
| ABRDN PLC                    | 2,858.31  | 2,858.31  | 460       | 87,107    |        | 資本市場           |
| EXPERIAN PLC                 | 1,127.09  | 1,401.33  | 4,707     | 890,435   |        | 専門サービス         |
| MONDI PLC                    | 588.87    | 675.54    | 913       | 172,838   |        | 紙製品・林産品        |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 369.42    | 369.42    | 306       | 58,058    |        | 資本市場           |
| OCADO GROUP PLC              | 697.66    | 697.66    | 371       | 70,316    |        | 生活必需品流通・小売り    |
| INFORMA PLC                  | 1,861.95  | 2,239.61  | 1,788     | 338,340   |        | メディア           |

| 銘柄                                       | 期首(前期末)          | 当期末                |                    |              |                      | 業種等                 |
|--|------------------|--------------------|--------------------|--------------|----------------------|---------------------|
|  |                  | 株数                 | 株数                 | 評価額          | 邦貨換算金額               |                     |
|  |                  | 外貨建金額              |                    |              |                      |                     |
| (イギリス)                                   |                  |                    |                    |              |                      |                     |
| GLENCORE PLC                             | 百株               | 千イギリス・ポンド          | 千円                 |              |                      | 金属・鉱業               |
| ENTAIN PLC                               | 12,257.76        | 15,701.88          | 6,145              | 1,162,585    |                      | ホテル・レストラン・レジャー      |
| COCA-COLA HBC AG                         | 744.51           | 969.24             | 904                | 171,139      |                      | 飲料                  |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC               | 213.38           | 310.35             | 739                | 139,844      |                      | 保険                  |
| M&G PLC                                  | 862.23           | 1,358.28           | 672                | 127,290      |                      | 金融サービス              |
| ENDEAVOUR MINING PLC                     | 2,704.01         | 2,704.01           | 594                | 112,380      |                      | 金属・鉱業               |
| WISE PLC                                 | —                | 280.75             | 356                | 67,395       |                      | 金融サービス              |
| JD SPORTS FASHION PLC                    | 2,521.8          | 3,820.71           | 413                | 78,203       |                      | 専門小売り               |
| HALEON PLC                               | 6,227.66         | 8,367.29           | 2,645              | 500,494      |                      | パーソナルケア用品           |
| SHELL PLC                                | 9,059.72         | 10,110.99          | 25,252             | 4,776,958    |                      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| AUTO TRADER GROUP PLC                    | 1,108.33         | 1,431.88           | 1,020              | 193,075      |                      | インターネット・メディアおよびサービス |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC                | —                | 271.04             | 4,500              | 851,382      |                      | ホテル・レストラン・レジャー      |
| MELROSE INDUSTRIES PLC                   | 4,872.07         | 2,161.24           | 1,301              | 246,286      |                      | 航空宇宙・防衛             |
| 小計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 351,435.94<br>77銘柄 | 417,024.34<br>81銘柄 | 281,373<br>— | 53,227,458<br><3.9%> |                     |
| (イスラエル)                                  |                  |                    |                    |              |                      |                     |
| BANK HAPOALIM BM                         | 百株               | 千イスラエル・シュケル        | 千円                 |              |                      | 銀行                  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL BM                  | 1,467.03         | 1,874.04           | 5,942              | 245,076      |                      | 銀行                  |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 1,803.43         | 2,390.83           | 6,574              | 271,149      |                      | 各種電気通信サービス          |
| ELBIT SYSTEMS LTD                        | 2,877.73         | —                  | —                  | —            |                      | 航空宇宙・防衛             |
| TOWER SEMICONDUCTOR LTD                  | 36.62            | 33.3               | 2,519              | 103,891      |                      | 半導体・半導体製造装置         |
| ISRAEL DISCOUNT BANK LTD                 | 125.74           | —                  | —                  | —            |                      |                     |
| ICL GROUP LTD                            | 1,629.44         | 1,629.44           | 2,861              | 118,002      |                      | 銀行                  |
| NICE LTD                                 | 1,030.67         | 1,030.67           | 1,769              | 72,982       |                      | 化学                  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD                 | 76.4             | 90.53              | 7,264              | 299,578      |                      | ソフトウェア              |
| AZRIELI GROUP                            | 174.4            | 294.44             | 3,954              | 163,079      |                      | 銀行                  |
| 小計                                       | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 9,268.18<br>10銘柄   | 7,389.97<br>8銘柄    | 31,991<br>—  | 1,319,366<br><0.1%>  |                     |
| (イス)                                     |                  |                    |                    |              |                      |                     |
| CREDIT SUISSE GROUP AG                   | 百株               | 千スイス・フラン           | 千円                 |              |                      | 資本市場                |
| LOGITECH INTL-REG                        | 4,515.99         | —                  | —                  | —            |                      | コンピュータ・周辺機器         |
| NESTLE SA-REGISTERED                     | 237.34           | 237.34             | 1,816              | 308,694      |                      | 食品                  |
| CIE FINANC RICHEMONT                     | 3,418.82         | 4,077.36           | 39,481             | 6,709,019    |                      | 繊維・アパレル・贅沢品         |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN             | 644.58           | 805.41             | 10,812             | 1,837,390    |                      | 医薬品                 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT              | 872.21           | 1,070.11           | 24,312             | 4,131,490    |                      | 機械                  |
| SIKA INHABER                             | 52.36            | 53.11              | 1,204              | 204,686      |                      | 化学                  |
| SGS SA-REG                               | 177.93           | 233.97             | 5,729              | 973,686      |                      | 専門サービス              |
| NOVARTIS AG-REG SHS                      | 7.48             | 229.78             | 1,909              | 324,554      |                      | 医薬品                 |
| BALOISE HOLDING AG -R                    | 2,693.94         | 3,120.75           | 27,400             | 4,656,113    |                      | 保険                  |
| BARRY CALLEBAUT AG                       | 56.75            | 58.3               | 829                | 140,876      |                      | 食品                  |
| CLARIANT AG-REG                          | 4.6              | 4.6                | 597                | 101,461      |                      | 化学                  |
| SWISSCOM AG-REG                          | 210.72           | 229.09             | 250                | 42,627       |                      | 各種電気通信サービス          |
| ABB LTD                                  | 34.31            | 44.57              | 2,242              | 381,112      |                      | 電気設備                |
| ADECCO GROUP AG-REG                      | 1,945.38         | 2,474.95           | 9,632              | 1,636,851    |                      | 専門サービス              |
| GEBERIT AG                               | 198.42           | 264.54             | 965                | 163,989      |                      | 建設関連製品              |
| LONZA GROUP AG-REG                       | 43.77            | 51.05              | 2,577              | 437,910      |                      | ライフサイエンス・ツール／サービス   |
| LINDT & SPRUENGLI PART                   | 90.27            | 115.36             | 5,336              | 906,840      |                      | 食品                  |
| LINDT & SPRUENGLI NAMEN                  | 1.37             | 1.61               | 1,822              | 309,700      |                      | 食品                  |
| GIVAUDAN-REG                             | 0.13             | 0.16               | 1,798              | 305,602      |                      | 化学                  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG                | 11.73            | 13.92              | 5,115              | 869,293      |                      | 保険                  |
| ROCHE HOLDING AG-BEARER                  | 187.71           | 221.6              | 9,692              | 1,647,094    |                      | 医薬品                 |
|  |                  | 36.12              | 48.1               | 1,153        | 196,003              |                     |

| 銘柄                           | 期首(前期末)          | 当期末          |                       |               |            | 業種等               |
|------------------------------|------------------|--------------|-----------------------|---------------|------------|-------------------|
|                              |                  | 株数           | 株数                    | 評価額           | 邦貨換算金額     |                   |
|                              |                  | 外貨建金額        |                       |               |            |                   |
| (スイス)                        |                  |              |                       |               |            |                   |
| HOLCIM LTD                   | 百株<br>666.07     | 百株<br>775.19 | 千スイス・フラン<br>5,158     | 千円<br>876,518 |            | 建設資材              |
| TEMENOS GROUP                | 70.82            | 109.3        | 967                   | 164,336       |            | ソフトウェア            |
| BACHEM HOLDING AG            | 46.73            | 46.73        | 295                   | 50,146        |            | ライフサイエンス・ツール／サービス |
| SONOVA HOLDING AG            | 69.84            | 81           | 2,307                 | 392,145       |            | ヘルスケア機器・用品        |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG       | 68.87            | 78.9         | 2,251                 | 382,515       |            | 海上運輸              |
| STRAUMANN HOLDING AG         | 145.31           | 164.75       | 2,293                 | 389,703       |            | ヘルスケア機器・用品        |
| THE SWATCH GROUP AG-B        | 31.3             | 43           | 899                   | 152,935       |            | 織維・アパレル・贅沢品       |
| THE SWATCH GROUP AG-REG      | 92.59            | 92.59        | 374                   | 63,564        |            | 織維・アパレル・贅沢品       |
| HELVETIA HOLDING AG          | —                | 49.06        | 599                   | 101,875       |            | 保険                |
| SCHINDLER NAMEN              | 27.2             | 42.09        | 914                   | 155,349       |            | 機械                |
| SWISS LIFE HOLDING AG        | 39.78            | 45.03        | 2,804                 | 476,563       |            | 保険                |
| BANQUE CANTONALE VAUD        | 49.03            | 49.03        | 518                   | 88,065        |            | 銀行                |
| EMS-CHEMIE HOLDING           | 8.1              | 12.45        | 779                   | 132,438       |            | 化学                |
| SWISS PRIME SITE AG          | 83.72            | 133.56       | 1,139                 | 193,709       |            | 不動産管理・開発          |
| AVOLTA AG                    | —                | 129.33       | 454                   | 77,271        |            | 専門小売り             |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 28.52            | 34.33        | 4,165                 | 707,919       |            | 資本市場              |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 260.31           | 321.14       | 1,520                 | 258,395       |            | 資本市場              |
| SWISS RE LTD                 | 381.39           | 455.02       | 4,663                 | 792,545       |            | 保険                |
| BKW AG                       | 31.94            | 31.94        | 420                   | 71,535        |            | 電力                |
| SIG GROUP AG                 | 383.22           | 509.69       | 915                   | 155,554       |            | 容器・包装             |
| ALCON INC                    | 612.85           | 749.22       | 5,091                 | 865,232       |            | ヘルスケア機器・用品        |
| SANDOZ GROUP AG              | —                | 573.47       | 1,631                 | 277,244       |            | 医薬品               |
| UBS GROUP AG                 | 4,189.21         | 5,033.06     | 12,205                | 2,074,024     |            | 資本市場              |
| VAT GROUP AG                 | 33.25            | 41.31        | 1,752                 | 297,850       |            | 機械                |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 22,761.98    | 22,956.87             | 208,806       | 35,482,442 |                   |
|                              |                  | 43銘柄         | 45銘柄                  | —             | <2.6%>     |                   |
| (デンマーク)                      |                  |              |                       |               |            |                   |
| CARLSBERG AS-B               | 百株<br>125.49     | 百株<br>151.67 | 千デンマーク・クローネ<br>14,105 | 千円<br>305,662 |            | 飲料                |
| A P MOLLER A/S               | 6.63             | 6.63         | 7,170                 | 155,381       |            | 海上運輸              |
| AP MOLLER MAERSK A           | 3.59             | 5.43         | 5,766                 | 124,963       |            | 海上運輸              |
| DANSKE BANK A/S              | 853.71           | 1,023.03     | 19,882                | 430,855       |            | 銀行                |
| GENMAB A/S                   | 79.26            | 97.83        | 18,367                | 398,025       |            | バイオテクノロジー         |
| NOVOZYMES-B SHS              | 238.59           | 547.95       | 20,060                | 434,709       |            | 化学                |
| ROCKWOOL AS                  | 8.73             | 8.73         | 1,889                 | 40,938        |            | 建設関連製品            |
| NOVO NORDISK A/S-B           | 2,063.49         | 4,980.24     | 421,776               | 9,139,897     |            | 医薬品               |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S      | 1,254.36         | 1,545.21     | 29,108                | 630,784       |            | 電気設備              |
| COLOPLAST-B                  | 153.43           | 212.91       | 18,706                | 405,364       |            | ヘルスケア機器・用品        |
| DSV A/S                      | 238.42           | 281.9        | 32,052                | 694,567       |            | 航空貨物・物流サービス       |
| DEMAND A/S                   | 113.67           | 177          | 6,331                 | 137,199       |            | ヘルスケア機器・用品        |
| TRYG A/S                     | 448.87           | 582.22       | 8,366                 | 181,302       |            | 保険                |
| PANDORA A/S                  | 124.73           | 124.73       | 13,770                | 298,400       |            | 織維・アパレル・贅沢品       |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 125.38           | —            | —                     | —             |            | 化学                |
| ORSTED A/S                   | 232.4            | 269.11       | 10,831                | 234,722       |            | 電力                |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 6,070.75     | 10,014.59             | 628,185       | 13,612,774 |                   |
|                              |                  | 16銘柄         | 15銘柄                  | —             | <1.0%>     |                   |
| (ノルウェー)                      |                  |              |                       |               |            |                   |
| MOWI ASA                     | 百株<br>563.75     | 百株<br>731.18 | 千ノルウェー・クローネ<br>14,448 | 千円<br>205,596 |            | 食品                |
| NORSK HYDRO ASA              | 1,629.71         | 2,211.82     | 12,448                | 177,136       |            | 金属・鉱業             |
| TELENOR ASA                  | 859.54           | 1,195.76     | 13,727                | 195,339       |            | 各種電気通信サービス        |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA        | 111.85           | 111.85       | 7,275                 | 103,535       |            | 航空宇宙・防衛           |
| ORKLA ASA                    | 1,160.68         | 1,160.68     | 8,802                 | 125,260       |            | 食品                |

| 銘柄                           | 期首(前期末)  | 当期末      |              |              | 業種等                 |
|------------------------------|----------|----------|--------------|--------------|---------------------|
|                              |          | 株数       | 株数           | 評価額<br>外貨建金額 |                     |
| (ノルウェー)                      | 百株       | 百株       | 千ノルウェー・クローネ  | 千円           |                     |
| EQUINOR ASA                  | 1,156.17 | 1,298.95 | 34,292       | 487,979      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| YARA INTERNATIONAL ASA       | 198.34   | 294.14   | 10,597       | 150,807      | 化学                  |
| AKER BP ASA                  | 387.23   | 409.33   | 10,708       | 152,375      | 石油・ガス・消耗燃料          |
| SALMAR ASA                   | 72.48    | 128.97   | 7,611        | 108,316      | 食品                  |
| GIENSIDIGE FORSIKRING ASA    | 257.21   | 257.21   | 4,406        | 62,697       | 保険                  |
| ADEVENTA ASA                 | 243.82   | 547.15   | 6,188        | 88,059       | インターネット・メディアおよびサービス |
| DNB BANK ASA                 | 1,193.19 | 1,439.09 | 29,472       | 419,394      | 銀行                  |
| 小計                           | 7,833.97 | 9,786.13 | 159,978      | 2,276,499    |                     |
| 株式銘柄数比                       | 12銘柄     | 12銘柄     | —            | <0.2%>       |                     |
| (スウェーデン)                     | 百株       | 百株       | 千スウェーデン・クローナ | 千円           |                     |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 3,341.22 | 3,960.72 | 66,757       | 955,973      | 機械                  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 1,942.04 | 2,418.69 | 35,409       | 507,065      | 機械                  |
| ERICSSON LM-B SHS            | 3,665.51 | 4,180    | 23,094       | 330,713      | 通信機器                |
| GETINGE AB-B SHS             | 257.55   | 389.25   | 7,720        | 110,561      | ヘルスケア機器・用品          |
| INVESTOR AB-A SHS            | 584.37   | —        | —            | —            | 金融サービス              |
| LUNDBERGS B                  | 78.59    | 148.72   | 8,152        | 116,748      | 金融サービス              |
| SKF AB-B SHS                 | 465.94   | 465.94   | 9,905        | 141,852      | 機械                  |
| SANDVIK AB                   | 1,333.5  | 1,692.18 | 36,720       | 525,834      | 機械                  |
| SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A | 1,958.37 | 2,502.03 | 37,230       | 533,136      | 銀行                  |
| SKANSKA AB-B SHS             | 439.37   | 439.37   | 8,207        | 117,530      | 建設・土木               |
| SWEDBANK AB                  | 1,122.96 | 1,325.81 | 28,359       | 406,101      | 銀行                  |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS   | 702.11   | 927.95   | 12,652       | 181,185      | 紙製品・林産品             |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 1,844.99 | 2,188.46 | 26,611       | 381,079      | 銀行                  |
| VOLVO AB-A SHS               | 241.98   | 241.98   | 6,591        | 94,390       | 機械                  |
| VOLVO AB-B SHS               | 1,916.25 | 2,375.69 | 63,157       | 904,418      | 機械                  |
| HOLMEN AB-B SHS              | 101.42   | 173.2    | 6,872        | 98,415       | 紙製品・林産品             |
| TELE2 AB-B SHS               | 644.16   | 676.54   | 5,639        | 80,759       | 無線通信サービス            |
| INDUSTRIVARDEN A             | 152.92   | 152.92   | 5,096        | 72,986       | 金融サービス              |
| INDUSTRIVARDEN C             | 213.25   | 213.25   | 7,107        | 101,781      | 金融サービス              |
| ELECTROLUX AB-SER B          | 269.07   | —        | —            | —            | 家庭用耐久財              |
| SAAB AB-B                    | —        | 117.89   | 9,145        | 130,969      | 航空宇宙・防衛             |
| SECURITAS AB-B SHS           | 760.85   | 760.85   | 8,091        | 115,872      | 商業サービス・用品           |
| INVESTOR AB-B SHS            | 2,263.92 | 2,715.48 | 68,104       | 975,252      | 金融サービス              |
| HENNES&MAURITZ AB-B SHS      | 822.87   | 1,046.69 | 14,768       | 211,489      | 専門小売り               |
| ASSA ABLOY AB-B              | 1,246.12 | 1,533.68 | 43,525       | 623,290      | 建設関連製品              |
| TELIA CO AB                  | 3,448.1  | 3,448.1  | 8,406        | 120,380      | 各種電気通信サービス          |
| BOLIDEN AB                   | 362.6    | 362.6    | 9,694        | 138,819      | 金属・鉱業               |
| ALFA LAVAL AB                | 353.13   | 444.07   | 16,879       | 241,708      | 機械                  |
| KINNEVIK AB-B                | 362.78   | —        | —            | —            | 金融サービス              |
| FASTIGHETS AB BALDER         | 729.42   | 729.42   | 4,655        | 66,661       | 不動産管理・開発            |
| INDUTRADE AB                 | 391.78   | 391.78   | 10,707       | 153,329      | 機械                  |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 477.69   | 477.69   | 3,664        | 52,480       | 機械                  |
| NIBE INDUSTRIER AB           | 1,858.45 | 2,128.32 | 13,978       | 200,176      | 建設関連製品              |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB  | 183.8    | 363.81   | 9,109        | 130,452      | バイオテクノロジー           |
| HEXAGON AB-B SHS             | 2,481.63 | 3,071.16 | 35,333       | 505,978      | 電子装置・機器・部品          |
| SAGAX AB                     | 280.22   | 280.22   | 7,033        | 100,720      | 不動産管理・開発            |
| EPIROC AB-A                  | 845.63   | 1,031.15 | 19,272       | 275,977      | 機械                  |
| EPIROC AB-B                  | 412.05   | 614.87   | 10,108       | 144,753      | 機械                  |
| ESSITY AB-B                  | 751.8    | 869      | 20,682       | 296,169      | 家庭用品                |
| EQT AB                       | 407.16   | 551.94   | 15,128       | 216,642      | 資本市場                |
| EMBRACER GROUP AB            | 797.91   | —        | —            | —            | 娯楽                  |

| 銘柄                             | 期首(前期末)          | 当期末               |                  |                   | 業種等                 |
|--------------------------------|------------------|-------------------|------------------|-------------------|---------------------|
|                                |                  | 株数                | 株数               | 評価額<br>外貨建金額      |                     |
| (スウェーデン)                       |                  |                   |                  |                   |                     |
| VOLVO CAR AB                   | 百株<br>637.1      | 百株<br>637.1       | 千円<br>33,829     |                   | 自動車                 |
| BEIWER REF AB                  | —                | 504.93            | 7,366            | 105,494           | 商社・流通業              |
| LIFCO AB                       | 268.35           | 396.31            | 10,625           | 152,151           | コングロマリット            |
| EVOLUTION AB                   | 223.26           | 282.66            | 37,062           | 530,733           | ホテル・レストラン・レジャー      |
| NORDEA BANK ABP                | 4,203.56         | —                 | —                | —                 | 銀行                  |
| INVESTMENT AB LATOUR           | 155.39           | 276.38            | 7,185            | 102,901           | コングロマリット            |
| 小計                             | 株数：金額<br>銘柄数<比率> | 46,001.14<br>45銘柄 | 47,508.8<br>42銘柄 | 788,182<br><0.8%> | 11,286,768          |
| (ユーロ…アイルランド)                   |                  |                   |                  |                   |                     |
| CRH PLC                        | 百株<br>907.48     | 百株<br>—           | 千円<br>—          | 建設資材              |                     |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC      | 199.53           | —                 | —                | ホテル・レストラン・レジャー    |                     |
| KERRY GROUP PLC-A              | 207.61           | 250.25            | 2,051            | 331,366           | 食品                  |
| KINGSPAN GROUP PLC             | 174.51           | 218.6             | 1,772            | 286,350           | 建設関連製品              |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC        | 324.22           | 398.69            | 1,483            | 239,554           | 容器・包装               |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC      | 1,345.37         | 1,641.56          | 1,356            | 219,115           | 銀行                  |
| AIB GROUP PLC                  | 1,475.78         | 2,269.14          | 921              | 148,876           | 銀行                  |
| 小計                             | 株数：金額<br>銘柄数<比率> | 4,634.5<br>7銘柄    | 4,778.24<br>5銘柄  | 7,585<br>—        | 1,225,263<br><0.1%> |
| (ユーロ…オランダ)                     |                  |                   |                  |                   |                     |
| AIRBUS SE                      | 百株<br>733.77     | 百株<br>907.75      | 千円<br>13,639     | 2,203,108         | 航空宇宙・防衛             |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV | —                | 124.03            | 1,918            | 309,815           | 半導体・半導体製造装置         |
| KONINKLIJKE DSM NV             | 222.01           | —                 | —                | —                 | 化学                  |
| ING GROEP NV-CVA               | 4,707.18         | 5,408.15          | 6,644            | 1,073,212         | 銀行                  |
| ASM INTERNATIONAL NV           | 59.78            | 72.73             | 4,062            | 656,206           | 半導体・半導体製造装置         |
| RANDSTAD NV                    | 155.84           | 155.84            | 825              | 133,256           | 専門サービス              |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV  | 1,258.84         | 1,466.67          | 3,907            | 631,092           | 生活必需品流通・小売り         |
| HEINEKEN NV                    | 320.26           | 437.59            | 3,813            | 615,901           | 飲料                  |
| AKZO NOBEL                     | 226.27           | 260.32            | 1,756            | 283,648           | 化学                  |
| ASML HOLDING NV                | 506.05           | 614.91            | 52,476           | 8,475,991         | 半導体・半導体製造装置         |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV         | 1,155.12         | 1,217.72          | 2,266            | 366,111           | ヘルスケア機器・用品          |
| WOLTERS KLUWER-CVA             | 320.47           | 387.24            | 5,520            | 891,607           | 専門サービス              |
| STMICROELECTRONICS NV          | 869.19           | 1,040.58          | 4,338            | 700,786           | 半導体・半導体製造装置         |
| QIAGEN N.V.                    | 274.12           | 345.44            | 1,374            | 222,065           | ライフサイエンス・ツール／サービス   |
| KONINKLIJKE KPN NV             | 4,757.39         | 4,960.95          | 1,589            | 256,814           | 各種電気通信サービス          |
| HEINEKEN HOLDING NV-A          | 108.53           | 176.9             | 1,275            | 206,010           | 飲料                  |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV       | 577.75           | 839.4             | 817              | 132,109           | 飲料                  |
| OCI NV                         | 123.29           | 123.29            | 334              | 54,105            | 化学                  |
| FERRARI NV                     | 154.35           | 188.5             | 6,701            | 1,082,373         | 自動車                 |
| ASR NEDERLAND NV               | —                | 273.65            | 1,176            | 190,015           | 保険                  |
| CNH INDUSTRIAL NV              | 1,246.04         | —                 | —                | —                 | 機械                  |
| PROSUS NV                      | 1,025.26         | 2,208.42          | 6,426            | 1,038,008         | 大規模小売り              |
| JDE PEET'S BV                  | 143.85           | 143.85            | 322              | 52,138            | 食品                  |
| EXOR NV                        | 141.42           | 141.42            | 1,360            | 219,695           | 金融サービス              |
| EURONEXT NV                    | 100.81           | 140.77            | 1,115            | 180,192           | 資本市場                |
| IMCD NV                        | 68.23            | 93.32             | 1,300            | 210,042           | 商社・流通業              |
| NN GROUP NV                    | 362.89           | 434.78            | 1,628            | 263,065           | 保険                  |
| ARGENX SE                      | 67.53            | 90.78             | 3,279            | 529,766           | バイオテクノロジー           |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP BV       | 925.02           | 1,256.11          | 3,422            | 552,866           | 娯楽                  |
| STELLANTIS NV                  | 2,806.95         | 3,419.19          | 7,718            | 1,246,744         | 自動車                 |
| FERROVIAL SE                   | —                | 738.17            | 2,610            | 421,594           | 建設・土木               |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV       | 226.7            | —                 | —                | —                 | ホテル・レストラン・レジャー      |

| 銘柄  |                  | 期首(前期末)   | 当期末  |  |  | 業種等   |
|---|------------------|---|--|--|--|---|
|   |                  |   | 株数   | 株数   | 評価額<br>外貨建金額   |   |
| (ユーロ…オランダ)<br>ABN AMRO BANK NV<br>ADYEN NV  |                  | 百株<br>528.35<br>25.93   | 百株<br>759.82<br>33.78  | 千ユーロ<br>1,088<br>4,889   | 千円<br>175,805<br>789,831   | 銀行<br>金融サービス  |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 24,199.19<br>31銘柄   | 28,462.07<br>31銘柄  | 149,603<br>—   | 24,163,985<br><1.8%>   |   |
| (ユーロ…ベルギー)<br>UMICORE<br>LOTUS BAKERIES NV<br>D'IETEREN TRDG<br>KBC GROUPE<br>SOFINA<br>SOLVAY SA<br>AGEAS<br>UCB SA<br>GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA<br>ELIA GROUP<br>SYENSQO SA<br>ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   |                  | 百株<br>242.9<br>—<br>27.36<br>322.13<br>22.81<br>90.7<br>181.36<br>167.32<br>113.18<br>40.78<br>—<br>1,053.27  | 百株<br>335.45<br>0.77<br>27.36<br>359.62<br>22.81<br>—<br>240.86<br>200.2<br>129.18<br>40.78<br>112.17<br>1,295.06  | 千ユーロ<br>693<br>692<br>479<br>2,269<br>501<br>—<br>926<br>1,883<br>901<br>428<br>926<br>7,500   | 千円<br>111,939<br>111,808<br>77,512<br>366,521<br>80,980<br>—<br>149,623<br>304,155<br>145,638<br>69,161<br>149,670<br>1,211,559  | 化学<br>食品<br>販売<br>銀行<br>金融サービス<br>化学<br>保険<br>医薬品<br>金融サービス<br>電力<br>化学<br>飲料   |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,261.81<br>10銘柄  | 2,764.26<br>11銘柄   | 17,202<br>—  | 2,778,571<br><0.2%>  |   |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)<br>ARCELOR MITTAL (NL)<br>EUROFINS SCIENTIFIC<br>TENARIS SA<br>AROUNDOWN SA   |                  | 百株<br>668.78<br>178.24<br>558.55<br>1,132.25  | 百株<br>811.29<br>230.38<br>760.02<br>—  | 千ユーロ<br>2,041<br>1,270<br>1,120<br>—   | 千円<br>329,761<br>205,181<br>180,945<br>—   | 金属・鉱業<br>ライフサイエンス・ツール／サービス<br>エネルギー設備・サービス<br>不動産管理・開発  |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,537.82<br>4銘柄   | 1,801.69<br>3銘柄  | 4,432<br>—   | 715,888<br><0.1%>  |   |
| (ユーロ…フランス)<br>AIR LIQUIDE<br>AXA SA<br>VEOLIA ENVIRONNEMENT<br>DASSAULT AVIATION SA<br>DANONE<br>SAFRAN SA<br>ACCOR SA<br>BOUYGUES<br>BNP PARIBAS<br>THALES SA<br>CAPGEMINI SA<br>EIFFAGE<br>PUBLICIS GROUPE<br>L'OREAL<br>LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE<br>BOLLORE<br>MICHELIN(CGDE)-B<br>PERNOD-RICARD<br>RENAULT SA<br>REMY COINTREAU<br>COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN<br>SEB SA<br>SOCIETE GENERALE-A<br>VINCI S.A. |                  | 百株<br>653.17<br>2,280.92<br>837.2<br>31.2<br>791.5<br>425.57<br>183.05<br>291.23<br>1,390.23<br>128.86<br>198.39<br>117.84<br>294.05<br>301.22<br>344.54<br>1,148.08<br>869.08<br>248.88<br>279.02<br>28.66<br>614.6<br>25.96<br>1,004.09<br>667.67 | 百株<br>798.31<br>2,717.13<br>981.92<br>31.2<br>965.32<br>510.62<br>314.27<br>291.23<br>1,608.93<br>150.23<br>250.63<br>127.06<br>334.67<br>366.99<br>422.43<br>1,148.08<br>983.59<br>309.48<br>279.02<br>28.66<br>695.01<br>25.96<br>1,166.35<br>763.13 | 千ユーロ<br>13,560<br>8,323<br>2,894<br>552<br>5,861<br>8,982<br>1,170<br>972<br>8,675<br>2,070<br>5,513<br>1,220<br>3,248<br>5,153<br>1,220<br>3,248<br>15,828<br>33,904<br>716<br>3,296<br>4,789<br>1,051<br>279<br>4,722<br>287<br>2,522<br>8,794 | 千円<br>2,190,226<br>1,344,480<br>467,551<br>89,197<br>946,737<br>1,450,906<br>189,033<br>157,111<br>1,401,242<br>334,495<br>890,598<br>197,141<br>524,666<br>メディア<br>パーソナルケア用品<br>繊維・アパレル・贅沢品<br>娯楽<br>自動車用部品<br>飲料<br>自動車<br>飲料<br>建設関連製品<br>家庭用耐久財<br>銀行<br>建設・土木 | 化学<br>保険<br>総合公益事業<br>航空宇宙・防衛<br>食品<br>航空宇宙・防衛<br>ホテル・レストラン・レジャー<br>建設・土木<br>銀行<br>航空宇宙・防衛<br>情報技術サービス<br>建設・土木<br>メディア<br>パーソナルケア用品<br>繊維・アパレル・贅沢品<br>娯楽<br>自動車用部品<br>飲料<br>自動車<br>飲料<br>建設・土木 |

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

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

| 銘柄   |                  | 期首(前期末)      | 当期末          |               |               | 業種等                     |
|--|------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------------------|
|  |                  | 株数           | 株数           | 評価額           |               |                         |
| (ユーロ…ポルトガル)<br>GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS |                  | 百株<br>594.06 | 百株<br>795.85 | 千ユーロ<br>1,124 | 千円<br>181,635 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,120.06     | 6,306.32     | 4,004         | 646,858       |                         |
|  |                  | 3銘柄          | 3銘柄          | —             | <0.0%>        |                         |
| (ユーロ…スペイン)                                 |                  | 百株           | 千ユーロ         | 千円            |               |                         |
| IBERDROLA SA                               |                  | 7,795.92     | 9,390.14     | 10,127        | 1,635,756     | 電力                      |
| REPSOL SA                                  |                  | 1,787.13     | 1,950.49     | 2,707         | 437,279       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TELEFONICA S.A.                            |                  | 6,649.75     | 7,557.2      | 2,701         | 436,378       | 各種電気通信サービス              |
| ENDESA S.A.                                |                  | 377.01       | 509.46       | 861           | 139,107       | 電力                      |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV                |                  | 235.71       | 348.36       | 1,271         | 205,431       | 建設・土木                   |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA               |                  | 7,351.18     | 9,146.52     | 8,401         | 1,357,089     | 銀行                      |
| ACCIONA S.A.                               |                  | 26.42        | 50.05        | 551           | 89,005        | 電力                      |
| NATURGY ENERGY GROUP SA                    |                  | 176.77       | 176.77       | 411           | 66,411        | ガス                      |
| BANCO SANTANDER SA                         |                  | 20,668.57    | 24,843.77    | 9,115         | 1,472,283     | 銀行                      |
| RED ELECTRICA DE CORPORACION SA            |                  | 490.11       | 655.89       | 949           | 153,294       | 電力                      |
| INDITEX                                    |                  | 1,363.21     | 1,621.41     | 6,357         | 1,026,871     | 専門小売り                   |
| ENAGAS                                     |                  | 382.7        | 382.7        | 548           | 88,609        | ガス                      |
| GRIFOLS SA                                 |                  | 319.82       | 319.82       | 339           | 54,834        | バイオテクノロジー               |
| FERROVIAL SA                               |                  | 635.13       | —            | —             | —             | 建設・土木                   |
| CAIXABANK                                  |                  | 5,660.59     | 6,300.95     | 2,514         | 406,175       | 銀行                      |
| EDP RENOVAVEIS SA                          |                  | 396.88       | 396.88       | 553           | 89,393        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AMADEUS IT GROUP SA                        |                  | 547.12       | 688.48       | 4,269         | 689,682       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA        |                  | 98.22        | 98.22        | 207           | 33,505        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AENA SME SA                                |                  | 99.89        | 116.03       | 1,925         | 311,009       | 運送インフラ                  |
| CELLNEX TELECOM SAU                        |                  | 695.72       | 819.74       | 2,701         | 436,404       | 各種電気通信サービス              |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 55,757.85    | 65,372.88    | 56,516        | 9,128,526     |                         |
|  |                  | 20銘柄         | 19銘柄         | —             | <0.7%>        |                         |
| (ユーロ…イタリア)                                 |                  | 百株           | 千ユーロ         | 千円            |               |                         |
| ASSICURAZIONI GENERALI                     |                  | 1,446.13     | 1,446.13     | 2,970         | 479,771       | 保険                      |
| INTESA SANPAOLO                            |                  | 20,509.73    | 23,301.03    | 6,559         | 1,059,448     | 銀行                      |
| UNICREDIT SPA                              |                  | 2,411.49     | 2,446.66     | 7,282         | 1,176,266     | 銀行                      |
| ENI SPA                                    |                  | 3,151.96     | 3,532.07     | 5,122         | 827,339       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MEDIOBANCA SPA                             |                  | 867.92       | 867.92       | 996           | 161,004       | 銀行                      |
| ENEL SPA                                   |                  | 10,193.43    | 12,028.25    | 7,113         | 1,148,973     | 電力                      |
| LEONARDO SPA                               |                  | —            | 649.15       | 1,187         | 191,771       | 航空宇宙・防衛                 |
| SNAM SPA                                   |                  | 2,564.15     | 3,175.18     | 1,380         | 222,989       | ガス                      |
| TELECOM ITALIA SPA                         |                  | 9,082.86     | 19,705.16    | 541           | 87,526        | 各種電気通信サービス              |
| TERNA SPA                                  |                  | 1,660.64     | 2,076.55     | 1,530         | 247,260       | 電力                      |
| RECORDATI SPA                              |                  | 109.08       | 181.97       | 918           | 148,369       | 医薬品                     |
| AMPLIFON SPA                               |                  | 123          | 202.49       | 630           | 101,847       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRYSMIAN SPA                               |                  | 307.28       | 383.43       | 1,572         | 253,919       | 電気設備                    |
| DIASORIN ITALIA SPA                        |                  | 24.29        | 24.29        | 210           | 34,046        | ヘルスケア機器・用品              |
| MONCLER SPA                                |                  | 250.14       | 297.63       | 1,776         | 286,996       | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NEXI SPA                                   |                  | 835.76       | 835.76       | 614           | 99,327        | 金融サービス                  |
| FINECOBANK SPA                             |                  | 751.8        | 963.93       | 1,245         | 201,234       | 銀行                      |
| BANCO BPM SPA                              |                  | —            | 2,027.27     | 1,035         | 167,193       | 銀行                      |
| POSTE ITALIANE SPA                         |                  | 588.89       | 887.62       | 883           | 142,651       | 保険                      |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA       |                  | 418.79       | 418.79       | 448           | 72,513        | 各種電気通信サービス              |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 55,297.34    | 75,451.28    | 44,022        | 7,110,450     |                         |
|  |                  | 18銘柄         | 20銘柄         | —             | <0.5%>        |                         |
| (ユーロ…フィンランド)<br>KESKO OYJ-B                |                  | 百株           | 千ユーロ         | 千円            |               |                         |
|  |                  | 352.52       | 352.52       | 606           | 97,992        | 生活必需品流通・小売り             |

| 銘柄                           | 期首(前期末)           | 当期末                     |                         |               |                          | 業種等 |  |
|------------------------------|-------------------|-------------------------|-------------------------|---------------|--------------------------|-----|--|
|                              |                   | 株数                      | 株数                      | 評価額           |                          |     |  |
|                              |                   |                         |                         | 外貨建金額         | 邦貨換算金額                   |     |  |
| (ユーロ…フィンランド)<br>WARTSILA OYJ | 百株<br>509.56      | 百株<br>771.48            | 千ユーロ<br>1,076           | 千円<br>173,830 | 機械                       |     |  |
| UPM-KYMMENE OYJ              | 677.58            | 779.73                  | 2,211                   | 357,171       | 紙製品・林産品                  |     |  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         | 749.6             | 959.8                   | 1,034                   | 167,041       | 紙製品・林産品                  |     |  |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 583.96            | 709.99                  | 2,879                   | 465,074       | 保険                       |     |  |
| FORTUM OYJ                   | 541.94            | 736.99                  | 803                     | 129,752       | 電力                       |     |  |
| NOKIA OYJ                    | 6,795.69          | 8,270.68                | 2,687                   | 434,027       | 通信機器                     |     |  |
| ELISA OYJ                    | 202.42            | 202.42                  | 833                     | 134,670       | 各種電気通信サービス               |     |  |
| NESTE OYJ                    | 505.99            | 662.48                  | 1,816                   | 293,404       | 石油・ガス・消耗燃料               |     |  |
| KONE OYJ                     | 438.14            | 493                     | 2,246                   | 362,791       | 機械                       |     |  |
| ORION OYJ                    | 135.59            | 135.59                  | 537                     | 86,769        | 医薬品                      |     |  |
| METSO CORPORATION            | —                 | 1,028.31                | 963                     | 155,695       | 機械                       |     |  |
| NORDEA BANK ABP              | —                 | 4,924.03                | 5,288                   | 854,183       | 銀行                       |     |  |
| 小計                           | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 11,492.99<br>11銘柄       | 20,027.02<br>13銘柄       | 22,984<br>—   | 3,712,404<br><0.3%>      |     |  |
| (ユーロ…オーストリア)<br>OMV AG       | 百株<br>172.58      | 百株<br>233.54            | 千ユーロ<br>935             | 千円<br>151,074 | 石油・ガス・消耗燃料               |     |  |
| VERBUND AG                   | 73.2              | 106.63                  | 667                     | 107,815       | 電力                       |     |  |
| VOEST-ALPINE AG              | 105.93            | 180.32                  | 454                     | 73,337        | 金属・鉱業                    |     |  |
| ERSTE GROUP BANK AG          | 456.86            | 565.74                  | 2,231                   | 360,396       | 銀行                       |     |  |
| 小計                           | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 808.57<br>4銘柄           | 1,086.23<br>4銘柄         | 4,288<br>—    | 692,622<br><0.1%>        |     |  |
| (ユーロ…パミューダ)<br>AEGON LTD     | 百株<br>2,324.33    | 百株<br>2,324.33          | 千ユーロ<br>1,252           | 千円<br>202,279 | 保険                       |     |  |
| 小計                           | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 2,324.33<br>1銘柄         | 2,324.33<br>1銘柄         | 1,252<br>—    | 202,279<br><0.0%>        |     |  |
| 合計                           | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 1,372,550.07<br>1,212銘柄 | 1,726,233.38<br>1,199銘柄 | —<br>—        | 1,311,536,937<br><96.4%> |     |  |

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

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

(注3) 純小数は、別途の記述と異なり四捨五入していません。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (2) 外国新株予約権証券

| 銘柄                                      | 期首(前期末)           |             | 当期                    |                            |   | 末     |        |
|---|-------------------|-------------|-----------------------|----------------------------|---|-------|--------|
|   | 証券数               | 証券数         | 評価額                   |                            |   | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
|   |                   |             | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |   |       |        |
| (カナダ)<br>CONSTELLATION SOFTWARE INC WRT | 証券<br>—           | 証券<br>2,968 | 千カナダ・ドル<br>0          | 千円<br>0                    |   |       |        |
| 合計                                      | 証券数・金額<br>銘柄数<比率> | —           | 2,968                 | 0                          | 0 | —     | <0.0%> |

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

(注1) 還貸換算金額は、期末の時価を各分野の対顧客電信売買相場の件

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

(3) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄                               | 期首(前期末)  |              | 当期                      |                        |              | 期末              |          |
|----------------------------------|----------|--------------|-------------------------|------------------------|--------------|-----------------|----------|
|                                  | 口数       | 千口           | 口数                      | 外貨建金額                  | 邦貨換算金額       | 比率              | %        |
| 不動産ファンド<br>(アメリカ)                |          | 千口           | 千口                      | 千アメリカ・ドル               | 千円           |                 | %        |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT     | 18,835   | 24,234       | 2,746                   | 413,348                | 0.0          |                 |          |
| BOSTON PROPERTIES INC            | 18,531   | 24,473       | 1,547                   | 232,835                | 0.0          |                 |          |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT        | 58,993   | 80,213       | 1,472                   | 221,628                | 0.0          |                 |          |
| PROLOGIS INC                     | 115,173  | 139,674      | 18,227                  | 2,743,050              | 0.2          |                 |          |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC        | 16,932   | 21,518       | 3,727                   | 560,896                | 0.0          |                 |          |
| CAMDEN PROPERTY TRUST            | 13,271   | 16,851       | 1,581                   | 237,969                | 0.0          |                 |          |
| EQUINIX INC                      | 11,399   | 14,299       | 11,908                  | 1,792,087              | 0.1          |                 |          |
| CROWN CASTLE INC                 | 54,164   | 65,066       | 6,883                   | 1,035,970              | 0.1          |                 |          |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC         | 8,345    | 9,893        | 2,248                   | 338,344                | 0.0          |                 |          |
| EQUITY RESIDENTIAL               | 46,054   | 54,104       | 3,173                   | 477,534                | 0.0          |                 |          |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC        | 68,971   | 90,133       | 1,519                   | 228,690                | 0.0          |                 |          |
| SBA COMMUNICATIONS CORP          | 13,584   | 16,539       | 3,457                   | 520,365                | 0.0          |                 |          |
| WELLTOWER INC                    | 58,944   | 77,707       | 7,255                   | 1,091,880              | 0.1          |                 |          |
| KIMCO REALTY                     | 79,991   | 95,524       | 1,859                   | 279,889                | 0.0          |                 |          |
| IRON MOUNTAIN INC                | 34,514   | 43,616       | 2,946                   | 443,382                | 0.0          |                 |          |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES      | 20,486   | 27,29        | 1,806                   | 271,792                | 0.0          |                 |          |
| HOST HOTELS & RESORTS INC        | 91,777   | 110,415      | 2,144                   | 322,689                | 0.0          |                 |          |
| MID AMERICA                      | 13,578   | 17,537       | 2,193                   | 330,130                | 0.0          |                 |          |
| REALTY INCOME CORP               | 76,685   | 129,955      | 6,678                   | 1,005,030              | 0.1          |                 |          |
| REGENCY CENTERS CORP             | 19,311   | 21,907       | 1,318                   | 198,433                | 0.0          |                 |          |
| UDR INC                          | 41,516   | 50,449       | 1,759                   | 264,735                | 0.0          |                 |          |
| SIMON PROPERTY GROUP INC         | 40,894   | 48,901       | 6,985                   | 1,051,322              | 0.1          |                 |          |
| PUBLIC STORAGE                   | 19,317   | 23,534       | 6,600                   | 993,356                | 0.1          |                 |          |
| SUN COMMUNITIES INC              | 14,694   | 18,509       | 2,348                   | 353,358                | 0.0          |                 |          |
| VENTAS INC                       | 48,092   | 60,757       | 2,771                   | 417,026                | 0.0          |                 |          |
| WEYERHAEUSER CO                  | 89,893   | 114,764      | 3,790                   | 570,455                | 0.0          |                 |          |
| EXTRA SPACE STORAGE INC          | 16,256   | 34,18        | 4,771                   | 718,067                | 0.1          |                 |          |
| DIGITAL REALTY TRUST INC         | 36,258   | 45,607       | 6,486                   | 976,181                | 0.1          |                 |          |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST         | 72,327   | —            | —                       | —                      | —            |                 |          |
| AMERICAN TOWER CORP              | 58,087   | 71,26        | 13,431                  | 2,021,351              | 0.1          |                 |          |
| WP CAREY INC                     | 23,664   | 32,996       | 1,842                   | 277,227                | 0.0          |                 |          |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC      | 42,371   | —            | —                       | —                      | —            |                 |          |
| AMERICAN HOMES 4 RENT            | 42,177   | 50,995       | 1,735                   | 261,154                | 0.0          |                 |          |
| INVITATION HOMES INC             | 76,646   | 96,467       | 3,118                   | 469,344                | 0.0          |                 |          |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 30,095   | 41,252       | 1,860                   | 280,043                | 0.0          |                 |          |
| VICI PROPERTIES INC              | 120,602  | 152,711      | 4,459                   | 671,059                | 0.0          |                 |          |
| 小計                               | 口数<br>銘柄 | ・金額<br>数<比率> | 1,612,427<br>36銘柄<1.9%> | 1,923,33<br>34銘柄<1.6%> | 146,658<br>— | 22,070,635<br>— | —<br>1.6 |
| (カナダ)                            |          |              | 千口                      | 千口                     | 千カナダ・ドル      | 千円              | %        |
| CANADIAN APT PPTYS REIT          |          |              | 8,722                   | 8,722                  | 429          | 47,770          | 0.0      |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST  |          |              | 14,424                  | 14,424                 | 265          | 29,560          | 0.0      |
| 小計                               | 口数<br>銘柄 | ・金額<br>数<比率> | 23,146<br>2銘柄<0.0%>     | 23,146<br>2銘柄<0.0%>    | 695<br>—     | 77,331<br>—     | —<br>0.0 |

| 銘柄                               |                  | 期首(前期末)                 | 当期                      |  |                 | 末比<br>率  |
|----------------------------------|------------------|-------------------------|-------------------------|--|-----------------|----------|
|                                  |                  | 口数                      | 口数                      | 外貨建金額  | 邦貨換算金額          |          |
| (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                     |                  | 432,802                 | 700,332                 | 1,568  | 153,125         | 0.0      |
| GPT GROUP                        |                  | 219,223                 | 349,447                 | 1,551  | 151,446         | 0.0      |
| STOCKLAND                        |                  | 259,328                 | 369,843                 | 1,667  | 162,812         | 0.0      |
| DEXUS                            |                  | 163,989                 | 163,989                 | 1,280  | 125,014         | 0.0      |
| GOODMAN GROUP                    |                  | 214,602                 | 255,895                 | 6,806  | 664,412         | 0.0      |
| VICINITY CENTRES                 |                  | 545,645                 | 545,645                 | 1,113  | 108,651         | 0.0      |
| SCENTRE GROUP                    |                  | 647,197                 | 825,454                 | 2,542  | 248,163         | 0.0      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,482,786<br>7銘柄<0.1%>  | 3,210,605<br>7銘柄<0.1%>  | 16,531<br>—                                    | 1,613,625<br>—  | —<br>0.1 |
| (香港)                             |                  | 千口                      | 千口                      | 千香港・ドル   | 千円              | %        |
| LINK REIT                        |                  | 262,516                 | 410,116                 | 15,317   | 294,868         | 0.0      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 262,516<br>1銘柄<0.0%>    | 410,116<br>1銘柄<0.0%>    | 15,317<br>—                                    | 294,868<br>—    | —<br>0.0 |
| (シンガポール)                         |                  | 千口                      | 千口                      | 千シンガポール・ドル                                     | 千円              | %        |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL |                  | 787,231                 | 787,231                 | 1,503  | 167,878         | 0.0      |
| CAPLAND ASCENDAS REIT            |                  | 440,678                 | 611,078                 | 1,662  | 185,577         | 0.0      |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST        |                  | 474.1                   | 474.1                   | 715  | 79,929          | 0.0      |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL    |                  | 405.5                   | 405.5                   | 551  | 61,572          | 0.0      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,107,509<br>4銘柄<0.0%>  | 2,277,909<br>4銘柄<0.0%>  | 4,433<br>—                                     | 494,957<br>—    | —<br>0.0 |
| (イギリス)                           |                  | 千口                      | 千口                      | 千イギリス・ポンド                                      | 千円              | %        |
| BRITISH LAND CO PLC              |                  | 119,111                 | —                       | —  | —               | —        |
| LAND SECURITIES GROUP PLC        |                  | 77,092                  | 121,345                 | 770  | 145,763         | 0.0      |
| SEGRO PLC                        |                  | 165,081                 | 165,081                 | 1,345  | 254,448         | 0.0      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 361,284<br>3銘柄<0.0%>    | 286,426<br>2銘柄<0.0%>    | 2,115<br>—                                     | 400,211<br>—    | —<br>0.0 |
| (ベルギー)                           |                  | 千口                      | 千口                      | 千ユーロ   | 千円              | %        |
| WAREHOUSES DE PAUW               |                  | 27,206                  | 31,043                  | 786  | 127,056         | 0.0      |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 27,206<br>1銘柄<0.0%>     | 31,043<br>1銘柄<0.0%>     | 786<br>—                                       | 127,056<br>—    | —<br>0.0 |
| (フランス)                           |                  | 千口                      | 千口                      | 千ユーロ   | 千円              | %        |
| GECINA SA                        |                  | 5,045                   | 8,697                   | 832  | 134,433         | 0.0      |
| KLEPIERRE                        |                  | 25,279                  | 36,407                  | 826  | 133,427         | 0.0      |
| COVIVIO                          |                  | 5,066                   | 5,066                   | 209  | 33,777          | 0.0      |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD        |                  | —                       | 18,477                  | 1,275  | 205,983         | 0.0      |
| UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD        |                  | 13,535                  | —                       | —  | —               | —        |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 48,925<br>4銘柄<0.0%>     | 68,647<br>4銘柄<0.0%>     | 3,142<br>—                                     | 507,622<br>—    | —<br>0.0 |
| 合計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 6,925,799<br>58銘柄<2.2%> | 8,231,222<br>55銘柄<1.9%> | — <td>25,586,308<br/>—</td> <td>—<br/>1.9</td> | 25,586,308<br>— | —<br>1.9 |

