

## 当ファン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／インデックス型   |
|--|---|
| 信託期間   | 2060年1月26日まで（2017年10月2日設定）  |
| 運用方針   | 各マザーファンド受益証券への投資を通じて、マイライフサイクル指数1970sに連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式、公社債および不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主要運用対象   | ベビーファンド TOPIXマザーファンド 東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。  |
|  | 外国株式インデックスマザーファンド MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。  |
|  | 新興国株式インデックスマザーファンド 新興国の株式等（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。  |
|  | 日本債券インデックスマザーファンド NOMURA-BPI総合に採用されている公社債を主要投資対象とします。   |
|  | 外国債券インデックスマザーファンド FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国債を主要投資対象とします。   |
|  | 新興国債券インデックスマザーファンド 新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限   | 東証REIT指數マザーファンド 東証REIT指數（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。   |
|  | MUAM G-REITマザーファンド S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。  |
|  | ベビーファンド 株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。   |
|  | TOPIXマザーファンド 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。   |
|  | 外国株式インデックスマザーファンド 株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |
|  | 新興国株式インデックスマザーファンド 株式および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。   |
| 分配方針   | 日本債券インデックスマザーファンド 外貨建資産への投資は行いません。  |
|  | 外国債券インデックスマザーファンド 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。   |
|  | 新興国債券インデックスマザーファンド 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |
|  | 東証REIT指數マザーファンド 株式および外貨建資産への投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。   |
|  | MUAM G-REITマザーファンド 株式への直接投資は行いません。投資信託証券および外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |
|  | 経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。  |
| 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） |   |

## 運用報告書（全体版）

eMAXIS  
イーマクシスe MAXIS  
マイマネージャー 1970s

第8期（決算日：2025年1月27日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「e MAXIS マイマネージャー 1970s」は、去る1月27日に第8期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

## 三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
フリーダイヤル  
0120-151034  
(受付時間：営業日の9:00～17:00、  
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く)

お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

e MAXIS 専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

## 本資料の表記にあたって

- 原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- 一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

| 決算期<br>(分配落)   | 基準価額     |       |       | マイライフサイクル指標 1970s |       | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額   |
|----------------|----------|-------|-------|-------------------|-------|--------|--------|--------|--------|------------|--------|
|                | 税込分配金    | み期騰落率 | 中期騰落率 | 期騰落率              |       |        |        |        |        |            |        |
| 4期(2021年1月26日) | 円 11,503 | 円 0   | % 3.9 | % 115.70          | % 4.3 | % 43.6 | % 1.3  | % 38.4 | % 0.0  | % 15.3     | 百万円 16 |
| 5期(2022年1月26日) | 12,448   | 0     | 8.2   | 125.40            | 8.4   | 45.0   | 0.7    | 37.4   | 0.0    | 15.3       | 32     |
| 6期(2023年1月26日) | 12,506   | 0     | 0.5   | 126.50            | 0.9   | 34.1   | 1.0    | 51.3   | 0.0    | 12.0       | 47     |
| 7期(2024年1月26日) | 14,178   | 0     | 13.4  | 143.50            | 13.4  | 31.9   | 1.1    | 55.3   | 0.0    | 10.1       | 67     |
| 8期(2025年1月27日) | 15,297   | 0     | 7.9   | 154.90            | 7.9   | 34.6   | 0.5    | 55.0   | 0.1    | 8.2        | 88     |

(注) マイライフサイクル指標は、特定の年代の人に合わせイボットソン・アソシエイツ・ジャパンがe MAX I Sシリーズのファンドを参考して算出する指標であり、3つの想定生まれ年別指標の総称です。各指標は想定生まれ年における特定の年齢の統計データを基に、人的資本と金融資産を推計した上で、金融資産部分の目標リスク水準を決定しております。そのため個人の資産構成によっては、想定生まれ年に示されている指標とは違う指標が適合する場合があります。指標の目標リスク水準および資産クラス別比率の決定は、原則として年1回行います。