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

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

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高

| 外<br>国 | 銘<br>柄<br>別           | 当<br>期 |               | 末      |          |
|--------|-----------------------|--------|---------------|--------|----------|
|        |                       | 買<br>建 | 額             | 売<br>建 | 額        |
|        | S & P 500 E MINI FUT  |        | 百万円<br>18,388 |        | 百万円<br>- |
|        | S & P / TSE 60 IX FUT |        | 785           |        | -        |
|        | SPI 200 FUTURES       |        | 475           |        | -        |
|        | FTSE 100 INDEX FUTURE |        | 968           |        | -        |
|        | DJ EURO STOXX 50      |        | 3,381         |        | -        |

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

■投資信託財産の構成

2024年2月15日現在

| 項<br>目        | 当<br>期        |    | 末<br>率    |
|---------------|---------------|----|-----------|
|               | 評<br>価<br>額   | 千円 |           |
| 株式            | 1,311,536,937 |    | %<br>96.3 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 25,586,308    |    | 1.9       |
| コール・ローン等、その他  | 24,345,898    |    | 1.8       |
| 投資信託財産総額      | 1,361,469,144 |    | 100.0     |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、1,360,702,498千円、99.9%です。

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

#### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月15日)現在

## ■損益の状況

当期 自2023年2月16日 至2024年2月15日

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

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

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

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

# J－REITインデックスファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第18期（決算日 2024年6月6日）

(計算期間 2023年6月7日～2024年6月6日)

J－REITインデックスファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

| 決算期            | 基準価額     | 東証REIT指数 |            | 投資証券組入比率 | 不動産投信指數先物比率 | 純資産額             |
|----------------|----------|----------|------------|----------|-------------|------------------|
|                |          | 期騰落率     | 中騰落率       |          |             |                  |
| 14期（2020年6月8日） | 円 19,706 | % △5.3   | % 3,696.98 | % △4.7   | % 97.4      | % 2.2 百万円 41,885 |
| 15期（2021年6月7日） | 24,869   | 26.2     | 4,660.79   | 26.1     | 97.6        | 2.2 88,531       |
| 16期（2022年6月6日） | 24,389   | △1.9     | 4,567.99   | △2.0     | 97.6        | 2.3 199,921      |
| 17期（2023年6月6日） | 23,686   | △2.9     | 4,437.30   | △2.9     | 97.8        | 2.2 200,500      |
| 18期（2024年6月6日） | 23,008   | △2.9     | 4,307.31   | △2.9     | 97.1        | 2.8 176,077      |

(注1) 不動産投信指數先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

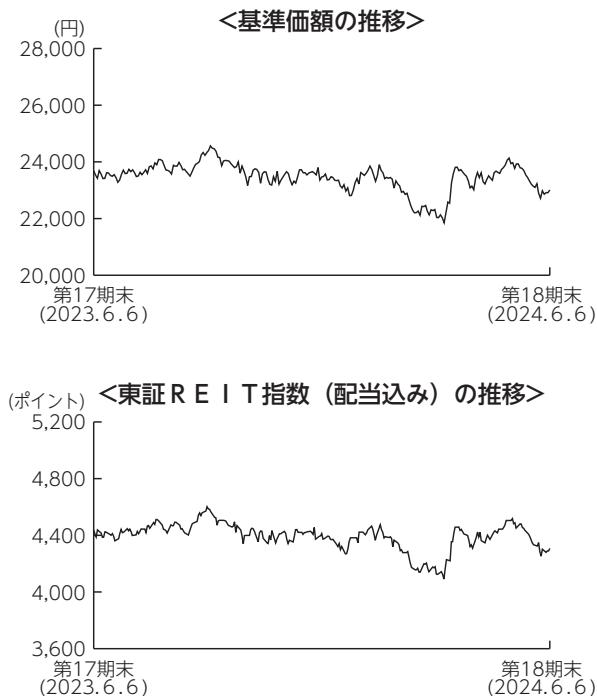
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                   | 基 準 価 額     | 東 証 R E I T 指 数 |                      | 投 資 証 券 組 入 比 率 | 不 動 産 投 信 物 信 指 比 |
|-------------------------|-------------|-----------------|----------------------|-----------------|-------------------|
|                         |             | 騰 落 率           | (配 当 込み)<br>(ペニチマーク) |                 |                   |
| (期 首)<br>2023 年 6 月 6 日 | 円<br>23,686 | %<br>—          | ポイント<br>4,437.30     | %<br>—          | %<br>97.8         |
| 6 月 末                   | 23,600      | △0.4            | 4,421.28             | △0.4            | 97.8              |
| 7 月 末                   | 23,876      | 0.8             | 4,472.88             | 0.8             | 97.7              |
| 8 月 末                   | 24,229      | 2.3             | 4,539.20             | 2.3             | 97.2              |
| 9 月 末                   | 23,852      | 0.7             | 4,468.30             | 0.7             | 97.0              |
| 10 月 末                  | 23,355      | △1.4            | 4,372.14             | △1.5            | 97.1              |
| 11 月 末                  | 23,801      | 0.5             | 4,455.46             | 0.4             | 97.2              |
| 12 月 末                  | 23,412      | △1.2            | 4,382.85             | △1.2            | 97.1              |
| 2024 年 1 月 末            | 23,392      | △1.2            | 4,378.56             | △1.3            | 97.1              |
| 2 月 末                   | 22,258      | △6.0            | 4,166.74             | △6.1            | 97.3              |
| 3 月 末                   | 23,557      | △0.5            | 4,410.17             | △0.6            | 97.2              |
| 4 月 末                   | 23,800      | 0.5             | 4,455.74             | 0.4             | 97.2              |
| 5 月 末                   | 22,980      | △3.0            | 4,302.09             | △3.0            | 97.2              |
| (期 末)<br>2024 年 6 月 6 日 | 23,008      | △2.9            | 4,307.31             | △2.9            | 97.1              |
|                         |             |                 |                      |                 | 2.8               |

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年6月7日から2024年6月6日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,008円となり、前期末比で2.9%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

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

## ポートフォリオについて

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.9%下落しました。

当ファンドはベンチマークとほぼ連動したパフォーマンスとなりました。

## 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目                                  | 当期               |                              | 項目の概要  |
|-------------------------------------|------------------|------------------------------|--|
|                                     | 金額               | 比率                           |  |
| (a) 売買委託手数料<br>(先物・オプション)<br>(投資証券) | 0円<br>(0)<br>(0) | 0.001%<br>(0.001)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<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 |
| 合計                                  | 0                | 0.001                        |  |
| 期中の平均基準価額は23,451円です。                |                  |                              |  |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ■ 売買及び取引の状況 (2023年6月7日から2024年6月6日まで)

### (1) 投資証券

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

|                       | 買      |           | 付      |           | 売      |        |
|-----------------------|--------|-----------|--------|-----------|--------|--------|
|                       | 口<br>数 | 金<br>額    | 口<br>数 | 金<br>額    | 口<br>数 | 金<br>額 |
|                       | 千口     | 千円        | 千口     | 千円        | 千円     | 千円     |
| 積水ハウス・リート投資法人         | 26,852 | 2,158,993 | 31,012 | 2,508,612 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| トーセイ・リート投資法人          | 1,871  | 259,702   | 2,371  | 327,950   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| ケネディクス商業リート投資法人       | 1,704  | 491,759   | 9.75   | 2,652,150 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| ヘルスケア&メディカル投資法人       | 2,207  | 313,314   | 2,548  | 358,481   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| サムティ・レジデンシャル投資法人      | 2,657  | 298,187   | 2,802  | 311,461   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 野村不動産マスターファンド投資法人     | 28,903 | 4,727,220 | 33.38  | 5,404,280 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| いちごホテルリート投資法人         | 1,478  | 162,524   | 1,707  | 187,696   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| ラサールロジポート投資法人         | 12,375 | 1,860,122 | 13.144 | 1,950,287 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| スターアジア不動産投資法人         | 18,561 | 1,062,613 | 15.279 | 887,851   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| マリモ地方創生リート投資法人        | 1,406  | 177,552   | 1.594  | 201,606   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人   | 4,074  | 1,914,082 | 4.263  | 1,968,867 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人     | 1,359  | 93,573    | 1.728  | 116,580   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 投資法人みらい               | 14,575 | 663,663   | 13.561 | 620,717   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 三菱地所物流リート投資法人         | 3,116  | 1,189,632 | 3.561  | 1,357,297 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 3,886  | 622,019   | 4.445  | 708,229   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| ザイマックス・リート投資法人        | 1,453  | 170,595   | 1.678  | 195,775   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| タカラレーベン不動産投資法人        | 5,304  | 520,584   | 4.907  | 485,949   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人     | 3,959  | 499,714   | 4.523  | 568,458   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 日本ビルファンド投資法人          | 10,424 | 6,292,531 | 12.039 | 7,189,709 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| ジャパンリアルエステイト投資法人      | 9,209  | 5,236,328 | 10.599 | 5,957,540 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 日本都市ファンド投資法人          | 42,515 | 4,137,198 | 53.819 | 5,196,002 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| オリックス不動産投資法人          | 17,806 | 3,070,729 | 20.564 | 3,548,381 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 日本プライムリアルティ投資法人       | 6,113  | 2,156,108 | 7.06   | 2,474,634 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| N T T 都市開発リート投資法人     | 9,364  | 1,214,627 | 9.795  | 1,268,538 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| 東急リアル・エステート投資法人       | 5,992  | 1,054,823 | 6.921  | 1,213,089 |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |
| グローバル・ワン不動産投資法人       | 6,638  | 744,935   | 7.614  | 851,266   |        |        |
|                       | (-)    | (-)       | (-)    | (-)       |        |        |

|                   | 買付                 |                  | 売付            |                  |
|-------------------|--------------------|------------------|---------------|------------------|
|                   | 口数                 | 金額               | 口数            | 金額               |
|                   | 千口                 | 千円               | 千口            | 千円               |
| ユナイテッド・アーバン投資法人   | 19.993<br>(-)      | 3,005,653<br>(-) | 23.089<br>(-) | 3,443,613<br>(-) |
| 森トラストリート投資法人      | 18.408<br>(-)      | 1,344,609<br>(-) | 19.85<br>(-)  | 1,440,247<br>(-) |
| インヴィンシブル投資法人      | 50.923<br>(-)      | 3,073,858<br>(-) | 49.476<br>(-) | 3,003,666<br>(-) |
| フロンティア不動産投資法人     | 3.315<br>(-)       | 1,492,992<br>(-) | 3.829<br>(-)  | 1,722,127<br>(-) |
| 平和不動産リート投資法人      | 7.538<br>(-)       | 1,063,901<br>(-) | 7.308<br>(-)  | 1,026,115<br>(-) |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 5.64<br>(-)        | 1,617,816<br>(-) | 7.189<br>(-)  | 2,054,307<br>(-) |
| 福岡リート投資法人         | 4.616<br>(-)       | 762,262<br>(-)   | 5.332<br>(-)  | 873,951<br>(-)   |
| KDX不動産投資法人        | 31.031<br>(24.335) | 7,788,795<br>(-) | 17.614<br>(-) | 3,381,983<br>(-) |
| いちごオフィスリート投資法人    | 7.328<br>(-)       | 623,720<br>(-)   | 8.462<br>(-)  | 720,480<br>(-)   |
| 大和証券オフィス投資法人      | 1.867<br>(3.676)   | 1,200,170<br>(-) | 2.283<br>(-)  | 1,361,843<br>(-) |
| 阪急阪神リート投資法人       | 4.709<br>(-)       | 665,980<br>(-)   | 4.905<br>(-)  | 686,661<br>(-)   |
| スタートプロシード投資法人     | 1.551<br>(-)       | 325,486<br>(-)   | 1.791<br>(-)  | 375,512<br>(-)   |
| 大和ハウスリート投資法人      | 13.465<br>(-)      | 3,557,715<br>(-) | 15.552<br>(-) | 4,085,667<br>(-) |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 31.902<br>(-)      | 2,301,345<br>(-) | 34.265<br>(-) | 2,511,266<br>(-) |
| 大和証券リビング投資法人      | 14.334<br>(-)      | 1,555,762<br>(-) | 14.764<br>(-) | 1,598,601<br>(-) |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 7.704<br>(-)       | 989,812<br>(-)   | 9.801<br>(-)  | 1,265,802<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      |
| 国内 不動産投信指数先物取引 | 百万円<br>20,724 | 百万円<br>19,938 | 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（2023年6月7日から2024年6月6日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

| 決算期         |   | 当期             |                    |           |                |                    |           |
|-------------|---|----------------|--------------------|-----------|----------------|--------------------|-----------|
| 区分          | 分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | B/A       | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D/C       |
| 投 資 証 券     |   | 百万円<br>100,979 | 百万円<br>13,310      | %<br>13.2 | 百万円<br>112,099 | 百万円<br>13,897      | %<br>12.4 |
| 不動産投信指数先物取引 |   | 20,724         | 5,118              | 24.7      | 19,938         | 9,265              | 46.5      |

### (2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

| 種類      | 買付額 | 当期    |   |
|---------|-----|-------|---|
|         |     | 百万円   | 額 |
| 投 資 証 券 |     | 4,180 |   |

### (3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項目              | 当期      |
|-----------------|---------|
| 売買委託手数料総額(A)    | 2,468千円 |
| うち利害関係人への支払額(B) | 885千円   |
| (B)/(A)         | 35.9%   |

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

## ■組入資産の明細

### (1) 国内投資証券

| 銘 柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末  |            |     |       |
|-------------------------|---------|--------|------------|-----|-------|
|                         |         | □ 数    | □ 数        | 評 價 | 額 比 率 |
| <b>不動産ファンド</b>          | 千口      | 千口     | 千円         |     | %     |
| エスコンジャパンリート投資法人         | 3,762   | 3,481  | 418,068    | 0.2 |       |
| サンケイリアルエステート投資法人        | 5,929   | 5,485  | 467,322    | 0.3 |       |
| S O S I L A 物流リート投資法人   | 9,206   | 8,543  | 1,002,948  | 0.6 |       |
| 東海道リート投資法人              | 3,078   | 2,925  | 359,190    | 0.2 |       |
| 日本アコモデーションファンド投資法人      | 6,391   | 5,913  | 3,843,450  | 2.2 |       |
| 森ビルズリート投資法人             | 21,763  | 20,136 | 2,625,734  | 1.5 |       |
| 産業ファンド投資法人              | 28,239  | 31,189 | 3,907,981  | 2.2 |       |
| アドバンス・レジデンス投資法人         | 18,505  | 16.8   | 5,510,400  | 3.1 |       |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 13,573  | —      | —          | —   |       |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人      | 9,771   | 8,983  | 3,373,116  | 1.9 |       |
| G L P 投資法人              | 62,397  | 57,517 | 7,644,009  | 4.3 |       |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人      | 8.85    | 8.42   | 2,723,870  | 1.5 |       |
| 日本プロジェクトリート投資法人         | 32,182  | 29,829 | 7,433,386  | 4.2 |       |
| 星野リゾート・リート投資法人          | 3,237   | 3,599  | 1,885,876  | 1.1 |       |
| Oneリート投資法人              | 3,228   | 2,987  | 761,386    | 0.4 |       |
| イオンリート投資法人              | 21,247  | 21,004 | 2,810,335  | 1.6 |       |
| ヒューリックリート投資法人           | 17,316  | 16,021 | 2,351,882  | 1.3 |       |
| 日本リート投資法人               | 6,012   | 5,562  | 1,888,299  | 1.1 |       |
| 積水ハウス・リート投資法人           | 55,614  | 51,454 | 4,121,465  | 2.3 |       |
| トーセイ・リート投資法人            | 4,106   | 3,606  | 498,349    | 0.3 |       |
| ケネディクス商業リート投資法人         | 8,046   | —      | —          | —   |       |
| ヘルスケア&メディカル投資法人         | 4,563   | 4,222  | 545,904    | 0.3 |       |
| サムティ・レジデンシャル投資法人        | 4,811   | 4,666  | 492,263    | 0.3 |       |
| 野村不動産マスターファンド投資法人       | 59.85   | 55,373 | 7,818,667  | 4.4 |       |
| いちごホテルリート投資法人           | 3,066   | 2,837  | 313,488    | 0.2 |       |
| ラサールロジポート投資法人           | 22,657  | 21,888 | 3,307,276  | 1.9 |       |
| スターアジア不動産投資法人           | 23,108  | 26.39  | 1,593,956  | 0.9 |       |
| マリモ地方創生リート投資法人          | 2,827   | 2,639  | 342,278    | 0.2 |       |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人     | 7,311   | 7,122  | 3,155,046  | 1.8 |       |
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人       | 2,987   | 2,618  | 195,041    | 0.1 |       |
| 投資法人みらい                 | 22,485  | 23,499 | 1,058,629  | 0.6 |       |
| 三菱地所物流リート投資法人           | 6,358   | 5,913  | 2,288,331  | 1.3 |       |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人   | 7.93    | 7,371  | 1,068,795  | 0.6 |       |
| ザイマックス・リート投資法人          | 3,002   | 2,777  | 331,851    | 0.2 |       |
| タカラレーベン不動産投資法人          | 8,724   | 9,121  | 902,066    | 0.5 |       |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人       | 8,067   | 7,503  | 907,863    | 0.5 |       |
| 日本ビルファンド投資法人            | 21,591  | 19,976 | 11,725,912 | 6.7 |       |

| 銘柄                | 期首(前期末)    | 当期末          |                          |                          |                  |
|-------------------|------------|--------------|--------------------------|--------------------------|------------------|
|                   |            | □ 数          | □ 数                      | 評価額                      | 比率               |
| <b>不動産ファンド</b>    |            | 千□           | 千□                       | 千円                       | %                |
| ジャパンリアルエステイト投資法人  | 18,979     | 17,589       | 9,163,869                | 5.2                      |                  |
| 日本都市ファンド投資法人      | 93,381     | 82,077       | 7,444,383                | 4.2                      |                  |
| オリックス不動産投資法人      | 36,876     | 34,118       | 5,455,468                | 3.1                      |                  |
| 日本プライムリアルティ投資法人   | 12,657     | 11,71        | 3,881,865                | 2.2                      |                  |
| N T T 都市開発リート投資法人 | 17,791     | 17,36        | 2,046,744                | 1.2                      |                  |
| 東急リアル・エステート投資法人   | 12,409     | 11,48        | 1,796,620                | 1.0                      |                  |
| グローバル・ワン不動産投資法人   | 13.62      | 12,644       | 1,284,630                | 0.7                      |                  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人   | 41.4       | 38,304       | 5,431,507                | 3.1                      |                  |
| 森トラストリート投資法人      | 34,447     | 33,005       | 2,323,552                | 1.3                      |                  |
| インヴィンシブル投資法人      | 81.46      | 82,907       | 5,662,548                | 3.2                      |                  |
| フロンティア不動産投資法人     | 6,867      | 6,353        | 2,877,909                | 1.6                      |                  |
| 平和不動産リート投資法人      | 13.04      | 13,27        | 1,762,256                | 1.0                      |                  |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 12,479     | 10,93        | 2,992,634                | 1.7                      |                  |
| 福岡リート投資法人         | 9,572      | 8,856        | 1,416,074                | 0.8                      |                  |
| K D X 不動産投資法人     | 10,769     | 48,521       | 7,399,452                | 4.2                      |                  |
| いちごオフィスリート投資法人    | 15,165     | 14,031       | 1,149,138                | 0.7                      |                  |
| 大和証券オフィス投資法人      | 3,834      | 7,094        | 1,992,704                | 1.1                      |                  |
| 阪急阪神リート投資法人       | 8.36       | 8,164        | 1,091,526                | 0.6                      |                  |
| スターツプロシード投資法人     | 3,208      | 2,968        | 606,065                  | 0.3                      |                  |
| 大和ハウスリート投資法人      | 27,898     | 25,811       | 6,540,507                | 3.7                      |                  |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 59,684     | 57,321       | 4,522,626                | 2.6                      |                  |
| 大和証券リビング投資法人      | 25,646     | 25,216       | 2,624,985                | 1.5                      |                  |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 16,978     | 14,881       | 1,827,386                | 1.0                      |                  |
| 合計                | □ 数<br>銘柄数 | ・ 金額<br><比率> | 1,128,309<br>60銘柄<97.8%> | 1,091,979<br>58銘柄<97.1%> | 170,968,898<br>— |
|                   |            |              |                          |                          | —<br>97.1        |

(注1) <>内は期末の純資産総額に対する投資証券評価額の比率です。

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

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘<br>柄<br>別    | 当<br>期      |              |             |  | 末        |
|----------------|-------------|--------------|-------------|--|----------|
|                | 買<br>建<br>額 |              | 売<br>建<br>額 |  |          |
| 国内 東 証 R E I T |             | 百万円<br>4,979 |             |  | 百万円<br>- |

■投資信託財産の構成

2024年6月6日現在

| 項<br>目          | 当<br>期      |    | 末      |
|-----------------|-------------|----|--------|
|                 | 評<br>価<br>額 | 千円 | 比<br>率 |
| 投 資 証 券         | 170,968,898 |    | 96.1   |
| コール・ローン等、その他    | 7,029,246   |    | 3.9    |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 177,998,145 |    | 100.0  |

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

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月6日)現在

| 項  | 目   | 当期末   |
|--|---|---|
| (A) 資  | 産   | 177,998,145,093円  |
| コ<br>一<br>ル<br>・<br>資<br>資<br>未<br>未<br>未<br>差 | 口<br>・<br>證<br>收<br>入<br>當<br>委<br>託<br>証<br>入<br>當<br>金<br>金<br>金<br>金 | 4,452,172,984<br>170,968,898,350<br>1,077,568,704<br>1,319,496,712<br>180,008,343 |
| (B) 負  | 債   | 1,920,896,895   |
| 未<br>未<br>未                                    | 払<br>解<br>約   | 226,286,895<br>1,694,610,000  |
| (C) 純  | 資<br>産<br>総<br>額(A-B)   | 176,077,248,198   |
| 元  | 本   | 76,529,156,421  |
| 次<br>期   | 繰<br>越<br>損<br>益  | 99,548,091,777  |
| (D) 受<br>益                                     | 權<br>総<br>口<br>数  | 76,529,156,421口   |
| 1<br>万<br>口<br>当<br>た<br>り                     | 基<br>準<br>価<br>額(C/D)   | 23,008円   |

(注1) 期首元本額 84,649,761,469円  
 追加設定元本額 43,457,370,268円  
 一部解約元本額 51,577,975,316円

(注2) 期末における元本の内訳

|  |                |
|--|----------------|
| MITO ラップ型ファンド (安定型)                    | 274,804円       |
| MITO ラップ型ファンド (中立型)                    | 1,143,704円     |
| MITO ラップ型ファンド (積極型)                    | 2,907,813円     |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)                  | 3,263,162円     |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)                  | 3,763,743円     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)                  | 2,003,505円     |
| たわらノーロード 国内リート                         | 5,959,788,163円 |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)                 | 3,691,467,158円 |
| たわらノーロード バランス (堅実型)                    | 47,220,839円    |
| たわらノーロード バランス (標準型)                    | 1,082,290,459円 |
| たわらノーロード バランス (積極型)                    | 1,367,082,467円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)           | 36,161円        |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)           | 363,532,982円   |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)           | 1,004,444,746円 |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)           | 714,849,012円   |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)                 | 854,144,072円   |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)                 | 4,118,390円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (新興国10)               | 82,954,597円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)            | 14,531,791円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)            | 26,594,772円    |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>                   | 12,646,122円    |
| マネックス資産設計ファンド<育成型>                     | 473,314,451円   |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                 | 4,539,059円     |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)            | 152,407,293円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)            | 236,914,240円   |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)            | 528,218,240円   |
| 投資のソムリエ                                | 3,343,920,338円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>                          | 354,825,931円   |
| DIAM 8資産バランスファンド<DC年金>                 | 225,908,401円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                    | 714,661,133円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                     | 2,188,732,008円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2045)                | 60,679,736円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2055)                | 31,642,088円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)                | 6,628,675円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2035)                | 74,459,869円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                    | 110,119,108円   |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                   | 134,261,239円   |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2040)                | 27,251,818円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2050)                | 33,832,205円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2060)                | 20,798,045円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット：イヤー2065)                | 5,257,990円     |
| Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>          | 55,791,387円    |
| Jリートインデックスファンド (DC)                    | 80,982,635円    |
| MHAM J-REIT インデックスファンド (隔月決算型)         | 14,068,198円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家認定) | 67,677,043円    |

|   |                 |
|---|-----------------|
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型) 20-04 (適格機関投資家認定)            | 213,663,893円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家認定)                    | 67,645,374円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家認定)                       | 89,471,283円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家認定)                    | 40,737,084円     |
| 固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建日本政府保証債券用型) (適格機関投資家認定)            | 187,394,813円    |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家認定)                       | 81,150,070円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型・シグナルヘッジ付き) 21-03 (適格機関投資家認定)  | 213,274,938円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家認定)                    | 104,578,140円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド21-04 (適格機関投資家認定)                      | 172,266,444円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-05 (適格機関投資家認定)        | 26,270,997円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-07 (適格機関投資家認定)        | 43,694,307円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-08 (適格機関投資家認定)        | 30,480,697円     |
| 低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09 (適格機関投資家認定)                | 81,099,581円     |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家認定)                    | 46,826,287円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-09 (適格機関投資家認定)        | 30,344,037円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) 2021-12 (適格機関投資家認定)        | 43,911,261円     |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家認定) | 174,653,236円    |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家認定)                         | 124,680,497円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (株式先物活用型・シグナルヘッジ付き) 24-04 (適格機関投資家認定)  | 111,255,376円    |
| マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2024-05 (適格機関投資家認定) | 175,975,490円    |
| DIAM J-REIT インデックスファンド (適格機関投資家向け)                        | 3,087,015,174円  |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家認定)                                    | 53,275,042円     |
| AMOn eマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家認定)          | 24,607,627円     |
| 日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家認定)              | 319,808,903円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家認定)                           | 111,939,256円    |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF用) (適格機関投資家専用)                 | 1,961,878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 (適格機関投資家認定)                 | 112,498,130円    |
| MHAM J-REIT インデックスファンド (毎月決算型)                            | 7,051,073,596円  |
| MHAM J-REIT インデックスファンド (年1回決算型)                           | 31,672,270,859円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ専用>                                     | 2,630,978,832円  |
| 期末元本合計  | 5,218,394,727円  |
| 期末元本合計  | 76,529,156,421円 |

## ■損益の状況

当期 自2023年6月7日 至2024年6月6日

| 項                        | 目 | 当期              |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 配 当 等 収 益            |   | 8,115,346,474円  |
| 受 取 配 当 金                |   | 8,115,874,480   |
| 受 取 利 息                  |   | 576,101         |
| そ の 他 収 益 金              |   | 6               |
| 支 払 利 息                  |   | △1,104,113      |
| (B) 有 價 証 券 売 買 損 益      |   | △13,925,966,692 |
| 売 買 益 益                  |   | 2,997,248,845   |
| 売 買 損 損                  |   | △16,923,215,537 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益    |   | △188,895,920    |
| 取 引 益 益                  |   | 297,573,890     |
| 取 引 損 損                  |   | △486,469,810    |
| (D) 当 期 損 益 金(A + B + C) |   | △5,999,516,138  |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金        |   | 115,851,031,341 |
| (F) 解 約 差 損 益 金          |   | △69,011,497,158 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金      |   | 58,708,073,732  |
| (H) 合 計(D + E + F + G)   |   | 99,548,091,777  |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)         |   | 99,548,091,777  |

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

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

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

# 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日 2024年6月24日）

(対象期間 2023年6月23日～2024年6月24日)

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

**当ファンドの仕組みは次の通りです。**

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2007年4月11日から無期限です。  |
| 運用方針   | S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。                                       |
| 主な組入制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<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<br>(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 | 純資産額       |
|-----------------|----------|---|-----------------|-------------------|-------------|------------|
|                 |          | 期初騰落率   | (ベンチマーク)        |                   |             |            |
| 13期(2020年6月22日) | 円 10,922 | % △16.4   | ポイント 111,241.50 | % △15.7           | % 99.7      | % - 34,753 |
| 14期(2021年6月22日) | 15,336   | 40.4  | 157,949.66      | 42.0              | 99.4        | - 78,959   |
| 15期(2022年6月22日) | 16,673   | 8.7   | 172,787.99      | 9.4               | 99.3        | - 56,003   |
| 16期(2023年6月22日) | 17,096   | 2.5   | 177,832.19      | 2.9               | 99.4        | - 81,199   |
| 17期(2024年6月24日) | 20,700   | 21.1  | 216,675.29      | 21.8              | 99.0        | 1.0 87,881 |

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) ベンチマークは S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指數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（「SP DJI」）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 SP DJI 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、SP DJI、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、遗漏、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）。

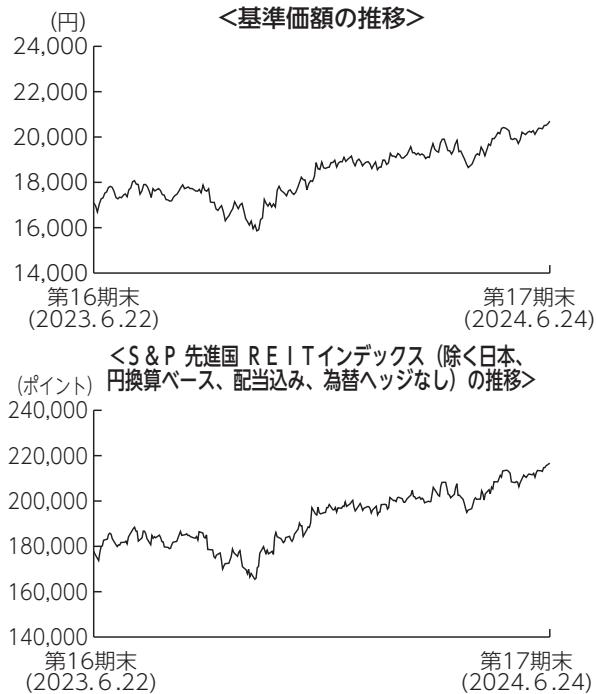
■当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は20,700円となり、前期末比で21.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

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

### 投資環境

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

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

### ポートフォリオについて

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

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で21.8%上昇しました。  
当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

### 今後の運用方針

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

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目  | 当期                      |   | 項目の概要   |
|---|-------------------------|---|---|
|   | 金額                      | 比率                                      |   |
| (a) 売買委託手数料<br>(先物・オプション)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券) | 2円<br>(0)<br>(0)<br>(2) | 0.013%<br>(0.000)<br>(0.002)<br>(0.011) | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<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              |
| (b) 有価証券取引税<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券)               | 4<br>(0)<br>(4)         | 0.024<br>(0.002)<br>(0.022)             | (b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<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            |
| (c) その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)                      | 8<br>(7)<br>(1)         | 0.046<br>(0.038)<br>(0.008)             | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計  | 15                      | 0.083                                   |   |
| 期中の平均基準価額は18,397円です。                              |                         |   |   |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## ■ 売買及び取引の状況 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

### (1) 投資信託受益証券、投資証券

|                              | 買付      |          | 売付      |          |
|------------------------------|---------|----------|---------|----------|
|                              | □ 数     | 金額       | □ 数     | 金額       |
| アメリカ                         | 千口      | 千アメリカ・ドル | 千口      | 千アメリカ・ドル |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 44,521  | 4,791    | 51,491  | 5,440    |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| ALEXANDER'S INC.             | 0.7     | 130      | 0.861   | 161      |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 42,103  | 2,474    | 47,241  | 2,780    |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| OMEGA HEALTHCARE INVS INC    | 73,871  | 2,399    | 78,516  | 2,541    |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| APARTMENT INV & MGMT CO-A    | 28,657  | 200      | 41,562  | 287      |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| AGREE REALTY CORP            | 29,363  | 1,710    | 30,57   | 1,712    |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| BRT APARTMENTS CORP          | 3,203   | 59       | 3,719   | 62       |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| SL GREEN                     | 17.22   | 655      | 19,099  | 746      |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| EPR PROPERTIES               | 20,917  | 908      | 24,191  | 1,014    |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| PROLOGIS INC                 | 262,201 | 29,328   | 303,138 | 34,024   |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 40,914  | 7,276    | 47,416  | 8,292    |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| LXP INDUSTRIAL TRUST         | 60.11   | 529      | 72,905  | 634      |
|                              | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |

|                              | 買付      |          | 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        | 30,337  | 2,942    | 35,142  | 3,339    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| VERIS RESIDENTIAL INC        | 25,854  | 413      | 27,396  | 438      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| EQUINIX INC                  | 26,952  | 20,491   | 30,643  | 22,767   |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| NNN REIT INC                 | 49,099  | 1,892    | 57,324  | 2,138    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| CTO REALTY GROUTH INC        | -       | -        | 1,936   | 33       |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 35,373  | 732      | 42,016  | 852      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES    | -       | -        | -       | -        |
| (△14,046)                    | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| SITE CENTERS CORP            | 37,223  | 464      | 46,279  | 564      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| SAFEHOLD INC                 | 12,207  | 221      | 12,873  | 215      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 18,669  | 4,210    | 21,491  | 4,749    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 101,285 | 6,084    | 114,785 | 6,785    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 19,889  | 1,875    | 23,003  | 2,129    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| FIRST INDUSTRIAL RT          | 36,575  | 1,700    | 42,101  | 1,970    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 163,634 | 2,990    | 192,551 | 3,410    |
| (68,793)                     | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 30,158  | 571      | 35,968  | 667      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 23,711  | 485      | 29,203  | 582      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| SERVICE PROPERTIES TRUST     | 34,114  | 248      | 41,344  | 307      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| WELLTOWER INC                | 191,286 | 16,821   | 173,196 | 14,779   |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| EAST GROUP                   | 13,221  | 2,224    | 13,918  | 2,300    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| KIMCO REALTY                 | 181,693 | 3,331    | 211,022 | 3,816    |
| (22,741)                     | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| KILROY REALTY CORP           | 33,041  | 1,051    | 37,091  | 1,184    |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| LTC PROPERTIES INC           | 12,892  | 419      | 14,463  | 456      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 42,905  | 89       | 54,866  | 131      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 29,058  | 114      | 45,368  | 192      |
| (-)                          | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |

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

|                                     | 買付       |          | 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        | 1,496    | 58       | 2,833   | 107      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| VENTAS INC                          | 119,656  | 5,316    | 135,393 | 5,812    |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| VORNADO REALTY TRUST                | 46.64    | 1,053    | 53,971  | 1,220    |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| ELME COMMUNITIES                    | 23,129   | 334      | 27,066  | 381      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| KITE REALTY GROUP TRUST             | 56,332   | 1,197    | 67,413  | 1,415    |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| EXTRA SPACE STORAGE INC             | 59,182   | 7,298    | 69,034  | 8,586    |
|                                     | (34,794) | (-)      | (-)     | (-)      |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C        | 15,813   | 38       | 22,988  | 40       |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC        | 43,304   | 416      | 54,462  | 522      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| CUBESMART                           | 64,136   | 2,501    | 73,264  | 2,856    |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 99,952   | 12,895   | 99,877  | 12,501   |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO          | 55,669   | 460      | 61,361  | 506      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST            | 120.97   | 728      | 144,998 | 696      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| DOUGLAS EMMETT INC                  | 49,277   | 627      | 57,755  | 720      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 34,935   | 436      | 37,953  | 464      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC    | 27,099   | 152      | 33,126  | 187      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC         | -        | -        | 9,459   | 56       |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| TERRENO REALTY CORP                 | 30,512   | 1,761    | 24,342  | 1,362    |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC           | 12,003   | 240      | 15,468  | 306      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| RLJ LODGING TRUST                   | 31,451   | 312      | 39,557  | 398      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| AMERICOLD REALTY TRUST              | 75,049   | 2,057    | 88,383  | 2,457    |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST             | 23,04    | 311      | 29,698  | 397      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| CHATHAM LODGING TRUST               | 5,225    | 51       | 8,382   | 82       |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC          | 55,891   | 782      | 65,968  | 921      |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |
| WHITESTONE REIT                     | 4,626    | 47       | 5,285   | 58       |
|                                     | (-)      | (-)      | (-)     | (-)      |

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

|                                      | 買付      |          | 売付     |          |
|--------------------------------------|---------|----------|--------|----------|
|                                      | 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 |
| POSTAL REALTY TRUST INC              | 5,632   | 80       | 5,703  | 76       |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC     | -       | -        | 2,368  | 36       |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP           | 21,094  | 522      | 22,303 | 544      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| FARMLAND PARTNERS INC                | 15,013  | 165      | 22,077 | 237      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| ORION OFFICE REIT INC                | -       | -        | 7,744  | 37       |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| NETSTREIT CORP                       | 17,614  | 278      | 17,012 | 268      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| CARETRUST REIT INC                   | 44,817  | 1,016    | 31,887 | 698      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| PEAKSTONE REALTY TRUST               | 25,787  | 461      | 12,15  | 175      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| INDUS REALTY TRUST INC               | -       | -        | 2,103  | 140      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| PHILLIPS EDISON & CO INC             | 30,863  | 1,050    | 34,113 | 1,157    |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC             | -       | -        | 1,188  | 15       |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| APARTMENT INCOME REIT CORP           | 38,971  | 1,266    | 48,023 | 1,509    |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| BROADSTONE NET LEASE INC             | 34,595  | 514      | 42,683 | 618      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| STAR HOLDINGS                        | -       | -        | 5,322  | 75       |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC      | 5,848   | 121      | 6,978  | 143      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD | 394.3   | 218      | 239.1  | 125      |
| (-)                                  | (△6)    | (-)      | (-)    | (-)      |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC         | 26,412  | 394      | -      | -        |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES          | (5,763) | (1)      | (-)    | (-)      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| PARAMOUNT GROUP INC                  | 28,405  | 128      | 43.11  | 192      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC              | 17,038  | 154      | 16,798 | 146      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| URBAN EDGE PROPERTIES                | 28.38   | 451      | 33.49  | 522      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC   | 20,737  | 249      | 23,172 | 269      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC           | 19,339  | 230      | 27,887 | 345      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC   | 163,733 | 829      | 64,263 | 312      |
| (-)                                  | (-)     | (-)      | (-)    | (-)      |

|  | 買付      |          | 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 |
| NEXPPOINT RESIDENTIAL TRUST INC                              | 3.317   | 122      | 3.621   | 118      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST                            | 15.828  | 492      | 24.069  | 822      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC                               | 6.372   | 186      | 6.899   | 194      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC                                   | 61.027  | 955      | 65.631  | 1,024    |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| GLOBAL NET LEASE INC   | 28.67   | 240      | 42.191  | 355      |
| (42.743)   | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| NEXPPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST                      | -       | -        | -       | -        |
| (0.629)  | (4)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| PARK HOTELS & RESORTS INC                                    | 49.336  | 652      | 60.888  | 808      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| VICI PROPERTIES INC  | 301.198 | 8,852    | 331.053 | 9,514    |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC                              | 28.644  | 652      | 30.699  | 687      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| カナダ  | 千口      | 千カナダ・ドル  | 千口      | 千カナダ・ドル  |
| SMARTCENTRES REIT  | 20.529  | 484      | 23.651  | 547      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| CANADIAN APT PPTYS REIT                                      | 25.791  | 1,179    | 29.746  | 1,323    |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT                                 | 49.618  | 460      | 54.877  | 496      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                   | 28.659  | 404      | 34.075  | 475      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST                              | 40.883  | 738      | 47.516  | 833      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| ALLIED PROPERTIES REIT                                       | 15.152  | 269      | 17.905  | 303      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST                           | -       | -        | 3.363   | 36       |
| (△2.585)   | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST                                 | 9.644   | 663      | 9.605   | 658      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                           | 4.232   | 26       | 6.905   | 41       |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| CROMBIE REAL ESTATE INV                                      | 16.028  | 209      | 18.95   | 242      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST                                 | 19.459  | 245      | 24.11   | 299      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 31.25   | 138      | 35.58   | 159      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| MORGARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT                      | -       | -        | 2.22    | 34       |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                        | -       | -        | 4.643   | 14       |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |
| DREAM INDUSTRIAL REIT  | 23.695  | 304      | 27.414  | 342      |
| (-)  | (-)     | (-)      | (-)     | (-)      |

|  | 買付        |             | 売付        |             |
|--|-----------|-------------|-----------|-------------|
|  | 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     |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST               | 8,558     | 602         | 10.2      | 703         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT                         | -         | -           | -         | -           |
|  | (△17,707) | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHOICE PROPERTIES REIT                             | 35,392    | 462         | 42,996    | 544         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST       | -         | -           | 1,955     | 33          |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                    | 11,913    | 165         | 14,896    | 203         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | -         | -           | 17,876    | 43          |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST                   | -         | -           | 5,878     | 31          |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SLATE GROCERY REIT                                 | 10,756    | 124         | 10,653    | 115         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| PRIMARIS REIT                                      | 13.25     | 178         | 14,806    | 198         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SLATE OFFICE REIT                                  | -         | -           | 17,818    | 27          |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | -         | -           | 8,337     | 85          |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST      | 17,472    | 297         | 18,761    | 315         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| 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  | 171,757   | 609         | 158,601   | 548         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| MIRVAC GROUP                                       | 1,167,272 | 2,476       | 1,323,343 | 2,806       |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CROMWELL PROPERTY GROUP                            | 206,513   | 84          | 318,514   | 125         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHARTER HALL RETAIL REIT                           | 158,557   | 534         | 184,015   | 606         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| GPT GROUP  | 569,358   | 2,289       | 647,888   | 2,601       |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CENTURIA CAPITAL GROUP                             | 308.93    | 449         | 270,119   | 395         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| ABACUS GROUP                                       | 174,871   | 184         | 201,768   | 218         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT            | 71,254    | 188         | 94,114    | 245         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| STOCKLAND  | 722,285   | 2,908       | 829,224   | 3,360       |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP                          | 114,527   | 494         | 119,742   | 515         |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| DEXUS  | 314.91    | 2,289       | 352,435   | 2,546       |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| GOODMAN GROUP                                      | 502,781   | 11,860      | 567,649   | 13,506      |
|  | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |

|                                       | 買付        |             | 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 |
| VICINITY CENTRES                      | 1,003.623 | 1,841       | 1,173.558 | 2,109       |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHARTER HALL GROUP                    | 136.538   | 1,411       | 154.812   | 1,569       |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA      | 84.538    | 196         | 108.784   | 242         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| REGION RE LTD                         | 238.016   | 520         | 286.625   | 605         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT              | 122.699   | 370         | 149.701   | 458         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| ARENA REIT                            | 67.105    | 228         | 85.07     | 285         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT           | 151.636   | 516         | 185.161   | 626         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| DEXUS INDUSTRIA REIT                  | 19.686    | 54          | 17.711    | 48          |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| NATIONAL STORAGE REIT                 | 296.673   | 659         | 326.065   | 709         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| RURAL FUNDS GROUP                     | 94.174    | 184         | 119.787   | 225         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SCENTRE GROUP                         | 1,544.091 | 4,175       | 1,777.304 | 4,775       |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND  | -         | -           | 140.343   | 97          |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| HMC CAPITAL LTD                       | 64.179    | 330         | 76.071    | 404         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| HOMEKO DAILY NEEDS REIT               | 538.614   | 643         | 503.146   | 594         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| HEALTHCO REIT                         | 75.434    | 104         | 56.03     | 81          |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| ABACUS STORAGE KING                   | 72.902    | 78          | 44.226    | 44          |
| (195.539)                             | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CENTURIA OFFICE REIT                  | 44.311    | 48          | 69.257    | 80          |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| WAYPOINT REIT LTD                     | 116.495   | 277         | 150.326   | 350         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| 香港                                    | 千口        | 千香港・ドル      | 千口        | 千香港・ドル      |
| LINK REIT                             | 630.5     | 24,255      | 728.7     | 26,800      |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 419       | 578         | 496       | 612         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| CHAMPION REIT                         | 366       | 965         | 527       | 1,230       |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 71        | 127         | 77        | 146         |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 277       | 1,382       | 364       | 1,680       |
| (-)                                   | (-)       | (-)         | (-)       | (-)         |

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

|   | 買付        |              | 売付        |              |
|---|-----------|--------------|-----------|--------------|
|   | 口数        | 金額           | 口数        | 金額           |
| 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                       | 348.222   | 420          | 328.964   | 382          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST           | 13.547    | 32           | 223.11    | 450          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| GOODMAN PROPERTY TRUST                    | 202.439   | 431          | 246.973   | 520          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD                   | 315.744   | 267          | 384.422   | 321          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| ARGOSY PROPERTY LTD                       | 189.174   | 211          | 200.554   | 220          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| STRIDE STAPLED GROUP                      | 30.039    | 41           | 263.389   | 331          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| 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                       | 270.474   | 895          | 307.817   | 1,018        |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| DERWENT LONDON PLC                        | 35.117    | 700          | 39.543    | 764          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| BIG YELLOW GROUP PLC                      | 56.282    | 598          | 55.829    | 551          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| HAMMERSOHN PLC                            | 1,244.694 | 312          | 1,539.073 | 383          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| LAND SECURITIES GROUP PLC                 | 220.397   | 1,342        | 255.575   | 1,536        |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| WORKSPACE GROUP PLC                       | 31.106    | 155          | 35.891    | 177          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| UNITE GROUP PLC                           | 144.545   | 1,345        | 162.453   | 1,483        |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC             | 233.58    | 215          | 298.954   | 274          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| SEGRO PLC                                 | 421.322   | 3,294        | 431.267   | 3,288        |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC                | 135.122   | 556          | 85.135    | 334          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| ASSURA PLC                                | 691.22    | 294          | 800.762   | 337          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI            | -         | -            | 50.234    | 27           |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD | -         | -            | 52.789    | 21           |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| HELICAL PLC                               | -         | -            | 5.963     | 13           |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD                | 170.84    | 113          | 185.846   | 120          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD           | 160.763   | 88           | 201.78    | 109          |
| (△354.973)                                | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD                    | 43.415    | 325          | 51.935    | 373          |
| (-)                                       | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC                 | 376.435   | 696          | 396.622   | 709          |
| (401.903)                                 | (-)       | (-)          | (-)       | (-)          |

|  | 買付                    |             | 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   |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 182.131<br>(-)        | 122<br>(-)  | 243.237<br>(-) | 165<br>(-)  |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC                | 549.049<br>(-)        | 655<br>(-)  | 635.277<br>(-) | 748<br>(-)  |
| WAREHOUSE REIT PLC                     | 58.167<br>(-)         | 48<br>(-)   | 60.241<br>(-)  | 48<br>(-)   |
| NEWRIVER REIT PLC                      | 30.491<br>(-)         | 26<br>(-)   | 64.763<br>(-)  | 49<br>(-)   |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC             | -<br>(-)              | -<br>(-)    | 293.773<br>(-) | 233<br>(-)  |
| PRS REIT PLC/THE                       | 141.145<br>(-)        | 109<br>(-)  | 180.137<br>(-) | 135<br>(-)  |
| CLS HOLDINGS PLC                       | -<br>(-)              | -<br>(-)    | 38.026<br>(-)  | 45<br>(-)   |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC   | 178.71<br>(-)         | 107<br>(-)  | 214.964<br>(-) | 121<br>(-)  |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC            | 325.039<br>(-)        | 246<br>(-)  | 381.621<br>(-) | 291<br>(-)  |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC                | 582.838<br>(157.608)  | 831<br>(-)  | 662.654<br>(-) | 941<br>(-)  |
| CUSTODIAN REIT PLC                     | 101.126<br>(-)        | 83<br>(-)   | 104.931<br>(-) | 86<br>(-)   |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC             | 436.589<br>(-)        | 342<br>(-)  | 183.813<br>(-) | 141<br>(-)  |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC           | 131.486<br>(-)        | 114<br>(-)  | 175.194<br>(-) | 155<br>(-)  |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC     | -<br>(-)              | -<br>(-)    | 103.977<br>(-) | 71<br>(-)   |
| LIFE SCIENCE REIT PLC                  | 201.363<br>(-)        | 143<br>(-)  | 53.766<br>(-)  | 34<br>(-)   |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC-RTS         | (96.861)<br>-         | (-)<br>-    | 96.861<br>(-)  | 102<br>(-)  |
| AEW UK REIT PLC                        | 33.925<br>(-)         | 29<br>(-)   | 62.221<br>(-)  | 52<br>(-)   |
| LXI REIT PLC                           | 366.301<br>(△730.734) | 331<br>(-)  | 403.027<br>(-) | 356<br>(-)  |
| REGIONAL REIT LTD                      | 56.067<br>(-)         | 24<br>(-)   | -<br>(-)       | -<br>(-)    |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC               | 98.957<br>(-)         | 111<br>(-)  | 130.393<br>(-) | 141<br>(-)  |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC             | 100.219<br>(-)        | 84<br>(-)   | 115.933<br>(-) | 93<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                             | 37.888<br>(-)         | 555<br>(-)  | 44.537<br>(-)  | 652<br>(-)  |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD          | 57.219<br>(-)         | 422<br>(-)  | 65.119<br>(-)  | 479<br>(-)  |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD              | 39.089<br>(-)         | 68<br>(-)   | 59.731<br>(-)  | 103<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        |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT | 10,475<br>(-) | 42,625<br>(-)      | 49,828<br>(-) | 194,286<br>(-) |
| E KOCREF CR-REIT CO LTD                                | -<br>(-)      | -<br>(-)           | 11,135<br>(-) | 54,863<br>(-)  |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD                              | 21,366<br>(-) | 131,851<br>(-)     | 24<br>(-)     | 151,899<br>(-) |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD                            | 5,697<br>(-)  | 26,264<br>(55)     | 24,051<br>(-) | 100,182<br>(-) |
| LOTTE REIT CO LTD                                      | 43,393<br>(-) | 133,723<br>(-)     | 51,072<br>(-) | 159,436<br>(-) |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT                                | 10,885<br>(-) | 58,631<br>(-)      | 8,873<br>(-)  | 45,653<br>(-)  |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD                          | -<br>(-)      | -<br>(-)           | 9,851<br>(-)  | 31,664<br>(-)  |
| JR REIT XXVII  | 44,308<br>(-) | 179,948<br>(-)     | 45,023<br>(-) | 182,075<br>(-) |
| SK REITS CO LTD  | 16,994<br>(-) | 74,021<br>(△3,172) | -<br>(-)      | -<br>(-)       |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD                         | 29,522<br>(-) | 109,361<br>(△159)  | 39,496<br>(-) | 147,731<br>(-) |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD                               | 17,128<br>(-) | 55,171<br>(△24)    | 19,888<br>(-) | 64,614<br>(-)  |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD                                 | 9,562<br>(-)  | 34,844<br>(△544)   | 8,876<br>(-)  | 30,237<br>(-)  |
| SK REITS CO LTD-RTS                                    | -<br>(11.9)   | -<br>(△16)         | 11.9<br>(-)   | 77<br>(-)      |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD-RTS                        | -<br>(7,341)  | -<br>(△55)         | 7,341<br>(-)  | 796<br>(-)     |
| ユーロ（ガーンジイ）   | 千口            | 千ユーロ               | 千口            | 千ユーロ           |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD                              | 14.26<br>(-)  | 568<br>(-)         | 1.676<br>(-)  | 71<br>(-)      |
| ユーロ（シンガポール）  | 千口            | 千ユーロ               | 千口            | 千ユーロ           |
| CROMWELL REIT EUR                                      | 95.4<br>(-)   | 127<br>(△16)       | 128.2<br>(-)  | 163<br>(-)     |
| 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                  | 60,918<br>(-) | 58<br>(-)          | 83,346<br>(-) | 78<br>(-)      |
| ユーロ（オランダ）  | 千口            | 千ユーロ               | 千口            | 千ユーロ           |
| VASTNED RETAIL   | 3,282<br>(-)  | 65<br>(-)          | 3,903<br>(-)  | 75<br>(-)      |
| WERELDHAVE NV  | 8.41<br>(-)   | 124<br>(-)         | 12.56<br>(-)  | 175<br>(-)     |
| NSI NV   | 2,777<br>(-)  | 48<br>(-)          | 3,792<br>(-)  | 65<br>(-)      |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV                           | 10,687<br>(-) | 225<br>(-)         | 12,016<br>(-) | 244<br>(-)     |
| ユーロ（ベルギー）  | 千口            | 千ユーロ               | 千口            | 千ユーロ           |
| COFINIMMO SA   | 10,952<br>(-) | 703<br>(-)         | 9,881<br>(-)  | 603<br>(-)     |

|                                  | 買付     |            | 売付     |       |
|----------------------------------|--------|------------|--------|-------|
|                                  | 口数     | 金額         | 口数     | 金額    |
| ユーロ (ベルギー)                       | 千口     | 千ユーロ       | 千口     | 千ユーロ  |
| RETAIL ESTATES                   | 4.347  | 252        | 4.62   | 266   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES     | 3.366  | 60         | 15.979 | 330   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| WAREHOUSES DE PAUW               | 54.907 | 1,367      | 53.483 | 1,278 |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| MONTEA SCA                       | 5.641  | 396        | 4.493  | 312   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| AEDIFICA                         | 17.307 | 963        | 15.759 | 838   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| CARE PROPERTY INVEST NV          | 4.423  | 53         | 5.343  | 62    |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| AEDIFICA SA-RTS                  | -      | -          | 17.659 | 7     |
| (17.659)                         | (△7)   | (-)        | (-)    | (-)   |
| XIOR STUDENT HOUSING NV          | 13.195 | 360        | 9.442  | 256   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| ユーロ (フランス)                       | 千口     | 千ユーロ       | 千口     | 千ユーロ  |
| GECINA SA                        | 16.193 | 1,555      | 19.88  | 1,884 |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| ICADE                            | 5.38   | 172        | 7.293  | 220   |
| (-)                              | (-)    | (△24)      | (-)    | (-)   |
| ALTAREA                          | 1.572  | 123        | 1.761  | 137   |
| (-)                              | (-)    | (△0.33328) | (-)    | (-)   |
| KLEPIERRE                        | 54.725 | 1,290      | 62.745 | 1,440 |
| (-)                              | (-)    | (△74)      | (-)    | (-)   |
| COVIVIO                          | 13.935 | 594        | 14.422 | 596   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| MERCIALYS                        | 27.097 | 222        | 25.38  | 209   |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| CARMILA SA                       | 11.681 | 165        | 15.53  | 218   |
| (-)                              | (-)    | (△20)      | (-)    | (-)   |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD        | 27.41  | 1,428      | 34.451 | 1,773 |
| (-)                              | (-)    | (△100)     | (-)    | (-)   |
| ユーロ (ドイツ)                        | 千口     | 千ユーロ       | 千口     | 千ユーロ  |
| HAMBORNER REIT AG                | 11.372 | 72         | 15.044 | 94    |
| (-)                              | (-)    | (△12)      | (-)    | (-)   |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG           | -      | -          | 3.939  | 15    |
| (-)                              | (-)    | (-)        | (-)    | (-)   |
| ユーロ (スペイン)                       | 千口     | 千ユーロ       | 千口     | 千ユーロ  |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA  | 66.154 | 362        | 84.623 | 456   |
| (-)                              | (-)    | (△7)       | (-)    | (-)   |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 11.497 | 66         | 18.351 | 104   |
| (-)                              | (-)    | (△1)       | (-)    | (-)   |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA      | 81.925 | 694        | 96.047 | 794   |
| (-)                              | (-)    | (△30)      | (-)    | (-)   |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別            | 買 建          |              | 売 建      |          |
|----------------|--------------|--------------|----------|----------|
|                | 新規買付額        | 決済額          | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国 不動産投信指数先物取引 | 百万円<br>1,922 | 百万円<br>1,032 | 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 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)**

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘<br>柄                           | 期<br>首(前期末)<br>口<br>数 | 当<br>期  |                       |                            |     | 末<br>比<br>率 |
|----------------------------------|-----------------------|---------|-----------------------|----------------------------|-----|-------------|
|                                  |                       | 口<br>数  | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |     |             |
| 不動産ファンド<br>(アメリカ)                | 千口                    | 千口      | 千アメリカ・ドル              |                            | 千円  | %           |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT       | 391.9                 | 291.8   | 39                    | 6,344                      | 0.0 |             |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST          | 72.7                  | 72.7    | 0                     | 0                          | 0.0 |             |
| PRIME US REIT                    | 317.6                 | 349.36  | 40                    | 6,423                      | 0.0 |             |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE | 144.6                 | 299.8   | 178                   | 28,519                     | 0.0 |             |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME | 839                   | 839     | 55                    | 8,853                      | 0.0 |             |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT     | 70,549                | 63,579  | 7,410                 | 1,184,833                  | 1.3 |             |
| ALEXANDER'S INC.                 | 1.021                 | 0.86    | 188                   | 30,159                     | 0.0 |             |
| BOSTON PROPERTIES INC            | 63,691                | 58,553  | 3,601                 | 575,729                    | 0.7 |             |
| OMEGA HEALTHCARE INV'S INC       | 104,551               | 99,906  | 3,298                 | 527,427                    | 0.6 |             |
| APARTMENT INV'T & MGMT CO-A      | 65,982                | 53,077  | 423                   | 67,633                     | 0.1 |             |
| AGREE REALTY CORP                | 41,761                | 40,554  | 2,494                 | 398,752                    | 0.5 |             |
| BRT APARTMENTS CORP              | 6,159                 | 5,643   | 101                   | 16,158                     | 0.0 |             |
| SL GREEN                         | 28,057                | 26,178  | 1,444                 | 230,988                    | 0.3 |             |
| EPR PROPERTIES                   | 33,842                | 30,568  | 1,247                 | 199,447                    | 0.2 |             |
| PROLOGIS INC                     | 414,926               | 373,989 | 40,914                | 6,541,393                  | 7.4 |             |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC        | 63,859                | 57,357  | 11,694                | 1,869,719                  | 2.1 |             |
| LXP INDUSTRIAL TRUST             | 131,103               | 118,308 | 1,050                 | 167,965                    | 0.2 |             |
| CAMDEN PROPERTY TRUST            | 47,839                | 43,034  | 4,720                 | 754,766                    | 0.9 |             |
| VERIS RESIDENTIAL INC            | 35,212                | 33,67   | 487                   | 77,948                     | 0.1 |             |
| EQUINIX INC                      | 42,028                | 38,337  | 29,327                | 4,688,929                  | 5.3 |             |
| NNN REIT INC                     | 82,288                | 74,063  | 3,126                 | 499,935                    | 0.6 |             |
| CTO REALTY GROWTH INC            | 9,356                 | 7,42    | 126                   | 20,285                     | 0.0 |             |
| COUSINS PROPERTIES INC           | 68,071                | 61,428  | 1,420                 | 227,162                    | 0.3 |             |
| URSTADT BIDDLE PROPERTIES        | 14,046                | —       | —                     | —                          | —   |             |
| SITE CENTERS CORP                | 81,813                | 72,757  | 1,043                 | 166,808                    | 0.2 |             |
| SAFEHOLD INC                     | 17,782                | 17,116  | 324                   | 51,856                     | 0.1 |             |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST        | 11,922                | 11,922  | 9                     | 1,562                      | 0.0 |             |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC         | 28,759                | 25,937  | 7,216                 | 1,153,724                  | 1.3 |             |
| EQUITY RESIDENTIAL               | 152,806               | 139,306 | 9,515                 | 1,521,416                  | 1.7 |             |
| FEDERAL REALTY INV'S TRUST       | 33,218                | 30,104  | 3,017                 | 482,506                    | 0.5 |             |
| FIRST INDUSTRIAL RT              | 58,984                | 53,458  | 2,526                 | 404,010                    | 0.5 |             |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC        | 244,412               | 284,288 | 5,469                 | 874,495                    | 1.0 |             |
| EQUITY COMMONWEALTH              | 49,039                | 43,229  | 837                   | 133,943                    | 0.2 |             |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC         | 48,223                | 42,731  | 1,109                 | 177,354                    | 0.2 |             |
| SERVICE PROPERTIES TRUST         | 76,925                | 69,695  | 353                   | 56,494                     | 0.1 |             |
| WELLTOWER INC                    | 223,439               | 241,529 | 24,713                | 3,951,153                  | 4.5 |             |
| EAST GROUP                       | 20,032                | 19,335  | 3,231                 | 516,614                    | 0.6 |             |
| KIMCO REALTY                     | 277,027               | 270,439 | 5,132                 | 820,653                    | 0.9 |             |
| KILROY REALTY CORP               | 47,193                | 43,143  | 1,362                 | 217,829                    | 0.2 |             |
| LTC PROPERTIES INC               | 18.9                  | 17,329  | 587                   | 93,922                     | 0.1 |             |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST     | 101,192               | 89,231  | 233                   | 37,377                     | 0.0 |             |

| 銘<br>柄                           | 期<br>首(前期末) | 当<br>期  |          |           |             |                            | 末<br>率 |
|----------------------------------|-------------|---------|----------|-----------|-------------|----------------------------|--------|
|                                  |             | 口<br>数  | 口<br>数   | 外<br>貨    | 建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |        |
| (アメリカ)                           | 千口          | 千口      | 千アメリカ・ドル |           | 千円          | %                          |        |
| BRANDYWINE REALTY TRUST          | 81,948      | 65,638  | 297      | 47,643    | 0.1         |                            |        |
| IRON MOUNTAIN INC                | 131,248     | 118,409 | 10,521   | 1,682,229 | 1.9         |                            |        |
| THE MACERICH COMPANY             | 95,956      | 87,151  | 1,278    | 204,407   | 0.2         |                            |        |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES      | 78,222      | 75,334  | 4,846    | 774,936   | 0.9         |                            |        |
| ACADIA REALTY TRUST              | 44,351      | 42,601  | 739      | 118,171   | 0.1         |                            |        |
| HOST HOTELS & RESORTS INC        | 318,701     | 284,799 | 5,220    | 834,632   | 0.9         |                            |        |
| MID AMERICA                      | 52,249      | 47,191  | 6,652    | 1,063,528 | 1.2         |                            |        |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST         | 13,525      | —       | —        | —         | —           |                            |        |
| NATIONAL HEALTH INVS INC         | 19,429      | 17,553  | 1,171    | 187,325   | 0.2         |                            |        |
| CENTERSPACE                      | 6,622       | 6,258   | 419      | 67,125    | 0.1         |                            |        |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC       | 8,132       | 5,83    | 138      | 22,183    | 0.0         |                            |        |
| GETTY REALTY CORP                | 20,182      | 19,838  | 524      | 83,796    | 0.1         |                            |        |
| RPT REALTY                       | 40,594      | —       | —        | —         | —           |                            |        |
| REALTY INCOME CORP               | 302,637     | 351,747 | 18,695   | 2,989,013 | 3.4         |                            |        |
| REGENCY CENTERS CORP             | 68,717      | 66,651  | 4,141    | 662,173   | 0.8         |                            |        |
| UDR INC                          | 138,65      | 122,38  | 4,983    | 796,732   | 0.9         |                            |        |
| COPT DEFENCE PROPERTIES          | 50,428      | 46,331  | 1,141    | 182,444   | 0.2         |                            |        |
| SAUL CENTERS INC                 | 5,447       | 4,875   | 176      | 28,261    | 0.0         |                            |        |
| SIMON PROPERTY GROUP INC         | 147,007     | 131,66  | 19,243   | 3,076,638 | 3.5         |                            |        |
| LIFE STORAGE INC                 | 38,018      | —       | —        | —         | —           |                            |        |
| PUBLIC STORAGE                   | 71,125      | 63,885  | 18,593   | 2,972,765 | 3.4         |                            |        |
| SUN COMMUNITIES INC              | 55,989      | 50,345  | 5,916    | 945,937   | 1.1         |                            |        |
| TANGER INC                       | 46,487      | 44,528  | 1,182    | 189,013   | 0.2         |                            |        |
| UMH PROPERTIES INC               | 26,109      | 26,733  | 414      | 66,290    | 0.1         |                            |        |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP        | 16,72       | 15,124  | 209      | 33,562    | 0.0         |                            |        |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME     | 6,151       | 4,814   | 185      | 29,678    | 0.0         |                            |        |
| VENTAS INC                       | 179,26      | 163,523 | 8,244    | 1,318,183 | 1.5         |                            |        |
| VORNADO REALTY TRUST             | 71,874      | 64,543  | 1,665    | 266,336   | 0.3         |                            |        |
| ELME COMMUNITIES                 | 40,732      | 36,795  | 555      | 88,771    | 0.1         |                            |        |
| KITE REALTY GROUP TRUST          | 99,789      | 88,708  | 1,944    | 310,883   | 0.4         |                            |        |
| EXTRA SPACE STORAGE INC          | 60,583      | 85,525  | 13,592   | 2,173,167 | 2.5         |                            |        |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C     | 53,55       | 46,375  | 74       | 11,863    | 0.0         |                            |        |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC     | 94,114      | 82,956  | 840      | 134,354   | 0.2         |                            |        |
| CUBESMART                        | 100,353     | 91,225  | 4,130    | 660,411   | 0.8         |                            |        |
| DIGITAL REALTY TRUST INC         | 131,006     | 131,081 | 19,445   | 3,109,005 | 3.5         |                            |        |
| DIAMONDRock HOSPITALITY CO       | 91,448      | 85,756  | 715      | 114,346   | 0.1         |                            |        |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST         | 266,517     | 242,489 | 1,163    | 186,091   | 0.2         |                            |        |
| DOUGLAS EMMETT INC               | 76,09       | 67,612  | 905      | 144,743   | 0.2         |                            |        |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C | 55,617      | 52,599  | 643      | 102,932   | 0.1         |                            |        |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 58,595      | 52,568  | 378      | 60,512    | 0.1         |                            |        |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC      | 50,883      | 41,424  | 241      | 38,677    | 0.0         |                            |        |
| TERRENO REALTY CORP              | 32,893      | 39,063  | 2,264    | 361,982   | 0.4         |                            |        |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC        | 23,022      | 19,557  | 421      | 67,319    | 0.1         |                            |        |
| RLJ LODGING TRUST                | 70,804      | 62,698  | 601      | 96,231    | 0.1         |                            |        |
| AMERICOLD REALTY TRUST           | 121,186     | 107,852 | 2,734    | 437,119   | 0.5         |                            |        |

| 銘柄                               | 期首(前期末) | 当期      |          |           |        | 末比率 |
|----------------------------------|---------|---------|----------|-----------|--------|-----|
|                                  |         | 口数      | 口数       | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |     |
| (アメリカ)                           | 千口      | 千口      | 千アメリカ・ドル | 千円        | %      |     |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST          | 55.166  | 48.508  | 672      | 107,568   | 0.1    |     |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST   | 23.664  | 23.664  | 53       | 8,550     | 0.0    |     |
| CHATHAM LODGING TRUST            | 22.868  | 19.711  | 162      | 26,030    | 0.0    |     |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC       | 103.588 | 93.511  | 1,369    | 218,875   | 0.2    |     |
| WHITESTONE REIT                  | 19.598  | 18.939  | 251      | 40,150    | 0.0    |     |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC    | 61.059  | 52.743  | 257      | 41,235    | 0.0    |     |
| STAG INDUSTRIAL INC              | 79.986  | 73.55   | 2,608    | 416,980   | 0.5    |     |
| WP CAREY INC                     | 96.284  | 88.393  | 4,872    | 778,970   | 0.9    |     |
| ALEXANDER & BALDWIN INC          | 33.832  | 30.467  | 499      | 79,788    | 0.1    |     |
| GLADSTONE LAND CORP              | 15.596  | 13.328  | 175      | 28,085    | 0.0    |     |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC      | 169.898 | 152.91  | 2,454    | 392,378   | 0.4    |     |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES     | 25.104  | 24.192  | 2,410    | 385,311   | 0.4    |     |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC    | 29.672  | 25.65   | 281      | 45,028    | 0.1    |     |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC        | 63.531  | —       | —        | —         | —      |     |
| PHYSICIANS REALTY TRUST          | 106.824 | —       | —        | —         | —      |     |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC    | 90.045  | 87.811  | 3,909    | 625,026   | 0.7    |     |
| AMERICAN HOMES 4 RENT            | 140.789 | 129.991 | 4,725    | 755,460   | 0.9    |     |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC    | 101.147 | 90.754  | 1,642    | 262,626   | 0.3    |     |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES | 12.848  | 11.565  | 1,245    | 199,194   | 0.2    |     |
| JBG SMITH PROPERTIES             | 43.096  | 34.53   | 506      | 80,988    | 0.1    |     |
| THE NECESSITY RETAIL REIT INC    | 63.796  | —       | —        | —         | —      |     |
| INVITATION HOMES INC             | 260.485 | 232.585 | 8,238    | 1,317,117 | 1.5    |     |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC    | 62.501  | 51.841  | 471      | 75,341    | 0.1    |     |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC     | 17.079  | 15.197  | 320      | 51,315    | 0.1    |     |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS | 66.693  | 70.815  | 1,901    | 303,993   | 0.3    |     |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES  | 26.881  | 26.881  | 92       | 14,741    | 0.0    |     |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN | 118.272 | 109.672 | 4,866    | 777,999   | 0.9    |     |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC       | 136.117 | 121.708 | 2,744    | 438,793   | 0.5    |     |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC     | 22.683  | 22.683  | 62       | 9,936     | 0.0    |     |
| POSTAL REALTY TRUST INC          | 7.309   | 7.238   | 95       | 15,228    | 0.0    |     |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 6.752   | 4.384   | 67       | 10,759    | 0.0    |     |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP       | 29.365  | 28.156  | 690      | 110,468   | 0.1    |     |
| FARMLAND PARTNERS INC            | 23.717  | 16.653  | 192      | 30,831    | 0.0    |     |
| CITY OFFICE REIT INC             | 17.231  | 17.231  | 86       | 13,774    | 0.0    |     |
| ORION OFFICE REIT INC            | 28.112  | 20.368  | 69       | 11,104    | 0.0    |     |
| NETSTREIT CORP                   | 28.118  | 28.72   | 485      | 77,600    | 0.1    |     |
| CARETRUST REIT INC               | 44.457  | 57.387  | 1,428    | 228,458   | 0.3    |     |
| PEAKSTONE REALTY TRUST           | —       | 13.637  | 148      | 23,699    | 0.0    |     |
| INDUS REALTY TRUST INC           | 2.103   | —       | —        | —         | —      |     |
| PHILLIPS EDISON & CO INC         | 52.693  | 49.443  | 1,603    | 256,436   | 0.3    |     |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC         | 1.188   | —       | —        | —         | —      |     |
| APARTMENT INCOME REIT CORP       | 67.666  | 58.614  | 2,285    | 365,383   | 0.4    |     |
| BROADSTONE NET LEASE INC         | 83.884  | 75.796  | 1,192    | 190,620   | 0.2    |     |
| STAR HOLDINGS                    | 5.322   | —       | —        | —         | —      |     |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC  | 11.835  | 10.705  | 239      | 38,269    | 0.0    |     |

| 銘柄                               | 期首(前期末)           | 当期                         |                            |           |            | 末    |
|----------------------------------|-------------------|----------------------------|----------------------------|-----------|------------|------|
|                                  |                   | 口数                         | 口数                         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |      |
| (アメリカ)                           | 千口                | 千口                         | 千アメリカ・ドル                   |           | 千円         | %    |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC     | —                 | 26,412                     | 394                        | 63,045    | 0.1        |      |
| NET LEASE OFFICE PROPERTIES      | —                 | 5,763                      | 138                        | 22,177    | 0.0        |      |
| PARAMOUNT GROUP INC              | 78,702            | 63,997                     | 287                        | 45,940    | 0.1        |      |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC          | 26,422            | 26,662                     | 234                        | 37,554    | 0.0        |      |
| URBAN EDGE PROPERTIES            | 52,509            | 47,399                     | 856                        | 136,937   | 0.2        |      |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I | 42,482            | 40,047                     | 487                        | 77,921    | 0.1        |      |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC       | 49,736            | 41,188                     | 586                        | 93,838    | 0.1        |      |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING I | —                 | 99,47                      | 284                        | 45,483    | 0.1        |      |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC   | 10,016            | 9,712                      | 361                        | 57,840    | 0.1        |      |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS | 36,394            | 28,153                     | 1,189                      | 190,171   | 0.2        |      |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC   | 10,321            | 9,794                      | 226                        | 36,249    | 0.0        |      |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC       | 95,647            | 91,043                     | 1,328                      | 212,371   | 0.2        |      |
| GLOBAL NET LEASE INC             | 48,468            | 77,69                      | 553                        | 88,438    | 0.1        |      |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE | 14,638            | 15,267                     | 74                         | 11,862    | 0.0        |      |
| CLIPPER REALTY INC               | 5,086             | 5,086                      | 18                         | 2,894     | 0.0        |      |
| PARK HOTELS & RESORTS INC        | 96,622            | 85,07                      | 1,260                      | 201,566   | 0.2        |      |
| VICI PROPERTIES INC              | 451,537           | 421,682                    | 11,849                     | 1,894,460 | 2.2        |      |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC  | 39,634            | 37,579                     | 921                        | 147,379   | 0.2        |      |
| 小計                               | 口数<br>銘柄<br>数<比率> | 11,681,835<br>145銘柄<77.0%> | 10,964,702<br>139銘柄<77.1%> | 423,772   | 67,752,784 | —    |
|                                  |                   |                            |                            | —         | —          | 77.1 |
| (カナダ)                            | 千口                | 千口                         | 千カナダ・ドル                    | 千円        | %          |      |
| SMARTCENTRES REIT                | 31,367            | 28,245                     | 608                        | 71,084    | 0.1        |      |
| CANADIAN APT PPTYS REIT          | 37,034            | 33,079                     | 1,424                      | 166,306   | 0.2        |      |
| H & R REAL ESTATE INVESTMENT     | 58,204            | 52,945                     | 457                        | 53,459    | 0.1        |      |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST | 46,831            | 41,415                     | 599                        | 69,953    | 0.1        |      |
| RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST  | 66,005            | 59,372                     | 972                        | 113,521   | 0.1        |      |
| ALLIED PROPERTIES REIT           | 28,626            | 25,873                     | 396                        | 46,329    | 0.1        |      |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU | 8,533             | 2,585                      | 47                         | 5,552     | 0.0        |      |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST     | 9,738             | 9,777                      | 670                        | 78,211    | 0.1        |      |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU | 24,568            | 21,895                     | 140                        | 16,382    | 0.0        |      |
| CROMBIE REAL ESTATE INV          | 24,648            | 21,726                     | 267                        | 31,193    | 0.0        |      |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST     | 32,303            | 27,652                     | 326                        | 38,088    | 0.0        |      |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES  | 55,673            | 51,343                     | 238                        | 27,868    | 0.0        |      |
| MORGARD NORTH AMERICAN RESIDENT  | 8,705             | 6,485                      | 95                         | 11,203    | 0.0        |      |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT  | 4,643             | —                          | —                          | —         | —          |      |
| DREAM INDUSTRIAL REIT            | 56,937            | 53,218                     | 654                        | 76,409    | 0.1        |      |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 15,423            | 15,423                     | 48                         | 5,635     | 0.0        |      |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T | 13,984            | 12,342                     | 816                        | 95,272    | 0.1        |      |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT       | 21,434            | 3,727                      | 30                         | 3,606     | 0.0        |      |
| CHOICE PROPERTIES REIT           | 72,055            | 64,451                     | 804                        | 93,891    | 0.1        |      |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE | 9,341             | 7,386                      | 107                        | 12,553    | 0.0        |      |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 25,088            | 22,105                     | 284                        | 33,234    | 0.0        |      |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE | 17,876            | —                          | —                          | —         | —          |      |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 15,769            | 9,891                      | 45                         | 5,345     | 0.0        |      |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 8,104             | 8,104                      | 125                        | 14,624    | 0.0        |      |

| 銘柄                               |                    | 期首(前期末)    | 当期末        |             |           |     |
|----------------------------------|--------------------|------------|------------|-------------|-----------|-----|
|                                  |                    | 口数         | 口数         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    | 比率  |
| (カナダ)                            |                    | 千口         | 千口         | 千カナダ・ドル     | 千円        | %   |
| SLATE GROCERY REIT               |                    | 12,066     | 12,169     | 133         | 15,540    | 0.0 |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT            |                    | 14,455     | 14,455     | 95          | 11,136    | 0.0 |
| PRIMARIS REIT                    |                    | 21,998     | 20,442     | 268         | 31,306    | 0.0 |
| SLATE OFFICE REIT                |                    | 17,818     | —          | —           | —         | —   |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT |                    | 8,337      | —          | —           | —         | —   |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV |                    | 24,983     | 23,694     | 396         | 46,271    | 0.1 |
| 小計                               | 口数 : 金額<br>銘柄数<比率> | 792,546    | 649,799    | 10,057      | 1,173,982 | —   |
|                                  | 30銘柄<1.7%>         |            | 26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        | %   |
| BVP TRUST                        |                    | 209,056    | 222,212    | 806         | 85,631    | 0.1 |
| MIRVAC GROUP                     |                    | 1,776,143  | 1,620,072  | 3,175       | 337,094   | 0.4 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP          |                    | 632,521    | 520,52     | 216         | 22,932    | 0.0 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT         |                    | 230,204    | 204,746    | 685         | 72,815    | 0.1 |
| GPT GROUP                        |                    | 853,243    | 774,713    | 3,191       | 338,843   | 0.4 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP           |                    | 302,227    | 341,038    | 601         | 63,901    | 0.1 |
| ABACUS GROUP                     |                    | 195,539    | 168,642    | 198         | 21,125    | 0.0 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU |                    | 160,446    | 137,586    | 335         | 35,638    | 0.0 |
| STOCKLAND                        |                    | 1,071,893  | 964,954    | 4,284       | 454,831   | 0.5 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP        |                    | 162,299    | 157,084    | 761         | 80,878    | 0.1 |
| DEXUS                            |                    | 479,312    | 441,787    | 2,893       | 307,195   | 0.3 |
| GOODMAN GROUP                    |                    | 769,687    | 704,819    | 25,288      | 2,684,670 | 3.1 |
| VICINITY CENTRES                 |                    | 1,758,932  | 1,588,997  | 2,995       | 317,976   | 0.4 |
| CHARTER HALL GROUP               |                    | 212,89     | 194,616    | 2,382       | 252,883   | 0.3 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA |                    | 126,146    | 101,9      | 241         | 25,637    | 0.0 |
| REGION RE LTD                    |                    | 515,147    | 466,538    | 1,045       | 110,941   | 0.1 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT         |                    | 240,142    | 213,14     | 667         | 70,822    | 0.1 |
| ARENA REIT                       |                    | 165,205    | 147,24     | 584         | 62,055    | 0.1 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT      |                    | 299,469    | 265,944    | 922         | 97,967    | 0.1 |
| DEXUS INDUSTRIA REIT             |                    | 91,184     | 93,159     | 281         | 29,867    | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT            |                    | 538,807    | 509,415    | 1,186       | 126,005   | 0.1 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD   |                    | 85,857     | 85,857     | 297         | 31,627    | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP               |                    | 222,442    | 222,442    | 133         | 14,168    | 0.0 |
| RURAL FUNDS GROUP                |                    | 173,97     | 148,357    | 307         | 32,601    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                    |                    | 2,339,436  | 2,106,223  | 6,718       | 713,273   | 0.8 |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY  |                    | 140,343    | —          | —           | —         | —   |
| HMC CAPITAL LTD                  |                    | 109,034    | 97,142     | 720         | 76,519    | 0.1 |
| HOMEKO DAILY NEEDS REIT          |                    | 709,912    | 745,38     | 913         | 96,933    | 0.1 |
| HEALTHCO REIT                    |                    | 182,619    | 202,023    | 232         | 24,663    | 0.0 |
| ABACUS STORAGE KING              |                    | —          | 224,215    | 266         | 28,325    | 0.0 |
| CENTURIA OFFICE REIT             |                    | 210,931    | 185,985    | 223         | 23,693    | 0.0 |
| WAYPOINT REIT LTD                |                    | 300,308    | 266,477    | 620         | 65,913    | 0.1 |
| 小計                               | 口数 : 金額<br>銘柄数<比率> | 15,265,344 | 14,123,223 | 63,182      | 6,707,435 | —   |
|                                  | 31銘柄<6.8%>         |            | 31銘柄<7.6%> | —           | —         | 7.6 |
| (香港)                             |                    | 千口         | 千口         | 千香港・ドル      | 千円        | %   |
| LINK REIT                        |                    | 1,145.32   | 1,047.12   | 33,350      | 683,357   | 0.8 |

| 銘柄                               |                  | 期首(前期末)    | 当期末        |              |           |     |
|----------------------------------|------------------|------------|------------|--------------|-----------|-----|
|                                  |                  | 口数         | 口数         | 外貨建金額        | 邦貨換算金額    | 比率  |
| (香港)                             |                  | 千口         | 千口         | 千香港・ドル       | 千円        | %   |
| PROSPERITY REIT                  |                  | 538        | 538        | 747          | 15,322    | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR |                  | 985        | 908        | 889          | 18,232    | 0.0 |
| CHAMPION REIT                    |                  | 896.07     | 735.07     | 1,117        | 22,893    | 0.0 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT  |                  | 445        | 439        | 768          | 15,741    | 0.0 |
| FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T |                  | 678        | 591        | 2,316        | 47,469    | 0.1 |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 4,687.39   | 4,258.19   | 39,190       | 803,017   | —   |
| (シンガポール)                         |                  | 千口         | 千口         | 千シンガポール・ドル   | 千円        | %   |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL |                  | 2,246.609  | 2,061.809  | 3,999        | 471,869   | 0.5 |
| CAPLAND ASCENDAS REIT            |                  | 1,505.56   | 1,441.46   | 3,646        | 430,224   | 0.5 |
| SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR     |                  | 1,005.29   | 898.09     | 951          | 112,304   | 0.1 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST        |                  | 1,469.02   | 1,375.42   | 1,788        | 210,935   | 0.2 |
| STARHILL GLOBAL REIT             |                  | 614.9      | 530.3      | 254          | 30,028    | 0.0 |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST          |                  | 995.816    | 997.316    | 882          | 104,123   | 0.1 |
| KEPPEL REIT                      |                  | 890.7      | 910        | 755          | 89,102    | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST        |                  | 480.7      | 472.4      | 1,006        | 118,702   | 0.1 |
| ESR LOGOS REIT                   |                  | 2,901.84   | 2,395.84   | 658          | 77,725    | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS           |                  | 394.5      | 277.2      | 266          | 31,393    | 0.0 |
| CAPITALAND CHINA TRUST           |                  | 548.48     | 449.78     | 301          | 35,550    | 0.0 |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU |                  | 538.1      | —          | —            | —         | —   |
| AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD    |                  | 228.595    | 273.095    | 344          | 40,593    | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REIT                |                  | 173.2      | 163.1      | 570          | 67,343    | 0.1 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST       |                  | 912.62     | 852.62     | 1,824        | 215,248   | 0.2 |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL    |                  | 1,038.8    | 957        | 1,167        | 137,734   | 0.2 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST       |                  | 481.4      | 464.5      | 285          | 33,700    | 0.0 |
| PARAGON REIT                     |                  | 493.8      | 487.1      | 421          | 49,705    | 0.1 |
| EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT  |                  | 112.4      | 112.4      | 15           | 1,856     | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T |                  | 259.9      | 242.3      | 159          | 18,865    | 0.0 |
| OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |                  | 1,039.155  | —          | —            | —         | —   |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT |                  | 847.2      | 716.6      | 408          | 48,186    | 0.1 |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST      |                  | 226.7      | —          | —            | —         | —   |
| KEPPEL DC REIT                   |                  | 594.4      | 537.3      | 951          | 112,191   | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T |                  | 1,304.864  | 1,178.864  | 1,131        | 133,507   | 0.2 |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,304.549 | 17,794.494 | 21,792       | 2,570,894 | —   |
|                                  |                  | 25銘柄<3.6%> | 22銘柄<2.9%> | —            | —         | 2.9 |
| (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              |                  | 610.508    | 629.766    | 714          | 69,905    | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST  |                  | 209.563    | —          | —            | —         | —   |
| GOODMAN PROPERTY TRUST           |                  | 476.422    | 431.888    | 898          | 87,856    | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD          |                  | 710.515    | 641.837    | 532          | 52,100    | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD              |                  | 376.442    | 365.062    | 376          | 36,774    | 0.0 |
| STRIDE STAPLED GROUP             |                  | 233.35     | —          | —            | —         | —   |
| 小計                               | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,616.8    | 2,068.553  | 2,521        | 246,636   | —   |
|                                  |                  | 6銘柄<0.4%>  | 4銘柄<0.3%>  | —            | —         | 0.3 |

| 銘柄                                 | 期首(前期末)   | 当期        |            |            |        |           | 末比率 |
|------------------------------------|-----------|-----------|------------|------------|--------|-----------|-----|
|                                    |           | 口数        | 口数         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |           |     |
| (イギリス)                             | 千口        | 千口        | 千円         | %          |        |           |     |
| BRITISH LAND CO PLC                | 416,926   | 379,583   | 1,567      | 316,937    | 0.4    |           |     |
| DERWENT LONDON PLC                 | 49,785    | 45,359    | 1,031      | 208,531    | 0.2    |           |     |
| BIG YELLOW GROUP PLC               | 78,821    | 79,274    | 930        | 188,154    | 0.2    |           |     |
| HAMMERSOM PLC                      | 1,850,26  | 1,555,881 | 440        | 89,018     | 0.1    |           |     |
| LAND SECURITIES GROUP PLC          | 339,433   | 304,255   | 1,903      | 384,752    | 0.4    |           |     |
| WORKSPACE GROUP PLC                | 60,495    | 55,71     | 328        | 66,338     | 0.1    |           |     |
| INTU PROPERTIES PLC                | 231,04    | 231,04    | 0          | 0          | 0.0    |           |     |
| UNITE GROUP PLC                    | 178,13    | 160,222   | 1,438      | 290,880    | 0.3    |           |     |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC      | 600,827   | 535,453   | 488        | 98,726     | 0.1    |           |     |
| SEGRO PLC                          | 550,499   | 540,554   | 4,827      | 975,904    | 1.1    |           |     |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC         | 114,09    | 164,077   | 554        | 112,119    | 0.1    |           |     |
| ASSURA PLC                         | 1,318,883 | 1,209,341 | 472        | 95,596     | 0.1    |           |     |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LTD    | 184,841   | 134,607   | 68         | 13,797     | 0.0    |           |     |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT    | 256,281   | 203,492   | 91         | 18,595     | 0.0    |           |     |
| HELICAL PLC                        | 48,089    | 42,126    | 100        | 20,269     | 0.0    |           |     |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD         | 248,473   | 233,467   | 158        | 31,954     | 0.0    |           |     |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD    | 395,99    | —         | —          | —          | —      |           |     |
| SAFESTORE HOLDINGS LTD             | 96,433    | 87,913    | 701        | 141,831    | 0.2    |           |     |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC          | 441,765   | 823,481   | 1,604      | 324,475    | 0.4    |           |     |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST | 351,056   | 289,95    | 223        | 45,136     | 0.1    |           |     |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC            | 875,198   | 788,97    | 1,090      | 220,437    | 0.3    |           |     |
| WAREHOUSE REIT PLC                 | 184,359   | 182,285   | 143        | 29,039     | 0.0    |           |     |
| NEWRIVER REIT PLC                  | 148,157   | 113,885   | 84         | 17,060     | 0.0    |           |     |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC         | 293,773   | —         | —          | —          | —      |           |     |
| PRS REIT PLC/THE                   | 249,964   | 210,972   | 162        | 32,842     | 0.0    |           |     |
| CLS HOLDINGS PLC                   | 83,611    | 45,585    | 42         | 8,607      | 0.0    |           |     |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT   | 153,569   | 117,315   | 66         | 13,519     | 0.0    |           |     |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC        | 552,98    | 496,398   | 358        | 72,557     | 0.1    |           |     |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC            | 844,097   | 921,889   | 1,415      | 286,090    | 0.3    |           |     |
| CUSTODIAN REIT PLC                 | 190,248   | 186,443   | 136        | 27,591     | 0.0    |           |     |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC         | —         | 252,776   | 203        | 41,087     | 0.0    |           |     |
| HOME REIT PLC                      | 286,621   | 286,621   | 0          | 0          | 0.0    |           |     |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC       | 288,036   | 244,328   | 229        | 46,481     | 0.1    |           |     |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO LTD | 103,977   | —         | —          | —          | —      |           |     |
| LIFE SCIENCE REIT PLC              | —         | 147,597   | 49         | 9,936      | 0.0    |           |     |
| AEW UK REIT PLC                    | 78,98     | 50,684    | 45         | 9,160      | 0.0    |           |     |
| LXI REIT PLC                       | 767,46    | —         | —          | —          | —      |           |     |
| REGIONAL REIT LTD                  | 180,491   | 236,558   | 49         | 9,995      | 0.0    |           |     |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC           | 221,68    | 190,244   | 235        | 47,692     | 0.1    |           |     |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC         | 185,316   | 169,602   | 145        | 29,453     | 0.0    |           |     |
| 小計                                 | 口数        | 金額        | 13,500,634 | 11,717,937 | 21,390 | 4,324,575 | —   |
|                                    | 銘柄        | 数<比率>     | 38銘柄<4.7%> | 36銘柄<4.9%> | —      | —         | 4.9 |
| (イスラエル)                            | 千口        | 千円        | 千円         | 千円         | %      |           |     |
| REIT 1 LTD                         | 87,414    | 80,765    | 1,102      | 46,935     | 0.1    |           |     |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD      | 92,361    | 84,461    | 554        | 23,588     | 0.0    |           |     |

| 銘柄  |                  | 期首(前期末)       | 当期            |                    |              | 期末       |
|---|------------------|---------------|---------------|--------------------|--------------|----------|
|   |                  | 口数            | 口数            | 外貨建金額              | 邦貨換算金額       | 比率       |
| (イスラエル)<br>MENIVIM- THE NEW REIT LTD                        |                  | 千口<br>314.331 | 千口<br>293.689 | 千イスラエル・シュケル<br>441 | 千円<br>18,780 | %<br>0.0 |
| 小計  | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 494.106       | 458.915       | 2,097              | 89,303       | —        |
|   |                  | 3銘柄<0.1%>     | 3銘柄<0.1%>     | —                  | —            | 0.1      |
| (韓国)  |                  | 千口            | 千口            | 千韓国・ウォン            | 千円           | %        |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE<br>E KOCREF CR-REIT CO LTD |                  | 39.353        | —             | —                  | —            | —        |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD                                   |                  | 11.135        | —             | —                  | —            | —        |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD                                 |                  | 29.807        | 27.173        | 168,200            | 19,359       | 0.0      |
| LOTTE REIT CO LTD   |                  | 18.354        | —             | —                  | —            | —        |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT                                     |                  | 55.954        | 48.275        | 162,686            | 18,725       | 0.0      |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD                               |                  | 20.53         | 22.542        | 104,031            | 11,974       | 0.0      |
| JR REIT XXVII   |                  | 9.851         | —             | —                  | —            | —        |
| SK REITS CO LTD   |                  | 66.386        | 65.671        | 273,191            | 31,444       | 0.0      |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD                              |                  | 31.791        | 48.785        | 231,728            | 26,671       | 0.0      |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD                                    |                  | 73.968        | 63.994        | 292,132            | 33,624       | 0.0      |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD                                      |                  | 26.101        | 23.341        | 78,659             | 9,053        | 0.0      |
|   |                  | 20.887        | 21.573        | 78,849             | 9,075        | 0.0      |
| 小計  | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 404.117       | 321.354       | 1,389,480          | 159,929      | —        |
|   |                  | 12銘柄<0.2%>    | 8銘柄<0.2%>     | —                  | —            | 0.2      |
| (ヨーロ…ガーンジイ)   |                  | 千口            | 千口            | 千ユーロ               | 千円           | %        |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD                                   |                  | —             | 12.584        | 482                | 82,504       | 0.1      |
| 小計  | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | —             | 12.584        | 482                | 82,504       | —        |
|   |                  | —銘柄<%>        | 1銘柄<0.1%>     | —                  | —            | 0.1      |
| (ヨーロ…シンガポール)  |                  | 千口            | 千口            | 千ユーロ               | 千円           | %        |
| CROMWELL REIT EUR   |                  | 162.64        | 129.84        | 184                | 31,520       | 0.0      |
| 小計  | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 162.64        | 129.84        | 184                | 31,520       | —        |
|   |                  | 1銘柄<0.0%>     | 1銘柄<0.0%>     | —                  | —            | 0.0      |
| (ヨーロ…アイルランド)  |                  | 千口            | 千口            | 千ユーロ               | 千円           | %        |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI                            |                  | 198.163       | 175.735       | 159                | 27,309       | 0.0      |
| 小計  | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 198.163       | 175.735       | 159                | 27,309       | —        |
|   |                  | 1銘柄<0.0%>     | 1銘柄<0.0%>     | —                  | —            | 0.0      |
| (ヨーロ…オランダ)  |                  | 千口            | 千口            | 千ユーロ               | 千円           | %        |
| VASTNED RETAIL  |                  | 7.975         | 7.354         | 173                | 29,670       | 0.0      |
| WERELDHAVE NV   |                  | 18.149        | 13.999        | 187                | 32,021       | 0.0      |
| NSI NV  |                  | 8.534         | 7.519         | 145                | 24,834       | 0.0      |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV                                |                  | 19.196        | 17.867        | 393                | 67,199       | 0.1      |
| 小計  | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 53.854        | 46.739        | 899                | 153,727      | —        |
|   |                  | 4銘柄<0.2%>     | 4銘柄<0.2%>     | —                  | —            | 0.2      |
| (ヨーロ…ベルギー)  |                  | 千口            | 千口            | 千ユーロ               | 千円           | %        |
| COFINIMMO SA  |                  | 13.78         | 14.851        | 849                | 145,226      | 0.2      |
| RETAIL ESTATES  |                  | 5.13          | 4.857         | 307                | 52,561       | 0.1      |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES                                |                  | 12.613        | —             | —                  | —            | —        |
| WAREHOUSES DE PAUW  |                  | 69.994        | 71.418        | 1,804              | 308,415      | 0.4      |
| MONTEA SCA  |                  | 6.01          | 7.158         | 563                | 96,307       | 0.1      |
| AEDIFICA  |                  | 17.659        | 19.207        | 1,098              | 187,823      | 0.2      |
| CARE PROPERTY INVEST NV                                     |                  | 16.012        | 15.092        | 197                | 33,748       | 0.0      |

| 銘柄                                    |                  | 期首(前期末)      | 当期末          |             |              |          |
|---------------------------------------|------------------|--------------|--------------|-------------|--------------|----------|
|                                       |                  | 口数           | 口数           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額       | 比率       |
| (ユーロ…ベルギー)<br>XIOR STUDENT HOUSING NV |                  | 千口<br>10,247 | 千口<br>14     | 千ユーロ<br>403 | 千円<br>68,931 | %<br>0.1 |
| 小計                                    | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 151,445      | 146,583      | 5,223       | 893,013      | —        |
| (ユーロ…フランス)                            |                  | 千口           | 千口           | 千ユーロ        | 千円           | %        |
| GECINA SA                             |                  | 24,437       | 20,75        | 1,886       | 322,460      | 0.4      |
| ICADE                                 |                  | 14,462       | 12,549       | 305         | 52,304       | 0.1      |
| ALTAREA                               |                  | 2,083        | 1,894        | 168         | 28,818       | 0.0      |
| KLEPIERRE                             |                  | 86,815       | 78,795       | 2,029       | 347,007      | 0.4      |
| COVIVIO                               |                  | 20,812       | 20,325       | 929         | 158,935      | 0.2      |
| MERCIALYS                             |                  | 35,663       | 37,38        | 397         | 67,930       | 0.1      |
| CARMILA SA                            |                  | 26,256       | 22,407       | 364         | 62,363       | 0.1      |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD             |                  | 48,183       | 41,142       | 3,023       | 516,831      | 0.6      |
| 小計                                    | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 258,711      | 235,242      | 9,105       | 1,556,652    | —        |
| (ユーロ…ドイツ)                             |                  | 千口           | 千口           | 千ユーロ        | 千円           | %        |
| HAMBORNER REIT AG                     |                  | 32,393       | 28,721       | 188         | 32,161       | 0.0      |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG                |                  | 3,939        | —            | —           | —            | —        |
| 小計                                    | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 36,332       | 28,721       | 188         | 32,161       | —        |
| (ユーロ…スペイン)                            |                  | 千口           | 千口           | 千ユーロ        | 千円           | %        |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA       |                  | 133,768      | 115,299      | 637         | 109,004      | 0.1      |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA      |                  | 26,318       | 19,464       | 134         | 22,960       | 0.0      |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA           |                  | 148,852      | 134,73       | 1,420       | 242,772      | 0.3      |
| 小計                                    | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 308,938      | 269,493      | 2,191       | 374,737      | —        |
| (ユーロ…イタリア)                            |                  | 千口           | 千口           | 千ユーロ        | 千円           | %        |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE      |                  | 20,555       | 20,555       | 35          | 6,149        | 0.0      |
| 小計                                    | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 20,555       | 20,555       | 35          | 6,149        | —        |
| 合計                                    | 口数・金額<br>銘柄数<比率> | 71,937,959   | 63,422,659   | —           | 86,986,336   | —        |
|                                       |                  | 324銘柄<99.4%> | 302銘柄<99.0%> | —           | —            | 99.0     |