\*マイライフサイクル指標 1970sを算出するために参照したファンド

e MAX I S TOPIXインデックス、e MAX I S 先進国株式インデックス、e MAX I S 新興国株式インデックス、e MAX I S 国内債券インデックス、e MAX I S 先進国債券インデックス、e MAX I S 新興国債券インデックス、e MAX I S 国内リートインデックス、e MAX I S 先進国リートインデックス

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 株式先物比率には、不動産投信指標先物を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日                 | 基 準 価 額  | マイライフサイクル指数 1970s |          | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 債 券<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 | 投 資 信 託<br>券 組入比率 |
|---------------------|----------|-------------------|----------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------------|
|                     |          | 騰 落 率             | 騰 落 率    |             |             |             |             |                   |
| (期 首)<br>2024年1月26日 | 円 14,178 | % —               | % 143.50 | % 31.9      | % 1.1       | % 55.3      | % 0.0       | % 10.1            |
| 1月末                 | 14,229   | 0.4               | 144.00   | 0.3         | 32.7        | 0.7         | 54.6        | 0.0               |
| 2月末                 | 14,508   | 2.3               | 146.80   | 2.3         | 34.0        | 0.9         | 55.7        | 0.0               |
| 3月末                 | 14,799   | 4.4               | 149.80   | 4.4         | 34.0        | 1.0         | 55.5        | 0.0               |
| 4月末                 | 14,826   | 4.6               | 150.10   | 4.6         | 34.1        | 1.1         | 55.1        | 0.1               |
| 5月末                 | 14,837   | 4.6               | 150.10   | 4.6         | 33.7        | 1.1         | 55.5        | 0.1               |
| 6月末                 | 15,185   | 7.1               | 153.70   | 7.1         | 34.2        | 0.8         | 55.4        | 0.1               |
| 7月末                 | 14,881   | 5.0               | 150.60   | 4.9         | 33.9        | 0.8         | 55.1        | 0.1               |
| 8月末                 | 14,782   | 4.3               | 149.70   | 4.3         | 34.1        | 1.1         | 54.7        | 0.1               |
| 9月末                 | 14,838   | 4.7               | 150.30   | 4.7         | 33.9        | 1.0         | 55.5        | 0.1               |
| 10月末                | 15,200   | 7.2               | 153.90   | 7.2         | 34.0        | 1.0         | 55.6        | 0.1               |
| 11月末                | 15,061   | 6.2               | 152.50   | 6.3         | 33.9        | 0.8         | 55.5        | 0.1               |
| 12月末                | 15,345   | 8.2               | 155.40   | 8.3         | 34.5        | 0.7         | 55.6        | 0.1               |
| (期 末)<br>2025年1月27日 | 15,297   | 7.9               | 154.90   | 7.9         | 34.6        | 0.5         | 55.0        | 0.1               |
|                     |          |                   |          |             |             |             |             | 8.2               |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 株式先物比率には、不動産投信指数先物を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第8期：2024年1月27日～2025年1月27日

## 〉当期中の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



**第8期首** 14,178円

**第8期末** 15,297円

**既払分配金** 0円

**騰落率** 7.9%

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみな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、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

**基準価額の動き**

基準価額は期間の初めに比べ7.9%の上昇となりました。

**ベンチマークとの差異**

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（7.9%）と同程度となりました。

## 》基準価額の主な変動要因

**上昇要因**

主に先進国株式市況が上昇したことなどが、基準価額の上昇要因となりました。

| 組入ファンド              | 騰落率   | 組入比率（対純資産総額） |
|---------------------|-------|--------------|
| MUAM G-R EITマザーファンド | 16.5% | 4.0%         |
| 新興国株式インデックススマザーファンド | 18.9% | 3.0%         |
| 東証REIT指数マザーファンド     | -2.0% | 4.1%         |
| 新興国債券インデックススマザーファンド | 7.0%  | 3.0%         |
| TOPIXマザーファンド        | 13.0% | 14.1%        |
| 外国株式インデックススマザーファンド  | 29.5% | 18.2%        |
| 日本債券インデックススマザーファンド  | -2.8% | 34.8%        |
| 外国債券インデックススマザーファンド  | 6.4%  | 17.8%        |