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

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

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

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別                           | 当期末        |     | 期末  |          |
|----|-----------------------------|------------|-----|-----|----------|
|    |                             | 買建額        | 売建額 | 買建額 | 売建額      |
| 外国 | D J U S R E A L E S T A T E | 百万円<br>895 | —   | —   | 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

2024年6月24日現在

| 項<br>目                    | 当<br>期<br>末      |           |
|---------------------------|------------------|-----------|
|                           | 評<br>価<br>額      | 比<br>率    |
| 投 資 信 託 受 益 証 券 、 投 資 証 券 | 千円<br>86,986,336 | %<br>98.4 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他   | 1,451,023        | 1.6       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額           | 88,437,359       | 100.0     |

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、87,853,241千円、99.3%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1香港・ドル=20.49円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シェケル=42.573円、100韓国・ウォン=11.51円、1ユーロ=170.96円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

| 項                        | 目 | 当期末             |
|--------------------------|---|-----------------|
| (A) 資                    | 産 | 88,649,701,899円 |
| コ 一 ル ル · 口 一 ナ 等        |   | 300,886,231     |
| 投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)     |   | 9,407,460,726   |
| 投 資 証 券(評価額)             |   | 77,578,875,696  |
| 未 収 入 金                  |   | 636,567,111     |
| 未 収 配 当 金                |   | 289,741,082     |
| 差 入 委 託 証 拠 金            |   | 436,171,053     |
| (B) 負 債                  |   | 767,857,343     |
| 未 払 金                    |   | 754,822,343     |
| 未 解 約 金                  |   | 13,035,000      |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)     |   | 87,881,844,556  |
| 元 本                      |   | 42,455,688,196  |
| 次 期 繰 越 損 益 金            |   | 45,426,156,360  |
| (D) 受 益 権 総 口 数          |   | 42,455,688,196口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D) |   | 20,700円         |

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

(注2) 期末における元本の内訳

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

|   |                 |
|---|-----------------|
| 投資のソムリエ <DC年金>リスク抑制型                            | 474,013,891円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                              | 1,452,619,453円  |
| ワールドアセットバランス (基本コース)                            | 246,980,107円    |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)                         | 680,485,328円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)                         | 63,029,259円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)                         | 32,850,694円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)                        | 4,386,291円      |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)                         | 86,191,058円     |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                             | 1,215,386,591円  |
| 9資産分散投資・スタンダード <DC年金>                           | 156,783,516円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)                         | 38,983,095円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)                         | 35,002,071円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)                         | 22,084,482円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)                         | 5,403,231円      |
| O neグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>                  | 68,809,621円     |
| D I AMパッシブ資産分散ファンド                              | 270,424,593円    |
| D I AM国外リートインデックスファンド <DC年金>                    | 383,275,072円    |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)          | 217,802円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)          | 647,540円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)          | 125,270円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)          | 867,926円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04 (適格機関投資家限定)          | 711,941円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)          | 501,108円        |
| 予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)               | 5,202円          |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)                          | 62,054,960円     |
| AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定) | 895,492円        |
| インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)                 | 572,716円        |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (P O F S用) (適格機関投資家専用)   | 2,122,603円      |
| D I AM世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)             | 40,047,574円     |
| D I AM世界アセットバランスファンドV A V A (適格機関投資家限定)         | 101,133,689円    |
| D I AMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)     | 16,902,701円     |
| 期末元本合計  | 42,455,688,196円 |

## ■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

| 項                      | 目                | 当 期                     |  |
|------------------------|------------------|-------------------------|--|
| (A) 配 受 受 そ 支          | 当 取 取 の 他 払      | 等 配 利 収 益 金 息 益 金 息 金 息 | 3,544,474,640円<br>3,509,420,266<br>22,157,843<br>12,979,415<br>△82,884 |
| (B) 有 売 売              | 価 証 券 買 買        | 証 券 売 買 損 益 益 損         | 11,467,586,659<br>18,334,949,393<br>△6,867,362,734                     |
| (C) 先 取 取              | 物 取 引 取 引        | 取 引 等 取 引 損 益 益 損       | 4,548,586<br>5,384,758<br>△836,172                                     |
| (D) そ の 他              |                  | 費 用                     | △38,379,043  |
| (E) 当 期 損 益            |                  | 金(A + B + C + D)        | 14,978,230,842   |
| (F) 前 期 繰 越            |                  | 損 益 金                   | 33,703,055,639   |
| (G) 解 約 差 損            |                  | 益 金                     | △27,955,379,863  |
| (H) 追 加 信 記 差 損        |                  | 益 金                     | 24,700,249,742   |
| (I) 合 次 期 繰 越 損 益 金(Ⅰ) | 計(E + F + G + H) | 金(Ⅰ)                    | 45,426,156,360<br>45,426,156,360                                       |

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

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

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

## 《お知らせ》

### 約款変更のお知らせ

■先物取引等の指図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12日)

# エマージング債券パッジブ・マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2024年4月18日）  
 (計算期間 2023年4月19日～2024年4月18日)

エマージング債券パッジブ・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2008年3月6日から無期限です。   |
| 運用方針   | 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 新興国の公社債を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 外貨建資産への投資には、制限を設けません。<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。                                    |

### ■最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス<br>(円換算ベース・為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |                | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額       |
|-----------------|----------|--|----------------|--------|--------|------------|
|                 |          | 期騰落率   | 中騰落率           |        |        |            |
| 12期（2020年4月20日） | 円 19,435 | % 1.2  | ポイント 88,952.63 | % △5.0 | % 96.5 | % 一 78,076 |
| 13期（2021年4月19日） | 21,087   | 8.5  | 98,265.18      | 10.5   | 98.4   | — 152,776  |
| 14期（2022年4月18日） | 19,947   | △5.4   | 93,033.64      | △5.3   | 97.6   | — 137,292  |
| 15期（2023年4月18日） | 20,300   | 1.8  | 93,922.40      | 1.0    | 96.8   | — 136,262  |
| 16期（2024年4月18日） | 23,481   | 15.7   | 117,190.62     | 24.8   | 98.2   | — 112,310  |

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

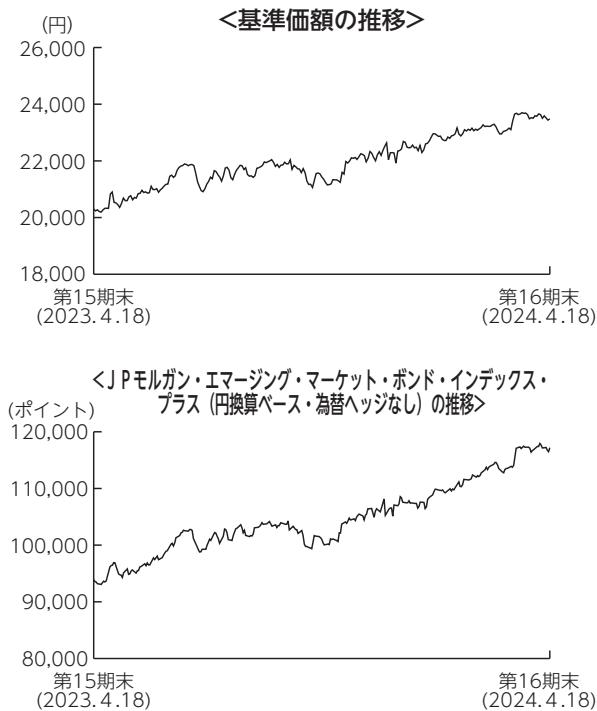
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                    | 基 準 価 額     | JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)(ベンチマーク) |                   | 債券組入比率 | 債券先物比率    |
|--------------------------|-------------|--|-------------------|--------|-----------|
|                          |             | 騰 落 率  | 騰 落 率             |        |           |
| (期 首)<br>2023 年 4 月 18 日 | 円<br>20,300 | %<br>—   | ポイント<br>93,922.40 | %<br>— | %<br>96.8 |
| 4 月 末                    | 20,326      | 0.1  | 93,661.07         | △0.3   | 98.6      |
| 5 月 末                    | 20,908      | 3.0  | 96,860.26         | 3.1    | 97.9      |
| 6 月 末                    | 21,872      | 7.7  | 102,541.84        | 9.2    | 95.9      |
| 7 月 末                    | 21,475      | 5.8  | 101,562.43        | 8.1    | 97.5      |
| 8 月 末                    | 21,963      | 8.2  | 103,973.59        | 10.7   | 97.6      |
| 9 月 末                    | 21,586      | 6.3  | 102,072.50        | 8.7    | 86.8      |
| 10 月 末                   | 21,245      | 4.7  | 100,626.42        | 7.1    | 97.7      |
| 11 月 末                   | 22,216      | 9.4  | 105,978.47        | 12.8   | 97.7      |
| 12 月 末                   | 22,482      | 10.7   | 107,454.17        | 14.4   | 96.0      |
| 2024 年 1 月 末             | 22,885      | 12.7   | 109,899.73        | 17.0   | 97.7      |
| 2 月 末                    | 23,224      | 14.4   | 113,752.19        | 21.1   | 97.7      |
| 3 月 末                    | 23,677      | 16.6   | 117,275.84        | 24.9   | 97.8      |
| (期 末)<br>2024 年 4 月 18 日 | 23,481      | 15.7   | 117,190.62        | 24.8   | 98.2      |

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年4月19日から2024年4月18日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,481円となり、前期末比で15.7%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

対米国債スプレッド（利回り格差）の縮小や米ドルが対円で上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

新興国債券市場は上昇しました。期初から2023年10月末は米金融引き締めの長期化観測などから米長期国債が下落し、それに連れて新興国債券も下落したものの、12月末にかけて米経済指標の下振れなどから早期の利下げ観測が強まり、米長期国債の上昇に連れて大きく上昇し、その後は横ばいで推移しました。対米国債スプレッドは縮小しました。米景気の軟着陸期待の高まりなどからリスク選考の改善などに伴い縮小しました。

為替市場では、米ドルは対円で上昇しました。期初から2023年10月にかけては、米国が利上げを続ける一方で日銀は緩和を続けたことにより、日米金融政策の違いが意識され、大幅に円安が進みました。その後は米国の早期利下げ観測が強まったことなどに伴い円高となる局面があったものの、日銀が2024年3月の金融政策決定会合にてマイナス金利を解除しつつも緩和的な金融環境を維持する方針を示したことで再び円安基調となりました。

## ポートフォリオについて

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

### 【運用状況】

#### ○国別構成比

#### 期首(前期末)

| 国         | ファンド     | ベンチマーク | 差            |
|-----------|----------|--------|--------------|
| 中南米       | アルゼンチン   | —      | 3.5% △3.5%   |
|           | ブラジル     | 5.1%   | 4.2% 0.8%    |
|           | チリ       | 6.4%   | 5.5% 0.9%    |
|           | メキシコ     | 9.2%   | 7.9% 1.3%    |
|           | パナマ      | 5.7%   | 4.8% 0.9%    |
|           | ペルー      | 3.8%   | 2.9% 0.9%    |
|           | ベネズエラ    | —      | 0.0% △0.0%   |
|           | エクアドル    | —      | 2.2% △2.2%   |
|           | コロンビア    | 5.9%   | 5.0% 0.9%    |
|           | ドミニカ共和国  | 5.8%   | 4.9% 1.0%    |
| 計         | ウルグアイ    | 2.6%   | 1.8% 0.7%    |
|           |          | 44.5%  | 42.8% 1.6%   |
| 欧州        | ハンガリー    | 4.6%   | 3.2% 1.4%    |
|           | トルコ      | —      | 10.0% △10.0% |
|           | ウクライナ    | —      | 0.4% △0.4%   |
|           | ルーマニア    | 2.9%   | 1.2% 1.7%    |
|           | 計        | 7.4%   | 14.8% △7.4%  |
| アジア・オセアニア | 中国       | 0.6%   | 3.4% △2.8%   |
|           | インドネシア   | 4.4%   | 3.0% 1.4%    |
|           | フィリピン    | 2.9%   | 1.6% 1.2%    |
|           | スリランカ    | —      | 0.4% △0.4%   |
|           | 計        | 7.9%   | 8.4% △0.6%   |
| 中近東       | カタール     | 9.7%   | 8.5% 1.2%    |
|           | アラブ首長国連邦 | 8.7%   | 7.3% 1.4%    |
|           | サウジアラビア  | 11.4%  | 10.1% 1.3%   |
|           | オマーン     | 3.3%   | 2.8% 0.5%    |
|           | 計        | 33.1%  | 28.6% 4.5%   |
| アフリカ      | 南アフリカ    | 3.9%   | 2.1% 1.9%    |
|           | エジプト     | —      | 2.8% △2.8%   |
|           | ナイジェリア   | —      | 0.4% △0.4%   |
|           | 計        | 3.9%   | 5.3% △1.4%   |
| 現金など      |          | 3.2%   | — —          |
| 合計        |          | 100.0% | 100.0% —     |

#### 期末

| 国         | ファンド     | ベンチマーク | 差           |
|-----------|----------|--------|-------------|
| 中南米       | アルゼンチン   | —      | 5.9% △5.9%  |
|           | ブラジル     | 7.3%   | 5.8% 1.6%   |
|           | チリ       | 6.7%   | 5.2% 1.4%   |
|           | メキシコ     | 9.8%   | 7.6% 2.2%   |
|           | パナマ      | 4.5%   | 3.5% 1.0%   |
|           | ペルー      | 3.3%   | 2.6% 0.7%   |
|           | ベネズエラ    | —      | 0.0% △0.0%  |
|           | エクアドル    | —      | 3.0% △3.0%  |
|           | コロンビア    | 4.5%   | 3.6% 1.0%   |
|           | ドミニカ共和国  | 6.3%   | 4.9% 1.4%   |
| 計         | ウルグアイ    | 1.1%   | 0.9% 0.2%   |
|           |          | 43.6%  | 42.9% 0.7%  |
| 欧州        | ポーランド    | 7.0%   | 5.8% 1.2%   |
|           | ハンガリー    | 7.0%   | 4.1% 2.9%   |
|           | トルコ      | —      | 9.6% △9.6%  |
|           | ウクライナ    | —      | 0.7% △0.7%  |
|           | ルーマニア    | 5.8%   | 3.2% 2.6%   |
| 計         |          | 19.8%  | 23.4% △3.6% |
|           |          |        |             |
| アジア・オセアニア | 中国       | 1.2%   | 3.3% △2.1%  |
|           | インドネシア   | 3.7%   | 2.7% 0.9%   |
|           | フィリピン    | 1.2%   | 0.9% 0.2%   |
|           | スリランカ    | —      | 0.6% △0.6%  |
| 計         |          | 6.1%   | 7.6% △1.5%  |
|           |          |        |             |
| 中近東       | カタール     | 3.8%   | 3.3% 0.5%   |
|           | アラブ首長国連邦 | 7.1%   | 6.2% 0.9%   |
|           | サウジアラビア  | 10.8%  | 9.6% 1.2%   |
|           | オマーン     | 2.3%   | 2.1% 0.3%   |
|           | 計        | 24.0%  | 21.1% 2.9%  |
| アフリカ      | 南アフリカ    | 4.8%   | 2.0% 2.8%   |
|           | エジプト     | —      | 2.5% △2.5%  |
|           | ナイジェリア   | —      | 0.5% △0.5%  |
|           | 計        | 4.8%   | 5.0% △0.2%  |
| 現金など      |          | 1.8%   | — —         |
| 合計        |          | 100.0% | 100.0% —    |

(注1) ファンドの比率は純資産総額に対する割合です。

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で24.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークを9.1%下回りました。運用の基本方針で定められた格付による債券組入制限により、相対的に信用力の低い国債へ投資しなかったことなどが要因です。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークの動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。

## ■1万口当たりの費用明細

| 項 目                                  | 当 期              |                              | 項 目 の 概 要  |
|--------------------------------------|------------------|------------------------------|--|
|                                      | 金 額              | 比 率                          |  |
| (a)そ の 他 費 用<br>(保 管 費 用)<br>(そ の 他) | 3円<br>(3)<br>(0) | 0.012%<br>(0.012)<br>(0.000) | (a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計                                  | 3                | 0.012                        |  |
| 期中の平均基準価額は22,003円です。                 |                  |                              |  |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

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

## ■売買及び取引の状況 (2023年4月19日から2024年4月18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 | 千アメリカ・ドル           |
|     |         |         | 770,013  | 991,781<br>(1,380) |

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ■利害関係人との取引状況等 (2023年4月19日から2024年4月18日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 外国（外貨建）公社債

| 区分   | 当期末                 |                     |                   |           |            |           |           |          |
|------|---------------------|---------------------|-------------------|-----------|------------|-----------|-----------|----------|
|      | 額面金額                | 評価額                 |                   | 組入比率      | うちB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|      |                     | 外貨建金額               | 邦貨換算金額            |           |            | 5年以上      | 2年以上      | 2年未満     |
| アメリカ | 千アメリカ・ドル<br>829,100 | 千アメリカ・ドル<br>714,199 | 千円<br>110,315,301 | %<br>98.2 | %<br>20.7  | %<br>81.2 | %<br>13.0 | %<br>4.0 |
| 合計   | —                   | —                   | 110,315,301       | 98.2      | 20.7       | 81.2      | 13.0      | 4.0      |

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

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

#### (B) 個別銘柄開示

##### 外国（外貨建）公社債銘柄別

| 銘柄                                      | 当期末  |        |          |        |           |            |
|---|------|--------|----------|--------|-----------|------------|
|   | 種類   | 利率     | 額面金額     | 評価額    |           |            |
|   |      |        |          | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千円     |           |            |
| REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61          | 国債証券 | 3.1000 | 3,000    | 1,788  | 276,254   | 2061/01/22 |
| PANAMA 4.5 01/19/63                     | 国債証券 | 4.5000 | 8,000    | 5,002  | 772,664   | 2063/01/19 |
| PANAMA 7.125 01/29/26                   | 国債証券 | 7.1250 | 1,000    | 1,012  | 156,361   | 2026/01/29 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55  | 国債証券 | 3.7500 | 5,400    | 3,656  | 564,768   | 2055/01/21 |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60       | 国債証券 | 5.8750 | 6,000    | 4,851  | 749,390   | 2060/01/30 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 01/18/53   | 国債証券 | 5.0000 | 4,000    | 3,388  | 523,379   | 2053/01/18 |
| INDONESIA 7.75 01/17/38                 | 国債証券 | 7.7500 | 500      | 600    | 92,769    | 2038/01/17 |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.3 01/21/41         | 国債証券 | 5.3000 | 3,000    | 2,435  | 376,183   | 2041/01/21 |
| INDONESIA 4.125 01/15/25                | 国債証券 | 4.1250 | 2,200    | 2,181  | 336,976   | 2025/01/15 |
| INDONESIA 4.35 01/08/27                 | 国債証券 | 4.3500 | 1,600    | 1,564  | 241,604   | 2027/01/08 |
| INDONESIA 4.75 01/08/26                 | 国債証券 | 4.7500 | 1,000    | 991    | 153,222   | 2026/01/08 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50  | 国債証券 | 5.2500 | 3,000    | 2,687  | 415,118   | 2050/01/16 |
| PERU 3.0 01/15/34                       | 国債証券 | 3.0000 | 9,000    | 7,109  | 1,098,158 | 2034/01/15 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50          | 国債証券 | 3.5000 | 4,000    | 2,785  | 430,245   | 2050/01/25 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34          | 国債証券 | 3.5000 | 10,200   | 8,704  | 1,344,573 | 2034/01/31 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.75 01/16/54  | 国債証券 | 5.7500 | 1,000    | 941    | 145,476   | 2054/01/16 |
| PANAMA 3.16 01/23/30                    | 国債証券 | 3.1600 | 8,000    | 6,592  | 1,018,267 | 2030/01/23 |
| BRAZIL 4.75 01/14/50                    | 国債証券 | 4.7500 | 7,000    | 4,964  | 766,892   | 2050/01/14 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32         | 国債証券 | 2.5500 | 8,200    | 6,769  | 1,045,598 | 2032/01/27 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50      | 国債証券 | 4.5000 | 6,000    | 4,512  | 697,074   | 2050/01/31 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31         | 国債証券 | 2.4500 | 1,200    | 1,005  | 155,328   | 2031/01/31 |
| OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28   | 国債証券 | 5.6250 | 5,000    | 4,939  | 762,894   | 2028/01/17 |
| REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 | 国債証券 | 4.3750 | 5,000    | 4,821  | 744,662   | 2031/01/23 |
| ROMANIA 7.125 01/17/33                  | 国債証券 | 7.1250 | 16,000   | 16,589 | 2,562,397 | 2033/01/17 |
| ROMANIA 6.375 01/30/34                  | 国債証券 | 6.3750 | 2,000    | 1,963  | 303,204   | 2034/01/30 |
| PERU 2.783 01/23/31                     | 国債証券 | 2.7830 | 9,000    | 7,522  | 1,161,962 | 2031/01/23 |
| COLOMBIA 3.0 01/30/30                   | 国債証券 | 3.0000 | 8,000    | 6,451  | 996,565   | 2030/01/30 |

| 銘<br>柄                                  | 当<br>期 |        |                  |                       | 末                          |            |
|---|--------|--------|------------------|-----------------------|----------------------------|------------|
|   | 種<br>類 | 利<br>率 | 額<br>面<br>金<br>額 | 評<br>価<br>額           | 償<br>還<br>年<br>月<br>日      |            |
|   |        |        |                  | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |            |
| (アメリカ)                                  |        | %      | 千アメリカ・ドル         | 千アメリカ・ドル              | 千円                         |            |
| OMAN GOV INTERNL BOND 6.25 01/25/31     | 国債証券   | 6.2500 | 5,000            | 5,058                 | 781,316                    | 2031/01/25 |
| PERU 2.392 01/23/26                     | 国債証券   | 2.3920 | 2,000            | 1,892                 | 292,378                    | 2026/01/23 |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.5 01/30/30         | 国債証券   | 4.5000 | 9,000            | 7,996                 | 1,235,186                  | 2030/01/30 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27         | 国債証券   | 2.7500 | 6,200            | 5,769                 | 891,156                    | 2027/01/31 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28  | 国債証券   | 4.7500 | 8,000            | 7,865                 | 1,214,925                  | 2028/01/18 |
| REPUBLIC OF CHILE 4.85 01/22/29         | 国債証券   | 4.8500 | 3,000            | 2,939                 | 454,061                    | 2029/01/22 |
| ROMANIA 5.875 01/30/29                  | 国債証券   | 5.8750 | 6,000            | 5,897                 | 910,866                    | 2029/01/30 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61  | 国債証券   | 3.4500 | 2,000            | 1,236                 | 191,054                    | 2061/02/02 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52      | 国債証券   | 4.4000 | 3,000            | 2,179                 | 336,645                    | 2052/02/12 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34      | 国債証券   | 3.5000 | 9,000            | 7,257                 | 1,120,941                  | 2034/02/12 |
| ROMANIA 4.0 02/14/51                    | 国債証券   | 4.0000 | 9,000            | 6,052                 | 934,869                    | 2051/02/14 |
| COLOMBIA 7.5 02/02/34                   | 国債証券   | 7.5000 | 8,000            | 7,900                 | 1,220,298                  | 2034/02/02 |
| PANAMA 6.4 02/14/35                     | 国債証券   | 6.4000 | 8,000            | 7,456                 | 1,151,748                  | 2035/02/14 |
| UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35     | 国債証券   | 6.3500 | 7,000            | 7,007                 | 1,082,357                  | 2035/02/09 |
| ROMANIA 3.0 02/14/31                    | 国債証券   | 3.0000 | 3,000            | 2,467                 | 381,139                    | 2031/02/14 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33  | 国債証券   | 2.2500 | 12,000           | 9,355                 | 1,445,069                  | 2033/02/02 |
| DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33         | 国債証券   | 6.0000 | 5,200            | 4,871                 | 752,524                    | 2033/02/22 |
| DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29         | 国債証券   | 5.5000 | 12,000           | 11,396                | 1,760,315                  | 2028/02/22 |
| ROMANIA 6.625 02/17/28                  | 国債証券   | 6.6250 | 9,000            | 9,149                 | 1,413,267                  | 2029/02/17 |
| REPUBLIC OF POLAND 5.5 03/18/54         | 国債証券   | 5.5000 | 9,000            | 8,625                 | 1,332,268                  | 2054/03/18 |
| STATE OF QATAR 4.817 03/14/49           | 国債証券   | 4.8170 | 8,000            | 7,070                 | 1,092,121                  | 2049/03/14 |
| HUNGARY 5.5 03/26/36                    | 国債証券   | 5.5000 | 3,000            | 2,819                 | 435,522                    | 2036/03/26 |
| REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42         | 国債証券   | 4.3400 | 7,000            | 5,887                 | 909,429                    | 2042/03/07 |
| PERU 3.55 03/10/51                      | 国債証券   | 3.5500 | 8,000            | 5,441                 | 840,571                    | 2051/03/10 |
| STATE OF QATAR 4.0 03/14/29             | 国債証券   | 4.0000 | 8,000            | 7,674                 | 1,185,464                  | 2029/03/14 |
| INDONESIA 3.05 03/12/51                 | 国債証券   | 3.0500 | 4,000            | 2,650                 | 409,322                    | 2051/03/12 |
| INDONESIA 1.85 03/12/31                 | 国債証券   | 1.8500 | 3,200            | 2,547                 | 393,540                    | 2031/03/12 |
| BRAZIL 6.125 03/15/34                   | 国債証券   | 6.1250 | 3,000            | 2,854                 | 440,920                    | 2034/03/15 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31       | 国債証券   | 1.7000 | 7,000            | 5,654                 | 873,436                    | 2031/03/02 |
| REPUBLIC OF POLAND 4.625 03/18/29       | 国債証券   | 4.6250 | 6,000            | 5,877                 | 907,770                    | 2029/03/18 |
| PANAMA 4.5 04/01/56                     | 国債証券   | 4.5000 | 9,000            | 5,706                 | 881,456                    | 2056/04/01 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71     | 国債証券   | 3.7500 | 4,000            | 2,390                 | 369,248                    | 2071/04/19 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60   | 国債証券   | 4.5000 | 4,000            | 3,095                 | 478,053                    | 2060/04/22 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53          | 国債証券   | 3.5000 | 5,000            | 3,455                 | 533,813                    | 2053/04/15 |
| UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51      | 国債証券   | 5.0000 | 7,000            | 5,628                 | 869,360                    | 2051/04/27 |
| SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52               | 国債証券   | 7.3000 | 10,000           | 8,437                 | 1,303,256                  | 2052/04/20 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29      | 国債証券   | 4.5000 | 5,000            | 4,742                 | 732,603                    | 2029/04/22 |
| REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53         | 国債証券   | 5.5000 | 8,000            | 7,662                 | 1,183,565                  | 2053/04/04 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32     | 国債証券   | 4.7500 | 5,000            | 4,608                 | 711,770                    | 2032/04/27 |
| COLOMBIA 3.25 04/22/32                  | 国債証券   | 3.2500 | 7,000            | 5,295                 | 817,999                    | 2032/04/22 |
| COLOMBIA 8.0 04/20/33                   | 国債証券   | 8.0000 | 7,000            | 7,166                 | 1,106,977                  | 2033/04/20 |
| SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26             | 国債証券   | 4.8750 | 1,400            | 1,354                 | 209,158                    | 2026/04/14 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 | 国債証券   | 4.3750 | 11,000           | 10,582                | 1,634,607                  | 2029/04/16 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30   | 国債証券   | 4.5000 | 4,000            | 3,824                 | 590,709                    | 2030/04/17 |

| 銘柄                                      | 種類   | 利 率    | 額面金額     | 期      |              | 償還年月日      |
|---|------|--------|----------|--------|--------------|------------|
|   |      |        |          | 評価額    | 外貨建金額 邦貨換算金額 |            |
| (アメリカ)                                  |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千円     |              |            |
| UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30     | 国債証券 | 3.2500 | 6,000    | 5,223  | 806,817      | 2030/04/16 |
| COLOMBIA 3.125 04/15/31                 | 国債証券 | 3.1250 | 8,000    | 6,220  | 960,820      | 2031/04/15 |
| STATE OF QATAR 4.4 04/16/50             | 国債証券 | 4.4000 | 6,000    | 4,956  | 765,596      | 2050/04/16 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50     | 国債証券 | 3.8750 | 5,000    | 3,788  | 585,114      | 2050/04/16 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30     | 国債証券 | 3.1250 | 6,000    | 5,399  | 834,080      | 2030/04/16 |
| STATE OF QATAR 3.75 04/16/30            | 国債証券 | 3.7500 | 2,000    | 1,876  | 289,829      | 2030/04/16 |
| STATE OF QATAR 3.4 04/16/25             | 国債証券 | 3.4000 | 6,000    | 5,878  | 907,946      | 2025/04/16 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25       | 国債証券 | 2.5000 | 6,000    | 5,822  | 899,293      | 2025/04/16 |
| UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61    | 国債証券 | 3.7710 | 4,000    | 2,450  | 378,437      | 2061/05/24 |
| UNITED MEXICAN STATES 6.4 05/07/54      | 国債証券 | 6,4000 | 2,000    | 1,901  | 293,685      | 2054/05/07 |
| UNITED MEXICAN STATES 6.338 05/04/53    | 国債証券 | 6,3380 | 5,000    | 4,705  | 726,795      | 2053/05/04 |
| BRAZIL 7.125 05/13/54                   | 国債証券 | 7.1250 | 3,000    | 2,863  | 442,248      | 2054/05/13 |
| REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41          | 国債証券 | 3.1000 | 9,000    | 6,405  | 989,445      | 2041/05/07 |
| UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31    | 国債証券 | 2.6590 | 8,000    | 6,506  | 1,005,016    | 2031/05/24 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33    | 国債証券 | 4.8750 | 6,000    | 5,514  | 851,750      | 2033/05/19 |
| BRAZIL 4.5 05/30/29                     | 国債証券 | 4.5000 | 8,000    | 7,432  | 1,147,995    | 2029/05/30 |
| HUNGARY 6.125 05/22/28                  | 国債証券 | 6.1250 | 8,000    | 8,109  | 1,252,665    | 2028/05/22 |
| SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30             | 国債証券 | 5.8750 | 2,000    | 1,835  | 283,434      | 2030/06/22 |
| DOMINICAN REPUBLIC 6.4 06/05/49         | 国債証券 | 6,4000 | 9,000    | 8,083  | 1,248,524    | 2049/06/05 |
| BRAZIL 3.875 06/12/30                   | 国債証券 | 3.8750 | 9,000    | 7,892  | 1,219,078    | 2030/06/12 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28     | 国債証券 | 1.6250 | 5,000    | 4,344  | 671,051      | 2028/06/02 |
| BRAZIL 2.875 06/06/25                   | 国債証券 | 2.8750 | 4,000    | 3,864  | 596,965      | 2025/06/06 |
| HUNGARY 5.25 06/16/29                   | 国債証券 | 5.2500 | 13,000   | 12,668 | 1,956,776    | 2029/06/16 |
| PANAMA 3.87 07/23/60                    | 国債証券 | 3.8700 | 4,000    | 2,244  | 346,614      | 2060/07/23 |
| REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33         | 国債証券 | 2.5500 | 4,000    | 3,173  | 490,203      | 2033/07/27 |
| PHILIPPINES 3.2 07/06/46                | 国債証券 | 3.2000 | 7,000    | 4,762  | 735,583      | 2046/07/06 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.875 07/18/33 | 国債証券 | 4.8750 | 9,000    | 8,625  | 1,332,347    | 2033/07/18 |
| UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32       | 国債証券 | 4.0500 | 5,000    | 4,682  | 723,243      | 2032/07/07 |
| UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41     | 国債証券 | 4.2800 | 9,000    | 6,936  | 1,071,341    | 2041/08/14 |
| OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29     | 国債証券 | 6,0000 | 7,000    | 7,032  | 1,086,280    | 2029/08/01 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70       | 国債証券 | 2.7000 | 4,000    | 2,180  | 336,867      | 2070/09/02 |
| HUNGARY 3.125 09/21/51                  | 国債証券 | 3.1250 | 7,000    | 4,199  | 648,604      | 2051/09/21 |
| INDONESIA 3.4 09/18/29                  | 国債証券 | 3.4000 | 200      | 182    | 28,153       | 2029/09/18 |
| DOMINICAN REPUBLIC 4.875 09/23/32       | 国債証券 | 4.8750 | 7,000    | 6,089  | 940,602      | 2032/09/23 |
| PANAMA 2.252 09/29/32                   | 国債証券 | 2.2520 | 7,000    | 4,904  | 757,509      | 2032/09/29 |
| REPUBLIC OF POLAND 5.125 09/18/34       | 国債証券 | 5.1250 | 9,000    | 8,725  | 1,347,768    | 2034/09/18 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49     | 国債証券 | 3.1250 | 4,000    | 2,645  | 408,546      | 2049/09/30 |
| UAE INT'L GOVT BOND 4.917 09/25/33      | 国債証券 | 4.9170 | 4,000    | 3,974  | 613,901      | 2033/09/25 |
| SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49              | 国債証券 | 5.7500 | 15,000   | 10,592 | 1,636,132    | 2049/09/30 |
| HUNGARY 6.25 09/22/32                   | 国債証券 | 6,2500 | 13,000   | 13,137 | 2,029,264    | 2032/09/22 |
| BRAZIL 3.75 09/12/31                    | 国債証券 | 3.7500 | 14,000   | 11,846 | 1,829,761    | 2031/09/12 |
| HUNGARY 2.125 09/22/31                  | 国債証券 | 2.1250 | 13,000   | 10,064 | 1,554,574    | 2031/09/22 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31     | 国債証券 | 1.8750 | 7,000    | 5,650  | 872,847      | 2031/09/15 |
| ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29       | 国債証券 | 2.5000 | 5,000    | 4,406  | 680,669      | 2029/09/30 |

| 銘柄                                     | 種類   | 利 率    | 額面金額     | 当期      |             | 末償還年月日     |
|--|------|--------|----------|---------|-------------|------------|
|  |      |        |          | 評価額     | 外貨建金額       |            |
| (アメリカ)                                 |      | %      | 千アメリカ・ドル | 千円      |             |            |
| SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29             | 国債証券 | 4.8500 | 14,000   | 12,454  | 1,923,747   | 2029/09/30 |
| UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61      | 国債証券 | 3.2500 | 5,000    | 3,234   | 499,571     | 2061/10/19 |
| REPUBLICA ORIENT URUGUAY 5.75 10/28/34 | 国債証券 | 5.7500 | 3,000    | 3,079   | 475,685     | 2034/10/28 |
| INDONESIA 4.2 10/15/50                 | 国債証券 | 4.2000 | 8,000    | 6,357   | 982,051     | 2050/10/15 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32  | 国債証券 | 5.5000 | 11,000   | 11,051  | 1,707,086   | 2032/10/25 |
| REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33      | 国債証券 | 4.8750 | 9,000    | 8,638   | 1,334,273   | 2033/10/04 |
| BRAZIL 6.0 10/20/33                    | 国債証券 | 6.0000 | 12,000   | 11,452  | 1,768,987   | 2033/10/20 |
| INDONESIA 3.85 10/15/30                | 国債証券 | 3.8500 | 10,400   | 9,564   | 1,477,398   | 2030/10/15 |
| CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30      | 国債証券 | 1.2000 | 4,000    | 3,255   | 502,832     | 2030/10/21 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 | 国債証券 | 3.2500 | 9,200    | 8,151   | 1,259,055   | 2030/10/22 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25  | 国債証券 | 2.9000 | 4,000    | 3,853   | 595,221     | 2025/10/22 |
| CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26     | 国債証券 | 1.2500 | 4,000    | 3,658   | 565,076     | 2026/10/26 |
| REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32       | 国債証券 | 5.7500 | 6,000    | 6,121   | 945,526     | 2032/11/16 |
| REPUBLIC OF POLAND 5.5 11/16/27        | 国債証券 | 5.5000 | 5,000    | 5,050   | 780,158     | 2027/11/16 |
| PERU 2.78 12/01/60                     | 国債証券 | 2.7800 | 4,000    | 2,130   | 329,128     | 2060/12/01 |
| PHILIPPINES 2.65 12/10/45              | 国債証券 | 2.6500 | 6,000    | 3,741   | 577,867     | 2045/12/10 |
| CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24     | 国債証券 | 1.9500 | 2,000    | 1,957   | 302,375     | 2024/12/03 |
| 合計                                     | -    | -      | 829,100  | 714,199 | 110,315,301 | -          |

## ■投資信託財産の構成

2024年4月18日現在

| 項目              | 当期          |       | 比率 |
|-----------------|-------------|-------|----|
|                 | 評価額         | 千円    |    |
| 公 社 債           | 110,315,301 | 97.7  | %  |
| コール・ローン等、その他    | 2,647,402   | 2.3   |    |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 112,962,704 | 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、112,350,092千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.46円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月18日)現在

| 項目              | 目       | 当期末              |
|-----------------|---------|------------------|
| (A) 資本          | 一ル・ローン等 | 113,312,304,596円 |
| 公社              | 債(評価額)  | 1,374,323,241    |
| 未収              | 入金      | 110,315,301,340  |
| 未収              | 利息      | 350,000,000      |
| 前払              | 費用      | 1,056,809,359    |
| (B) 負債          | 未払金     | 215,870,656      |
| 未払              | 解約金     | 1,002,018,226    |
| 未払              | 金       | 573,079,226      |
| (C) 純資産         | 総額(A-B) | 428,939,000      |
| 元本              | 本期繰越損益金 | 112,310,286,370  |
| 次回期             | 元本      | 47,831,274,931   |
| (D) 受益権         | 総口数     | 64,479,011,439   |
| 1万口当たり基準価額(C/D) |         | 47,831,274,931円  |
|                 |         | 23,481円          |

(注1) 期首元本額  
追加設定元本額  
一部解約元本額

(注2) 期末における元本の内訳

|   |                 |
|---|-----------------|
| DIAM新興国債券インディスクファンド                       | 56,545,881円     |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)                    | 3,402,228,783円  |
| たわらノーロード バランス (堅実型)                       | 185,898,554円    |
| たわらノーロード バランス (標準型)                       | 611,432,709円    |
| たわらノーロード バランス (積極型)                       | 288,880,377円    |
| たわらノーロード 最適化バランス (保守型)                    | 488,065円        |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)                    | 5,013,325円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)                  | 66,432,394円     |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)                    | 7,270,485円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)                    | 8,800,979円      |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                    | 62,340,964円     |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国10)               | 271,810,079円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国20)               | 409,557,576円    |
| DIAM DC 8資産バランスファンド (新興国30)               | 829,027,400円    |
| 投資のソムリエ                                   | 12,760,704,368円 |
| グローズコントロール                                | 175,172,226円    |
| 投資のソムリエ <DC年金>                            | 1,299,821,204円  |
| DIAM 8資産バランスファンド N <DC年金>                 | 377,434,623円    |
| 投資のソムリエ <DC年金>/リスク抑制型                     | 1,188,460,901円  |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                        | 3,769,475,205円  |
| ワールドアセットバランス (基本コース)                      | 332,991,505円    |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)                   | 755,680,455円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)                   | 79,148,286円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)                   | 40,307,356円     |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)                   | 10,742,825円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)                   | 261,787,480円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                       | 641,380,664円    |
| 9資産分散投資・スタンダード <DC年金>                     | 222,835,935円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)                   | 96,645,355円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)                   | 43,884,243円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)                   | 27,134,290円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)                   | 6,707,467円      |
| Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>             | 2,067,283円      |
| Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>             | 19,919,297円     |
| エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)                | 15,421,084,811円 |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)                    | 194,553,833円    |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド (適格機関投資家限定)             | 726,463,768円    |
| 高度リスク分散・安定型戦略ファンド2 (適格機関投資家限定)            | 451,003,739円    |
| リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF用) (適格機関投資家専用) | 7,063,327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)         | 93,025,067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)         | 63,720,320円     |
| DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家専用) | 2,556,331,527円  |
| 期末元本合計                                    | 47,831,274,931円 |

## ■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

| 項目               | 当期              |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等取扱        | 5,614,232,019円  |
| 受取その他収益          | 5,613,461,401   |
| 支払利息             | 1,112,433       |
| (B) 有価証券売買損益     | △341,815        |
| 売買益              | 10,007,181,950  |
| 売買損              | 18,663,475,866  |
| (C) その他費用        | △8,656,293,916  |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △13,081,454     |
| (E) 前期繰越損益金      | 15,608,332,515  |
| (F) 解約差損益金       | 69,138,728,177  |
| (G) 追加信託差損益金     | △72,993,928,691 |
| (H) 合計(D+E+F+G)  | 52,725,879,438  |
| 次期繰越損益金(H)       | 64,479,011,439  |

(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、元本から解約額を差し引いた差額分をいいます。

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

# エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日 2024年4月18日）  
 (計算期間 2023年4月19日～2024年4月18日)

エマージング株式パッシブ・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

**当ファンドの仕組みは次の通りです。**

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 2008年2月20日から無期限です。  |
| 運用方針   | 主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 海外の証券取引所に上場している株式*を主要投資対象とします。<br>※DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。               |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。<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<br>期中騰落率    | MSCI エマージング・マーケット・インデックス<br>(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |                 | 株式組入比率         | 株式先物比率       | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 | 純資産額   |
|-----------------|------------------|---|-----------------|----------------|--------------|-------------------|--------|
|                 |                  | ポイント  | %               |                |              |                   |        |
| 12期(2020年4月20日) | 円 9,723<br>△20.7 | % 225,442.54<br>△20.7   | % △18.4<br>64.7 | % 34.8<br>34.8 | % 0.4<br>0.4 | 百万円 41,166        |        |
| 13期(2021年4月19日) | 14,848           | 52.7  | 347,921.32      | 54.3           | 93.2         | 6.1               | 58,156 |
| 14期(2022年4月18日) | 14,507           | △2.3  | 343,415.90      | △1.3           | 84.0         | 15.2              | 62,888 |
| 15期(2023年4月18日) | 14,206           | △2.1  | 339,863.92      | △1.0           | 92.1         | 7.4               | 91,982 |
| 16期(2024年4月18日) | 16,801           | 18.3  | 405,964.98      | 19.4           | 91.7         | 7.4               | 92,003 |

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

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

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

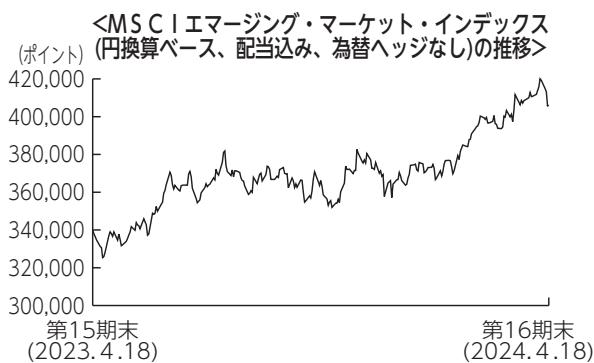
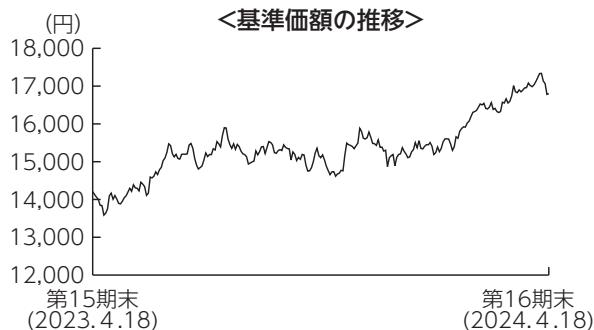
## ■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                 | 基 準 価 額     | M S C I エマージング・マーケット・インデックス<br>(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)<br>(ベンチマーク) |                    | 騰落率    | 株式組入比率    | 株式先物比率   | 投資信託受益証券、投資証券組入比率 |
|-----------------------|-------------|--|--------------------|--------|-----------|----------|-------------------|
|                       |             | 騰落率  |                    |        |           |          |                   |
| (期 首)<br>2023年 4月 18日 | 円<br>14,206 | %<br>—   | ポイント<br>339,863.92 | %<br>— | %<br>92.1 | %<br>7.4 | %<br>0.7          |
| 4 月 末                 | 13,747      | △3.2   | 328,440.62         | △3.4   | 91.0      | 8.3      | 0.7               |
| 5 月 末                 | 14,340      | 0.9  | 342,757.44         | 0.9    | 93.8      | 5.5      | 0.8               |
| 6 月 末                 | 15,194      | 7.0  | 363,768.93         | 7.0    | 96.0      | 3.1      | 0.9               |
| 7 月 末                 | 15,690      | 10.4   | 375,788.62         | 10.6   | 94.1      | 5.0      | 0.9               |
| 8 月 末                 | 15,401      | 8.4  | 370,134.23         | 8.9    | 94.1      | 5.2      | 0.9               |
| 9 月 末                 | 15,064      | 6.0  | 362,611.45         | 6.7    | 96.9      | 2.2      | 0.9               |
| 10 月 末                | 14,695      | 3.4  | 354,176.77         | 4.2    | 93.9      | 5.3      | 0.8               |
| 11 月 末                | 15,432      | 8.6  | 372,080.74         | 9.5    | 93.0      | 6.1      | 0.9               |
| 12 月 末                | 15,506      | 9.2  | 374,221.28         | 10.1   | 91.2      | 7.9      | 0.8               |
| 2024年 1 月 末           | 15,469      | 8.9  | 373,407.20         | 9.9    | 94.7      | 4.4      | 0.9               |
| 2 月 末                 | 16,409      | 15.5   | 396,672.06         | 16.7   | 91.8      | 7.4      | 0.8               |
| 3 月 末                 | 16,899      | 19.0   | 408,467.23         | 20.2   | 93.7      | 5.5      | 0.9               |
| (期 末)<br>2024年 4月 18日 | 16,801      | 18.3   | 405,964.98         | 19.4   | 91.7      | 7.4      | 0.8               |

(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、賃建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年4月19日から2024年4月18日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は16,801円となり、前期末比で18.3%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークに占める構成比が最大の中国は下落したものの、インドやブラジル、台湾、韓国など多くの株式市場が上昇したことや、為替市場で多くの通貨に対して円安になったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

### 投資環境

新興国市場は多くの市場が上昇しました。中国では国内経済の低迷や不動産市場を巡る不透明感が懸念され下落しましたが、2023年10－12月期の実質GDP成長率が市場予想を上回ったインドや利下げによる景気回復が期待されるブラジルが上昇したほか、米ハイテク株高を受けて台湾や韓国なども上昇しました。

為替市場では、米ドルは期前半、日米の金融政策の方向性の違いが意識され円安ドル高が進行しました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年以降は米国の利下げ観測は後退し、改めて円安ドル高となりました。その他の通貨ではトルコリラなど一部を除き、多くの通貨に対して円安となりました。

## ポートフォリオについて

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

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

### 【運用状況】

#### ○組入上位10業種

#### 期首（前期末）

| No. | 業種                 | 組入比率  |
|-----|--------------------|-------|
| 1   | 銀行                 | 14.4% |
| 2   | 半導体・半導体製造装置        | 8.6   |
| 3   | 素材                 | 8.3   |
| 4   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 7.8   |
| 5   | メディア・娯楽            | 6.6   |
| 6   | 一般消費財・サービス流通・小売り   | 5.2   |
| 7   | エネルギー              | 4.6   |
| 8   | 食品・飲料・タバコ          | 3.7   |
| 9   | 資本財                | 3.7   |
| 10  | 自動車・自動車部品          | 3.1   |

#### 期末

| No. | 業種                 | 組入比率  |
|-----|--------------------|-------|
| 1   | 銀行                 | 15.7% |
| 2   | 半導体・半導体製造装置        | 11.2  |
| 3   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 8.4   |
| 4   | 素材                 | 6.9   |
| 5   | メディア・娯楽            | 5.4   |
| 6   | エネルギー              | 5.1   |
| 7   | 資本財                | 4.5   |
| 8   | 一般消費財・サービス流通・小売り   | 4.5   |
| 9   | 自動車・自動車部品          | 3.6   |
| 10  | 食品・飲料・タバコ          | 3.2   |



(注1) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で19.4%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを1.2%下回りましたが、ファンドとベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることや、配当課税の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

## 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。また、保有しているロシア関連銘柄につきましては、売却可能となり次第、速やかに売却する方針です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

| 項目  | 当期                             |  | 項目の概要   |
|---|--------------------------------|--|---|
|   | 金額                             | 比率   |   |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(先物・オプション)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券) | 9円<br>(7)<br>(2)<br>(0)<br>(0) | 0.057%<br>(0.043)<br>(0.014)<br>(0.000)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<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              |
| (b) 有価証券取引税<br>(株式)<br>(投資信託受益証券)<br>(投資証券)               | 13<br>(13)<br>(0)<br>(0)       | 0.087<br>(0.087)<br>(0.000)<br>(0.000)             | (b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<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            |
| (c) その他費用<br>(保管費用)<br>(その他)                              | 34<br>(24)<br>(10)             | 0.221<br>(0.155)<br>(0.066)                        | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用<br>その他は、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合計  | 56                             | 0.364  |   |
| 期中の平均基準価額は15,373円です。                                      |                                |  |   |

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

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

## ■ 売買及び取引の状況 (2023年4月19日から2024年4月18日まで)

### (1) 株式

|        |       | 買付                             |                                 | 売付               |                      |
|--------|-------|--------------------------------|---------------------------------|------------------|----------------------|
|        |       | 株数                             | 金額                              | 株数               | 金額                   |
| 外<br>国 | アメリカ  | 百株<br>4,141.97<br>(△237.36)    | 千アメリカ・ドル<br>5,661<br>(-)        | 百株<br>7,939.09   | 千アメリカ・ドル<br>10,934   |
|        | 香港    | 百株<br>238,932<br>(1,736.93)    | 千香港・ドル<br>388,003<br>(△346)     | 百株<br>407,896.57 | 千香港・ドル<br>541,915    |
|        | 台湾    | 百株<br>102,289.41<br>(2,437.15) | 千台湾・ドル<br>1,020,740<br>(△4,964) | 百株<br>154,676.1  | 千台湾・ドル<br>1,488,893  |
|        | トルコ   | 百株<br>6,216.31<br>(5,292.21)   | 千トルコ・リラ<br>36,995<br>(-)        | 百株<br>11,165.9   | 千トルコ・リラ<br>57,404    |
|        | メキシコ  | 百株<br>18,823.65<br>(2,346)     | 千メキシコ・ペソ<br>83,145<br>(-)       | 百株<br>35,274.8   | 千メキシコ・ペソ<br>124,160  |
|        | フィリピン | 百株<br>10,716.3<br>(△157.45)    | 千フィリピン・ペソ<br>71,232<br>(△71)    | 百株<br>25,075.94  | 千フィリピン・ペソ<br>122,349 |
|        | チリ    | 百株<br>175,801.35<br>(14.57)    | 千チリ・ペソ<br>965,084<br>(-)        | 百株<br>75,484.42  | 千チリ・ペソ<br>1,438,830  |
|        | コロンビア | 百株<br>71.12<br>(-)             | 千コロンビア・ペソ<br>249,512<br>(-)     | 百株<br>378.07     | 千コロンビア・ペソ<br>890,331 |
|        | クウェート | 百株<br>6,704.76<br>(1,123.25)   | 千クウェート・ディナール<br>498<br>(-)      | 百株<br>10,076.61  | 千クウェート・ディナール<br>751  |

|        |          | 買付                            |                                    | 売付              |                           |
|--------|----------|-------------------------------|------------------------------------|-----------------|---------------------------|
|        |          | 株数                            | 金額                                 | 株数              | 金額                        |
| 外<br>国 | カタール     | 百株<br>11,005.72<br>(-)        | 千カタール・リアル<br>7,025<br>(-)          | 百株<br>13,553.29 | 千カタール・リアル<br>9,773        |
|        | サウジアラビア  | 百株<br>8,578.79<br>(1,982.08)  | 千サウジアラビア・リアル<br>35,518<br>(-)      | 百株<br>12,083.81 | 千サウジアラビア・リアル<br>47,696    |
|        | インドニア    | 百株<br>60,950.74<br>(6,472.94) | 千インド・ルピー<br>3,236,415<br>(-)       | 百株<br>56,153.11 | 千インド・ルピー<br>3,945,854     |
|        | インドネシア   | 百株<br>1,088,076<br>(5,960)    | 千インドネシア・ルピア<br>73,042,490<br>(-)   | 百株<br>481,736   | 千インドネシア・ルピア<br>92,702,980 |
|        | アラブ首長国連邦 | 百株<br>12,141.88<br>(-)        | 千アラブ首長国連邦・ディルハム<br>10,016<br>(-)   | 百株<br>17,633.82 | 千アラブ首長国連邦・ディルハム<br>14,874 |
|        | ブラジル     | 百株<br>22,408<br>(1,262.62)    | 千ブラジル・リアル<br>52,046<br>(△27)       | 百株<br>34,191.25 | 千ブラジル・リアル<br>81,907       |
|        | チエコ      | 百株<br>388.4<br>(-)            | 千チェコ・コルナ<br>6,848<br>(-)           | 百株<br>363.91    | 千チェコ・コルナ<br>10,101        |
|        | 韓国       | 百株<br>4,848.79<br>(85.25)     | 千韓国・ウォン<br>38,326,937<br>(△19,765) | 百株<br>7,634.67  | 千韓国・ウォン<br>52,136,375     |
|        | 中国       | 百株<br>62,972.04<br>(1,799.25) | 千オフショア・人民元<br>78,461<br>(-)        | 百株<br>73,942.67 | 千オフショア・人民元<br>99,059      |
|        | マレーシア    | 百株<br>29,815<br>(-)           | 千マレーシア・リンギット<br>13,672<br>(-)      | 百株<br>44,046    | 千マレーシア・リンギット<br>19,990    |
| 国      | 南アフリカ    | 百株<br>8,333.17<br>(-)         | 千南アフリカ・ランド<br>110,694<br>(△475)    | 百株<br>14,343.29 | 千南アフリカ・ランド<br>198,680     |
|        | タイ       | 百株<br>62,489<br>(2,641.5)     | 千タイ・バーツ<br>133,691<br>(-)          | 百株<br>78,836    | 千タイ・バーツ<br>227,722        |
|        | ポーランド    | 百株<br>1,697.75<br>(-)         | 千ポーランド・ズロチ<br>7,601<br>(-)         | 百株<br>2,503.25  | 千ポーランド・ズロチ<br>11,015      |
|        | ハンガリー    | 百株<br>172.4<br>(-)            | 千ハンガリー・フォリント<br>132,641<br>(-)     | 百株<br>339.51    | 千ハンガリー・フォリント<br>270,398   |
|        | ユーロギリシャ  | 百株<br>3,440.77<br>(-)         | 千ユーロ<br>1,178<br>(△8)              | 百株<br>3,418.85  | 千ユーロ<br>1,343             |

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 投資信託受益証券、投資証券

|  | 買付                   |                            | 売付                  |                            |
|--|----------------------|----------------------------|---------------------|----------------------------|
|  | 口数                   | 金額                         | 口数                  | 金額                         |
| 香港<br>YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST    | 千口<br>—<br>(12.04)   | 千香港・ドル<br>—<br>(28)        | 千口<br>12.04<br>(—)  | 千香港・ドル<br>19<br>(—)        |
| メキシコ<br>FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | 千口<br>50.8<br>(—)    | 千メキシコ・ペソ<br>9,918<br>(—)   | 千口<br>82.49<br>(—)  | 千メキシコ・ペソ<br>16,519<br>(—)  |
| GRUPO TELEVISA SAB                           | 69.3<br>(—)          | 1,181<br>(—)               | 316.2<br>(—)        | 4,158<br>(—)               |
| CEMEX SAB DE CV                              | 430.7<br>(—)         | 5,226<br>(—)               | 678.5<br>(—)        | 8,792<br>(—)               |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA                  | 34.1<br>(—)          | 846<br>(—)                 | 101.2<br>(—)        | 2,562<br>(—)               |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV                    | 4.6<br>(—)           | 695<br>(—)                 | 14.2<br>(—)         | 2,103<br>(—)               |
| ブラジル<br>BANCO SANTANDER BRASIL SA            | 千口<br>—<br>(—)       | 千ブラジル・レアル<br>—<br>(—)      | 千口<br>8.3<br>(—)    | 千ブラジル・レアル<br>223<br>(—)    |
| ENERGISA SA                                  | 18.4<br>(—)          | 875<br>(—)                 | 14.6<br>(—)         | 707<br>(—)                 |
| KLABIN SA                                    | —<br>(—)             | —<br>(—)                   | 18.7<br>(—)         | 430<br>(—)                 |
| BANCO BTG PACTUAL SA                         | 36.4<br>(—)          | 1,154<br>(—)               | 55.9<br>(—)         | 1,870<br>(—)               |
| 南アフリカ<br>GROWTHPOINT PROPERTIES LTD          | 千口<br>119.486<br>(—) | 千南アフリカ・ランド<br>1,389<br>(—) | 千口<br>441.09<br>(—) | 千南アフリカ・ランド<br>4,953<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。

(3) 先物取引の種類別取引状況

| 種類別       | 買建            |               | 売建       |          |
|-----------|---------------|---------------|----------|----------|
|           | 新規買付額         | 決済額           | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国 株式先物取引 | 百万円<br>89,599 | 百万円<br>90,061 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(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     | 78,631,663千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 85,385,717千円 |
| (c) 売買高比率 (a)/(b) | 0.92         |

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2023年4月19日から2024年4月18日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

| 銘 柏  | 期 首(前期末)     | 当 期 末     |                 |              |             | 業 種 等               |  |
|--|--------------|-----------|-----------------|--------------|-------------|---------------------|--|
|  |              | 株 数       | 株 数             | 評 価 額        |             |                     |  |
|  |              |           |                 | 外 貨 建 金 額    | 邦 貨 換 算 金 額 |                     |  |
| (アメリカ)   |              |           |                 |              |             |                     |  |
| TRIP.COM GROUP LTD ADR                                 | 百株<br>517.04 | 百株<br>—   | 千アメリカ・ドル<br>—   | —            | 千円<br>—     | ホテル・レストラン・レジャー      |  |
| CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR                       | 179.59       | 156.44    | 243             | 37,671       | —           | 金属・鉱業               |  |
| SURGUTNEfteGAZ SP ADR PREF (※1)                        | 242.1        | 242.1     | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| CREDICORP LTD  | 68.17        | 54        | 869             | 134,279      | —           | 銀行                  |  |
| MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR (※1) | 423.11       | 423.11    | 0               | 0            | 0           | 無線通信サービス            |  |
| SOUTHERN COPPER CORP                                   | 82.72        | 68.34     | 780             | 120,515      | —           | 金属・鉱業               |  |
| GAZPROM PJSC (※2)                                      | 9,669.42     | 9,669.42  | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| LUKOIL PJSC (※2)                                       | 338.45       | 338.45    | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT GDR                | 3,060.34     | 2,195.22  | 353             | 54,590       | —           | 銀行                  |  |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL CO                           | 827          | 890       | 181             | 27,961       | —           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE                            | 864.88       | —         | —               | —            | —           | 不動産管理・開発            |  |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD                      | 574.4        | 515.68    | 105             | 16,264       | —           | ソフトウェア              |  |
| EFG HOLDING S.A.E.-GDR                                 | 502.59       | 628.24    | 43              | 6,792        | —           | 資本市場                |  |
| SURGUTNEfteGAZ ADR (※1)                                | 710.84       | 710.84    | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| X5 RETAIL GROUP NV GDR (※1)                            | 160.03       | 160.03    | 0               | 0            | 0           | 生活必需品流通・小売り         |  |
| NOVATEK PJSC GDR (※1)                                  | 74.13        | 74.13     | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| NOVOLIPETSK STEEL GDR (※1)                             | 132.6        | 132.6     | 0               | 0            | 0           | 金属・鉱業               |  |
| MMC NORILSK NICKEL ADR (※1)                            | 539.53       | 539.53    | 0               | 0            | 0           | 金属・鉱業               |  |
| MAGNIT PJSC (※2)                                       | 75.74        | 75.74     | 0               | 0            | 0           | 生活必需品流通・小売り         |  |
| ROSNEFT OIL CO PJSC (※2)                               | 1,079.51     | 1,079.51  | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| SEVERSTAL GDR (※1)                                     | 186.08       | 186.08    | 0               | 0            | 0           | 金属・鉱業               |  |
| TATNEFT ADR (※1)                                       | 195.09       | 195.09    | 0               | 0            | 0           | 石油・ガス・消耗燃料          |  |
| VTB BANK PJSC (※2)                                     | 3,040,000    | 3,040,000 | 0               | 0            | 0           | 銀行                  |  |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR                               | 396.53       | 271.4     | 416             | 64,264       | —           | 大規模小売り              |  |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR                                | 461.95       | 355.82    | 413             | 63,863       | —           | 各種消費者サービス           |  |
| VK CO LTD GDR (※1)                                     | 98.58        | 98.58     | 0               | 0            | 0           | インターネット・メディアおよびサービス |  |
| SBERBANK OF RUSSIA PJSC (※2)                           | 8,971.12     | 8,971.12  | 0               | 0            | 0           | 銀行                  |  |
| YANDEX NV (※3)   | 256.01       | 256.01    | 0               | 0            | 0           | インターネット・メディアおよびサービス |  |
| PHOSAGRO PJSC GDR (※1)                                 | 181.63       | 181.63    | 0               | 0            | 0           | 化学                  |  |
| H WORLD GROUP LTD ADR                                  | 181.69       | 164.09    | 619             | 95,653       | —           | ホテル・レストラン・レジャー      |  |
| JOYY INC-ADR   | 43.68        | —         | —               | —            | —           | インターネット・メディアおよびサービス |  |
| DAQO NEW ENERGY CORP ADR                               | 59.96        | —         | —               | —            | —           | 半導体・半導体製造装置         |  |
| ZAI LAB LTD ADR  | 89.02        | —         | —               | —            | —           | バイオテクノロジー           |  |
| TCS GROUP HOLDING PLC GDR (※1)                         | 99.61        | 99.61     | 0               | 0            | 0           | 銀行                  |  |
| QIFU TECHNOLOGY INC ADR                                | 126.87       | 100       | 178             | 27,555       | —           | 消費者金融               |  |
| NIO INC ADR  | 1,294.54     | 1,081.22  | 422             | 65,299       | —           | 自動車                 |  |
| TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR                  | 704.12       | 598.63    | 674             | 104,207      | —           | 娯楽                  |  |
| AUTOHOME INC ADR                                       | 78.01        | 49.83     | 120             | 18,679       | —           | インターネット・メディアおよびサービス |  |
| MINISO GROUP HOLDING LTD ADR                           | 83.23        | —         | —               | —            | —           | 大規模小売り              |  |
| WEIBO CORP ADR   | 62.61        | —         | —               | —            | —           | インターネット・メディアおよびサービス |  |
| KANZHUN LTD ADR  | 169.73       | 180.55    | 326             | 50,504       | —           | インターネット・メディアおよびサービス |  |
| KE HOLDINGS INC ADR                                    | 627.96       | 521.92    | 672             | 103,833      | —           | 不動産管理・開発            |  |
| LEGEND BIOTECH CORP ADR                                | 50.58        | 57.82     | 282             | 43,609       | —           | バイオテクノロジー           |  |
| OZON HOLDINGS PLC ADR (※1)                             | 45.37        | 45.37     | 0               | 0            | —           | 大規模小売り              |  |
| LUFAX HOLDING LTD ADR                                  | 604.38       | —         | —               | —            | —           | 消費者金融               |  |
| PDD HOLDINGS INC ADR                                   | 482.84       | 470.54    | 5,337           | 824,404      | —           | 大規模小売り              |  |
| YUM CHINA HOLDINGS INC                                 | 396.96       | 322.05    | 1,187           | 183,455      | —           | ホテル・レストラン・レジャー      |  |
| IQIYI INC ADR  | 404.57       | 334.39    | 139             | 21,537       | —           | 娯楽                  |  |
| POLYUS PJSC GDR (※1)                                   | 67.87        | 67.87     | 0               | 0            | —           | 金属・鉱業               |  |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR                             | 396.34       | 341.64    | 659             | 101,898      | —           | 航空貨物・物流サービス         |  |
| 小 計  | 株 数          | ・ 金 額     |                 |              |             |                     |  |
|  | 銘柄           | ・ 比 率     |                 |              |             |                     |  |
|  | 銘柄           | ・ 金 額     |                 |              |             |                     |  |
|  | 銘柄           | ・ 金 額     |                 |              |             |                     |  |
| (香港)   |              |           |                 |              |             |                     |  |
| JIANGXI COPPER CO LTD                                  | 百株<br>910    | 百株<br>880 | 千香港・ドル<br>1,383 | 千円<br>27,293 | —           | 金属・鉱業               |  |

| 銘<br>柄   | 期 首(前期末) | 当 期 末    |         |           |        | 業 種 等               |
|--|----------|----------|---------|-----------|--------|---------------------|
|  |          | 株 数      | 株 数     | 評 価 額     | 邦貨換算金額 |                     |
|  |          |          |         | 外 貨 建 金 額 |        |                     |
| (香港)   |          |          |         |           |        |                     |
| JIANGSU EXPRESS  | 百株       | 百株       | 千香港・ドル  | 千円        |        |                     |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD                                       | 1,440    | 1,020    | 809     | 15,978    |        | 運送インフラ              |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD                                       | 2,060    | —        | —       | —         |        | 旅客航空輸送              |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD  | 120      | 87       | 931     | 18,375    |        | 飲料                  |
| BEIJING ENTERPRISES  | 1,090    | 855      | 1,480   | 29,217    |        | 建設資材                |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL IN ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY | 415      | 425      | 1,009   | 19,914    |        | ガス                  |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD   | 3,900    | 3,200    | 1,625   | 32,073    |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| HENGAN INTERNATIONAL GROUP   | 4,420    | 4,760    | 1,256   | 24,793    |        | 生活必需品流通・小売業         |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE  | 1,540    | 1,790    | 3,236   | 63,852    |        | 石油・ガス・消耗燃料          |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD  | 675      | 510      | 1,259   | 24,853    |        | パーソナルケア用品           |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT                                     | —        | 2,340    | 1,649   | 32,548    |        | 自動車                 |
| CITIC LTD  | 8,436    | 7,276    | 4,227   | 83,405    |        | 医薬品                 |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL  | 3,541.2  | 3,201.2  | 3,623   | 71,496    |        | 不動産管理・開発            |
| LENOVO GROUP LTD   | 3,008.88 | 2,613.88 | 6,051   | 119,388   |        | 不動産管理・開発            |
| PETRO CHINA CO LTD   | 5,720    | 4,630    | 3,180   | 62,757    |        | コンプロマリット            |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD                              | 1,480    | —        | —       | —         |        | 運送インフラ              |
| SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC                                       | 6,760    | 6,100    | 5,038   | 99,411    |        | コンピュータ・周辺機器         |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR                                       | 19,920   | 16,480   | 12,244  | 241,586   |        | 石油・ガス・消耗燃料          |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   | 1,227.9  | 1,163.9  | 725     | 14,306    |        | 保険                  |
| KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD                          | 290      | —        | —       | —         |        | 半導体・半導体製造装置         |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD  | 23,952   | 19,672   | 8,891   | 175,434   |        | 石油・ガス・消耗燃料          |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD  | 770      | 740      | 685     | 13,534    |        | ホテル・レストラン・レジャー      |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD   | 2,570    | 2,210    | 1,726   | 34,054    |        | ソフトウェア              |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD   | 743      | 641      | 3,983   | 78,600    |        | ガス                  |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD                                 | 3,580    | 2,860    | 2,067   | 40,797    |        | ガス                  |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD   | 2,160    | 940      | 408     | 8,067     |        | 運送インフラ              |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING                                       | 1,522    | 1,112    | 418     | 8,249     |        | 不動産管理・開発            |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD   | 1,160    | 1,080    | 1,086   | 21,436    |        | 運送インフラ              |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD   | 3,800    | 3,100    | 1,581   | 31,193    |        | 金属・鉱業               |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD  | 1,305    | —        | —       | —         |        | 運送インフラ              |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD  | 2,878    | 1,990    | 1,391   | 27,444    |        | ガス                  |
| BYD CO LTD   | 585      | 545      | 806     | 15,914    |        | 電子装置・機器・部品          |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD  | 5,690    | 4,820    | 4,294   | 84,732    |        | 自動車                 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP                                   | 882      | 649      | 1,534   | 30,283    |        | ガス                  |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD  | 785      | 815      | 16,609  | 327,709   |        | 自動車                 |
| ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL  | 2,000    | 1,600    | 1,486   | 29,326    |        | エネルギー設備・サービス        |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 4,115.92 | —        | —       | —         |        | 商業サービス・用品           |
| AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY                                       | 3,000    | —        | —       | —         |        | 情報技術サービス            |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS                                       | 130      | 100      | 939     | 18,526    |        | 海上運輸                |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD   | 6,497.88 | 5,617.88 | 5,612   | 110,729   |        | 保険                  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD  | 2,190    | 2,190    | 676     | 13,351    |        | 航空宇宙・防衛             |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD  | 1,932    | 1,532    | 3,014   | 59,485    |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H                                      | 2,860    | 1,900    | 2,097   | 41,385    |        | 自動車                 |
| WEICHAI POWER CO LTD   | 7,200    | 5,840    | 5,156   | 101,742   |        | 保険                  |
| CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO  | 5,470    | 4,190    | 7,273   | 143,512   |        | 金属・鉱業               |
| TINGYI HOLDING CORP  | 2,264    | 1,944    | 923     | 18,218    |        | ヘルスケア機器・用品          |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD  | 1,894.4  | 1,524.4  | 2,588   | 51,069    |        | 機械                  |
| GUANGDONG INVESTMENTS LTD  | —        | 1,140    | 998     | 19,703    |        | 石油・ガス・消耗燃料          |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD                   | 2,020    | 1,800    | 1,492   | 29,441    |        | 食品                  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS  | 580      | 460      | 2,366   | 46,694    |        | 飲料                  |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD   | 2,540    | 2,060    | 725     | 14,306    |        | 水道                  |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL   | 3,160    | —        | —       | —         |        | 医薬品                 |
| CHINA MENNIU DAIRY CO  | 1,533.33 | 1,293.33 | 4,151   | 81,910    |        | 飲料                  |
| TENCENT HOLDINGS LTD   | 1,000    | 940      | 475     | 9,384     |        | 運送インフラ              |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H   | 10,222.5 | 8,232.5  | 2,025   | 39,957    |        | 医薬品                 |
|  | 2,980    | 2,390    | 3,651   | 72,052    |        | 食品                  |
|  | 5,942    | 5,202    | 156,476 | 3,087,274 |        | インターネット・メディアおよびサービス |
|  | 6,060    | 5,250    | 15,828  | 312,301   |        | 保険                  |

| 銘<br>柄   | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |           |                       |                            | 業<br>種<br>等             |  |
|--|-------------|-------------|-----------|-----------------------|----------------------------|-------------------------|--|
|  |             | 株<br>数      | 株<br>数    | 評<br>価<br>額           |                            |                         |  |
|  |             |             |           | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |                         |  |
| (香港)   |             |             |           |                       |                            |                         |  |
| LI NING CO LTD                                     |             | 百株          | 百株        | 千香港・ドル                | 千円                         |                         |  |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD                |             | 2,240       | 1,935     | 3,335                 | 65,818                     | 織維・アパレル・贅沢品             |  |
| CHINA POWER INTERNATIONAL                          |             | 2,660       | 2,680     | 511                   | 10,099                     | 水道                      |  |
| AIR CHINA / HONG KONG                              |             | 5,430       | 3,480     | 1,117                 | 22,039                     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |  |
| ZTE CORP   |             | 1,960       | 1,560     | 567                   | 11,203                     | 旅客航空輸送                  |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD                        |             | 706.88      | 632.88    | 1,007                 | 19,878                     | 通信機器                    |  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD                     |             | 3,210       | 2,665     | 8,687                 | 171,412                    | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS                             |             | 2,852.5     | 2,212.5   | 1,911                 | 37,715                     | 海上運輸                    |  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD          |             | 8,052.05    | 6,862.05  | 3,568                 | 70,401                     | 銀行                      |  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC                      |             | 2,162.5     | 1,402.5   | 1,231                 | 24,295                     | 建設・土木                   |  |
| BAIDU INC  |             | 645         | 515       | 1,279                 | 25,249                     | 電子装置・機器・部品              |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK                            |             | 2,105.5     | 1,775     | 16,525                | 326,043                    | インターネット・メディアおよびサービス     |  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD          |             | 91,335.3    | 75,225.3  | 35,957                | 709,445                    | 銀行                      |  |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H                        |             | 778         | 667       | 4,655                 | 91,856                     | 織維・アパレル・贅沢品             |  |
| MINTH GROUP LTD                                    |             | 2,440       | 2,020     | 563                   | 11,119                     | 自動車                     |  |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD                    |             | 820         | —         | —                     | —                          | 自動車用部品                  |  |
| CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL                       |             | 1,620       | —         | —                     | —                          | 紙製品・林産品                 |  |
| BANK OF CHINA LTD                                  |             | 3,700       | 3,200     | 966                   | 19,067                     | 建設資材                    |  |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD                       |             | 75,262      | 61,802    | 20,271                | 399,947                    | 銀行                      |  |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD                        |             | 840         | —         | —                     | —                          | 不動産管理・開発                |  |
| IND & COMM BK OF CHINA - H                         |             | 3,724.7     | 3,084.7   | 9,793                 | 193,234                    | 銀行                      |  |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD                     |             | 54,302.35   | 51,062.35 | 20,527                | 404,998                    | 銀行                      |  |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING                        |             | 970         | 950       | 1,204                 | 23,766                     | 金属・鉱業                   |  |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES                      |             | 1,125       | —         | —                     | —                          | 電子装置・機器・部品              |  |
| CHINA COAL ENERGY CO                               |             | 2,856       | 1,476     | 538                   | 10,629                     | 建設・土木                   |  |
| HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD                 |             | 2,090       | 1,400     | 1,162                 | 22,926                     | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD                 |             | 500         | 550       | 1,399                 | 27,617                     | 機械                      |  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD                     |             | 535         | 376       | 1,094                 | 21,587                     | 機械                      |  |
| CMOC GROUP LIMITED                                 |             | 12,801.42   | —         | —                     | —                          | 不動産管理・開発                |  |
| CHINA CITIC BANK-H                                 |             | 3,030       | 3,150     | 2,321                 | 45,804                     | 金属・鉱業                   |  |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD              |             | 8,418       | 6,788     | 2,918                 | 57,588                     | 銀行                      |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD                           |             | 671         | 587       | 2,198                 | 43,372                     | 電子装置・機器・部品              |  |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD                   |             | 1,156       | 1,022     | 8,339                 | 164,538                    | 織維・アパレル・贅沢品             |  |
| FOSUN INTERNATIONAL                                |             | 350         | —         | —                     | —                          | 家庭用品                    |  |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD                    |             | 2,130.28    | 2,420.28  | 1,026                 | 20,246                     | コングロマリット                |  |
| BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD                |             | 5,580       | —         | —                     | —                          | 不動産管理・開発                |  |
| KINGSOFT CORP LTD                                  |             | 2,840       | 3,160     | 1,251                 | 24,689                     | 織維・アパレル・贅沢品             |  |
| GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD                       |             | 988         | 762       | 1,882                 | 37,134                     | 娯楽                      |  |
| SINOTRUK HONG KONG LTD                             |             | 19,060      | 15,820    | 1,756                 | 34,646                     | 半導体・半導体製造装置             |  |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD                            |             | —           | 480       | 1,080                 | 21,308                     | 機械                      |  |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD                   |             | 3,950       | 3,510     | 1,446                 | 28,531                     | 建設・土木                   |  |
| DONGYUE GROUP                                      |             | 1,520       | —         | —                     | —                          | 食品                      |  |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD                |             | 1,590       | —         | —                     | —                          | 化学                      |  |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD                       |             | 710         | 635       | 1,568                 | 30,945                     | 通信機器                    |  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD               |             | 4,920       | 4,230     | 1,865                 | 36,804                     | 食品                      |  |
| CRRC CORP LTD - H                                  |             | 2,494       | 1,960     | 2,916                 | 57,542                     | 保険                      |  |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS                        |             | 3,960       | 3,420     | 1,590                 | 31,376                     | 機械                      |  |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD                  |             | 1,145       | —         | —                     | —                          | 織維・アパレル・贅沢品             |  |
| SINOPHARM GROUP CO                                 |             | 1,430       | 920       | 648                   | 12,796                     | 医薬品                     |  |
| CHINA RESOURCES CEMENT                             |             | 1,224       | 1,040     | 2,063                 | 40,710                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD                  |             | 1,920       | —         | —                     | —                          | 建設資材                    |  |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD                           |             | 2,905.27    | 2,145.27  | 662                   | 13,078                     | 自動車                     |  |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP                    |             | 2,090       | 2,040     | 2,031                 | 40,088                     | 金属・鉱業                   |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD            |             | 3,100       | 2,280     | 1,290                 | 25,461                     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |  |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD                  |             | 613         | 704       | 753                   | 14,862                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD |             | 1,850       | 1,416     | 1,458                 | 28,775                     | 専門小売り                   |  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD                         |             | 990         | 970       | 513                   | 10,124                     | 機械                      |  |
|  |             | 1,710       | 1,550     | 1,426                 | 28,134                     | 不動産管理・開発                |  |

| 銘<br>柄                                      | 期 首(前期末)  | 当 期 末     |        |           |        | 業 種 等                   |
|---|-----------|-----------|--------|-----------|--------|-------------------------|
|   |           | 株 数       | 株 数    | 評 価 額     | 邦貨換算金額 |                         |
|   |           |           |        | 外 貨 建 金 額 |        |                         |
| (香港)  |           |           |        |           |        |                         |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD             | 百株        | 百株        | 千香港・ドル | 千円        |        | 保険                      |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD             | 883       | 690       | 903    | 17,833    |        | 銀行                      |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD              | 6,281.56  | 5,316.56  | 1,462  | 28,846    |        | 建設関連製品                  |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD                | 1,060     | —         | —      | —         |        | 銀行                      |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA                  | 2,270     | 2,270     | 513    | 10,121    |        | 銀行                      |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD               | 28,560    | 21,570    | 7,312  | 144,270   |        | 銀行                      |
| FAR EAST HORIZON LTD                        | 615       | 680       | 874    | 17,253    |        | 専門小売り                   |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP                   | 1,200     | 1,690     | 941    | 18,572    |        | 金融サービス                  |
| CITIC SECURITIES CO LTD                     | 612       | —         | —      | —         |        | ヘルスケア機器・用品              |
| HAITONG SECURITIES CO LTD                   | 1,950     | 1,290     | 1,426  | 28,149    |        | 資本市場                    |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD    | 2,604     | 2,396     | 838    | 16,545    |        | 資本市場                    |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD  | 8,360     | 6,720     | 1,693  | 33,411    |        | 保険                      |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD              | 460       | 270       | 311    | 6,136     |        | 医薬品                     |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP               | 3,480     | 2,650     | 1,014  | 20,024    |        | 資本市場                    |
| CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD         | 9,860     | 9,860     | 0      | 0         |        | 半導体・半導体製造装置             |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD              | 3,230     | 3,230     | 0      | 0         |        | 食品                      |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD         | 1,760     | —         | —      | —         |        | 不動産管理・開発                |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD             | 7,140     | 5,860     | 2,326  | 45,900    |        | 銀行                      |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP                      | 410       | —         | —      | —         |        | 食品                      |
| EAST BUY HOLDING LTD                        | 1,140     | 840       | 966    | 19,059    |        | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD     | 425       | 325       | 510    | 10,067    |        | 生活必需品流通・小売り             |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD    | 2,020     | —         | —      | —         |        | 不動産管理・開発                |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD                 | 561       | —         | —      | —         |        | 生活必需品流通・小売り             |
| CHINA TOWER CORP LTD                        | 617.5     | 640       | 1,162  | 22,930    |        | 金属・鉱業                   |
| XIAOMI CORP                                 | 42,920    | 36,740    | 3,306  | 65,239    |        | 各種電気通信サービス              |
| BEIGENE LTD                                 | 14,496    | 12,164    | 19,802 | 390,713   |        | コンピュータ・周辺機器             |
| WUXI APPTEC CO LTD                          | 582       | 546       | 4,425  | 87,311    |        | バイオテクノロジー               |
| MEITUAN                                     | 344.12    | 241.12    | 829    | 16,365    |        | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD               | 4,712.1   | 4,002.1   | 39,040 | 770,268   |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD          | 1,280     | 1,048     | 2,310  | 45,592    |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD                    | 1,020     | 1,360     | 2,238  | 44,166    |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INNOVON BIOLOGICS INC                       | 4,900     | 3,860     | 2,084  | 41,125    |        | 半導体・半導体製造装置             |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD         | 1,030     | 985       | 3,378  | 66,658    |        | バイオテクノロジー               |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD             | 9,970     | 8,920     | 561    | 11,087    |        | 資本市場                    |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD            | 520       | —         | —      | —         |        | 専門小売り                   |
| ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOGY LTD           | 1,435     | —         | —      | —         |        | 建設・土木                   |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD        | —         | 403       | 945    | 18,645    |        | 自動車                     |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD          | 1,520     | 1,330     | 674    | 13,304    |        | 専門小売り                   |
| CHINA FEIHE LTD                             | 1,280     | 880       | 1,388  | 27,397    |        | 医薬品                     |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD                   | 3,740     | 3,410     | 1,404  | 27,719    |        | 食品                      |
| PHARMARON BEIJING CO LTD                    | 14,176.68 | 12,801.68 | 87,051 | 1,717,524 |        | 大規模小売り                  |
| JD.COM INC                                  | 193       | —         | —      | —         |        | ライフサイエンス・ツール／サービス       |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD           | 2,063.85  | 1,851.35  | 18,282 | 360,705   |        | 大規模小売り                  |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD      | 1,840     | 1,400     | 957    | 18,893    |        | タバコ                     |
| JIUMAOJU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD         | 76        | 76        | 503    | 9,926     |        | 専門小売り                   |
| KUAISHOU TECHNOLOGY                         | 690       | —         | —      | —         |        | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HAIER SMART HOME CO LTD                     | 1,672     | 1,862     | 8,500  | 167,705   |        | インターネット・メディアおよびサービス     |
| BILIBILI INC                                | 2,202     | 1,978     | 5,043  | 99,516    |        | 家庭用耐久財                  |
| AKESO INC                                   | 194.2     | 156.4     | 1,373  | 27,093    |        | 娯楽                      |
| NETEASE INC                                 | 410       | 400       | 1,870  | 36,895    |        | バイオテクノロジー               |
| GDS HOLDINGS LTD                            | 1,876     | 1,527     | 21,545 | 425,101   |        | 情報技術サービス                |
| ZAI LAB LTD                                 | 905       | —         | —      | —         |        | バイオテクノロジー               |
| NONGFU SPRING CO LTD                        | —         | 705       | 789    | 15,578    |        | 飲料                      |
| LI AUTO INC                                 | 1,656     | 1,570     | 6,672  | 131,648   |        | 自動車                     |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC                 | 1,058     | 906       | 10,409 | 205,388   |        | 生活必需品流通・小売り             |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD           | 1,047     | 880.5     | 2,033  | 40,129    |        | ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD | 302       | 304       | 881    | 17,393    |        | 不動産管理・開発                |
|   | 692       | 632       | 1,636  | 32,295    |        |                         |

| 銘柄  | 期首(前期末)          | 当期末        |            |         |            | 業種等                |
|---|------------------|------------|------------|---------|------------|--------------------|
|   |                  | 株数         | 株数         | 評価額     | 邦貨換算金額     |                    |
|   |                  |            |            | 外貨建金額   |            |                    |
| (香港)  |                  |            |            |         |            |                    |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD           | 百株               | 百株         | 千香港・ドル     | 千円      |            | ライフサイエンス・ツール／サービス  |
| CHINA VANKE CO LTD-H                          | 126              | —          | —          | —       |            | 不動産管理・開発           |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC | 1,746.61         | 1,631.61   | 623        | 12,297  |            | 各種消費者サービス          |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD              | 1,504            | 1,179      | 7,934      | 156,551 |            | 専門小売り              |
| JD LOGISTICS INC                              | 496              | 356        | 1,087      | 21,457  |            | 航空貨物・物流サービス        |
| GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD                  | —                | 1,481      | 1,118      | 22,061  |            | パーソナルケア用品          |
| TRIP.COM GROUP LTD                            | —                | 240        | 1,104      | 21,781  |            | ホテル・レストラン・レジャー     |
| XPENG INC                                     | —                | 434.5      | 16,641     | 328,333 |            | 自動車                |
| MINISO GROUP HOLDING LTD                      | 786              | 862        | 2,435      | 48,045  |            | 大規模小売り             |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD                    | —                | 286        | 1,111      | 21,922  |            | 半導体・半導体製造装置        |
| CGN POWER CO LTD                              | 530              | 420        | 608        | 11,998  |            | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GF SECURITIES CO LTD                          | 10,430           | 8,260      | 2,147      | 42,372  |            | 資本市場               |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD             | 1,060            | 832        | 611        | 12,065  |            | 自動車用部品             |
| HUATAI SECURITIES CO LTD                      | 616              | 484        | 1,957      | 38,626  |            | 資本市場               |
| 3SBIO INC                                     | 1,494            | 806        | 698        | 13,787  |            | バイオテクノロジー          |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD      | 1,465            | —          | —          | —       |            | 医薬品                |
| CHINA LITERATURE LTD                          | 1,825            | 955        | 454        | 8,968   |            | メディア               |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD                       | 386              | 272        | 701        | 13,845  |            | 半導体・半導体製造装置        |
| DALI FOODS GROUP CO LTD                       | 430              | 250        | 429        | 8,474   |            | 食品                 |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD          | 2,615            | —          | —          | —       |            | 不動産管理・開発           |
| BOC AVIATION LTD                              | 1,450            | 1,000      | 410        | 8,089   |            | 商社・流通業             |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD           | 236              | 135        | 843        | 16,647  |            | 保険                 |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD                      | 617              | 612        | 741        | 14,634  |            | 自動車                |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD          | 1,240            | 980        | 1,254      | 24,749  |            | 資本市場               |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC                     | 1,440            | 1,228      | 1,025      | 20,230  |            | バイオテクノロジー・ツール／サービス |
| HENTEN NETWORKS GROUP LTD                     | 3,410            | 3,080      | 4,102      | 80,943  |            | 娯楽                 |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD                  | 4,360            | 5,200      | 878        | 17,338  |            | 化学                 |
| C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD        | 372.4            | 330.4      | 773        | 15,253  |            | 不動産管理・開発           |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 810,633.78 | 643,406.14 | 816,768 | 16,114,834 |                    |
|   |                  | 191銘柄      | 168銘柄      | —       | <17.5%>    |                    |
| (台湾)  |                  |            |            |         |            |                    |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP                        | 百株               | 百株         | 千台湾・ドル     | 千円      |            | 通信機器               |
| ACER INC                                      | 489.06           | 406.33     | 16,578     | 78,789  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| ASUSTEK COMPUTER INC                          | 2,573.85         | 2,139.47   | 9,638      | 45,807  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP                    | 668.28           | 571.08     | 24,470     | 116,299 |            | 半導体・半導体製造装置        |
| ASIA CEMENT CORP                              | 425.9            | 372.97     | 21,259     | 101,036 |            | 建設資材               |
| TAIWAN BUSINESS BANK                          | 2,361.05         | 1,647.78   | 6,830      | 32,460  |            | 銀行                 |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP     | 5,515.58         | 4,983.99   | 7,974      | 37,899  |            | 半導体・半導体製造装置        |
| GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD                    | 960              | 830.53     | 7,034      | 33,432  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD               | —                | 416.46     | 12,826     | 60,961  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP                     | 700              | 573.35     | 9,259      | 44,007  |            | 電子装置・機器・部品         |
| QUANTA COMPUTER INC                           | 1,185.01         | 1,095.25   | 19,604     | 93,174  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| EVA AIRWAYS CORP                              | 2,535.29         | 2,156.97   | 54,894     | 260,893 |            | 旅客航空輸送             |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD                     | 2,550            | 1,919.77   | 5,951      | 28,284  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK                     | 657.6            | 449.75     | 9,242      | 43,925  |            | 銀行                 |
| CHINA AIRLINES                                | 4,354.21         | 3,776.85   | 6,722      | 31,950  |            | 旅客航空輸送             |
| CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO                 | 2,900            | 2,318.23   | 4,462      | 21,208  |            | 自動車用部品             |
| CHINA STEEL CORP                              | 1,781.69         | 1,606.84   | 7,712      | 36,656  |            | 金属・鉱業              |
| ADVANTECH CO LTD                              | 11,182.31        | 9,646.7    | 23,586     | 112,095 |            | コンピュータ・周辺機器        |
| COMPAL ELECTRONICS INC                        | 386.68           | 389.79     | 14,461     | 68,728  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| DELTA ELECTRONICS INC                         | 3,902.91         | 3,534.45   | 12,582     | 59,800  |            | コンピュータ・周辺機器        |
| NANYA TECHNOLOGY CORP                         | 1,859.04         | 1,539.77   | 46,270     | 219,903 |            | 電子装置・機器・部品         |
| CHUNGHWACHEL COM CO LTD                       | 1,340            | 1,107.88   | 7,145      | 33,961  |            | 半導体・半導体製造装置        |
| AUO CORP                                      | 3,672.99         | 3,005.65   | 37,119     | 176,415 |            | 各種電気通信サービス         |
| TAIWAN MOBILE CO LTD                          | 6,186.49         | 5,265      | 9,240      | 43,914  |            | 電子装置・機器・部品         |
| EVERGREEN MARINE CORP                         | 1,681            | 1,477.84   | 15,073     | 71,640  |            | 無線通信サービス           |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP                  | 948.26           | 746.24     | 12,723     | 60,469  |            | 海上運輸               |
|   | 3,013.39         | 2,257.68   | 7,213      | 34,281  |            | コングロマリット           |

| 銘<br>柄                                 | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |           |                       |                            | 業<br>種<br>等 |  |
|--|-------------|-------------|-----------|-----------------------|----------------------------|-------------|--|
|  |             | 株<br>数      | 株<br>数    | 評<br>価<br>額           |                            |             |  |
|  |             |             |           | 外<br>貨<br>建<br>金<br>額 | 邦<br>貨<br>換<br>算<br>金<br>額 |             |  |
| (台湾)                                   |             | 百株          | 百株        | 千台湾・ドル                | 千円                         |             |  |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD             | 447.68      | 401.31      | 6,320     | 30,039                | 織維・アパレル・贅沢品                |             |  |
| ECLAT TEXTILE CO LTD                   | 193.22      | 147.8       | 7,316     | 34,770                | 織維・アパレル・贅沢品                |             |  |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD           | 545.64      | 469.61      | 29,162    | 138,599               | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| FORMOSA PLASTICS CORP                  | 3,939.52    | 3,128.57    | 21,211    | 100,810               | 化学                         |             |  |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO           | 3,339.38    | 2,810.26    | 15,062    | 71,588                | 化学                         |             |  |
| GIANT MANUFACTURING                    | 312.44      | —           | —         | —                     | レジャー用品                     |             |  |
| MEDIATEK INC                           | 1,449.75    | 1,198.81    | 125,875   | 598,233               | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD         | 7,123.07    | 6,014.88    | 39,698    | 188,669               | 保険                         |             |  |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD      | 8,260.67    | 6,780.42    | 15,222    | 72,344                | 銀行                         |             |  |
| HOTAI MOTOR CO LTD                     | 280.81      | 235.56      | 14,274    | 67,843                | 専門小売り                      |             |  |
| FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD  | 1,650       | 1,503.43    | 12,087    | 57,447                | 無線通信サービス                   |             |  |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD        | 9,464.4     | 7,891       | 23,673    | 112,508               | 金融サービス                     |             |  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO            | 8,249.24    | 7,306.72    | 34,999    | 166,337               | 保険                         |             |  |
| CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING           | 14,338.46   | 12,343.86   | 16,479    | 78,318                | 保険                         |             |  |
| E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD         | 12,089.06   | 11,032.18   | 29,235    | 138,943               | 銀行                         |             |  |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY             | 12,017.73   | 9,831.77    | 144,035   | 684,542               | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD          | 10,509.83   | 9,091.73    | 35,457    | 168,516               | 銀行                         |             |  |
| LARGAN PRECISION CO LTD                | 95.66       | 76.04       | 16,728    | 79,505                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD      | 9,990.73    | 9,343.91    | 16,398    | 77,935                | 銀行                         |             |  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO         | 12,453.81   | 10,480.98   | 8,510     | 40,447                | 保険                         |             |  |
| INVENTEC CO LTD                        | 2,700.05    | 1,968.49    | 10,649    | 50,612                | コンピュータ・周辺機器                |             |  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP                | 1,913.35    | 1,652.21    | 15,910    | 75,617                | コンピュータ・周辺機器                |             |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD      | 10,494.72   | 8,366.86    | 18,030    | 85,692                | 銀行                         |             |  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD          | 16,741.73   | 13,870.73   | 43,692    | 207,654               | 銀行                         |             |  |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD         | 9,941.62    | 8,599.97    | 23,133    | 109,946               | 銀行                         |             |  |
| NAN YA PLASTICS CORP                   | 4,511.51    | 3,758.94    | 20,674    | 98,256                | 化学                         |             |  |
| WISTRON CORP                           | —           | 2,102.11    | 24,069    | 114,391               | コンピュータ・周辺機器                |             |  |
| POU CHEN CORP                          | 2,339.9     | 1,682.25    | 5,803     | 27,582                | 織維・アパレル・贅沢品                |             |  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP         | 4,625.95    | 3,684.78    | 27,783    | 132,042               | 食品                         |             |  |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP             | 523.09      | 437.96      | 11,934    | 56,719                | 生活必需品流通・小売り                |             |  |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP             | 1,127.06    | 873.41      | 6,140     | 29,181                | 石油・ガス・消耗燃料                 |             |  |
| E INK HOLDINGS INC                     | 839.2       | 686.2       | 15,713    | 74,682                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD             | 1,743.36    | 1,215.17    | 4,234     | 20,126                | 不動産管理・開発                   |             |  |
| SYNTEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP   | 1,161.74    | 907.18      | 6,985     | 33,198                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| TAIWAN CEMENT CORP                     | 5,712.01    | 5,481.63    | 17,897    | 85,059                | 建設資材                       |             |  |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR                   | 23,548.79   | 19,374.36   | 1,557,698 | 7,403,118             | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP           | 11,311.88   | 8,998.43    | 45,262    | 215,112               | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| WAN HAI LINES LTD                      | 787.47      | 514.82      | 2,203     | 10,472                | 海上運輸                       |             |  |
| WALSIN LIHWA CORP                      | 2,461.63    | 2,216.05    | 8,941     | 42,496                | 電気設備                       |             |  |
| WINBOND ELECTRONICS CORP               | 2,580.59    | 2,476.93    | 6,452     | 30,665                | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| YAGEO CORP                             | 329.04      | 271.65      | 16,108    | 76,558                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| YANG MING MARINE TRANSPORT             | 1,656.08    | 1,259.96    | 5,537     | 26,317                | 海上運輸                       |             |  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP            | 1,930       | 1,454.65    | 4,305     | 20,463                | 運送インフラ                     |             |  |
| GLOBAL UNICHIP CORP                    | —           | 69.04       | 8,284     | 39,374                | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| INNOLUX CORPORATION                    | 9,107.42    | 6,913.96    | 9,437     | 44,852                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| WPG HOLDINGS CO LTD                    | 1,652.03    | 1,191.87    | 11,012    | 52,339                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP      | 200.79      | 175.65      | 3,188     | 15,151                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| EMMEMORY TECHNOLOGY INC                | 60.64       | 49.25       | 11,672    | 55,473                | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| PEGATRON CORP                          | 1,918.8     | 1,588.74    | 15,315    | 72,788                | コンピュータ・周辺機器                |             |  |
| ALCHIP TECHNOLOGIES LTD                | —           | 56.57       | 16,405    | 77,967                | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP             | 130.87      | 112.48      | 12,541    | 59,604                | 機械                         |             |  |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP                | 304.7       | —           | —         | —                     | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD               | 1,350.42    | 1,203.33    | 20,516    | 97,508                | 金融サービス                     |             |  |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD                | 80          | 58.51       | 4,938     | 23,469                | 半導体・半導体製造装置                |             |  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD       | 629.23      | 469.6       | 5,329     | 25,331                | 電子装置・機器・部品                 |             |  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING   | 9,165.76    | 7,762.14    | 19,948    | 94,808                | 銀行                         |             |  |
| SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD | 3,834.37    | 3,225.7     | 14,967    | 71,133                | 銀行                         |             |  |

| 銘柄   | 期首(前期末)          | 当期末               |                     |                |                       | 業種等 |
|--|------------------|-------------------|---------------------|----------------|-----------------------|-----|
|  |                  | 株数                | 株数                  | 評価額            | 邦貨換算金額                |     |
|  |                  | 外貨建金額             |                     |                |                       |     |
| (台湾)                                       |                  |                   |                     |                |                       |     |
| VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP            | 百株<br>59.93      | 百株<br>49.34       | 千台湾・ドル<br>8,042     | 千円<br>38,222   | 電気設備                  |     |
| WIVYNN CORP                                | 80               | 77.91             | 18,620              | 88,495         | コンピュータ・周辺機器           |     |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD              | 3,129.76         | 2,447.35          | 38,178              | 181,447        | 半導体・半導体製造装置           |     |
| SILERGY CORP                               | 303.33           | 263.96            | 9,726               | 46,228         | 半導体・半導体製造装置           |     |
| POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP | 2,630.9          | 2,486.47          | 5,880               | 27,947         | 半導体・半導体製造装置           |     |
| PHARMAESSENTIA CORP                        | 205.76           | 175.93            | 5,401               | 25,669         | バイオテクノロジー             |     |
| MOMO.COM INC                               | 66               | —                 | —                   | —              | 大規模小売り                |     |
| GLOBALWAFERS CO LTD                        | 200.53           | 171.28            | 9,317               | 44,282         | 半導体・半導体製造装置           |     |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD                | 151.7            | 146.58            | 5,306               | 25,218         | 家庭用耐久財                |     |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 324,825.4<br>88銘柄 | 274,875.86<br>89銘柄  | 3,174,827<br>— | 15,088,683<br><16.4%> |     |
| (トルコ)                                      |                  |                   |                     |                |                       |     |
| AKBANK TAS                                 | 百株<br>2,866.08   | 百株<br>2,245.07    | 千トルコ・リラ<br>12,583   | 千円<br>59,831   | 銀行                    |     |
| ASESAN ELEKTRONIK SANAYI                   | 738.27           | 1,088.54          | 6,280               | 29,863         | 航空宇宙・防衛               |     |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS      | 1,257.64         | 1,076.71          | 4,319               | 20,539         | 金属・鉱業                 |     |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS                    | 74.1             | 56.91             | 6,362               | 30,251         | 自動車                   |     |
| HEKTAS TICARET TAS                         | 1,211.18         | —                 | —                   | —              | 化学                    |     |
| KOC HOLDING AS                             | 715.98           | 598.63            | 12,984              | 61,736         | コングロマリット              |     |
| SASA POLYESTER SANAYI                      | 469.86           | 1,052.3           | 4,196               | 19,953         | 化学                    |     |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS            | 1,445.86         | 1,090             | 5,090               | 24,202         | コングロマリット              |     |
| TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS           | —                | 95.53             | 2,481               | 11,798         | 自動車                   |     |
| TURK HAVA YOLLARI                          | 496.83           | 446.86            | 13,193              | 62,731         | 旅客航空輸送                |     |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS                | 1,060.83         | 838.1             | 6,277               | 29,847         | 無線通信サービス              |     |
| TURKIYE IS BANKASI                         | 3,158.42         | 6,571.93          | 8,057               | 38,309         | 銀行                    |     |
| TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE               | 948.78           | 798.7             | 14,895              | 70,824         | 石油・ガス・消耗燃料            |     |
| YAPI VE KREDI BANKASI AS                   | 3,137.27         | 2,811.9           | 8,598               | 40,884         | 銀行                    |     |
| HACI OMER SABANCI HOLDING AS               | 923.61           | 827.71            | 6,911               | 32,861         | 銀行                    |     |
| COCA-COLA ICECEK AS                        | —                | 63.4              | 4,216               | 20,046         | 飲料                    |     |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS                  | 399.99           | 369.89            | 14,342              | 68,194         | 生活必需品流通・小売り           |     |
| KOZA ALTIN ISLETMELERİ AS                  | 784.29           | —                 | —                   | —              | 金属・鉱業                 |     |
| PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS               | 34.88            | 34.31             | 2,880               | 13,695         | 旅客航空輸送                |     |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 19,723.87<br>17銘柄 | 20,066.49<br>17銘柄   | 133,672<br>—   | 635,571<br><0.7%>     |     |
| (メキシコ)                                     |                  |                   |                     |                |                       |     |
| ALFA SAB DE CV                             | 百株<br>2,346      | 百株<br>2,629       | 千メキシコ・ペソ<br>3,191   | 千円<br>29,055   | コングロマリット              |     |
| GRUPO BIMBO SAB DE CV                      | 1,304            | 1,052             | 6,960               | 63,362         | 食品                    |     |
| GRUMA SAB DE CV                            | 182.7            | 161.15            | 5,023               | 45,734         | 食品                    |     |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA   | 226.6            | 158.6             | 2,776               | 25,275         | 運送インフラ                |     |
| GRUPO CARSO SAB DE CV                      | 485              | 421               | 5,725               | 52,124         | コングロマリット              |     |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV         | 2,474            | 2,068             | 35,457              | 322,798        | 銀行                    |     |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV               | 842.25           | 870.25            | 2,919               | 26,579         | 化学                    |     |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV               | 123.1            | 154.95            | 4,728               | 43,050         | 金属・鉱業                 |     |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV         | 1,364            | 1,216             | 4,583               | 41,723         | 家庭用品                  |     |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV  | 187.55           | 139.5             | 7,188               | 65,441         | 運送インフラ                |     |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV                     | 2,938.52         | 2,506.52          | 25,624              | 233,274        | 金属・鉱業                 |     |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA SA                | 2,199            | 1,532             | 7,517               | 68,437         | 銀行                    |     |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV                 | 447              | 397               | 6,656               | 60,602         | 飲料                    |     |
| WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV               | 4,998            | 4,192             | 26,719              | 243,249        | 生活必需品流通・小売り           |     |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | 348.65           | 327.25            | 8,579               | 78,102         | 運送インフラ                |     |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO             | —                | 228               | 3,679               | 33,498         | 運送インフラ                |     |
| OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV      | 1,014            | 1,040             | 2,057               | 18,727         | 各種電気通信サービス            |     |
| AMERICA MOVIL SAB DE CV                    | 26,406.78        | 14,816.78         | 22,669              | 206,377        | 無線通信サービス              |     |
| BANCO DEL BAJIO SA                         | 686              | 558               | 3,398               | 30,936         | 銀行                    |     |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 48,573.15<br>18銘柄 | 34,468<br>19銘柄      | 185,457<br>—   | 1,688,351<br><1.8%>   |     |
| (フィリピン)                                    |                  |                   |                     |                |                       |     |
| AYALA LAND INC                             | 百株<br>7,555      | 百株<br>4,968       | 千フィリピン・ペソ<br>13,388 | 千円<br>36,150   | 不動産管理・開発              |     |

| 銘柄  | 期首(前期末)          | 当期末                |                    |                |                    | 業種等 |
|---|------------------|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|-----|
|   |                  | 株数                 | 株数                 | 評価額            | 邦貨換算金額             |     |
|   |                  | 外貨建金額              |                    |                |                    |     |
| (フィリピン)                                   |                  |                    |                    |                |                    |     |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC               | 百株<br>1,581.2    | 百株<br>1,513.9      | 千円<br>6,070        | 16,391         | コングロマリット           |     |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND             | 2,049.93         | 1,444.48           | 17,044             | 46,022         | 銀行                 |     |
| AYALA CORP                                | 210.83           | 214.63             | 12,738             | 34,394         | コングロマリット           |     |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC | 963.7            | 797.6              | 25,124             | 67,838         | 運送インフラ             |     |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC                    | 3,182.9          | 2,049.6            | 5,984              | 16,159         | コングロマリット           |     |
| JOLLIBEE FOODS CORP                       | 469.6            | 342.4              | 7,656              | 20,672         | ホテル・レストラン・レジャー     |     |
| METROPOLITAN BANK & TRUST                 | 1,433.05         | 1,164.55           | 7,686              | 20,753         | 銀行                 |     |
| BDO UNIBANK INC                           | 2,300.62         | 1,896.82           | 28,452             | 76,824         | 銀行                 |     |
| PLDT INC                                  | 89.85            | 56.9               | 7,397              | 19,972         | 無線通信サービス           |     |
| SM PRIME HOLDINGS INC                     | 10,577.75        | 8,433.75           | 23,825             | 64,330         | 不動産管理・開発           |     |
| UNIVERSAL ROBINA CORP                     | 736.1            | 754.5              | 7,243              | 19,557         | 食品                 |     |
| SM INVESTMENTS CORP                       | 241.33           | 193.83             | 18,181             | 49,091         | コングロマリット           |     |
| MANILA ELECTRIC COMPANY                   | 247.2            | 244.2              | 8,791              | 23,737         | 電力                 |     |
| ACEN CORP                                 | 461.19           | —                  | —                  | —              | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |     |
| MONDE NISSIN CORP                         | 6,492            | —                  | —                  | —              | 食品                 |     |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 38,592.25<br>16銘柄  | 24,075.16<br>14銘柄  | 189,584<br>—   | 511,896<br><0.6%>  |     |
| (チリ)                                      |                  |                    |                    |                |                    |     |
| BANCO SANTANDER CHILE                     | 百株<br>68,685.1   | 百株<br>52,798.08    | 千円<br>242,079      | 38,211         | 銀行                 |     |
| BANCO DE CREDITO E INVERSIONES            | 57.09            | 70.27              | 186,981            | 29,514         | 銀行                 |     |
| BANCO DE CHILE                            | 46,141.1         | 34,257.13          | 367,236            | 57,966         | 銀行                 |     |
| EMPRESAS CMPC SA                          | 1,192.58         | 849.02             | 161,313            | 25,462         | 紙製品・林産品            |     |
| EMPRESAS COPEC SA                         | 404.23           | 299.69             | 209,783            | 33,113         | 石油・ガス・消耗燃料         |     |
| CIA CERVEcerIAS UNIDAS SA                 | 105.16           | —                  | —                  | —              | 飲料                 |     |
| CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA           | 11,784.8         | 11,739.23          | 84,170             | 13,285         | 海上運輸               |     |
| ENEL AMERICAS SA                          | 21,331.52        | 16,834.61          | 152,841            | 24,125         | 電力                 |     |
| LATAM AIRLINES GROUP SA                   | —                | 138,235.87         | 170,306            | 26,882         | 旅客航空輸送             |     |
| SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA     | 133.94           | 115.01             | 519,155            | 81,946         | 電気設備               |     |
| FALABELLA SA                              | 807.36           | 634.7              | 156,136            | 24,645         | 大規模小売り             |     |
| CENSOUSD SA                               | 1,169.08         | 1,162.72           | 191,499            | 30,227         | 生活必需品流通・小売り        |     |
| ENEL CHILE SA                             | 24,157.02        | 19,304.15          | 109,068            | 17,216         | 電力                 |     |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 175,968.98<br>12銘柄 | 276,300.48<br>12銘柄 | 2,550,571<br>— | 402,597<br><0.4%>  |     |
| (コロンビア)                                   |                  |                    |                    |                |                    |     |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP            | 百株<br>485.42     | 百株<br>311.05       | 千円<br>572,332      | 22,643         | 電力                 |     |
| BANCOLOMBIA SA                            | 203.22           | 200.49             | 686,477            | 27,159         | 銀行                 |     |
| BANCOLOMBIA SA-PREF                       | 456.92           | 327.07             | 1,062,977          | 42,054         | 銀行                 |     |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,145.56<br>3銘柄    | 838.61<br>3銘柄      | 2,321,787<br>— | 91,856<br><0.1%>   |     |
| (クエート)                                    |                  |                    |                    |                |                    |     |
| KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP                 | 百株<br>7,714.53   | 百株<br>7,352.44     | 千円<br>522          | 262,217        | 銀行                 |     |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC          | 1,997            | 1,523.16           | 73                 | 37,107         | 無線通信サービス           |     |
| GULF BANK KSCP                            | 1,363.55         | 1,543.4            | 39                 | 20,079         | 銀行                 |     |
| NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP              | 7,175.18         | 6,316.68           | 533                | 268,112        | 銀行                 |     |
| AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC         | 1,379.27         | 1,251.43           | 64                 | 32,310         | 航空貨物・物流サービス        |     |
| MABANEE CO KPSC                           | 727.04           | 490.98             | 38                 | 19,286         | 不動産管理・開発           |     |
| BOUBYAN BANK KSCP                         | 1,444.41         | 1,074.29           | 65                 | 33,079         | 銀行                 |     |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 21,800.98<br>7銘柄   | 19,552.38<br>7銘柄   | 1,338<br>—     | 672,192<br><0.7%>  |     |
| (カタール)                                    |                  |                    |                    |                |                    |     |
| QATAR NATIONAL BANK                       | 百株<br>4,414.61   | 百株<br>3,646.84     | 千円<br>5,196        | 220,497        | 銀行                 |     |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC              | 3,122.67         | 2,686.21           | 1,141              | 48,439         | 銀行                 |     |
| OOREDOQ QSC                               | 860.85           | 609.2              | 620                | 26,339         | 各種電気通信サービス         |     |
| QATAR FUEL QSC                            | 513.75           | 462.22             | 686                | 29,123         | 石油・ガス・消耗燃料         |     |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO              | 384.78           | 374.16             | 606                | 25,750         | 総合公益事業             |     |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC      | 866.84           | 696.58             | 726                | 30,826         | 銀行                 |     |
| INDUSTRIES QATAR QSC                      | 1,384.6          | 1,122.06           | 1,374              | 58,321         | コングロマリット           |     |

| 銘柄   | 期首(前期末)          | 当期末              |           |           |         | 業種等                     |
|--|------------------|------------------|-----------|-----------|---------|-------------------------|
|  |                  | 株数               | 株数        | 評価額       | 邦貨換算金額  |                         |
|  |                  | 外貨建金額            |           |           |         |                         |
| (カタール)   |                  |                  |           |           |         |                         |
| QATAR ISLAMIC BANK SAQ                         | 百株               | 千カタール・リアル        | 千円        |           |         |                         |
| QATAR GAS TRANSPORT CO LTD                     | 1,556.84         | 1,352.11         | 2,495     | 105,905   |         | 銀行                      |
| MASRAF AL RAYAN                                | 2,494.88         | 1,901.07         | 745       | 31,619    |         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BARWA REAL ESTATE CO                           | 5,542.59         | 4,791.5          | 1,212     | 51,435    |         | 銀行                      |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO              | 2,038.13         | 1,901.41         | 555       | 23,557    |         | 不動産管理・開発                |
| DUKHAN BANK                                    | 4,516.62         | 4,291.05         | 819       | 34,775    |         | 化学                      |
|  | —                | 1,315.18         | 511       | 21,707    |         | 銀行                      |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 27,697.16        | 25,149.59 | 16,693    | 708,299 |                         |
| (サウジアラビア)                                      |                  |                  |           |           |         |                         |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO                | 百株               | 千サウジアラビア・リアル     | 千円        |           |         |                         |
| JARIR MARKETING CO                             | 260.55           | 215.87           | 804       | 33,161    |         | 化学                      |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE                   | 61.27            | 454.3            | 662       | 27,316    |         | 専門小売り                   |
| ETIHAD ETISALAT CO                             | —                | 56.9             | 853       | 35,198    |         | 保険                      |
| SAUDI BRITISH BANK                             | 385.69           | 311.95           | 1,600     | 65,996    |         | 無線通信サービス                |
| AL RAJHI BANK                                  | 856.85           | 803.49           | 3,213     | 132,543   |         | 銀行                      |
| ARAB NATIONAL BANK                             | 1,867.14         | 1,530.72         | 12,322    | 508,171   |         | 銀行                      |
| BANK ALBILAD                                   | 584.12           | 555.19           | 1,612     | 66,512    |         | 銀行                      |
| BANK AL-JAZIRA                                 | 479.8            | 385.73           | 1,749     | 72,140    |         | 銀行                      |
| BANQUE SAUDI FRANSI                            | 417.43           | 299.17           | 633       | 26,131    |         | 銀行                      |
| RIYAD BANK                                     | 536.56           | 475.79           | 1,736     | 71,618    |         | 銀行                      |
| SAUDI INVESTMENT BANK/THE                      | 1,246.58         | 1,155.71         | 3,253     | 134,167   |         | 銀行                      |
| SAUDI TELECOM CO                               | 525.54           | 450.08           | 741       | 30,589    |         | 銀行                      |
| SABIC AGRI-NUTRIENTS CO                        | 1,439.07         | 1,574.67         | 6,023     | 248,393   |         | 各種電気通信サービス              |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP                    | 198.15           | 183.17           | 2,124     | 87,625    |         | 化学                      |
| SAUDI ELECTRICITY CO                           | 857.18           | 695.03           | 5,692     | 234,750   |         | 化学                      |
| SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP              | 756.74           | 707.94           | 1,400     | 57,748    |         | 電力                      |
| SAVOLA GROUP                                   | 388.56           | 278.47           | 643       | 26,551    |         | 化学                      |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO                  | 215.55           | 209.51           | 1,078     | 44,496    |         | 食品                      |
| ALMARAI CO JSC                                 | 240.22           | —                | —         | —         |         | 化学                      |
| SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP                   | 239.32           | 199.78           | 1,156     | 47,703    |         | 食品                      |
| EMAAR ECONOMIC CITY                            | 39.87            | 31.21            | 777       | 32,048    |         | メディア                    |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO          | 224.94           | —                | —         | —         |         | 不動産管理・開発                |
| ADVANCED PETROCHEMICAL CO                      | 339.39           | 302.96           | 978       | 40,355    |         | 化学                      |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO                   | 143.97           | 101.64           | 440       | 18,149    |         | 化学                      |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO        | 759.12           | 604.76           | 558       | 23,019    |         | 化学                      |
| RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO             | 473.34           | 385.09           | 528       | 21,788    |         | 不動産管理・開発                |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA      | 333.39           | —                | —         | —         |         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO       | 328.21           | 360.59           | 447       | 18,439    |         | 無線通信サービス                |
| ALINMA BANK                                    | 65.5             | 65.1             | 1,518     | 62,607    |         | 保険                      |
| SAUDI ARABIAN MINING CO                        | 914.69           | 750.68           | 3,171     | 130,797   |         | 銀行                      |
| MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO                   | 812.99           | 1,014.36         | 5,416     | 223,383   |         | 金属・鉱業                   |
| DALLAH HEALTHCARE CO                           | 50.36            | 79.75            | 1,102     | 45,452    |         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SAUDI ARABIAN OIL CO                           | 41.27            | 25.53            | 428       | 17,688    |         | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO | 2,300.08         | 2,061.98         | 6,175     | 254,682   |         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ACWA POWER CO                                  | 85.1             | 69.66            | 2,197     | 90,607    |         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SAUDI ARAMCO BASE OIL CO                       | 79.4             | 75.78            | 3,193     | 131,694   |         | 化学                      |
| ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO  | —                | 39.81            | 613       | 25,316    |         | 情報技術サービス                |
| NAHDI MEDICAL CO                               | 26.27            | 16.86            | 601       | 24,822    |         | 生活必需品流通・小売り             |
| SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO                 | 42.79            | 32.77            | 462       | 19,055    |         | 資本市場                    |
| ELM CO   | 52.02            | 35               | 910       | 37,528    |         | 情報技術サービス                |
| POWER & WATER UTILITY CO FOR JUBAIL & YANBU    | 24.2             | 19.59            | 1,782     | 73,518    |         | 総合公益事業                  |
| ADES HOLDING CO                                | —                | 66.35            | 444       | 18,333    |         | エネルギー設備・サービス            |
| THE SAUDI NATIONAL BANK                        | 2,085.06         | 2,309.07         | 523       | 21,589    |         | 銀行                      |
|  | 小計               | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 20,778.28 | 19,255.34 | 88,280  | 3,640,699               |
| (インド)  |                  |                  | 40銘柄      | 41銘柄      | —       | <4.0%>                  |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD                        | 百株               | 千インド・ルピー         | —         | —         | 千円      |                         |
|  | 2,915.11         | 2,388.22         | 700,106   | 1,302,198 |         | 石油・ガス・消耗燃料              |

| 銘<br>柄                           | 期<br>首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         |             |                         | 業<br>種<br>等 |
|----------------------------------|-------------|-------------|---------|-------------|-------------------------|-------------|
|                                  |             | 株<br>数      | 株<br>数  | 評<br>価<br>額 | 邦貨換算金額                  |             |
|                                  |             | 外<br>貨      | 建<br>金  | 額           |                         |             |
| (インド)                            |             | 百株          | 百株      | 千印度・ルピー     | 千円                      |             |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD        | 886.86      | 591.89      | 35,057  | 65,207      | 石油・ガス・消耗燃料              |             |
| ASIAN PAINTS LTD                 | 362.3       | 306.91      | 86,855  | 161,551     | 化学                      |             |
| BANK OF BARODA                   | 942.2       | 743.65      | 18,940  | 35,229      | 銀行                      |             |
| EICHER MOTORS LTD                | 133.32      | 111.49      | 48,561  | 90,324      | 自動車                     |             |
| GRASIM INDUSTRIES LTD            | 241.84      | 214.88      | 48,196  | 89,645      | 建設資材                    |             |
| HDFC BANK LTD                    | —           | 2,194.63    | 331,224 | 616,077     | 銀行                      |             |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD          | 831.51      | 737.64      | 149,836 | 278,696     | 自動車                     |             |
| SHREE CEMENT LTD                 | 11.1        | 6.37        | 15,850  | 29,481      | 建設資材                    |             |
| ICICI BANK LTD                   | 4,955.54    | 4,064.12    | 433,661 | 806,611     | 銀行                      |             |
| INDUSIND BANK LTD                | —           | 217.21      | 32,384  | 60,235      | 銀行                      |             |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD     | 689.31      | 425.9       | 19,955  | 37,117      | 石油・ガス・消耗燃料              |             |
| STATE BANK OF INDIA LTD          | 1,718.79    | 1,391.71    | 104,614 | 194,583     | 銀行                      |             |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD      | 282.93      | 196.95      | 18,648  | 34,685      | 陸上運輸                    |             |
| TATA STEEL LTD                   | 7,003.46    | 5,841.62    | 93,495  | 173,900     | 金属・鉱業                   |             |
| TATA MOTORS LTD                  | 1,582.84    | 1,306.79    | 129,738 | 241,312     | 自動車                     |             |
| JSW STEEL LTD                    | 716.65      | 473.96      | 40,061  | 74,514      | 金属・鉱業                   |             |
| TATA COMMUNICATIONS LTD          | —           | 83.25       | 15,682  | 29,168      | 各種電気通信サービス              |             |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD       | 521.02      | 456.53      | 51,845  | 96,433      | 食品                      |             |
| BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD  | 28.95       | 20.47       | 16,177  | 30,089      | 金融サービス                  |             |
| TATA POWER CO LTD                | 1,496.77    | 1,164.8     | 50,132  | 93,247      | 電力                      |             |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD         | 106.84      | 86.9        | 41,196  | 76,625      | 食品                      |             |
| NESTLE INDIA LTD                 | 31.63       | 261.23      | 66,511  | 123,711     | 食品                      |             |
| BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD     | —           | 821.26      | 21,167  | 39,372      | 電気設備                    |             |
| GAIL INDIA LTD                   | 2,149.62    | 1,763.91    | 36,310  | 67,536      | ガス                      |             |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD          | 534.17      | 858.6       | 153,912 | 286,277     | 銀行                      |             |
| VEDANTA LTD                      | 748.77      | 679.08      | 25,682  | 47,770      | 金属・鉱業                   |             |
| SUPREME INDUSTRIES LTD           | —           | 44.91       | 18,391  | 34,207      | 化学                      |             |
| AXIS BANK LTD                    | 2,180.25    | 1,793.47    | 188,655 | 350,898     | 銀行                      |             |
| TITAN COMPANY LTD                | 337.01      | 285.58      | 104,119 | 193,662     | 繊維・アパレル・贅沢品             |             |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD       | 2,328.74    | 2,537.43    | 71,847  | 133,636     | 石油・ガス・消耗燃料              |             |
| COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD      | 102.6       | 116.12      | 31,372  | 58,353      | パーソナルケア用品               |             |
| BHARAT ELECTRONICS LTD           | 3,517.92    | 2,942.08    | 68,682  | 127,750     | 航空宇宙・防衛                 |             |
| LUPIN LTD                        | 175.11      | 176.11      | 28,379  | 52,785      | 医薬品                     |             |
| NMDC LTD                         | —           | 815.82      | 19,616  | 36,486      | 金属・鉱業                   |             |
| MPHASIS LTD                      | 88.86       | 52.63       | 12,147  | 22,593      | 情報技術サービス                |             |
| ACC LTD                          | 51.68       | —           | —       | —           | 建設資材                    |             |
| BAJAJ FINANCE LTD                | 260.02      | 219.1       | 152,367 | 283,403     | 消費者金融                   |             |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP | 1,657.1     | —           | —       | —           | 金融サービス                  |             |
| INFOSYS LTD                      | 3,216.1     | 2,613.92    | 369,725 | 687,690     | 情報技術サービス                |             |
| WIPRO LTD                        | 1,290.52    | 1,054       | 47,256  | 87,896      | 情報技術サービス                |             |
| TATA ELXSI LTD                   | 34.06       | 24.5        | 18,448  | 34,314      | ソフトウェア                  |             |
| MRF LTD                          | 1.65        | 1.75        | 22,777  | 42,365      | 自動車用部品                  |             |
| INDIAN OIL CORP LTD              | 2,588.17    | 2,319.8     | 39,204  | 72,920      | 石油・ガス・消耗燃料              |             |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD           | 783.39      | 644.08      | 143,037 | 266,049     | パーソナルケア用品               |             |
| TRENT LTD                        | 182.69      | 148.59      | 59,260  | 110,224     | 専門小売り                   |             |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD  | 93.66       | 82.12       | 52,020  | 96,758      | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |             |
| CUMMINS INDIA LTD                | —           | 117.53      | 36,676  | 68,219      | 機械                      |             |
| HCL TECHNOLOGIES LTD             | 899.89      | 759.76      | 112,239 | 208,765     | 情報技術サービス                |             |
| DABUR INDIA LTD                  | 635.91      | 484.46      | 24,411  | 45,406      | パーソナルケア用品               |             |
| HERO MOTOCORP LTD                | 105.49      | 90.07       | 38,936  | 72,421      | 自動車                     |             |
| SRF LTD                          | 134.32      | 114.93      | 28,942  | 53,832      | 化学                      |             |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD        | 65.4        | 51.83       | 12,190  | 22,675      | 自動車用部品                  |             |
| DR REDDYS LABORATORIES LTD       | 109.56      | 89.27       | 54,011  | 100,461     | 医薬品                     |             |
| BHARTI AIRTEL LTD                | 2,128.84    | 1,750.21    | 212,904 | 396,001     | 無線通信サービス                |             |
| PUNJAB NATIONAL BANK LTD         | —           | 1,750.51    | 22,502  | 41,855      | 銀行                      |             |
| UNITED SPIRITS LTD               | 268.7       | 226.98      | 26,121  | 48,586      | 飲料                      |             |
| UNION BANK OF INDIA LTD          | —           | 1,193.19    | 17,092  | 31,791      | 銀行                      |             |

| 銘 柏                                   | 期 首(前期末)     | 当 期 末        |         |           |             | 業 種 等               |
|---------------------------------------|--------------|--------------|---------|-----------|-------------|---------------------|
|                                       |              | 株 数          | 株 数     | 評 価 額     | 邦 貨 換 算 金 額 |                     |
|                                       |              |              |         | 外 貨 建 金 額 |             |                     |
| (インド)                                 |              |              |         | 千インド・ルピー  | 千円          |                     |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD     | 百株<br>901.88 | 百株<br>770.06 | 118,400 | 220,225   |             | 医薬品                 |
| DIVI'S LABORATORIES LTD               | 121.65       | 100.63       | 37,879  | 70,455    |             | ライフサイエンス・ツール／サービス   |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD               | 115.59       | 112.12       | 140,180 | 260,735   |             | 自動車                 |
| AUROBINDO PHARMA LTD                  | 211.02       | 192.55       | 21,394  | 39,793    |             | 医薬品                 |
| HAVELLS INDIA LTD                     | 227.29       | 197.28       | 29,236  | 54,380    |             | 電気設備                |
| TVS MOTOR COMPANY LTD                 | 193.01       | 193.42       | 38,212  | 71,074    |             | 自動車                 |
| INDRAPRASTHA GAS LTD                  | 305.76       | 279.95       | 12,953  | 24,093    |             | ガス                  |
| JINDAL STEEL & POWER LTD              | 327.7        | 272.84       | 24,604  | 45,764    |             | 金属・鉱業               |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT        | 2,104.54     | 1,685.9      | 20,947  | 38,961    |             | 自動車用部品              |
| SHIRIRAM FINANCE LTD                  | 211.63       | 217.11       | 52,122  | 96,948    |             | 消費者金融               |
| PETRONET LNG LTD                      | 652.33       | 615.07       | 18,944  | 35,236    |             | 石油・ガス・消耗燃料          |
| CIPILA LTD/INDIA                      | 449.87       | 428.66       | 58,949  | 109,645   |             | 医薬品                 |
| LARSEN & TOUBRO LTD                   | 656.38       | 530.51       | 187,983 | 349,649   |             | 建設・土木               |
| ULTRATECH CEMENT LTD                  | 95.68        | 91.65        | 86,735  | 161,328   |             | 建設資材                |
| ASHOK LEYLAND LTD                     | —            | 1,046.17     | 18,433  | 34,286    |             | 機械                  |
| TATA CONSULTANCY SERVICES LTD         | 875.62       | 709.93       | 274,941 | 511,391   |             | 情報技術サービス            |
| ADANI ENTERPRISES LTD                 | 149.72       | 136.28       | 42,334  | 78,741    |             | 商社・流通業              |
| NTPC LTD                              | 3,671.12     | 3,501.03     | 125,774 | 233,940   |             | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| YES BANK LTD                          | 12,307.92    | 9,770.54     | 23,400  | 43,524    |             | 銀行                  |
| AMBUJA CEMENTS LTD                    | 531.17       | 433.08       | 26,744  | 49,745    |             | 建設資材                |
| BHARAT FORGE LTD                      | 266.09       | 213.19       | 25,170  | 46,816    |             | 自動車用部品              |
| SUZLON ENERGY LTD                     | —            | 6,473.42     | 26,217  | 48,764    |             | 電気設備                |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD               | 1,277.64     | 1,022.74     | 62,269  | 115,821   |             | 金属・鉱業               |
| ITC LTD                               | 2,851.79     | 2,358.96     | 100,468 | 186,870   |             | タバコ                 |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD               | 151.13       | 119.91       | 34,523  | 64,213    |             | 化学                  |
| UNITED PHOSPHORUS LTD                 | 492.94       | 388.55       | 18,831  | 35,025    |             | 化学                  |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD           | 98.51        | 82.01        | 20,810  | 38,708    |             | 医薬品                 |
| SIEMENS INDIA LTD                     | 71.73        | 65.37        | 36,161  | 67,260    |             | コングロマリット            |
| INFO EDGE INDIA LTD                   | 65.9         | 60.37        | 34,692  | 64,527    |             | インターネット・メディアおよびサービス |
| GMR INFRASTRUCTURE LTD                | —            | 1,913.62     | 15,404  | 28,652    |             | 運送インフラ              |
| CG POWER AND INDUSTRIAL SOLUTIONS LTD | 536.06       | 439.8        | 22,766  | 42,345    |             | 電気設備                |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD          | 412.11       | 334.47       | 39,375  | 73,238    |             | パーソナルケア用品           |
| TECH MAHINDRA LTD                     | 548.61       | 440.64       | 52,691  | 98,006    |             | 情報技術サービス            |
| INDIAN HOTELS CO LTD                  | 787          | 709.81       | 41,428  | 77,056    |             | ホテル・レストラン・レジャー      |
| MARICO LTD                            | 530.87       | 393.3        | 19,985  | 37,173    |             | 食品                  |
| POWER FINANCE CORP LTD                | —            | 1,204.94     | 47,781  | 88,874    |             | 金融サービス              |
| PAGE INDUSTRIES LTD                   | 5.89         | 5.08         | 18,123  | 33,709    |             | 繊維・アパレル・贅沢品         |
| ABB LTD/INDIA                         | 44.73        | 38.37        | 25,496  | 47,423    |             | 電気設備                |
| DLF LTD                               | 548.7        | 580.79       | 50,853  | 94,588    |             | 不動産管理・開発            |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD          | 2,940.62     | 3,739.75     | 102,562 | 190,766   |             | 電力                  |
| PERSISTENT SYSTEMS LTD                | —            | 77.78        | 30,009  | 55,817    |             | 情報技術サービス            |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 482.12       | 427.28       | 55,732  | 103,662   |             | 運送インフラ              |
| REC LTD                               | —            | 1,075.03     | 46,156  | 85,850    |             | 金融サービス              |
| BAJAJ FINSERV LTD                     | 359.61       | 298.64       | 48,334  | 89,902    |             | 金融サービス              |
| BAJAJ AUTO LTD                        | 68.64        | 56.35        | 50,259  | 93,482    |             | 自動車                 |
| JUBLANT FOODWORKS LTD                 | 405.48       | 302.66       | 13,459  | 25,034    |             | ホテル・レストラン・レジャー      |
| ADANI POWER LTD                       | 774.37       | 567.27       | 34,126  | 63,476    |             | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| MUTHOOT FINANCE LTD                   | 115.65       | 80.95        | 13,221  | 24,591    |             | 消費者金融               |
| COAL INDIA LTD                        | 1,560.07     | 1,253.13     | 56,791  | 105,632   |             | 石油・ガス・消耗燃料          |
| TATA MOTORS LTD                       | —            | 335.23       | 22,054  | 41,021    |             | 自動車                 |
| INDUS TOWERS LTD                      | 643.46       | —            | —       | —         |             | 各種電気通信サービス          |
| PI INDUSTRIES LTD                     | 74.18        | 68.56        | 25,656  | 47,721    |             | 化学                  |
| VARUN BEVERAGES LTD                   | 205.55       | 366.45       | 51,447  | 95,692    |             | 飲料                  |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD         | 94.03        | 87.31        | 30,747  | 57,189    |             | 自動車用部品              |
| LTMINDTREE LTD                        | 81.99        | 73.01        | 34,043  | 63,320    |             | 情報技術サービス            |
| ADANI GREEN ENERGY LTD                | 278.84       | 254.26       | 46,063  | 85,677    |             | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者  |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD            | 908.35       | 786.39       | 47,545  | 88,433    |             | 保険                  |

| 銘柄  | 期首(前期末)           | 当期末                |                     |                  |                       | 業種等                     |
|---|-------------------|--------------------|---------------------|------------------|-----------------------|-------------------------|
|   |                   | 株数                 | 株数                  | 評価額              | 邦貨換算金額                |                         |
|   |                   | 外貨建金額              |                     |                  |                       |                         |
| (インド)                                       |                   |                    |                     |                  |                       |                         |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD                   | 百株<br>157.99      | 百株<br>115.93       | 千円<br>7,111         | 13,226           |                       | 銀行                      |
| HINDUSTAN AERONAUTICS LTD                   | —                 | 161                | 59,926              | 111,463          |                       | 航空宇宙・防衛                 |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD                | —                 | 74.21              | 27,672              | 51,470           |                       | 資本市場                    |
| BANDHAN BANK LTD                            | 589.28            | 723.75             | 12,582              | 23,403           |                       | 銀行                      |
| ADANI TOTAL GAS LTD                         | 279.88            | —                  | —                   | —                |                       | ガス                      |
| GODREJ PROPERTIES LTD                       | 126.88            | 97.9               | 25,521              | 47,470           |                       | 不動産管理・開発                |
| POLYCARB INDIA LTD                          | —                 | 33.86              | 17,835              | 33,174           |                       | 電気設備                    |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD | 395.47            | 333.61             | 37,697              | 70,118           |                       | 消費者金融                   |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD            | 238.9             | 221.15             | 16,051              | 29,854           |                       | 消費者金融                   |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD  | 267.75            | 183.62             | 18,664              | 34,715           |                       | 商業サービス・用品               |
| ZOMATO LTD                                  | 3,322.58          | 4,891.43           | 91,200              | 169,633          |                       | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MACROTECH DEVELOPERS LTD                    | —                 | 178.89             | 20,737              | 38,572           |                       | 不動産管理・開発                |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD                | —                 | 598.52             | 48,955              | 91,058           |                       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APL APOLLO TUBES LTD                        | —                 | 125.92             | 19,467              | 36,210           |                       | 金属・鉱業                   |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS LTD             | —                 | 326.84             | 22,140              | 41,180           |                       | 自動車用部品                  |
| ONE 97 COMMUNICATIONS LTD                   | —                 | 179.09             | 7,008               | 13,036           |                       | 金融サービス                  |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD                  | —                 | 2,287.97           | 82,790              | 153,989          |                       | 金融サービス                  |
| ASTRAL POLYTECHNIK LTD                      | —                 | 105.69             | 21,004              | 39,068           |                       | 建設関連製品                  |
| BERGER PAINTS INDIA LTD                     | 186.55            | 226.56             | 12,034              | 22,384           |                       | 化学                      |
| ADANI ENERGY SOLUTIONS LTD                  | 252.73            | —                  | —                   | —                |                       | 電力                      |
| AVENUE SUPERMARTS LTD                       | 151.32            | 128.52             | 59,688              | 111,020          |                       | 生活必需品流通・小売              |
| IDFC BANK LTD                               | —                 | 2,488.08           | 20,576              | 38,272           |                       | 銀行                      |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD      | 239.26            | 188.97             | 31,154              | 57,947           |                       | 保険                      |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD      | 366.67            | 248.01             | 15,091              | 28,070           |                       | 保険                      |
| INTERGLOBE AVIATION LTD                     | 96.62             | 118.95             | 42,465              | 78,986           |                       | 旅客航空輸送                  |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD                   | 417.01            | 351.81             | 51,461              | 95,717           |                       | 保険                      |
| 小計  | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 101,010.6<br>114銘柄 | 112,281.17<br>136銘柄 | 8,349,430<br>—   | 15,529,940<br><16.9%> |                         |
| (インドネシア)                                    |                   |                    |                     |                  |                       |                         |
| ANEKA TAMBANG TBK PT                        | 百株<br>9,022       | 百株<br>5,470        | 千円<br>981,865       | 9,425            |                       | 金属・鉱業                   |
| BARITO PACIFIC TBK PT                       | 28,850.85         | 21,783.85          | 2,167,493           | 20,807           |                       | 化学                      |
| UNITED TRACTORS TBK PT                      | 1,697.01          | 1,122.01           | 2,869,540           | 27,547           |                       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT               | 3,570             | 3,640              | 2,202,200           | 21,141           |                       | 食品                      |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT                   | 8,225             | 5,916              | 1,402,092           | 13,460           |                       | 家庭用品                    |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK                  | 18,907            | 16,542             | 8,477,775           | 81,386           |                       | コングロマリット                |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK                | 46,469            | 39,477             | 12,632,640          | 121,273          |                       | 各種電気通信サービス              |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT           | 7,526             | 6,206              | 3,149,545           | 30,235           |                       | 食品                      |
| INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT       | 2,924             | 1,921              | 1,824,950           | 17,519           |                       | 紙製品・林産品                 |
| BANK MANDIRI                                | 34,760            | 29,266             | 19,388,725          | 186,131          |                       | 銀行                      |
| BANK RAKYAT INDONESIA                       | 64,553            | 53,424             | 28,314,720          | 271,821          |                       | 銀行                      |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT        | 7,179             | 12,039             | 6,320,475           | 60,676           |                       | 銀行                      |
| KALBE FARMA TBK PT                          | 18,101            | 19,530             | 2,841,615           | 27,279           |                       | 医薬品                     |
| SEMENT INDONESIA PERSERO TBK PT             | 2,744.32          | 2,349.32           | 1,256,886           | 12,066           |                       | 建設資材                    |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT                    | 52,483            | 43,211             | 41,158,477          | 395,121          |                       | 銀行                      |
| VALE INDONESIA TBK PT                       | 2,877             | —                  | —                   | —                |                       | 金属・鉱業                   |
| ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT               | 13,809            | 13,080             | 3,597,000           | 34,531           |                       | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT           | 2,593             | 1,941              | 1,970,115           | 18,913           |                       | 食品                      |
| SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT               | 16,979            | 14,828             | 4,137,012           | 39,715           |                       | 生活必需品流通・小売              |
| SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT              | 22,186            | 15,237             | 1,218,960           | 11,702           |                       | 各種電気通信サービス              |
| GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT                 | —                 | 669,872            | 4,153,206           | 39,870           |                       | 大規模小売                   |
| AMMAN MINERAL INTERNASIONAL PT              | —                 | 5,284              | 4,649,920           | 44,639           |                       | 金属・鉱業                   |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT                  | 12,324.82         | 7,940.82           | 2,255,192           | 21,649           |                       | 金属・鉱業                   |
| 小計  | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 377,780<br>21銘柄    | 990,080<br>22銘柄     | 156,970,405<br>— | 1,506,915<br><1.6%>   |                         |
| (アラブ首長国連邦)                                  |                   |                    |                     |                  |                       |                         |
| ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC                 | 百株<br>1,498.1     | 百株<br>1,181.72     | 千円<br>1,290         | 54,366           |                       | 銀行                      |
| DUBAI ISLAMIC BANK PJSC                     | 2,790.91          | 2,436.92           | 1,389               | 58,520           |                       | 銀行                      |

| 銘柄  | 期首(前期末)          | 当期末            |                          |             |                     | 業種等                     |  |
|---|------------------|----------------|--------------------------|-------------|---------------------|-------------------------|--|
|   |                  | 株数             | 株数                       | 評価額         |                     |                         |  |
|   |                  |                |                          | 外貨建金額       | 邦貨換算金額              |                         |  |
| (アラブ首長国連邦)                                      |                  |                |                          |             |                     |                         |  |
| EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC       | 百株<br>3,311.06   | 百株<br>2,701.55 | 千アラブ首長国連邦・ディルハム<br>4,797 | 202,137     | 千円                  | 各種電気通信サービス              |  |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC                  | 2,742.84         | 2,307.9        | 1,915                    | 80,702      |                     | 銀行                      |  |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC                       | 4,173.2          | 3,509.11       | 4,519                    | 190,416     |                     | 銀行                      |  |
| EMAAR PROPERTIES PJSC                           | 6,291.31         | 5,324.92       | 4,451                    | 187,547     |                     | 不動産管理・開発                |  |
| ALDAR PROPERTIES PJSC                           | 3,530.66         | 2,896.82       | 1,578                    | 66,513      |                     | 不動産管理・開発                |  |
| EMIRATES NBD BANK PJSC                          | 1,792.41         | 1,513.32       | 2,549                    | 107,429     |                     | 銀行                      |  |
| Q HOLDING PJSC                                  | 2,229.15         | —              | —                        | —           |                     | コングロマリット                |  |
| MULTIPLY GROUP                                  | 3,134.48         | 3,163.86       | 819                      | 34,522      |                     | コングロマリット                |  |
| AMERICANA RESTAURANTS INTERNATIONAL PLC         | —                | 1,884.16       | 621                      | 26,195      |                     | ホテル・レストラン・レジャー          |  |
| ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC | 3,119.88         | 2,201.78       | 772                      | 32,559      |                     | 専門小売り                   |  |
| 小計  | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 34,614<br>11銘柄 | 29,122.06<br>11銘柄        | 24,707<br>— | 1,040,910<br><1.1%> |                         |  |
| (ブラジル)  |                  |                |                          |             |                     |                         |  |
| VALE SA   | 百株<br>3,657.89   | 百株<br>2,676.89 | 千ブラジル・レアル<br>16,626      | 489,517     | 千円                  | 金属・鉱業                   |  |
| COMPANHIA PARANAENSE DE ENERGIA                 | —                | 835            | 769                      | 22,642      |                     | 電力                      |  |
| RAIA DROGASIL SA                                | 1,066            | 1,020.64       | 2,541                    | 74,825      |                     | 生活必需品流通・小売り             |  |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA               | 239.5            | 204.5          | 873                      | 25,703      |                     | 電力                      |  |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA               | 1,147            | 964            | 3,669                    | 108,052     |                     | 電力                      |  |
| BANCO DO BRASIL SA                              | 825              | 1,366          | 3,820                    | 112,491     |                     | 銀行                      |  |
| ITAUSA SA                                       | 4,900.26         | 4,401.07       | 4,203                    | 123,747     |                     | 銀行                      |  |
| GERDAU SA                                       | 1,102.81         | 927.81         | 2,088                    | 61,490      |                     | 金属・鉱業                   |  |
| PETROLEO BRASILEIRO SA                          | 3,503.1          | 2,894.1        | 11,909                   | 350,638     |                     | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| VIBRA ENERGIA SA                                | 1,166            | 968            | 2,356                    | 69,370      |                     | 専門小売り                   |  |
| PETROLEO BRASILEIRO SA                          | 4,599.12         | 3,781.12       | 15,041                   | 442,854     |                     | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| CCR SA  | 1,210.2          | 799.2          | 1,013                    | 29,836      |                     | 運送インフラ                  |  |
| WEG SA  | 1,582.44         | 1,333.44       | 5,096                    | 150,051     |                     | 電気設備                    |  |
| BANCO BRADESCO SA PREF                          | 5,205.02         | 4,279.02       | 5,917                    | 174,237     |                     | 銀行                      |  |
| BANCO BRADESCO SA                               | 1,395.92         | 1,265.92       | 1,552                    | 45,695      |                     | 銀行                      |  |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA                     | 646.06           | 482.06         | 690                      | 20,324      |                     | 金属・鉱業                   |  |
| SUZANO SA                                       | 743.75           | 627.75         | 3,817                    | 112,392     |                     | 紙製品・林産品                 |  |
| CPFL ENERGIA SA                                 | 236              | 169            | 593                      | 17,465      |                     | 電力                      |  |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA                        | 4,657.47         | 3,795.47       | 12,027                   | 354,131     |                     | 銀行                      |  |
| ENGIE BRASIL SA                                 | 154.87           | 152.87         | 619                      | 18,233      |                     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |  |
| LOCALIZA RENT A CAR                             | 689.89           | 704.89         | 3,524                    | 103,768     |                     | 陸上運輸                    |  |
| LOJAS RENNER SA                                 | 937.2            | 840.2          | 1,315                    | 38,739      |                     | 専門小売り                   |  |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA                       | 663.04           | 532.04         | 1,425                    | 41,965      |                     | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| COSAN SA  | 1,093            | 879            | 1,265                    | 37,267      |                     | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| TOTVS SA  | 534              | 433            | 1,172                    | 34,536      |                     | ソフトウェア                  |  |
| EQUATORIAL ENERGIA SA                           | 941              | 826            | 2,572                    | 75,731      |                     | 電力                      |  |
| JBS SA  | 714              | 569            | 1,274                    | 37,526      |                     | 食品                      |  |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS                  | 1,379.62         | 1,092.62       | 1,407                    | 41,434      |                     | 電力                      |  |
| CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO | 317.98           | 274.98         | 2,239                    | 65,934      |                     | 水道                      |  |
| ENEVA SA  | 711              | 440            | 530                      | 15,610      |                     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |  |
| HYPERA SA                                       | 412              | 298            | 843                      | 24,830      |                     | 医薬品                     |  |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO                       | 5,786.48         | 4,500.48       | 5,058                    | 148,936     |                     | 資本市場                    |  |
| MAGAZINE LUIZA SA                               | 2,715            | 2,394          | 363                      | 10,713      |                     | 大規模小売り                  |  |
| PRIO SA   | 709              | 616            | 3,001                    | 88,379      |                     | 石油・ガス・消耗燃料              |  |
| TELEFONICA BRASIL SA                            | 505.28           | 308.28         | 1,507                    | 44,393      |                     | 各種電気通信サービス              |  |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES                     | 653              | 517            | 1,704                    | 50,186      |                     | 保険                      |  |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA        | 4,686.61         | 3,559.61       | 1,260                    | 37,100      |                     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |  |
| ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA | 551              | 548            | 614                      | 18,102      |                     | 生活必需品流通・小売り             |  |
| AMBEV SA  | 4,534.95         | 3,733.95       | 4,447                    | 130,935     |                     | 飲料                      |  |
| NATURA &CO HOLDING SA                           | 927              | 688            | 1,118                    | 32,916      |                     | パーソナルケア用品               |  |
| CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACOES S/A              | —                | 521            | 801                      | 23,592      |                     | 保険                      |  |
| SENDAS DISTRIBUIDORA SA                         | 888              | 1,089          | 1,398                    | 41,168      |                     | 生活必需品流通・小売り             |  |
| TIM SA  | 765              | 613            | 1,059                    | 31,187      |                     | 無線通信サービス                |  |
| LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS                      | 3.08             | —              | —                        | —           |                     | 陸上運輸                    |  |

| 銘柄  |                   | 期首(前期末)  | 当期末  |   |  | 業種等   |
|---|-------------------|--|--|---|--|---|
|   |                   |  | 株数   | 株数  | 評価額  |   |
|   |                   |  |  | 外貨建金額   | 邦貨換算金額   |   |
| (ブラジル)<br>REDE D'OR SAO LUIZ SA<br>RUMO SA  |                   | 百株<br>607<br>1,188   | 百株<br>463<br>1,045   | 千ブラジル・レアル<br>1,082<br>2,207   | 千円<br>31,857<br>64,980   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス<br>陸上運輸   |
| 小計  | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 70,950.54<br>44銘柄  | 60,429.91<br>45銘柄  | 138,421<br>—  | 4,075,500<br><4.4%>  |   |
| (チェコ)<br>KOMERCNI BANKA AS<br>CEZ<br>MONETA MONEY BANK AS   |                   | 百株<br>80.62<br>147.52<br>250.56  | 百株<br>58.81<br>119.57<br>324.81  | 千チェコ・コルナ<br>5,104<br>10,522<br>3,306  | 千円<br>33,307<br>68,654<br>21,574   | 銀行<br>電力<br>銀行  |
| 小計  | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 478.7<br>3銘柄   | 503.19<br>3銘柄  | 18,933<br>—   | 123,536<br><0.1%>  |   |
| (韓国)<br>SKC CO LTD<br>CHEIL WORLDWIDE INC<br>HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD<br>SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC<br>DB INSURANCE CO LTD<br>COWAY CO LTD<br>KT&G CORP<br>S-1 CORPORATION<br>CJ CORP<br>KAKAO CORP<br>KUM YANG CO LTD<br>HANWHA OCEAN CO LTD<br>SK TELECOM CO LTD<br>MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD<br>NCSOFT CORPORATION<br>LG UPLUS CORP<br>DOOSAN ENERBILITY<br>POSCO INTERNATIONAL CORP<br>LG H&H CO LTD<br>LG CHEM LTD<br>LG CHEM LTD<br>SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD<br>HYUNDAI MERCHANT MARINE<br>S-OIL CORP<br>HANWHA SOLUTIONS CORPORATION<br>SAMSUNG SECURITIES CO LTD<br>POSCO FUTURE M CO LTD<br>LOTTE CHEMICAL CORPORATION<br>HOTEL SHILLA CO LTD<br>HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD<br>HYUNDAI MOBIS<br>SK HYNIX INC<br>HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD<br>HYUNDAI MOTOR CO<br>HYUNDAI MOTOR CO<br>HYUNDAI MIPO DOCKYARD<br>HYUNDAI STEEL CO<br>INDUSTRIAL BANK OF KOREA<br>KIA CORPORATION<br>KOREA ZINC CO LTD<br>KOREA ELECTRIC POWER CORP<br>KOREAN AIR CO LTD<br>KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD<br>KT CORP<br>HLB INC<br>LG ELECTRONICS INC |                   | 百株<br>23.57<br>46.13<br>34.98<br>29.79<br>40.39<br>58.33<br>103.26<br>15.57<br>9.39<br>295.75<br>—<br>—<br>—<br>312.28<br>15.42<br>177.16<br>391.12<br>—<br>8.66<br>47.04<br>7.33<br>436.85<br>257.38<br>46.49<br>114.38<br>62.76<br>25.09<br>19<br>27.51<br>43.83<br>58.44<br>520.44<br>69.3<br>20.64<br>135.05<br>26.94<br>78.56<br>280.33<br>250.43<br>8.17<br>244.75<br>166.09<br>15.44<br>—<br>100.07<br>101.53 | 百株<br>17.2<br>—<br>29.28<br>23.44<br>36.55<br>40.84<br>77.03<br>—<br>—<br>243.74<br>25.99<br>58.03<br>37.45<br>154.99<br>11.42<br>171.31<br>357.73<br>42.25<br>7.62<br>38.84<br>5.99<br>344.6<br>174.05<br>32.89<br>91.75<br>51.98<br>24.67<br>13.12<br>—<br>33.14<br>48.09<br>430.02<br>56.95<br>18.64<br>107.45<br>—<br>78.56<br>217.85<br>206.05<br>6.76<br>210.38<br>140.33<br>12.09<br>55.36<br>94.3<br>83.78 | 千韓国・ウォン<br>193,156<br>—<br>425,731<br>649,288<br>322,005<br>231,154<br>684,796<br>—<br>—<br>1,143,140<br>238,328<br>168,287<br>188,373<br>112,367<br>191,970<br>163,601<br>512,269<br>177,450<br>294,132<br>1,458,442<br>144,658<br>1,397,353<br>255,853<br>247,661<br>221,117<br>187,128<br>614,283<br>131,068<br>—<br>372,162<br>1,127,710<br>7,684,457<br>178,538<br>269,534<br>2,508,957<br>—<br>240,786<br>278,848<br>2,330,425<br>322,790<br>415,921<br>282,764<br>140,969<br>186,009<br>878,876<br>762,398 | 千円<br>21,672<br>—<br>47,767<br>72,850<br>36,129<br>25,935<br>76,834<br>—<br>—<br>128,260<br>26,740<br>18,881<br>21,135<br>無線通信サービス<br>資本市場<br>21,539<br>18,356<br>57,476<br>19,909<br>33,001<br>163,637<br>16,230<br>156,783<br>海上運輸<br>28,706<br>27,787<br>24,809<br>20,995<br>68,922<br>14,705<br>—<br>41,756<br>126,529<br>862,196<br>20,031<br>30,241<br>281,505<br>—<br>27,016<br>31,286<br>261,473<br>36,217<br>46,666<br>31,726<br>15,816<br>20,870<br>98,609<br>85,541 | 化学<br>メディア<br>自動車<br>保険<br>保険<br>家庭用耐久財<br>タバコ<br>商業サービス・用品<br>コングロマリット<br>インターネット・メディアおよびサービス<br>化学<br>機械<br>無線通信サービス<br>資本市場<br>娯楽<br>各種電気通信サービス<br>電気設備<br>商社・流通業<br>パーソナルケア用品<br>化学<br>化学<br>銀行<br>海上運輸<br>石油・ガス・消耗燃料<br>化学<br>資本市場<br>電気設備<br>化学<br>専門小売り<br>機械<br>自動車用部品<br>半導体・半導体製造装置<br>建設・土木<br>自動車<br>自動車<br>機械<br>金属・鉱業<br>銀行<br>自動車<br>金属・鉱業<br>電力<br>旅客航空輸送<br>化学<br>各種電気通信サービス<br>ヘルスケア機器・用品<br>家庭用耐久財 |

| 銘<br>柄                            | 期 首(前期末) | 当 期 末    |            |           |                     | 業 種 等 |
|-----------------------------------|----------|----------|------------|-----------|---------------------|-------|
|                                   |          | 株 数      | 株 数        | 評 価 額     | 邦貨換算金額              |       |
|                                   |          |          |            | 外 貨 建 金 額 |                     |       |
| (韓国)                              |          |          |            |           |                     |       |
| LG CORP                           | 百株       | 百株       | 千韓国・ウォン    | 千円        | コングロマリット            |       |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 94.86    | 70.73    | 538,255    | 60,392    | 資本市場                |       |
| NAVER CORP                        | 152.9    | 92.34    | 101,481    | 11,386    | インターネット・メディアおよびサービス |       |
| L&F CO LTD                        | 125.28   | 102.18   | 1,835,152  | 205,904   | 電気設備                |       |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD  | 21.69    | 20.34    | 285,980    | 32,087    | 資本市場                |       |
| KANGWON LAND INC                  | 37.39    | 34.43    | 209,678    | 23,525    | ホテル・レストラン・レジャー      |       |
| POSCO HOLDINGS INC                | 92.45    | 72.38    | 106,470    | 11,946    | 金属・鉱業               |       |
| SAMSUNG E&A CO LTD                | 68.68    | 56.79    | 2,106,909  | 236,395   | 建設・土木               |       |
| SAMSUNG SDI CO LTD                | 140.98   | 122.26   | 303,204    | 34,019    | コンピュータ・周辺機器         |       |
| COSMOAM&T CO LTD                  | —        | 17.3     | 246,352    | 27,640    | 電子装置・機器・部品          |       |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD  | 52.32    | 43.48    | 1,678,328  | 188,308   | 電子装置・機器・部品          |       |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD        | 54.94    | 46.73    | 689,734    | 77,388    | コンピュータ・周辺機器         |       |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD   | 4,571.21 | 3,754.76 | 29,625,056 | 3,323,931 | 機械                  |       |
| HANWHA AEROSPACE CO LTD           | 547.49   | 541.1    | 470,215    | 52,758    | 航空宇宙・防衛             |       |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PFD           | —        | 28.34    | 623,480    | 69,954    | コンピュータ・周辺機器         |       |
| YUHAN CORP                        | 787.43   | 641.76   | 4,254,868  | 477,396   | 医薬品                 |       |
| HANON SYSTEMS                     | 43.95    | 47       | 321,950    | 36,122    | 自動車用部品              |       |
| GS HOLDINGS CORP                  | 191.41   | 130.64   | 65,581     | 7,358     | コングロマリット            |       |
| LG DISPLAY CO LTD                 | 42.59    | 38.03    | 161,057    | 18,070    | 電子装置・機器・部品          |       |
| CELLTRION INC                     | 237.42   | 235.92   | 231,673    | 25,993    | バイオテクノロジー           |       |
| HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD        | 97.18    | 121      | 2,069,100  | 232,153   | 半導体・半導体製造装置         |       |
| HANA FINANCIAL GROUP              | —        | 30.79    | 419,667    | 47,086    | 銀行                  |       |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD             | 280.57   | 231.72   | 1,211,895  | 135,974   | 航空貨物・物流サービス         |       |
| CELLTRION PHARM INC               | 19.28    | 16.2     | 276,858    | 31,063    | 医薬品                 |       |
| LOTTE SHOPPING CO                 | 17.64    | 13.14    | 115,369    | 12,944    | 大規模小売り              |       |
| POSCO DX CO LTD                   | 10.25    | —        | —          | —         | 情報技術サービス            |       |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD     | —        | 43.64    | 168,886    | 18,949    | 保険                  |       |
| AMOREPACIFIC CORP                 | 77.04    | 65.63    | 511,914    | 57,436    | パーソナルケア用品           |       |
| SK INNOVATION CO LTD              | 30.32    | 22.8     | 323,988    | 36,351    | 石油・ガス・消耗燃料          |       |
| ECOPRO CO LTD                     | 51.89    | 48.55    | 508,804    | 57,087    | 電気設備                |       |
| CJ CHEILJEDANG CORP               | —        | 15.9     | 822,030    | 92,231    | 食品                  |       |
| STX PAN OCEAN CO LTD              | 8.9      | 7.13     | 233,507    | 26,199    | 海上運輸                |       |
| LG INNOTEK CO LTD                 | 312.93   | —        | —          | —         | 電子装置・機器・部品          |       |
| SK INC                            | 14.36    | 12.42    | 228,652    | 25,654    | コングロマリット            |       |
| KB FINANCIAL GROUP INC            | 36.19    | 29.45    | 462,365    | 51,877    | 銀行                  |       |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD    | 370.99   | 302.64   | 1,909,658  | 214,263   | 航空宇宙・防衛             |       |
| LOTTE ENERGY MATERIALS CORP       | 74.26    | 56.45    | 274,064    | 30,750    | 電子装置・機器・部品          |       |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC        | 25.08    | —        | —          | —         | 金融サービス              |       |
| HANMI PHARM CO LTD                | 61.86    | 80.42    | 587,870    | 65,959    | 医薬品                 |       |
| E-MART CO LTD                     | 8.1      | 5.85     | 174,037    | 19,527    | 生活必需品流通・小売り         |       |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD  | 17.3     | —        | —          | —         | 自動車用部品              |       |
| HANJIN KAL CORP                   | 76.97    | 55.31    | 346,793    | 38,910    | 旅客航空輸送              |       |
| HD HYUNDAI CO LTD                 | —        | 20.68    | 118,910    | 13,341    | 石油・ガス・消耗燃料          |       |
| BGF RETAIL CO LTD                 | 40.06    | 39.43    | 240,917    | 27,030    | 生活必需品流通・小売り         |       |
| ORION CORP REPUBLIC OF KOREA      | 7.15     | —        | —          | —         | 食品                  |       |
| NETMARBLE CORP                    | 21.29    | 20.13    | 183,384    | 20,575    | 娯楽                  |       |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC         | 25.97    | 21.12    | 115,104    | 12,914    | 銀行                  |       |
| ECOPRO BM CO LTD                  | 508.23   | 485.05   | 638,810    | 71,674    | 電気設備                |       |
| SD BIOSENSOR INC                  | 45.55    | 39.06    | 839,790    | 94,224    | ヘルスケア機器・用品          |       |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD      | 42.88    | —        | —          | —         | 医薬品                 |       |
| KRAFTON INC                       | 29.49    | 22.1     | 178,347    | 20,010    | 娯楽                  |       |
| ECOPRO MATERIALS CO LTD           | 27.1     | 23       | 581,900    | 65,289    | 電気設備                |       |
| HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO    | —        | 10.66    | 111,077    | 12,462    | 機械                  |       |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD           | 15.06    | 15.45    | 171,958    | 19,293    | 電気設備                |       |
| SK SQUARE CO LTD                  | 27.2     | 18.78    | 112,304    | 12,600    | バイオテクノロジー           |       |
| SK BIOSCIENCE CO LTD              | 101.44   | 80.02    | 630,557    | 70,748    | コングロマリット            |       |
| KAKAO GAMES CORP                  | 19.81    | 23.4     | 132,678    | 14,886    | 娯楽                  |       |
|                                   | 32.64    | —        | —          | —         |                     |       |

| 銘柄   | 期首(前期末)                  | 当期末                |                   |                 |                         | 業種等 |
|--|--------------------------|--------------------|-------------------|-----------------|-------------------------|-----|
|  |                          | 株数                 | 株数                | 評価額             | 邦貨換算金額                  |     |
|  |                          | 外貨建金額              |                   |                 |                         |     |
| (韓国)   |                          |                    |                   |                 |                         |     |
| HYBE CO LTD                                      | 百株                       | 百株                 | 千韓国・ウォン           | 千円              |                         |     |
| LG ENERGY SOLUTION                               | 19.2                     | 16.49              | 361,131           | 40,518          | 娯楽                      |     |
| KAKAOBANK CORP                                   | 33.27                    | 36.71              | 1,338,079         | 150,132         | 電気設備                    |     |
| F&F CO LTD / NEW                                 | 129.07                   | 132.92             | 308,374           | 34,599          | 銀行                      |     |
| KAKAOPAY CORP                                    | 18.75                    | —                  | —                 | —               | 繊維・アパレル・贅沢品             |     |
| SAMSUNG SDS CO LTD                               | 22.37                    | 22.37              | 73,149            | 8,207           | 金融サービス                  |     |
| SAMSUNG C&T CORP                                 | 36.4                     | 30.71              | 446,523           | 50,099          | 情報技術サービス                |     |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD                         | 79.98                    | 63.52              | 881,657           | 98,921          | コングロマリット                |     |
| PEARL ABYSS CORP                                 | 16.61                    | 14.15              | 1,098,040         | 123,200         | ライフサイエンス・ツール／サービス       |     |
| DOOSAN BOBCAT INC                                | 34.27                    | —                  | —                 | —               | 娯楽                      |     |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD                      | 46                       | 45.42              | 228,462           | 25,633          | 機械                      |     |
|  | 90.33                    | —                  | —                 | —               | ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス |     |
| 小計   | 株数<br>銘柄数<br>・<br>比<br>率 | 15,049.86<br>102銘柄 | 12,349.23<br>99銘柄 | 91,626,818<br>— | 10,280,529<br><11.2%>   |     |
| (中国)   |                          |                    |                   |                 |                         |     |
| EVE ENERGY CO LTD                                | 百株                       | 百株                 | 千オフショア・人民元        | 千円              |                         |     |
| SIEYUAN ELECTRIC CO LTD                          | 130.32                   | 147.32             | 537               | 11,466          | 電気設備                    |     |
| LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD                       | 58                       | 58                 | 394               | 8,404           | 電気設備                    |     |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD               | 227                      | —                  | —                 | —               | 化学                      |     |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD  | 59.4                     | 59.4               | 185               | 3,952           | 電子装置・機器・部品              |     |
| HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD            | 30                       | 30                 | 153               | 3,282           | 電子装置・機器・部品              |     |
| DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD                 | —                        | 150                | 215               | 4,595           | 電子装置・機器・部品              |     |
| GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD | 51                       | —                  | —                 | —               | 化学                      |     |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD               | 483                      | —                  | —                 | —               | 資本市場                    |     |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD                     | 120                      | 120                | 91                | 1,951           | 半導体・半導体製造装置             |     |
| YUNNAN ALUMINIUM CO LTD                          | 120.8                    | 51.8               | 194               | 4,149           | 化学                      |     |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD                    | 122                      | 122                | 182               | 3,898           | 金属・鉱業                   |     |
| UNISPLENDOUR CORP LTD                            | 175                      | 175                | 318               | 6,786           | 航空宇宙・防衛                 |     |
| JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD            | 212.4                    | 70.4               | 144               | 3,085           | 電子装置・機器・部品              |     |
| SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD              | 105                      | 105                | 101               | 2,173           | 電気設備                    |     |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD              | 191                      | 191                | 302               | 6,445           | 紙製品・林産品                 |     |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD                        | 12                       | 12                 | 63                | 1,349           | ライフサイエンス・ツール／サービス       |     |
| HUAGONG TECH CO LTD                              | 162                      | 162                | 229               | 4,900           | 電気設備                    |     |
| CHANGCHUN HIGH-TECH INDUSTRY GROUP CO LTD        | —                        | 22                 | 72                | 1,536           | 電子装置・機器・部品              |     |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD      | 21                       | 21                 | 254               | 5,425           | 医薬品                     |     |
| NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD          | —                        | 118                | 246               | 5,257           | 機械                      |     |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD                     | 89                       | —                  | —                 | —               | 機械                      |     |
| SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD                 | 81                       | 81                 | 189               | 4,044           | 娯楽                      |     |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD   | —                        | 136                | 185               | 3,963           | 電子装置・機器・部品              |     |
| YINTAI GOLD CO LTD                               | 139                      | 139                | 191               | 4,083           | 電子装置・機器・部品              |     |
| TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD                    | 239                      | 239                | 472               | 10,062          | 金属・鉱業                   |     |
| ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD                       | 315                      | —                  | —                 | —               | 建設資材                    |     |
| GEM CO LTD                                       | 618                      | —                  | —                 | —               | 商業サービス・用品               |     |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD               | 291                      | 291                | 183               | 3,920           | 金属・鉱業                   |     |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD                      | 26                       | 26                 | 119               | 2,540           | ソフトウェア                  |     |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD            | 69                       | 69                 | 98                | 2,090           | バイオテクノロジー               |     |
| INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD          | 186                      | 581                | 252               | 5,375           | 娯楽                      |     |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD                      | 169                      | 169                | 343               | 7,331           | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD                      | 98                       | 59                 | 584               | 12,459          | 電気設備                    |     |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD                 | 119.95                   | 155.93             | 103               | 2,200           | 電子装置・機器・部品              |     |
| ZHEJIANG NHU CO LTD                              | 59.04                    | 59.04              | 142               | 3,045           | 家庭用耐久財                  |     |
| HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD       | 273.12                   | 58.12              | 101               | 2,157           | 医薬品                     |     |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD        | 296                      | 296                | 186               | 3,981           | 不動産管理・開発                |     |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD                 | 133.6                    | 133.6              | 263               | 5,610           | 医薬品                     |     |
| BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC               | 66                       | 66                 | 102               | 2,185           | 食品                      |     |
| GUANGDONG HAID GROUP CO LTD                      | 51                       | 51                 | 154               | 3,288           | 建設関連製品                  |     |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD                          | 93                       | 93                 | 415               | 8,868           | 食品                      |     |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD  | 104                      | 104                | 196               | 4,181           | 電気設備                    |     |
|  | 115                      | 10                 | 36                | 768             | ヘルスケア機器・用品              |     |

| 銘<br>柄   | 期 首(前期末) | 当 期 末  |       |            |        | 業 種 等                   |
|--|----------|--------|-------|------------|--------|-------------------------|
|  |          | 株 数    | 株 数   | 評 価 額      | 邦貨換算金額 |                         |
|  |          |        |       | 外 貨 建 金 額  |        |                         |
| (中国)   |          |        |       | 千オフショア・人民元 | 千円     |                         |
| MUYUAN FOODSTUFF CO LTD                                      | 百株       | 百株     |       | 1,032      | 22,020 | 食品                      |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD                  | 333      | 240    |       | 376        | 8,034  | バイオテクノロジー               |
| CETC CYBERSPACE SECURITY TECHNOLOGY CO LTD                   | 113      | 89.5   |       | —          | —      | ソフトウェア                  |
| SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD                | 57       | —      |       | —          | —      | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CHINA BAOAN GROUP CO LTD                                     | 180      | 180    | 201   | 4,290      | 4,048  | コングロマリット                |
| TIANQI LITHIUM CORP  | 180      | 180    | 189   | 4,389      | 4,389  | 化学                      |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD                      | 101      | 43     | 205   | 2,182      | 2,182  | コンピュータ・周辺機器             |
| BEIJING YANJING BREWERY CO LTD                               | 112      | 112    | 102   | 5,133      | 5,133  | 飲料                      |
| TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD                               | 29       | 248    | 240   | 1,679      | 1,679  | 電子装置・機器・部品              |
| NAVINFO CO LTD   | 101      | 101    | 78    | 4,953      | 4,953  | ソフトウェア                  |
| BY-HEALTH CO LTD   | 56       | —      | —     | —          | —      | パーソナルケア用品               |
| DAAN GENE CO LTD   | 141      | 141    | 232   | 7,648      | 7,648  | バイオテクノロジー               |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD                          | 139      | —      | —     | 3,170      | 3,170  | 医薬品                     |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC                            | 21       | 120    | 358   | 12,176     | 12,176 | バイオテクノロジー               |
| RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD                              | 78       | 78     | 148   | 2,976      | 2,976  | 化学                      |
| CHINA RESOURCES SANJUJI MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD      | 717.5    | 515.5  | 571   | 7,357      | 7,357  | 医薬品                     |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD                      | 60       | 60     | 345   | 3,216      | 3,216  | 半導体・半導体製造装置             |
| INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD                | 61.39    | 22.39  | 139   | 2,980      | 2,980  | コンピュータ・周辺機器             |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD                                 | 35.7     | 114.7  | 438   | —          | —      | コンピュータ・周辺機器             |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD                        | 127      | 127    | 150   | —          | —      | 金属・鉱業                   |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD                                     | 367      | 367    | 139   | —          | —      | 機械                      |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD                               | 320      | —      | —     | 10,595     | 10,595 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD                           | 373.67   | 397.29 | 497   | 5,811      | 5,811  | 電子装置・機器・部品              |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD              | 108      | 108    | 272   | 1,489      | 1,489  | 飲料                      |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD                     | 35.84    | 35.84  | 69    | 308        | 308    | 医薬品                     |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD                       | 111      | 5      | 14    | 1,997      | 1,997  | ヘルスケア機器・用品              |
| XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD                           | 69       | 69     | 93    | 5,327      | 5,327  | 機械                      |
| DONG-E-E-JIAO CO LTD   | 375      | 331    | 249   | 7,064      | 7,064  | 医薬品                     |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO                  | 49       | 49     | 331   | 3,522      | 3,522  | 通信機器                    |
| HUADONG MEDICINE CO LTD                                      | 153      | 153    | 165   | 3,971      | 3,971  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD                  | 75       | 62     | 186   | 3,537      | 3,537  | エネルギー設備・サービス            |
| TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD                      | 50       | 50     | 165   | —          | —      | 金属・鉱業                   |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD | 991      | —      | —     | 5,769      | 5,769  | 娯楽                      |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD                              | 66       | 159    | 270   | 3,802      | 3,802  | 航空宇宙・防衛                 |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD  | 98       | 98     | 178   | 1,079      | 1,079  | 飲料                      |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD                          | 81       | 61     | 1,079 | 23,004     | 23,004 | 機械                      |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD                    | 178      | 48     | 296   | 6,322      | 6,322  | 食品                      |
| TCL ZHONGHUA RENEWABLE ENERGY                                | 149.5    | 149.5  | 68    | 1,456      | 1,456  | 半導体・半導体製造装置             |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD                     | 223      | 136.75 | 149   | 3,192      | 3,192  | ホテル・レストラン・レジャー          |
| BEIJING SHUI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD                   | 87.4     | 87.4   | 90    | 1,919      | 1,919  | ソフトウェア                  |
| BEIJING KUNLUN TECH CO LTD                                   | 74.48    | —      | —     | —          | —      | 娯楽                      |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD                | —        | 91     | 372   | 7,942      | 7,942  | 資本市場                    |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD                                 | 21       | 36     | 415   | 8,848      | 8,848  | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD                                 | 143      | 143    | 143   | 5,801      | 5,801  | 娯楽                      |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD                           | 450.54   | 311.54 | 849   | 3,054      | 3,054  | 電子装置・機器・部品              |
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD                            | 299      | 299    | 487   | 18,117     | 18,117 | 化学                      |
| SHANXI SECURITIES CO LTD                                     | 275      | —      | —     | 10,402     | 10,402 | 資本市場                    |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD                    | 713      | 713    | 503   | 10,731     | 10,731 | メディア                    |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD  | 199      | 199    | 178   | 3,801      | 3,801  | 食品                      |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD                             | 191      | 191    | 346   | 7,382      | 7,382  | 電子装置・機器・部品              |
| IFLYTEK CO LTD   | 118      | 79     | 371   | 7,928      | 7,928  | ソフトウェア                  |
| HESTEE CO LTD  | 934      | 934    | 206   | 4,400      | 4,400  | 金属・鉱業                   |
| GOERTEK INC  | 251      | 251    | 382   | 8,160      | 8,160  | 電子装置・機器・部品              |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD                                    | 213      | 213    | 137   | 2,933      | 2,933  | 資本市場                    |
| BANK OF NINGBO CO LTD  | 326      | 352    | 779   | 16,621     | 16,621 | 銀行                      |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD                                       | 396      | 95     | 129   | 2,760      | 2,760  | 電子装置・機器・部品              |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION                             | 1,352    | 544.2  | 273   | 5,823      | 5,823  | 電子装置・機器・部品              |

| 銘柄  | 期首(前期末) | 当期末    |    |            |        | 業種等                |
|---|---------|--------|----|------------|--------|--------------------|
|   |         | 株数     | 株数 | 評価額        | 邦貨換算金額 |                    |
|   |         |        |    | 外貨建金額      |        |                    |
| (中国)  |         |        |    | 千オフショア・人民元 | 千円     |                    |
| CHANGJIANG SECURITIES CO LTD                            | 百株      | 百株     |    | 153        | 3,263  | 資本市場               |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD                   | 283     | 283    |    | 92         | 1,971  | 不動産管理・開発           |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD                     | 376     | 376    |    | 693        | 14,785 | 自動車                |
| WESTERN SECURITIES CO LTD                               | 404.88  | 404.88 |    | 227        | 165    | 資本市場               |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD         | 227     | 227    |    | 123        | 3,522  | 食品                 |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD                              | 274     | 274    |    | 331        | 7,077  | 医薬品                |
| EAST MONEY INFORMATION CO LTD                           | 105.2   | 105.2  |    | 589        | 12,574 | 資本市場               |
| JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD               | 843.49  | 779.18 |    | 976        | 20,813 | 飲料                 |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD                                  | 81      | 78     |    | 748        | 15,963 | 飲料                 |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD                     | 229     | 186    |    | 2,702      | 57,614 | バイオテクノロジー          |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD                             | 40      | 589    |    | 402        | 8,576  | 電子装置・機器・部品         |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD  | 2,181   | 1,374  |    | 588        | 12,536 | 不動産管理・開発           |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI                  | 459     | 459    |    | 389        | 8,297  | 家庭用耐久財             |
| MIDEA GROUP CO LTD                                      | 459     | 162    |    | 1,110      | 10,207 | 家庭用耐久財             |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD                                | 423     | 423    |    | 367        | 23,684 | 資本市場               |
| PING AN BANK CO LTD                                     | 1,070   | 972    |    | 1,032      | 7,827  | 銀行                 |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD                            | 291.8   | 244.8  |    | 452        | 22,006 | 食品                 |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD                           | 1,463   | 1,135  |    | 506        | 9,638  | 資本市場               |
| CHINA VANKE CO LTD                                      | 551     | 551    |    | 391        | 10,791 | 不動産管理・開発           |
| ZTE CORP  | 197     | 165    |    | 478        | 8,339  | 通信機器               |
| ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD    | 285     | 285    |    | 266        | 10,197 | 機械                 |
| WEICHAI POWER CO LTD                                    | 481     | 442    |    | 817        | 5,680  | 機械                 |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC                         | 42      | 42     |    | 158        | 17,422 | 医薬品                |
| GF SECURITIES CO LTD                                    | 387     | 153    |    | 198        | 3,384  | 資本市場               |
| GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD                    | 211     | 211    |    | 162        | 4,233  | 電気設備               |
| BYD CO LTD  | 104     | 84     |    | 1,789      | 3,454  | 自動車                |
| YOUNGY CO LTD   | 21      | —      |    | —          | 38,142 | 金属・鉱業              |
| CCECP SOLAR ENERGY CO LTD                               | 302     | 302    |    | 159        | —      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD           | 341     | 341    |    | 179        | 3,816  | 電子装置・機器・部品         |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD             | 96.6    | 96.6   |    | 222        | 4,734  | 化学                 |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD                      | 52.2    | 52.2   |    | 173        | 4,702  | 化学                 |
| LB GROUP CO LTD   | 110     | 110    |    | 219        | 4,673  | 化学                 |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD                        | 179     | 428    |    | 447        | 9,534  | 化学                 |
| SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD                   | 84      | —      |    | —          | —      | 化学                 |
| YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD           | 21      | 21     |    | 75         | 1,605  | 半導体・半導体製造装置        |
| ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD | 96      | 96     |    | 189        | 4,033  | 化学                 |
| SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD                      | 117     | 117    |    | 200        | 4,272  | 化学                 |
| SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD            | 64      | —      |    | —          | —      | 電気設備               |
| RISEN ENERGY CO LTD                                     | —       | 11     |    | 15         | 331    | 半導体・半導体製造装置        |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD                            | 80      | —      |    | —          | —      | 医薬品                |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD          | 127     | 127    |    | 210        | 4,494  | 建設関連製品             |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD                           | 35      | 22     |    | 683        | 14,574 | 半導体・半導体製造装置        |
| INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD                  | 301     | 301    |    | 195        | 4,164  | 化学                 |
| NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD                 | 128     | 128    |    | 264        | 5,637  | 半導体・半導体製造装置        |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD                                  | 342     | 342    |    | 257        | 5,497  | 化学                 |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD                                | 573     | —      |    | —          | —      | 金属・鉱業              |
| PERFECT WORLD CO LTD/CHINA                              | 55.5    | 55.5   |    | 56         | 1,200  | 娯楽                 |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD                          | 16      | 17     |    | 433        | 9,248  | 飲料                 |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD                             | 156     | 156    |    | 105        | 2,258  | 化学                 |
| ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD       | 66      | 66     |    | 215        | 4,596  | 半導体・半導体製造装置        |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD                                   | 6       | 6      |    | 35         | 760    | 家庭用耐久財             |
| NINESTAR CORP   | 45      | 11     |    | 24         | 519    | コンピュータ・周辺機器        |
| CNPC CAPITAL CO LTD                                     | —       | 382    |    | 220        | 4,698  | 銀行                 |
| YUNDA HOLDING CO LTD                                    | 254.2   | 254.2  |    | 177        | 3,787  | 航空貨物・物流サービス        |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD                            | 16      | —      |    | —          | —      | 医薬品                |
| HENAN SHENHUA COAL & POWER CO LTD                       | 169     | 169    |    | 416        | 8,877  | 金属・鉱業              |
| SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD               | 107     | —      |    | —          | —      | 容器・包装              |

| 銘<br>柄   | 期 首(前期末) | 当 期 末  |     |            |        | 業 種 等                   |
|--|----------|--------|-----|------------|--------|-------------------------|
|  |          | 株 数    | 株 数 | 評 価 額      | 邦貨換算金額 |                         |
|  |          |        |     | 外 貨 建 金 額  |        |                         |
| (中国)   |          |        |     | 千オフショア・人民元 | 千円     |                         |
| ASYMCHEN LABORATORIES TIANJIN CO LTD                 | 百株       | 百株     |     | 142        | 3,038  | 医薬品                     |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD                                 | 18.2     | 18.2   |     | 90         | 1,930  | 飲料                      |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD         | 151      | 151    |     | 69         | 1,483  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SF HOLDING CO LTD                                    | 320      | 244    |     | 850        | 18,127 | 航空貨物・物流サービス             |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD           | 18       | —      |     | —          | —      | 建設関連製品                  |
| FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD                      | 236      | 236    |     | 124        | 2,646  | 資本市場                    |
| BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD          | 40       | —      |     | —          | —      | 電気設備                    |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD                         | 25       | 25     |     | 163        | 3,482  | 半導体・半導体製造装置             |
| GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD     | 47       | —      |     | —          | —      | 電気設備                    |
| EOPTOLINK TECHNOLOGY INC LTD                         | —        | 39     |     | 278        | 5,940  | 電子装置・機器・部品              |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD                              | 517.9    | 974.9  |     | 678        | 14,465 | 銀行                      |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY INC                          | 389      | 389    |     | 326        | 6,957  | ソフトウェア                  |
| PEOPLES INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD              | 730      | 828    |     | 440        | 9,390  | 保険                      |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD                              | 23       | 23     |     | 78         | 1,675  | 家庭用耐久財                  |
| CSC FINANCIAL CO LTD                                 | 261      | 289    |     | 627        | 13,375 | 資本市場                    |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD       | 121.8    | 64.61  |     | 124        | 2,656  | 化学                      |
| NANJING KINGFRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD | 91       | 91     |     | 116        | 2,488  | 医薬品                     |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD                          | 332      | 248    |     | 389        | 8,305  | 化学                      |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD                              | 31       | 31     |     | 135        | 2,897  | 飲料                      |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD                           | 225      | 225    |     | 226        | 4,825  | 資本市場                    |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD                | 103.72   | 0.46   |     | 1          | 21     | 生活必需品流通・小売り             |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD                          | 388      | 388    |     | 251        | 5,359  | 金属・鉱業                   |
| CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD                        | 37       | 37     |     | 70         | 1,493  | 化学                      |
| CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD                 | 52       | —      |     | —          | —      | 食品                      |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD                            | 152.78   | 152.78 |     | 295        | 6,308  | 化学                      |
| SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD                      | 30       | 22     |     | 191        | 4,092  | 自動車用部品                  |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD                  | 31.5     | 44.1   |     | 153        | 3,282  | 通信機器                    |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD                    | 39       | 37     |     | 161        | 3,450  | 化学                      |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD       | 27       | 27     |     | 88         | 1,885  | 電子装置・機器・部品              |
| JUEWEI FOOD CO LTD                                   | 31       | —      |     | —          | —      | 食品                      |
| OPPEIN HOME GROUP INC                                | 21       | 21     |     | 122        | 2,621  | 家庭用耐久財                  |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD                        | 91.16    | 91.16  |     | 262        | 5,604  | 金属・鉱業                   |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD                      | 95       | 95     |     | 122        | 2,610  | 食品                      |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD                             | 30       | 31     |     | 541        | 11,539 | 通信機器                    |
| SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD                      | 103      | —      |     | —          | —      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD                       | 47       | 1      |     | 5          | 119    | 化学                      |
| HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD                   | 69       | 69     |     | 215        | 4,586  | 化学                      |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD                              | 45.4     | 0.4    |     | 3          | 76     | 電子装置・機器・部品              |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD                   | 30       | 30     |     | 394        | 8,416  | 自動車用部品                  |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD             | 27       | —      |     | —          | —      | 医薬品                     |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD                             | 80.3     | —      |     | —          | —      | ヘルスケア機器・用品              |
| BGI GENOMICS CO LTD                                  | 13       | —      |     | —          | —      | バイオテクノロジー               |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD                    | 30       | 48     |     | 138        | 2,946  | 化学                      |
| CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD     | 31       | 31     |     | 92         | 1,974  | 金属・鉱業                   |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD          | 32       | 32     |     | 65         | 1,395  | バイオテクノロジー               |
| CAITONG SECURITIES CO LTD                            | 127      | 127    |     | 91         | 1,960  | 資本市場                    |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD                      | 24       | 24     |     | 117        | 2,514  | 化学                      |
| BANK OF CHENGDU CO LTD                               | 213      | 213    |     | 299        | 6,388  | 銀行                      |
| SHENGIE RESOURCES HOLDING CO LTD                     | 132      | —      |     | —          | —      | 金属・鉱業                   |
| BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD              | 42       | 1      |     | 5          | 110    | 自動車用部品                  |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD           | 19       | 19     |     | 87         | 1,866  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HEBEI YANGYUAN ZIHUI BEVERAGE CO LTD                 | —        | 118    |     | 309        | 6,590  | 食品                      |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD                   | 561      | 576    |     | 1,296      | 27,628 | 電子装置・機器・部品              |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD      | 74       | 58     |     | 1,580      | 33,700 | ヘルスケア機器・用品              |
| OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD                    | —        | 608    |     | 158        | 3,382  | 各種消費者サービス               |
| HUAXI SECURITIES CO LTD                              | 155      | —      |     | —          | —      | 資本市場                    |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC                             | 16       | 16     |     | 89         | 1,900  | ソフトウェア                  |

| 銘<br>柄  | 期 首(前期末) | 当 期 末  |        |             |                    | 業 種 等       |
|---|----------|--------|--------|-------------|--------------------|-------------|
|   |          | 株 数    | 株 数    | 評 価 額       | 邦貨換算金額             |             |
|   |          |        |        | 外 貨 建 金 額   |                    |             |
| (中国)  |          |        |        | 千オフショア・人民元  | 千円                 |             |
| SUNRESIN NEW MATERIALS CO LTD                         | 百株       | 百株     | 40.5   | 206         | 4,395              | 化学          |
| SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD            | —        | —      | —      | —           | —                  | 化学          |
| OVCTEK CHINA INC                                      | 85       | —      | —      | —           | —                  | ヘルスケア機器・用品  |
| SG MICRO CORP   | 40.6     | —      | —      | —           | —                  | 半導体・半導体製造装置 |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD                | 31.5     | 33.95  | 211    | 4,504       | 電気設備               |             |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC                          | 138      | 202.4  | 3,966  | 84,565      | 半導体・半導体製造装置        |             |
| WUXI APPTEC CO LTD                                    | 30.16    | 30.16  | 228    | 4,871       | ライフサイエンス・ツール／サービス  |             |
| BAIC BLUEPARK NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD            | 129.72   | 139.72 | 602    | 12,852      | 自動車                |             |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD                               | —        | 514    | 336    | 7,166       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD                | 103      | 103    | 261    | 5,566       | 銀行                 |             |
| HAINAN AIRPORT INFRASTRUCTURE CO LTD                  | 921      | 234    | 108    | 2,314       | 不動産管理・開発           |             |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD                            | —        | 825    | 278    | 5,944       | 電子装置・機器・部品         |             |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD                      | 73       | 73     | 257    | 5,482       | 電子装置・機器・部品         |             |
| NINGKIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD                   | 25.6     | 25.6   | 239    | 5,100       | 化学                 |             |
| PHARMARON BEIJING CO LTD                              | 297      | 253    | 428    | 9,131       | ライフサイエンス・ツール／サービス  |             |
| SHENZHEN DYNANOMIC CO LTD                             | 49.5     | 74.25  | 141    | 3,007       | 化学                 |             |
| BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD | 6        | —      | —      | —           | 電子装置・機器・部品         |             |
| SHANGHAI FRIENDLESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD    | 29       | —      | —      | —           | 電子装置・機器・部品         |             |
| AMLOGIC SHANGHAI CO LTD                               | 11       | 11     | 330    | 7,038       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD          | 11       | 11     | 59     | 1,265       | 商社・流通業             |             |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD           | 39       | —      | —      | —           | 金属・鉱業              |             |
| ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA        | 18       | 25.2   | 93     | 1,999       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD                             | 30       | 30     | 425    | 9,071       | 電子装置・機器・部品         |             |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD         | 54       | 54     | 267    | 5,698       | 電子装置・機器・部品         |             |
| NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD            | 750      | 534    | 320    | 6,841       | 電気設備               |             |
| ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO                     | 27       | —      | —      | —           | 電気設備               |             |
| TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD       | 35       | —      | —      | —           | 通信機器               |             |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD                    | 82       | 82     | 175    | 3,744       | 不動産管理・開発           |             |
| WILL SEMICONDUCTOR LTD                                | 263      | 287    | 281    | 5,995       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD                            | 91.3     | 50.3   | 498    | 10,626      | 半導体・半導体製造装置        |             |
| JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD                       | 23.8     | —      | —      | —           | ライフサイエンス・ツール／サービス  |             |
| MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD                      | 32.2     | —      | —      | —           | 電気設備               |             |
| BANK OF CHANGSHA CO LTD                               | 128      | 128    | 117    | 2,502       | 銀行                 |             |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD                            | 437      | —      | —      | —           | 銀行                 |             |
| PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD    | 1,143    | 1,143  | 341    | 7,285       | 銀行                 |             |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD                         | 707      | 707    | 226    | 4,823       | 金属・鉱業              |             |
| CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD                    | 107      | 107    | 236    | 5,036       | 電子装置・機器・部品         |             |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP                | 248      | 248    | 179    | 3,827       | 資本市場               |             |
| PROYA COSMETICS CO LTD                                | 22       | 22     | 127    | 2,720       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD                   | 12.6     | —      | —      | —           | パーソナルケア用品          |             |
| CGN POWER CO LTD                                      | 29       | 29     | 124    | 2,650       | 電気設備               |             |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD            | —        | 695    | 297    | 6,341       | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |             |
| GONEO GROUP CO LTD                                    | —        | 1,993  | 1,030  | 21,965      | 陸上運輸               |             |
| ROCKCHIP ELECTRONICS CO LTD                           | —        | 19     | 208    | 4,446       | 電気設備               |             |
| STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD                           | 8        | 32     | 172    | 3,683       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| SUZHOU TFC OPTICAL COMMUNICATION CO LTD               | —        | 8      | 112    | 2,406       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD                    | 9.6      | 20     | 343    | 7,321       | 通信機器               |             |
| CSPC INNOVATION PHARMACEUTICAL CO LTD                 | —        | 15.36  | 175    | 3,746       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD                   | 1,850    | 46     | 170    | 3,627       | 医薬品                |             |
| BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD                        | 1,176    | —      | —      | —           | 銀行                 |             |
| ISOFTSTONE INFORMATION TECHNOLOGY GROUP CO LTD        | 210      | 571    | 12,184 | 資本市場        |                    |             |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD                    | —        | 32     | 210    | 4,494       | 情報技術サービス           |             |
| JIANGSU PACIFIC QUARTZ CO LTD                         | 23       | 23     | 136    | 2,919       | バイオテクノロジー          |             |
| HOYMILES POWER ELECTRONICS INC                        | 9        | 57     | 1,231  | 半導体・半導体製造装置 |                    |             |
| VERISILICON MICROELECTRONICS SHANGHAI CO LTD          | —        | 9      | 1,705  | 電気設備        |                    |             |
| TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD                        | —        | 5.96   | 143    | 3,055       | 半導体・半導体製造装置        |             |
| CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD                            | 435      | 40     | 124    | 2,661       | 金属・鉱業              |             |
|   | 39       | 435    | 304    | 6,491       | 化学                 |             |
|   |          | 50.7   | 98     | 2,097       |                    |             |

| 銘<br>柄  | 期 首(前期末) | 当 期 末  |       |            |        | 業 種 等                |
|---|----------|--------|-------|------------|--------|----------------------|
|   |          | 株 数    | 株 数   | 評 価 額      | 邦貨換算金額 |                      |
|   |          |        |       | 外 貨 建 金 額  |        |                      |
| (中国)  |          |        |       | 千オフショア・人民元 | 千円     |                      |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD                           | 百株       | 百株     |       |            |        | 電気設備                 |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD                   | 14       | 14     | 79    | 1,685      |        | 食品                   |
| ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD                | 61       | 61     | 184   | 3,935      |        | 医薬品                  |
| SHENZHEN SED INDUSTRY CO LTD                          | 16       | —      | —     | —          |        | 建設・土木                |
| HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD                    | —        | 76     | 125   | 2,678      |        | 化学                   |
| HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD                | 63       | —      | —     | —          |        |                      |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD          | 60       | 60     | 162   | 3,470      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD                            | 22       | 28.6   | 140   | 3,005      |        | 金属・鉱業                |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD                            | 104.8    | 115.72 | 179   | 3,836      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD  | 356      | 356    | 223   | 4,773      |        | 資本市場                 |
| SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD | 50.55    | 24.77  | 173   | 3,706      |        | バイオテクノロジー            |
| SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY CO LTD                     | 29       | 29     | 182   | 3,884      |        | ヘルスケア機器・用品           |
| FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD                            | 38       | 53.2   | 70    | 1,493      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD                  | 26       | 26     | 214   | 4,570      |        | 食品                   |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD                    | 75       | 79     | 245   | 5,237      |        | 資本市場                 |
| SHANGHAI UNITED IMAGING HEALTHCARE CO LTD             | 46       | 46     | 241   | 5,145      |        | 機械                   |
| PIOTECH INC   | —        | 40     | 488   | 10,422     |        | ヘルスケア機器・用品           |
| RANGE INTELLIGENT COMPUTING TECHNOLOGY GROUP CO LTD   | —        | 5.92   | 110   | 2,350      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| ASR MICROELECTRONICS CO LTD                           | —        | 91     | 279   | 5,959      |        | 情報技術サービス             |
| JINKO SOLAR CO LTD                                    | —        | 40     | 149   | 3,193      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| CAMBICON TECHNOLOGIES CORP LTD                        | —        | 402    | 310   | 6,624      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| QI AN XIN TECHNOLOGY GROUP INC                        | —        | 28     | 420   | 8,959      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD                        | —        | 56     | 161   | 3,444      |        | ソフトウェア               |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD                   | 29       | 40.6   | 152   | 3,257      |        | 金属・鉱業                |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD                    | 16       | 11     | 325   | 6,947      |        | バイオテクノロジー            |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC                  | 22       | 32     | 546   | 11,641     |        | コンピュータ・周辺機器          |
| NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD                | 32.47    | 24.47  | 707   | 15,087     |        | ソフトウェア               |
| BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD                    | —        | 190    | 244   | 5,212      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| SHANGHAI MEDICILON INC                                | —        | 8.4    | 314   | 6,708      |        | 家庭用耐久財               |
| XINJIANG DAQO NEW ENERGY CO LTD                       | 8        | —      | —     | —          |        | ライフソリューションズ・ツール／サービス |
| CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD                     | —        | 86     | 222   | 4,746      |        | 半導体・半導体製造装置          |
| ANHUI JIANGHUA AUTOMOBILE GROUP CORP LTD              | 1,856    | 1,856  | 417   | 8,902      |        | 建設・土木                |
| PETROCHINA CO LTD                                     | 1,221    | 1,173  | 1,282 | 27,331     |        | 自動車                  |
| INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD             | 3,737    | 3,057  | 1,681 | 35,843     |        | 石油・ガス・消耗燃料           |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD                        | 5,112    | 4,131  | 1,842 | 39,277     |        | 銀行                   |
| BANK OF CHINA LTD                                     | 1,960    | 1,960  | 913   | 19,471     |        | 銀行                   |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP                       | 2,273    | 1,203  | 798   | 17,028     |        | 石油・ガス・消耗燃料           |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD                           | 138      | 138    | 380   | 8,107      |        | 保険                   |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD                           | 334      | 339    | 1,420 | 30,280     |        | 石油・ガス・消耗燃料           |
| CHINA MERCHANTS BANK CO LTD                           | 1,186    | 937    | 3,120 | 66,517     |        | 銀行                   |
| PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD               | 626      | 518    | 2,017 | 43,011     |        | 保険                   |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD                                | 1,299    | 886    | 1,433 | 30,560     |        | 銀行                   |
| SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD               | 1,513    | 1,667  | 1,223 | 26,084     |        | 銀行                   |
| CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD                       | 2,177    | 1,334  | 537   | 11,460     |        | 銀行                   |
| SAIC MOTOR CORP LTD                                   | 425      | 425    | 645   | 13,762     |        | 自動車                  |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD                                | 72       | 58     | 9,668 | 206,117    |        | 飲料                   |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD                         | 2,257    | 1,943  | 1,313 | 28,000     |        | 銀行                   |
| CITIC SECURITIES CO LTD                               | 703      | 597    | 1,080 | 23,035     |        | 資本市場                 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD                  | 407      | 402    | 945   | 20,156     |        | 保険                   |
| SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD              | 383      | 383    | 222   | 4,743      |        | 運送インフラ               |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD                            | 1,254    | 1,106  | 2,873 | 61,255     |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者   |
| DAQIN RAILWAY CO LTD                                  | 826      | 826    | 630   | 13,435     |        | 陸上輸送                 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD                          | 2,151    | 2,303  | 723   | 15,416     |        | 銀行                   |
| CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD         | 2,715    | 1,683  | 900   | 19,195     |        | 建設・土木                |
| HAITONG SECURITIES CO LTD                             | 555      | 555    | 440   | 9,382      |        | 資本市場                 |
| HUAXIA BANK CO LTD                                    | 707      | 707    | 478   | 10,203     |        | 銀行                   |
| INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD           | 325      | 296    | 809   | 17,264     |        | 食品                   |

| 銘柄  | 期首(前期末) | 当期末    |       |            |        | 業種等                     |
|---|---------|--------|-------|------------|--------|-------------------------|
|   |         | 株数     | 株数    | 評価額        | 邦貨換算金額 |                         |
|   |         |        |       | 外貨建金額      |        |                         |
| (中国)  |         | 百株     | 百株    | 千オフショア・人民元 | 千円     |                         |
| BANK OF BEIJING CO LTD                              | 1,664   | 1,383  | 795   | 16,952     |        | 銀行                      |
| CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD             | 1,912   | 1,248  | 601   | 12,823     |        | 無線通信サービス                |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD                         | 1,081   | 792    | 571   | 12,173     |        | 金属・鉱業                   |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD                           | 232     | 232    | 537   | 11,459     |        | 建設資材                    |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD                   | 283     | 413    | 579   | 12,352     |        | 資本市場                    |
| HUANENG POWER INTERNATIONAL INC                     | 590     | 590    | 592   | 12,640     |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD                             | 117     | 117    | 299   | 6,382      |        | 自動車                     |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD         | 544     | 557    | 450   | 9,594      |        | 不動産管理・開発                |
| CRRC CORP LTD                                       | 1,417   | 1,089  | 858   | 18,293     |        | 機械                      |
| JIANGSU HENGTRUI MEDICINE CO LTD                    | 347.52  | 266.52 | 1,183 | 25,221     |        | 医薬品                     |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD    | 174     | 174    | 354   | 7,567      |        | 金属・鉱業                   |
| HUATAI SECURITIES CO LTD                            | 495     | 403    | 544   | 11,598     |        | 資本市場                    |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD                             | 1,004   | 856    | 623   | 13,284     |        | 建設・土木                   |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD                     | 163     | 66     | 192   | 4,111      |        | 保険                      |
| HAIER SMART HOME CO LTD                             | 321     | 257    | 715   | 15,258     |        | 家庭用耐久財                  |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD                          | 482     | 279    | 449   | 9,581      |        | 機械                      |
| GD POWER DEVELOPMENT CO LTD                         | 1,013   | 1,013  | 528   | 11,272     |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| CHINA CONSTRUCTION BANK CORP                        | 562     | 562    | 409   | 8,722      |        | 銀行                      |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD          | 174     | 124    | 282   | 6,021      |        | 医薬品                     |
| GUANGHUI ENERGY CO LTD                              | 264     | 264    | 207   | 4,429      |        | 石油・ガス・消耗燃料              |
| GEMDALE CORP  | 397     | —      | —     | —          |        | 不動産管理・開発                |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD                        | —       | 381    | 441   | 9,405      |        | 半導体・半導体製造装置             |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD                        | 200     | 145    | 1,262 | 26,917     |        | 化学                      |
| SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD                      | 787     | 787    | 355   | 7,583      |        | 電気設備                    |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD                           | 1,135   | 1,035  | 1,871 | 39,892     |        | 金属・鉱業                   |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD                           | —       | 551    | 424   | 9,056      |        | 資本市場                    |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD                          | —       | 382    | 608   | 12,964     |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD                              | 323.44  | 417.12 | 1,065 | 22,719     |        | 電気設備                    |
| OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD                     | 298     | 298    | 197   | 4,218      |        | エネルギー設備・サービス            |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD              | 111     | 98     | 756   | 16,122     |        | 専門小売り                   |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD                   | 309     | 309    | 266   | 5,671      |        | 自動車                     |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD            | 2,225   | 2,225  | 362   | 7,731      |        | 金属・鉱業                   |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD                             | 44      | 44     | 343   | 7,316      |        | 飲料                      |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD               | 250     | 250    | 75    | 1,604      |        | 金融サービス                  |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD                          | 1,020   | 372    | 277   | 5,908      |        | 金属・鉱業                   |
| AIR CHINA LTD                                       | 607     | 448    | 321   | 6,857      |        | 旅客航空輸送                  |
| TBEA CO LTD   | 186     | 241.8  | 355   | 7,577      |        | 電気設備                    |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD          | 435     | 435    | 306   | 6,537      |        | 建設・土木                   |
| METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD                     | 636     | 562    | 193   | 4,133      |        | 建設・土木                   |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD                | 1,173   | 445    | 233   | 4,970      |        | 建設・土木                   |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD                             | 337     | 212    | 834   | 17,793     |        | 機械                      |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD               | 104     | 116    | 427   | 9,107      |        | 運送インフラ                  |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD | 69      | 69     | 209   | 4,461      |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| JIANGXI COPPER CO LTD                               | 149     | 149    | 387   | 8,268      |        | 金属・鉱業                   |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LTD                         | 343     | 343    | 129   | 2,756      |        | 資本市場                    |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD                     | 285     | 58     | 104   | 2,229      |        | 自動車用部品                  |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD                          | —       | 252    | 212   | 4,539      |        | 資本市場                    |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD                     | —       | 330    | 294   | 6,268      |        | 化学                      |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD                      | 237     | 237    | 406   | 8,659      |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| SHANGHAI PHARMACEUTICAL HOLDING CO LTD              | 114     | 114    | 200   | 4,269      |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AECC AVIATION POWER CO LTD                          | 112     | 93     | 305   | 6,522      |        | 航空宇宙・防衛                 |
| BANK OF NANJING CO LTD                              | 573     | 573    | 534   | 11,384     |        | 銀行                      |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD                | 76      | 158.53 | 135   | 2,879      |        | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD                      | 896.7   | 480.7  | 522   | 11,139     |        | 海上運輸                    |
| CMOC GROUP LIMITED                                  | 1,197   | 534    | 482   | 10,291     |        | 金属・鉱業                   |
| ZHONGJIN GOLD CORP LTD                              | —       | 412    | 547   | 11,681     |        | 金属・鉱業                   |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD                        | 338     | 338    | 183   | 3,919      |        | 資本市場                    |

| 銘柄  | 期首(前期末) | 当期末    |       |            |        | 業種等                |
|---|---------|--------|-------|------------|--------|--------------------|
|   |         | 株数     | 株数    | 評価額        | 邦貨換算金額 |                    |
|   |         |        |       | 外貨建金額      |        |                    |
| (中国)  |         |        |       | 千オフショア・人民元 | 千円     |                    |
| BEIJING TONGRENTANG CO LTD                                      | 百株      | 90     | 90    | 376        | 8,033  | 医薬品                |
| SHANDONG GOLD MINING CO LTD                                     | 201.2   | 201.2  | 624   | 13,309     |        | 金属・鉱業              |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD                                 | 78      | 78     | 156   | 3,340      |        | 電気設備               |
| JINDUICHENG MOLYBDENUM CO LTD                                   | —       | 277    | 330   | 7,050      |        | 金属・鉱業              |
| PEOPLE.CN CO LTD  | —       | 70     | 167   | 3,578      |        | メディア               |
| BBMG CORP   | 542     | —      | —     | —          | —      | 建設資材               |
| YONGHUI SUPERSTORES CO LTD                                      | —       | 845    | 185   | 3,945      |        | 生活必需品流通・小売         |
| HAINAN AIRLINES HOLDING CO LTD                                  | —       | 2,683  | 362   | 7,721      |        | 旅客航空輸送             |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD                                    | 140     | 210    | 538   | 11,469     |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| YUTONG BUS CO LTD   | —       | 60     | 144   | 3,085      |        | 機械                 |
| SHENERGY CO LTD   | —       | 429    | 370   | 7,892      |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD                                 | 306     | 795    | 278   | 5,931      |        | 旅客航空輸送             |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD                                      | 150.19  | 150.19 | 271   | 5,779      |        | 電気設備               |
| HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD                            | 580     | 580    | 428   | 9,137      |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANXI LUAN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD             | 264     | 164    | 380   | 8,104      |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| HUNDSEN TECHNOLOGIES INC  | 102.64  | 102.64 | 215   | 4,601      |        | ソフトウェア             |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD                                | 162.5   | 162.5  | 180   | 3,852      |        | ソフトウェア             |
| COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD                               | 1,275   | —      | —     | —          |        | 商社・流通業             |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD  | 33      | 33     | 68    | 1,466      |        | 金属・鉱業              |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD                                  | 364     | 451    | 248   | 5,297      |        | 旅客航空輸送             |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD                              | 590     | 590    | 142   | 3,043      |        | 建設・土木              |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD                               | 102     | 102    | 462   | 9,852      |        | 自動車用部品             |
| XIAMEN C & D INC  | 189     | 189    | 196   | 4,190      |        | 商社・流通業             |
| YOUNGOR FASHION CO LTD  | 256     | 256    | 192   | 4,109      |        | 不動産管理・開発           |
| AVIC HELICOPTER CO LTD  | 46      | 46     | 185   | 3,956      |        | 航空宇宙・防衛            |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD                                       | 168     | 168    | 105   | 2,249      |        | 資本市場               |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD                               | 151     | 8      | 15    | 338        |        | 医薬品                |
| ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD                    | 495     | 142    | 120   | 2,560      |        | 大規模小売り             |
| SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD                        | 149     | 223.5  | 227   | 4,840      |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD | 394     | 394    | 153   | 3,275      |        | 化学                 |
| HISENSE VISUAL TECHNOLOGY CO LTD                                | —       | 3      | 8     | 173        |        | 家庭用耐久財             |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD                               | 196     | 196    | 96    | 2,059      |        | 電気設備               |
| WESTERN MINING CO LTD   | 233     | —      | —     | —          |        | 金属・鉱業              |
| ZHANGZHOU PIENTZUJUANG PHARMACEUTICAL CO LTD                    | 39      | 25     | 568   | 12,127     |        | 医薬品                |
| GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD                         | 341     | 341    | 299   | 6,375      |        | 金属・鉱業              |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD                       | 74.8    | 50.8   | 1,235 | 26,340     |        | 飲料                 |
| KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD                                    | 126     | 126    | 127   | 2,723      |        | 機械                 |
| CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD                          | 568     | 568    | 495   | 10,558     |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD                       | 250     | 250    | 154   | 3,283      |        | 専門小売り              |
| SHANGHAI ZHANJIANG HIGH-TECH PARK DEVELOPMENT CO LTD            | —       | 164    | 298   | 6,356      |        | 不動産管理・開発           |
| CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD                        | 65      | 12.5   | 36    | 773        |        | ソフトウェア             |
| ZHEJIANG JUHHUA CO LTD  | 203     | 203    | 478   | 10,200     |        | 化学                 |
| PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD                          | 194     | —      | —     | —          |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD                                | 292     | 292    | 105   | 2,240      |        | 金属・鉱業              |
| BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD                    | —       | 27     | 76    | 1,637      |        | バイオテクノロジー          |
| SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD                                  | 319     | —      | —     | —          |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD                             | 126     | 126    | 168   | 3,593      |        | 電気設備               |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD                     | 261     | 23     | 37    | 795        |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| JONEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD          | 42      | 42     | 109   | 2,340      |        | 食品                 |
| DALIAN PORT PDA CO LTD  | 1,732   | 1,732  | 247   | 5,280      |        | 運送インフラ             |
| SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD                              | 339     | 474.6  | 372   | 7,932      |        | 建設・土木              |
| YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD  | 127     | 127    | 267   | 5,699      |        | 化学                 |
| ZHEJIANG HUAIHAI PHARMACEUTICAL CO LTD                          | 58.3    | 58.3   | 88    | 1,884      |        | 医薬品                |
| GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD                   | —       | 195    | 201   | 4,294      |        | 運送インフラ             |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD                   | 118     | 118    | 137   | 2,940      |        | 医薬品                |
| SINOMA INTERNATIONAL ENGINEERING CO                             | —       | 224    | 286   | 6,098      |        | 建設・土木              |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD                                       | 33      | 26     | 42    | 908        |        | 電子装置・機器・部品         |

| 銘<br>柄  | 期 首(前期末) | 当 期 末  |       |            |        | 業 種 等              |
|---|----------|--------|-------|------------|--------|--------------------|
|   |          | 株 数    | 株 数   | 評 価 額      | 邦貨換算金額 |                    |
|   |          |        |       | 外 貨 建 金 額  |        |                    |
| (中国)  |          |        |       | 千オフショア・人民元 | 千円     |                    |
| SHANXI COAL INTERNATIONAL ENERGY GROUP CO LTD       | 百株       | 百株     | 111   | 176        | 3,771  | 商社・流通業             |
| TONGWEI CO LTD                                      | —        | 111    | 176   | 3,771      |        |                    |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD                   | 290      | 170    | 407   | 8,679      |        | 半導体・半導体製造装置        |
| JCET GROUP CO LTD                                   | 88.79    | 106.54 | 407   | 8,692      |        | ソフトウェア             |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD              | 109      | 109    | 278   | 5,946      |        | 半導体・半導体製造装置        |
| CHONGQING BREWERY CO LTD                            | 68       | 68     | 128   | 2,745      |        | 半導体・半導体製造装置        |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD       | 25       | 25     | 163   | 3,490      |        | 飲料                 |
| HUAXIN CEMENT CO LTD                                | 53       | 53     | 146   | 3,116      |        | ホテル・レストラン・レジャー     |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD            | 56       | —      | —     | —          |        | 建設資材               |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD                            | 104.9    | 104.9  | 295   | 6,295      |        | 化学会社               |
| CHINA JUSHI CO LTD                                  | 17       | 17     | 159   | 3,399      |        | 電子装置・機器・部品         |
| SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD                 | 202.46   | 202.46 | 229   | 4,903      |        | 建設資材               |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD                              | 624      | 624    | 147   | 3,139      |        | 化学会社               |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD                     | 132      | 132    | 156   | 3,326      |        | 化学会社               |
| ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD                         | 45.24    | 39.24  | 215   | 4,590      |        | 機械                 |
| HEGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD                       | 196      | —      | —     | —          |        | 建設関連製品             |
| SAILUN GROUP CO LTD                                 | 196      | 196    | 257   | 5,490      |        | 通信機器               |
| TONGKUN GROUP CO LTD                                | 197      | 197    | 323   | 6,887      |        | 自動車用部品             |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD                    | 157      | 157    | 218   | 4,648      |        | 化学会社               |
| ANGEL YEAST CO LTD                                  | 17       | 22.1   | 127   | 2,718      |        | 化学会社               |
| HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD                 | 49       | 49     | 145   | 3,107      |        | 食品                 |
| NINGBO SANXING MEDICAL ELECTRIC CO LTD              | 56       | —      | —     | —          |        | 化学会社               |
| SHEDE SPIRITS CO LTD                                | —        | 138.04 | 503   | 10,723     |        | 電気設備               |
| BTG HOTELS GROUP CO LTD                             | —        | 21     | 149   | 3,191      |        | 飲料                 |
| SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD        | 148      | —      | —     | —          |        | ホテル・レストラン・レジャー     |
| CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD                       | 42       | —      | —     | —          |        | 半導体・半導体製造装置        |
| YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD          | 15       | 15     | 78    | 1,680      |        | 化学会社               |
| NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD                       | 9        | 9      | 50    | 1,083      |        | パーソナルケア用品          |
| HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD                    | 8        | 15.4   | 128   | 2,731      |        | 機械                 |
| EASTROC BEVERAGE GROUP CO LTD                       | 26       | —      | —     | —          |        | 半導体・半導体製造装置        |
| BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD                     | —        | 10     | 190   | 4,070      |        | 飲料                 |
| GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD                          | 16       | 16     | 87    | 1,858      |        | バイオテクノロジー          |
| CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD                | 10       | 14     | 144   | 3,088      |        | 電気設備               |
| TRINA SOLAR CO LTD                                  | 71       | 71     | 284   | 6,063      |        | 半導体・半導体製造装置        |
| CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD          | 111      | 111    | 245   | 5,227      |        | 半導体・半導体製造装置        |
| ZANGGE MINING CO LTD                                | 1,817    | 1,518  | 737   | 15,727     |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD               | 116      | 116    | 335   | 7,146      |        | 化学会社               |
| PYLON TECHNOLOGIES CO LTD                           | 290      | 151    | 106   | 2,269      |        | 銀行                 |
| IRAY TECHNOLOGY CO LTD                              | 10       | —      | —     | —          |        | 電気設備               |
| WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD                     | 6        | 8.4    | 166   | 3,549      |        | ヘルスケア機器・用品         |
| 3PEAK INC   | 16       | —      | —     | —          |        | 半導体・半導体製造装置        |
| SUPCON TECHNOLOGY CO LTD                            | 12       | —      | —     | —          |        | 半導体・半導体製造装置        |
| HYGON INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD                 | 48       | 77.6   | 364   | 7,771      |        | 電子装置・機器・部品         |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD                | —        | 78     | 624   | 13,309     |        | 半導体・半導体製造装置        |
| HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD                      | 469.68   | 449.68 | 836   | 17,830     |        | 半導体・半導体製造装置        |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD | 127      | 127    | 252   | 5,376      |        | 金属・鉱業              |
| ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC POWER CO LTD              | 18       | 18     | 246   | 5,261      |        | 自動車用部品             |
| HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD                 | —        | 733    | 488   | 10,407     |        | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| HEILAN HOME CO LTD                                  | 102      | 7      | 30    | 655        |        | 医薬品                |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD                        | —        | 441    | 405   | 8,649      |        | 専門小売り              |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD             | 632.51   | 401.51 | 1,086 | 23,170     |        | 石油・ガス・消耗燃料         |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD                 | 240.16   | 255.19 | 951   | 20,275     |        | 食品                 |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD                            | 50       | 44     | 248   | 5,298      |        | 飲料                 |
| DONGXING SECURITIES CO LTD                          | 70       | 70     | 190   | 4,060      |        | 電気設備               |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD                           | 132      | 132    | 105   | 2,248      |        | 資本市場               |
| JUNEAIR AIRLINES CO LTD                             | 70       | 70     | 380   | 8,110      |        | 自動車用部品             |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD                      | 223      | 10     | 11    | 254        |        | 旅客航空輸送             |
|   | 407      | 407    | 544   | 11,617     |        | 資本市場               |

| 銘柄   | 期首(前期末)       | 当期末                         |                     |                     |                         | 業種等                 |  |
|--|---------------|-----------------------------|---------------------|---------------------|-------------------------|---------------------|--|
|  |               | 株数                          | 株数                  | 評価額                 |                         |                     |  |
|  |               |                             |                     | 外貨建金額               | 邦貨換算金額                  |                     |  |
| (中国)   |               |                             |                     |                     |                         |                     |  |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD            | 百株<br>1,050   | 百株<br>1,050                 | 千オフショア・人民元<br>1,008 | 21,488              | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |                     |  |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD                  | 34            | 34                          | 131                 | 2,800               | 飲料                      |                     |  |
| SERES GROUP CO LTD                             | —             | 90                          | 851                 | 18,161              | 自動車                     |                     |  |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD                | 53            | 53                          | 330                 | 7,040               | 飲料                      |                     |  |
| SKSHU PAINT CO LTD                             | 20            | 28                          | 84                  | 1,804               | 化学                      |                     |  |
| BANK OF JIANGSU CO LTD                         | 832           | 832                         | 672                 | 14,331              | 銀行                      |                     |  |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD                        | 454           | 339                         | 401                 | 8,556               | 銀行                      |                     |  |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD                  | 114           | 114                         | 257                 | 5,497               | 自動車用部品                  |                     |  |
| AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD                     | 14            | 14                          | 73                  | 1,568               | ヘルスケア機器・用品              |                     |  |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD        | 20            | —                           | —                   | —                   | 医薬品                     |                     |  |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD                       | 283           | 41                          | 66                  | 1,421               | 航空貨物・物流サービス             |                     |  |
| JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD                | 88.5          | 9.5                         | 31                  | 668                 | 家庭用耐久財                  |                     |  |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD                 | 304           | 304                         | 342                 | 7,290               | 資本市場                    |                     |  |
| SDIC CAPITAL CO LTD                            | 63            | 423                         | 265                 | 5,663               | 資本市場                    |                     |  |
| TOPCHOICE MEDICAL CORP                         | 32            | 32                          | 175                 | 3,743               | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |                     |  |
| ENN NATURAL GAS CO LTD                         | 213           | 184                         | 354                 | 7,558               | ガス                      |                     |  |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD         | 105.8         | 40.12                       | 100                 | 2,149               | 半導体・半導体製造装置             |                     |  |
| TOLY BREAD CO LTD                              | 70.56         | —                           | —                   | —                   | 食品                      |                     |  |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD                   | 28.6          | 40.04                       | 169                 | 3,610               | 生活必需品流通・小売り             |                     |  |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD               | 29.4          | 29.4                        | 210                 | 4,490               | 機械                      |                     |  |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD | 113.1         | 113.1                       | 222                 | 4,749               | 商業サービス・用品               |                     |  |
| ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA                 | 493           | 159                         | 127                 | 2,725               | 資本市場                    |                     |  |
| SPRING AIRLINES CO LTD                         | —             | 66                          | 379                 | 8,084               | 旅客航空輸送                  |                     |  |
| EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD                   | 160           | 160                         | 251                 | 5,351               | 資本市場                    |                     |  |
| SHANGHAI M&G STATIONERY INC                    | 45            | 45                          | 161                 | 3,432               | 商業サービス・用品               |                     |  |
| GREENLAND HOLDINGS CORP LTD                    | —             | 1,035                       | 179                 | 3,817               | 不動産管理・開発                |                     |  |
| FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD                    | 107           | 107                         | 89                  | 1,904               | 不動産管理・開発                |                     |  |
| 小計   | 株数<br>銘柄<br>数 | ・金額<br>率<br>数<比<br>銘柄<br>数> | 139,805.47<br>464銘柄 | 130,634.09<br>464銘柄 | 176,721<br>—            | 3,767,381<br><4.1%> |  |
| (マレーシア)  |               |                             |                     |                     |                         |                     |  |
| AMMB HOLDINGS BHD                              | 百株<br>1,652   | 百株<br>1,375                 | 千円<br>566           | 18,271              | 銀行                      |                     |  |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD                        | 6,808         | 5,243                       | 3,423               | 110,426             | 銀行                      |                     |  |
| CELCOMDIGI BHD                                 | 2,852         | 2,727                       | 1,131               | 36,501              | 無線通信サービス                |                     |  |
| MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD                 | 559.2         | 631.2                       | 624                 | 20,134              | 運送インフラ                  |                     |  |
| RHB BANK BHD                                   | 1,463.8       | 1,037.8                     | 593                 | 19,146              | 銀行                      |                     |  |
| HAP SENG CONSOLIDATED BHD                      | 600           | —                           | —                   | —                   | コングロマリット                |                     |  |
| TOP GLOVE CORP BHD                             | 5,007         | —                           | —                   | —                   | ヘルスケア機器・用品              |                     |  |
| GAMUDA BHD                                     | 1,498         | 1,561                       | 805                 | 25,979              | 建設・土木                   |                     |  |
| GENTING BHD                                    | 2,098         | 1,649                       | 740                 | 23,880              | ホテル・レストラン・レジャー          |                     |  |
| YTL CORP BHD                                   | —             | 2,630                       | 657                 | 21,206              | 総合公益事業                  |                     |  |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD                 | 180.56        | —                           | —                   | —                   | 銀行                      |                     |  |
| HONG LEONG BANK BHD                            | 655.08        | 490.08                      | 944                 | 30,475              | 銀行                      |                     |  |
| IOI CORP BHD                                   | 2,182.13      | 2,067.13                    | 822                 | 26,535              | 食品                      |                     |  |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD                        | 385           | 331                         | 750                 | 24,191              | 食品                      |                     |  |
| MALAYAN BANKING BHD                            | 4,764.75      | 4,142.75                    | 3,977               | 128,274             | 銀行                      |                     |  |
| MISC BHD                                       | 1,098.8       | 1,021.8                     | 797                 | 25,706              | 海上運輸                    |                     |  |
| NESTLE MALAYSIA BHD                            | 63            | 60                          | 738                 | 23,803              | 食品                      |                     |  |
| PPB GROUP BHD                                  | 594.6         | 502.6                       | 781                 | 25,191              | 食品                      |                     |  |
| PETRONAS DAGANGAN BHD                          | 344           | 229                         | 499                 | 16,101              | 石油・ガス・消耗燃料              |                     |  |
| PETRONAS GAS BHD                               | 795           | 610                         | 1,098               | 35,414              | ガス                      |                     |  |
| GENTING MALAYSIA BHD                           | 2,542         | 2,401                       | 626                 | 20,212              | ホテル・レストラン・レジャー          |                     |  |
| TELEKOM MALAYSIA BHD                           | 981           | 953                         | 584                 | 18,842              | 各種電気通信サービス              |                     |  |
| TENAGA NASIONAL BHD                            | 2,500.5       | 2,137.5                     | 2,462               | 79,421              | 電力                      |                     |  |
| QL RESOURCES BHD                               | 1,154.5       | 870.5                       | 535                 | 17,267              | 食品                      |                     |  |
| DIALOG GROUP BHD                               | 3,100.44      | —                           | —                   | —                   | エネルギー設備・サービス            |                     |  |
| PUBLIC BANK BHD(LOCAL)                         | 14,244.5      | 11,405.5                    | 4,733               | 152,665             | 銀行                      |                     |  |
| YTL POWER INTERNATIONAL BHD                    | —             | 1,933                       | 753                 | 24,315              | 総合公益事業                  |                     |  |

| 銘柄   | 期首(前期末)           | 当期末               |                   |              |                     | 業種等                     |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|--------------|---------------------|-------------------------|
|  |                   | 株数                | 株数                | 評価額          | 邦貨換算金額              |                         |
|  |                   | 外貨建金額             |                   |              |                     |                         |
| (マレーシア)  |                   |                   |                   |              |                     |                         |
| SIME DARBY BERHAD                                  | 百株<br>2,340       | 百株<br>2,344       | 千円<br>639         | 20,639       | 20,639              | コングロマリット                |
| AXIATA GROUP BERHAD                                | 2,353             | 2,647             | 688               | 22,197       | 22,197              | 無線通信サービス                |
| MAXIS BHD  | 2,060             | 1,758             | 608               | 19,618       | 19,618              | 無線通信サービス                |
| INARI AMERTRON BHD                                 | 2,347             | 2,219             | 694               | 22,401       | 22,401              | 半導体・半導体製造装置             |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD                       | 2,320             | 2,174             | 1,484             | 47,891       | 47,891              | 化学                      |
| IHH HEALTHCARE BHD                                 | 1,777             | 1,593             | 970               | 31,290       | 31,290              | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD                 | 3,761             | 2,841             | 1,494             | 48,198       | 48,198              | 金属・鉱業                   |
| SIME DARBY PLANTATION BHD                          | 2,208             | 1,615             | 713               | 23,023       | 23,023              | 食品                      |
| MR DIY GROUP M BHD                                 | 2,592             | 2,451             | 367               | 11,858       | 11,858              | 専門小売り                   |
| 小計   | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 79,881.86<br>34銘柄 | 65,650.86<br>32銘柄 | 36,308<br>—  | 1,171,087<br><1.3%> |                         |
| (南アフリカ)  |                   |                   |                   |              |                     |                         |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD                       | 百株<br>100         | 百株<br>—           | 千円<br>—           | —            | —                   | 金属・鉱業                   |
| BIDVEST GROUP LTD                                  | 278.47            | 207.17            | 4,820             | 39,093       | 39,093              | コングロマリット                |
| CLICKS GROUP LTD                                   | 242.86            | 191.96            | 5,337             | 43,283       | 43,283              | 生活必需品流通・小売り             |
| DISCOVERY LTD                                      | 491.2             | 426.19            | 4,648             | 37,698       | 37,698              | 保険                      |
| GOLD FIELDS LTD                                    | 838.89            | 718.33            | 24,228            | 196,493      | 196,493             | 金属・鉱業                   |
| REMGRO LTD   | 508.32            | 411.48            | 4,817             | 39,070       | 39,070              | 金融サービス                  |
| THE FOSCHINI GROUP LTD                             | 329.91            | —                 | —                 | —            | —                   | 専門小売り                   |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD                         | 608.94            | 435.21            | 7,625             | 61,841       | 61,841              | 金属・鉱業                   |
| EXXARO RESOURCES LTD                               | 247.34            | 170.72            | 3,169             | 25,702       | 25,702              | 石油・ガス・消耗燃料              |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD                          | 81.51             | 69.63             | 13,797            | 111,895      | 111,895             | 銀行                      |
| MTN GROUP LTD                                      | 1,610.39          | 1,350.77          | 10,869            | 88,152       | 88,152              | 無線通信サービス                |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD                              | 394.98            | —                 | —                 | —            | —                   | 金属・鉱業                   |
| FIRSTRAND LTD                                      | 4,859.72          | 3,891.92          | 23,012            | 186,634      | 186,634             | 金融サービス                  |
| NASPERS LTD  | 208.43            | 143.68            | 45,998            | 373,048      | 373,048             | 大規模小売り                  |
| NEDBANK GROUP LTD                                  | 445.78            | 322.6             | 6,876             | 55,768       | 55,768              | 銀行                      |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD                        | 48.23             | 58.42             | 4,671             | 37,887       | 37,887              | 金属・鉱業                   |
| SASOL LTD  | 542.4             | 481.38            | 7,591             | 61,569       | 61,569              | 化学                      |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD                              | 475.6             | 397.69            | 9,034             | 73,268       | 73,268              | 生活必需品流通・小売り             |
| MR PRICE GROUP LTD                                 | 260.25            | —                 | —                 | —            | —                   | 専門小売り                   |
| STANDARD BANK GROUP LTD                            | 1,286.35          | 1,065.44          | 17,800            | 144,360      | 144,360             | 銀行                      |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD                            | 901.73            | 677.55            | 3,845             | 31,183       | 31,183              | 大規模小売り                  |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD                      | 385.63            | 301.67            | 6,758             | 54,812       | 54,812              | 医薬品                     |
| ABSA GROUP LTD                                     | 811.22            | 700.74            | 9,654             | 78,300       | 78,300              | 銀行                      |
| SANLAM LTD   | 1,698.04          | 1,390.73          | 8,902             | 72,195       | 72,195              | 保険                      |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD                       | 811.33            | 693.63            | 6,914             | 56,073       | 56,073              | 金属・鉱業                   |
| KUMBA IRON ORE LTD                                 | 70.79             | 53.86             | 2,545             | 20,647       | 20,647              | 金属・鉱業                   |
| OUTSURANCE GROUP LTD                               | 646.4             | 703.5             | 2,776             | 22,513       | 22,513              | 保険                      |
| VODACOM GROUP PTY LTD                              | 595.48            | 439.38            | 3,840             | 31,147       | 31,147              | 無線通信サービス                |
| NEPI ROCKCASTLE NV                                 | 407.69            | 459.37            | 5,843             | 47,391       | 47,391              | 不動産管理・開発                |
| OLD MUTUAL LTD                                     | 4,792.38          | 3,914.87          | 3,973             | 32,225       | 32,225              | 保険                      |
| REINET INVESTMENTS SCA                             | 125.15            | 116.2             | 5,002             | 40,569       | 40,569              | 資本市場                    |
| PEPKOR HOLDINGS LTD                                | 1,661.42          | 1,697.35          | 2,926             | 23,731       | 23,731              | 専門小売り                   |
| MULTICHOICE GROUP LTD                              | 345.85            | —                 | —                 | —            | —                   | メディア                    |
| SIBANYE STILLWATER LTD                             | 2,808.77          | 2,240.39          | 5,766             | 46,768       | 46,768              | 金属・鉱業                   |
| NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD                      | 324.04            | 241.33            | 3,460             | 28,064       | 28,064              | 金属・鉱業                   |
| ANGLOGOLD ASHANTI PLC                              | —                 | 321.52            | 14,831            | 120,280      | 120,280             | 金属・鉱業                   |
| BID CORP LTD                                       | 319.82            | 260.51            | 10,822            | 87,771       | 87,771              | 生活必需品流通・小売り             |
| 小計   | 株数<br>銘柄<br>数<比率> | 30,565.31<br>36銘柄 | 24,555.19<br>32銘柄 | 292,163<br>— | 2,369,447<br><2.6%> |                         |
| (タイ)   |                   |                   |                   |              |                     |                         |
| BERLI JUCKER PCL NVDR                              | 百株<br>947         | 百株<br>—           | 千円<br>—           | —            | —                   | 生活必需品流通・小売り             |
| KRUNG THAI BANK PCL NVDR                           | 3,085             | 3,030             | 4,908             | 20,616       | 20,616              | 銀行                      |
| CP AXTRA PCL NVDR                                  | —                 | 1,593             | 4,978             | 20,908       | 20,908              | 生活必需品流通・小売り             |
| RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR | 1,243             | —                 | —                 | —            | —                   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| KASIKORN BANK PCL NVDR                             | 570               | 454               | 5,675             | 23,835       | 23,835              | 銀行                      |

| 銘柄  | 期首(前期末)    | 当期末        |            |           |                         | 業種等 |
|---|------------|------------|------------|-----------|-------------------------|-----|
|   |            | 株数         | 株数         | 評価額       | 邦貨換算金額                  |     |
|   |            |            |            | 外貨建金額     |                         |     |
| (タイ)  |            |            |            |           |                         |     |
| TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR                 | 百株         | 百株         | 千タイ・バーツ    | 千円        |                         |     |
| BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR                | —          | 16,672     | 2,934      | 12,323    | 銀行                      |     |
| ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR             | 6,721      | —          | —          | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| SHIN CORP PCL                               | 294        | —          | —          | —         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| CHAROEN POKPHAND FOODS PCL                  | 972        | 707        | 4,736      | 19,894    | 無線通信サービス                |     |
| ADVANCED INFO SERVICE PCL                   | 3,922      | 3,000      | 5,280      | 22,176    | 食品                      |     |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR                | 1,187      | 941        | 18,772     | 78,846    | 無線通信サービス                |     |
| DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR             | 5,190.2    | 3,803.2    | 3,993      | 16,772    | 専門小売り                   |     |
| PTT PCL                                     | 293.5      | 2,500      | 17,875     | 75,075    | 電子装置・機器・部品              |     |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR                   | 9,327      | 7,834      | 27,223     | 114,337   | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR                     | 2,650      | —          | —          | —         | 食品                      |     |
| LAND AND HOUSES PCL NVDR                    | 831        | 805        | 3,562      | 14,960    | 消費者金融                   |     |
| SIAM CEMENT PCL NVDR                        | 8,261      | 6,561      | 4,789      | 20,116    | 不動産管理・開発                |     |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR               | 729.5      | 650.5      | 16,327     | 68,575    | 建設資材                    |     |
| CENTRAL PATTANA PCL NVDR                    | 4,084      | 3,478      | 22,780     | 95,679    | 運送インフラ                  |     |
| BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR         | 1,934      | 1,565      | 9,742      | 40,916    | 不動産管理・開発                |     |
| BUMRUNGGRAD HOSPITAL PCL-NVDR               | 9,628      | 9,111      | 25,283     | 106,188   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR                | 525        | 513        | 11,542     | 48,478    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |     |
| THAI OIL PCL NVDR                           | 3,281.1    | 2,740.1    | 8,699      | 36,539    | ホテル・レストラン・レジャー          |     |
| CP ALL PCL NVDR                             | 1,247      | 890        | 5,228      | 21,960    | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL                      | 5,488      | 4,518      | 24,849     | 104,365   | 生活必需品流通・小売り             |     |
| PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR       | 8,669      | 6,431      | 3,955      | 16,611    | 陸上運輸                    |     |
| INDORAMA VENTURES PCL NVDR                  | 1,388.45   | 1,104.45   | 18,112     | 76,074    | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR                | 1,411.22   | 1,351.22   | 3,351      | 14,074    | 化学                      |     |
| JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR               | 2,349.08   | 1,834.08   | 7,336      | 30,812    | 化学                      |     |
| ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR                    | 543        | —          | —          | —         | 消費者金融                   |     |
| BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR         | 1,676      | 1,380      | 4,623      | 19,416    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| B GRIMM POWER PCL NVDR                      | 6,124      | 6,299      | 5,165      | 21,693    | 運送インフラ                  |     |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR            | 982        | —          | —          | —         | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| OSOTSPA PCL NVDR                            | 2,910      | 2,112      | 8,870      | 37,255    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| ASSET WORLD CORP PCL NVDR                   | 1,428      | —          | —          | —         | 飲料                      |     |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR                | 8,172      | 5,271      | 2,308      | 9,696     | ホテル・レストラン・レジャー          |     |
| SCG PACKAGING PCL NVDR                      | 1,584.33   | 1,210.33   | 4,236      | 17,791    | 大規模小売り                  |     |
| SRIAWAD POWER 1979 PCL NVDR                 | 1,433      | 978        | 3,105      | 13,041    | 容器・包装                   |     |
| PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR          | 690        | —          | —          | —         | 消費者金融                   |     |
| SCB X PCL NVDR                              | 2,953      | 2,086      | 3,775      | 15,857    | 専門小売り                   |     |
| TRUE CORP PCL NVDR                          | 903        | 677        | 7,176      | 30,140    | 銀行                      |     |
| CARABAO GROUP PCL NVDR                      | 8,489.28   | 8,963.28   | 7,170      | 30,116    | 各種電気通信サービス              |     |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR                  | 325        | —          | —          | —         | 飲料                      |     |
| GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR            | 554        | 587        | 2,553      | 10,724    | 消費者金融                   |     |
| 小計  | 744        | 383        | 1,905      | 8,002     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |     |
| 株式数   | 125,738.66 | 112,033.16 | 312,828    | 1,313,877 |                         |     |
| 銘柄数   | 43銘柄       | 35銘柄       | —          | <1.4%>    |                         |     |
| (ポーランド)                                     |            |            |            |           |                         |     |
| MBANK                                       | 百株         | 百株         | 千ポーランド・ズロチ | 千円        |                         |     |
| BUDIMEX SA                                  | 13.44      | 11.96      | 816        | 31,013    | 銀行                      |     |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA                        | —          | 10.92      | 751        | 28,544    | 建設・土木                   |     |
| BANK PEKAO SA                               | 132.82     | 100.79     | 1,435      | 54,490    | 金属・鉱業                   |     |
| ORLEN SA                                    | 171.77     | 141.31     | 2,552      | 96,918    | 銀行                      |     |
| LPP SA                                      | 600.93     | 474.36     | 3,203      | 121,619   | 石油・ガス・消耗燃料              |     |
| SANTANDER BANK POLSKA SA                    | 1.12       | 0.91       | 1,380      | 52,411    | 繊維・アパレル・贅沢品             |     |
| CD PROJEKT RED SA                           | 32.41      | 28.35      | 1,568      | 59,564    | 銀行                      |     |
| POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA | 70.01      | 46.71      | 525        | 19,941    | 娯楽                      |     |
| CYFROWY POLSAT SA                           | 859.44     | 696.57     | 4,035      | 153,228   | 銀行                      |     |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA                | 200.87     | —          | —          | —         | メディア                    |     |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA            | 800.42     | 608.56     | 365        | 13,876    | 電力                      |     |
| DINO POLSKA SA                              | 585        | 479.01     | 2,387      | 90,639    | 保険                      |     |
| ALLEGRO.EU SA                               | 46.92      | 39.14      | 1,401      | 53,198    | 生活必需品流通・小売り             |     |
|   | 345.9      | 416.96     | 1,329      | 50,483    | 大規模小売り                  |     |

| 銘柄  | 期首(前期末)   | 当期末  |  |  | 業種等  |
|---|---|--|--|--|--|
|   |   | 株数   | 株数   | 評価額  |  |
|   |   |  |  | 外貨建金額  | 邦貨換算金額   |
| (ポーランド)<br>PEPCO GROUP NV   | 百株<br>165.87  | 百株<br>165.87   | 千ポーランド・ズロチ<br>311  | 千円<br>11,810   | 大規模小売り   |
| 小計  | 株数：金額<br>銘柄数<比率><br>4,026.92<br>14銘柄  | 株数<br>3,221.42<br>14銘柄   | 評価額<br>22,065  | 邦貨換算金額<br>837,742<br><0.9%>  |  |
| (ハンガリー)<br>RICHTER GEDEON NYRT<br>MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT<br>OTP BANK NYRT   | 百株<br>137.96<br>407.81<br>222.96  | 百株<br>102.84<br>326.09<br>172.69   | 千ハンガリー・フォリント<br>93,121<br>98,674<br>297,199  | 千円<br>39,053<br>41,382<br>124,639  | 医薬品<br>石油・ガス・消耗燃料<br>銀行  |
| 小計  | 株数：金額<br>銘柄数<比率><br>768.73<br>3銘柄   | 株数<br>601.62<br>3銘柄  | 評価額<br>488,995   | 邦貨換算金額<br>205,075<br><0.2%>  |  |
| (ユーロ…ギリシャ)<br>PIRAEUS BANK S.A.<br>ALPHA BANK A.E.<br>NATIONAL BANK OF GREECE<br>HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA<br>FF GROUP<br>EUROBANK ERGASIAS SERVICES<br>MYTILINEOS HOLDINGS<br>MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN<br>OPAP SA<br>JUMBO SA<br>PUBLIC POWER CORP<br>TERNA ENERGY SA | 百株<br>—<br>2,124.73<br>515.07<br>208.5<br>31.3<br>2,404.41<br>90.56<br>46.96<br>178.33<br>120.11<br>214.41<br>61.02 | 百株<br>817.45<br>1,855.91<br>605.62<br>166.76<br>31.3<br>2,017.92<br>77.37<br>55.06<br>137.44<br>83.74<br>168.75<br>— | 千ユーロ<br>305<br>284<br>426<br>232<br>0<br>363<br>275<br>143<br>221<br>215<br>184<br>— | 千円<br>50,308<br>46,928<br>70,313<br>38,266<br>0<br>59,900<br>45,398<br>23,672<br>36,428<br>35,562<br>30,383<br>— | 銀行<br>銀行<br>銀行<br>各種電気通信サービス<br>繊維・アパレル・贅沢品<br>銀行<br>コングロマリット<br>石油・ガス・消耗燃料<br>ホテル・レストラン・レジャー<br>専門小売り<br>電力<br>独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計  | 株数：金額<br>銘柄数<比率><br>5,995.4<br>11銘柄   | 株数<br>6,017.32<br>11銘柄   | 評価額<br>2,653   | 邦貨換算金額<br>437,162<br><0.5%>  |  |
| 合計  | 株数：金額<br>銘柄数<比率><br>5,553,344.58<br>1,354銘柄   | 株数<br>5,958,371.91<br>1,332銘柄  | 評価額<br>—   | 邦貨換算金額<br>84,380,932<br><91.7%>  |  |

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

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

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

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

(※1) 当該銘柄はロシア株式を原資産とする預託証券です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。  
(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(※2) 当該銘柄はロシア株式です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(※3) 当該銘柄はロシアで事業を展開する会社の株式です。市場での取引の停止・制限が継続されているため、評価額をゼロとしています。  
(ファンド監査人と協議の上、企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」及び社団法人投資信託協会「投資信託財産の評価及び計理等に関する規則」に則り、委託会社が適切と判断した価格を採用しております。)

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

| 銘柄                               |          | 期首(前期末)<br>口数      | 当期末                     |                     |              |
|----------------------------------|----------|--------------------|-------------------------|---------------------|--------------|
|                                  |          |                    | 口数                      | 外貨建金額               | 邦貨換算金額       |
| (メキシコ)                           |          | 千口                 | 千口                      | 千メキシコ・ペソ            | 千円           |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB D |          | 186.1              | 154.41                  | 31,039              | 282,574      |
| GRUPO TELEVISA SAB               |          | 246.9              | —                       | —                   | —            |
| CEMEX SAB DE CV                  |          | 1,453.275          | 1,205.475               | 16,780              | 152,762      |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA      |          | 296.3              | 229.2                   | 6,112               | 55,648       |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV        |          | 49.5               | 39.9                    | 6,210               | 56,541       |
| 小計                               | 口数<br>銘柄 | 2,232,075<br>数<比率> | 1,628,985<br>5銘柄<0.5%>  | 60,143<br>4銘柄<0.6%> | 547,526<br>— |
| (ブラジル)                           |          | 千口                 | 千口                      | 千ブラジル・レアル           | 千円           |
| BANCO SANTANDER BRASIL SA        |          | 38                 | 29.7                    | 792                 | 23,347       |
| ENERGISA SA                      |          | 16.1               | 19.9                    | 909                 | 26,781       |
| KLABIN SA                        |          | 78.2               | 59.5                    | 1,449               | 42,674       |
| BANCO BTG PACTUAL SA             |          | 111                | 91.5                    | 2,995               | 88,201       |
| 小計                               | 口数<br>銘柄 | 243.3<br>数<比率>     | 200.6<br>4銘柄<0.2%>      | 6,147<br>4銘柄<0.2%>  | 181,005<br>— |
| (南アフリカ)                          |          | 千口                 | 千口                      | 千南アフリカ・ランド          | 千円           |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD       |          | 321,604            | —                       | —                   | —            |
| 小計                               | 口数<br>銘柄 | 321,604<br>数<比率>   | —<br>1銘柄<0.0%>          | —<br>—銘柄<-%>        | —<br>—       |
| 合計                               | 口数<br>銘柄 | 2,796,979<br>数<比率> | 1,829,585<br>10銘柄<0.7%> | —<br>8銘柄<0.8%>      | 728,532<br>— |

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

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

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別                                 | 当期末 |              |    | 末        |
|----|-----------------------------------|-----|--------------|----|----------|
|    |                                   | 買建  | 額            | 売建 |          |
| 外国 | M I N I   M S C I   E M G   M K T |     | 百万円<br>6,842 |    | 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

2024年4月18日現在

| 項<br>目        | 当<br>期<br>末      |           |
|---------------|------------------|-----------|
|               | 評<br>価<br>額      | 比<br>率    |
| 株式            | 千円<br>84,380,932 | %<br>91.0 |
| 投資信託受益証券、投資証券 | 728,532          | 0.8       |
| コール・ローン等、その他  | 7,596,644        | 8.2       |
| 投資信託財産総額      | 92,706,109       | 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、92,184,547千円、99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2024年4月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.46円、1香港・ドル=19.73円、1台湾・ドル=4.752円、1イギリス・ポンド=192.32円、1トルコ・リラ=4.754円、1メキシコ・ペソ=9.103円、1フィリピン・ペソ=2.70円、100チリ・ペソ=15.784円、100コロンビア・ペソ=3.956円、1クウェート・ディナール=502.31円、1カタール・リアル=42.43円、1サウジアラビア・リアル=41.24円、1インド・ルピー=1.86円、100インドネシア・ルピア=0.96円、1アラブ首長国連邦・ディルハム=42.13円、1ブラジル・レアル=29.442円、1チェコ・コルナ=6.524円、100韓国・ウォン=11.22円、1オフショア・人民元=21.318円、1マレーシア・リンギット=32.253円、1南アフリカ・ランド=8.11円、1タイ・バーツ=4.20円、1ポーランド・ズロチ=37.966円、100ハンガリー・フォリント=41.938円、1ユーロ=164.73円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年4月18日)現在

| 項                          | 目              | 当期末             |
|----------------------------|----------------|-----------------|
| (A) 資                      | 産              | 93,019,447,422円 |
| コ 一 ル ル · 口 一 シ ン 等        | 式(評価額)         | 5,539,021,875   |
| 株                          | 84,380,932,702 |                 |
| 投 資 信 託 受 益 証              | 券(評価額)         | 672,883,580     |
| 投 資 証                      | 券(評価額)         | 55,648,770      |
| 未 収 入 金                    |                | 315,066,506     |
| 未 収 配 当 金                  |                | 163,877,305     |
| 差 入 委 託 証 抱 金              |                | 1,892,016,684   |
| (B) 負 債                    |                | 1,015,806,086   |
| 未 払 金                      |                | 569,120,086     |
| 未 解 約 金                    |                | 446,686,000     |
| (C) 純 資 産 総 額(A - B)       |                | 92,003,641,336  |
| 元 本                        |                | 54,761,986,005  |
| 次 期 繰 越 損 益 金              |                | 37,241,655,331  |
| (D) 受 益 権 総 口 数            |                | 54,761,986,005口 |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D) |                | 16,801円         |

(注1) 期首元本額 64,749,710,350円  
 追加設定元本額 32,675,227,035円  
 一部解約元本額 42,662,951,380円

(注2) 期末における元本の内訳

|                                |                 |
|--------------------------------|-----------------|
| D I AM新興国株式インデックスファンド<DC年金>    | 10,092,188,846円 |
| たわらノーロード 新興国株式<ラップ専用>          | 4,332,203,323円  |
| MITO ラップ型ファンド (安定型)            | 2,597,345円      |
| MITO ラップ型ファンド (中立型)            | 10,877,357円     |
| MITO ラップ型ファンド (積極型)            | 27,524,296円     |
| グローバル8資産ラップファンド (安定型)          | 31,030,283円     |
| グローバル8資産ラップファンド (中立型)          | 35,760,662円     |
| グローバル8資産ラップファンド (積極型)          | 22,467,888円     |
| たわらノーロード 新興国株式                 | 13,287,751,461円 |
| たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>          | 1,875,988,956円  |
| たわらノーロード バランス (8資産均等型)         | 4,740,095,109円  |
| たわらノーロード バランス (堅実型)            | 29,723,372円     |
| たわらノーロード バランス (標準型)            | 140,600,619円    |
| たわらノーロード バランス (積極型)            | 267,189,918円    |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)   | 93,091円         |
| たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)   | 491,029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) | 103,365,101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)   | 126,190,831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)   | 224,234,382円    |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定型)         | 11,703円         |
| たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)       | 9,281,270円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (成長型)         | 2,540,142円      |
| たわらノーロード 最適化バランス (積極型)         | 9,825,079円      |
| たわらノーロード 全世界株式                 | 1,948,996,478円  |
| One DC 新興国株式インデックスファンド         | 1,240,761,618円  |

|  |                |
|--|----------------|
| マネックス資産設計ファンド エボリューション                     | 385,770,348円   |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)              | 400,914,931円   |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)              | 597,969,327円   |
| D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)              | 1,176,177,128円 |
| 投資のソムリエ                                    | 4,679,807,167円 |
| クルーズコントロール                                 | 238,565,155円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>                              | 477,230,061円   |
| D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>                  | 518,294,972円   |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型                        | 818,140,867円   |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド                         | 2,594,368,576円 |
| ワールドアセットバランス (基本コース)                       | 488,459,044円   |
| ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)                    | 1,056,982,887円 |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)                    | 101,547,035円   |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)                    | 51,687,588円    |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)                    | 7,391,597円     |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)                    | 96,074,435円    |
| リスクコントロール世界資産分散ファンド                        | 1,756,435,037円 |
| 9資産分散投資・スタンダード<DC年金>                       | 302,237,195円   |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)                    | 35,469,393円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)                    | 56,051,103円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)                    | 34,676,533円    |
| 投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)                    | 8,632,083円     |
| Oneグローバル最適化バランス (成長型)<ラップ向け>               | 22,285,974円    |
| 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)                     | 71,456,700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) | 2,609,447円     |
| D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)        | 131,375,767円   |
| D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)        | 89,585,495円    |

期末元本合計

54,761,986,005円

## ■損益の状況

当期 自2023年4月19日 至2024年4月18日

| 項   | 目  | 当 期   |
|---|--|---|
| (A) 配<br>受<br>受<br>そ<br>支                               | 当 等 収 益<br>取 配 当 金<br>取 利 息<br>の 他 収 益 金<br>払 利 息  | 2,697,521,902円<br>2,487,727,503<br>104,102,749<br>105,856,488<br>△164,838   |
| (B) 有<br>売<br>売   | 価 証 券 売 買 損 益<br>買 益<br>買 損  | 13,517,889,164<br>25,325,622,271<br>△11,807,733,107   |
| (C) 先<br>取<br>取   | 物 取 引 等 取 引 損 益<br>引<br>引  | △395,445,347<br>1,130,970,765<br>△1,526,416,112   |
| (D) そ<br>(E) 当<br>(F) 前<br>(G) 解<br>(H) 追<br>(I) 合<br>次 | の 他 費 用<br>期 損 益 金(A + B + C + D)<br>期 繰 越 損 益 金<br>約 差 損 益 金<br>加 信 託 差 損 益 金<br>計(E + F + G + H)<br>期 繰 越 損 益 金(I) | △204,339,761<br>15,615,625,958<br>27,233,140,175<br>△22,816,115,767<br>17,209,004,965<br>37,241,655,331<br>37,241,655,331 |

(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。