第8期：2024年1月27日～2025年1月27日

## ▶ 投資環境について

### ▶ 国内株式市況

#### **国内株式市況は上昇しました。**

好調な企業業績や外国為替市場で円安・米ドル高が進行したこと等を背景に、国内株式市況は上昇しました。

### ▶ 外国株式市況

#### **外国株式市況は上昇しました。**

主要国での政策金利の引き下げやインフレ率の鈍化などを受けて外国株式市況は上昇しました。

### ▶ 新興国株式市況

#### **新興国株式市況は上昇しました。**

主要国での政策金利の引き下げやインフレ率の鈍化などを受けて新興国株式市況は上昇しました。

### ▶ 国内債券市況

#### **国内債券市況は下落しました。**

期間の初めにもみ合いで推移した後、日銀のマイナス金利解除などから下落しました。その後、米景気後退懸念などを背景に国内債券市況は反発しましたが、期間の後半には日銀の更なる金融引き締めに対する警戒感や、政策金利の引き上げなどを受けて下落し、期間を通して見ても下落しました。

### ▶ 外国債券市況

#### **先進国の債券市況は上昇しました。**

先進国の債券市況は、景気の先行き懸念による利下げ期待や利金が積みあがったことなどから、期間の初めとの比較では上昇しました。

### ▶ 新興国債券市況

#### **新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。**

新興国の現地通貨建て債券市況は、利金が相応に積みあがったことなどから上昇しました。

### ▶ 国内REIT市況

#### **国内REIT市況は下落しました。**

国内長期金利上昇等の影響により国内REIT市況は下落しました。

### ▶ 外国REIT市況

#### **外国REIT市況は上昇しました。**

主要国での政策金利の引き下げやインフレ率の鈍化などを受けて外国REIT市況は上昇しました。

### ▶ 為替市況

#### **米ドル、ユーロ、香港ドルは円に対して上昇しました。**

為替市況は、期間の初めに比べて円安・米ドル高、円安・ユーロ高、円安・香港

ドル高となりました。

また、期間の初めに比べてブラジルレアルやメキシコペソなどが対円で下落した一方、マレーシアリンギットやタイバーツなどが対円で上昇しました。

## ▶当該投資信託のポートフォリオについて

### ► eMAXIS マイマネージャー 1970s

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券市場の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

資産配分方針は、マイライフサイクル指数 1970sの資産クラス別比率を維持しました。

資産クラス別比率は以下の通りです。原則年1回、目標リスク水準および資産クラス別比率の変更を行います。

### (ご参考)

#### ■ベンチマークの資産クラス別比率

| マザーファンド            | アセット    | 期首    | 期末    |
|--------------------|---------|-------|-------|
| TOPIXマザーファンド       | 国内株式    | 12.0% | 14.0% |
| 外国株式インデックスマザーファンド  | 先進国株式   | 18.0% | 18.0% |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | 新興国株式   | 3.0%  | 3.0%  |
| 日本債券インデックスマザーファンド  | 国内債券    | 36.0% | 36.0% |
| 外国債券インデックスマザーファンド  | 先進国債券   | 17.0% | 18.0% |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 新興国債券   | 4.0%  | 3.0%  |
| 東証REIT指数マザーファンド    | 国内REIT  | 4.0%  | 4.0%  |
| MUAM G-REITマザーファンド | 先進国REIT | 6.0%  | 4.0%  |

## ► TOPIXマザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。

株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

## ► 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

## ► 新興国株式インデックスマザーファンド

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（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式等（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果

をめざして運用を行いました。

株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

（注）マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

## ► 日本債券インデックスマザーファンド

資産のほぼ全額を債券（先物を含む）に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました\*。

\*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

## ► 外国債券インデックスマザーファンド

日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポート

フォリオを構築しました。

#### ▶ 新興国債券インデックスマザーファンド

新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJPモルガンGBI-E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。

ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

#### ▶ 東証REIT指数マザーファンド

資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（REIT）（先物を含む）に投資しました。

ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

#### ▶ MUAM G-REIT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、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

### ▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

#### ▶ eMAXIS マイマネージャー 1970s

基準価額の騰落率は7.9%の上昇となり、ベンチマークの騰落率（7.9%）と同程度となりました。  
差異の内訳は以下の通りです。

（内訳）

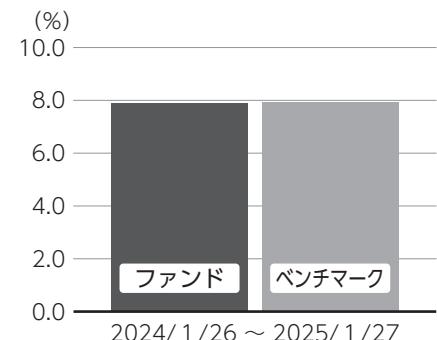
資産配分要因

その他

△0.1%程度

0.1%程度

基準価額（ベビーファンド）と  
ベンチマークの対比（騰落率）



## ► TOPIXマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**取引要因によるものです。

**主なマイナス要因：**組入要因によるものです。

## ► 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**その他の要因\*によるものです。

\*その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

**主なマイナス要因：**為替評価差異要因\*によるものです。

\*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる為替レートが異なるため生じる要因です。

## ► 新興国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**その他の要因\*によるものです。

\*その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

## ► 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**ポートフォリオ要因によるものです。

**主なマイナス要因：**評価時価差異要因\*によるものです。

\*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

## ▶ 外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因**：ありません。

**主なマイナス要因**：評価時価差異要因\*によるものです。

\*ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

## ▶ 新興国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因**：ありません。

**主なマイナス要因**：ポートフォリオ要因によるものです。

## ▶ 東証REIT指数マザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因**：銘柄選択要因によるものです。

**主なマイナス要因**：組入要因によるものです。

## ▶ MUAM G-REITマザーファンド

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因**：その他の要因\*によるものです。

\*その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

**主なマイナス要因**：組入要因によるものです。

## 》分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

### 分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項目             | 第8期<br>2024年1月27日～2025年1月27日 |
|----------------|------------------------------|
| 当期分配金（対基準価額比率） | — (−%)                       |
| 当期の収益          | —                            |
| 当期の収益以外        | —                            |
| 翌期繰越分配対象額      | 5,296                        |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

# 今後の運用方針

(作成対象期間末での見解です。)

## ▶ eMAXIS マイマネージャー 1970s

資産配分方針は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンが算出するマイライフサイクル指数 1970sの資産クラス別比率を維持します。また、原則年1回、目標リスク水準および資産クラス別比率の変更を行い、各資産の組入比率は、期間を通じて同比率に準ずるよう調整を行います。

## ▶ TOPIXマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 新興国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 外国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 新興国債券インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ 東証REIT指数マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ▶ MUAM G-REITマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2024年1月27日～2025年1月27日

## 〉1万口当たりの費用明細

| 項目         | 当期    |         | 項目の概要  |
|------------|-------|---------|--|
|            | 金額(円) | 比率(%)   |  |
| (a)信託報酬    | 82    | 0.551   | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(期中の日数÷年間日数)                             |
| (投信会社)     | (36)  | (0.243) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価                       |
| (販売会社)     | (36)  | (0.242) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価                             |
| (受託会社)     | (10)  | (0.066) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価                               |
| (b)売買委託手数料 | 0     | 0.001   | (b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株式)       | (0)   | (0.001) |  |
| (投資信託証券)   | (0)   | (0.000) |  |
| (先物・オプション) | (0)   | (0.001) |  |
| (c)有価証券取引税 | 1     | 0.004   | (c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>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)   | (0.003) |  |
| (投資信託証券)   | (0)   | (0.000) |  |
| (d)その他費用   | 2     | 0.016   | (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)   | (0.010) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用                                  |
| (監査費用)     | (1)   | (0.004) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用                                      |
| (その他)      | (0)   | (0.002) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用   |
| 合計         | 85    | 0.572   |  |

期中の平均基準価額は、14,884円です。

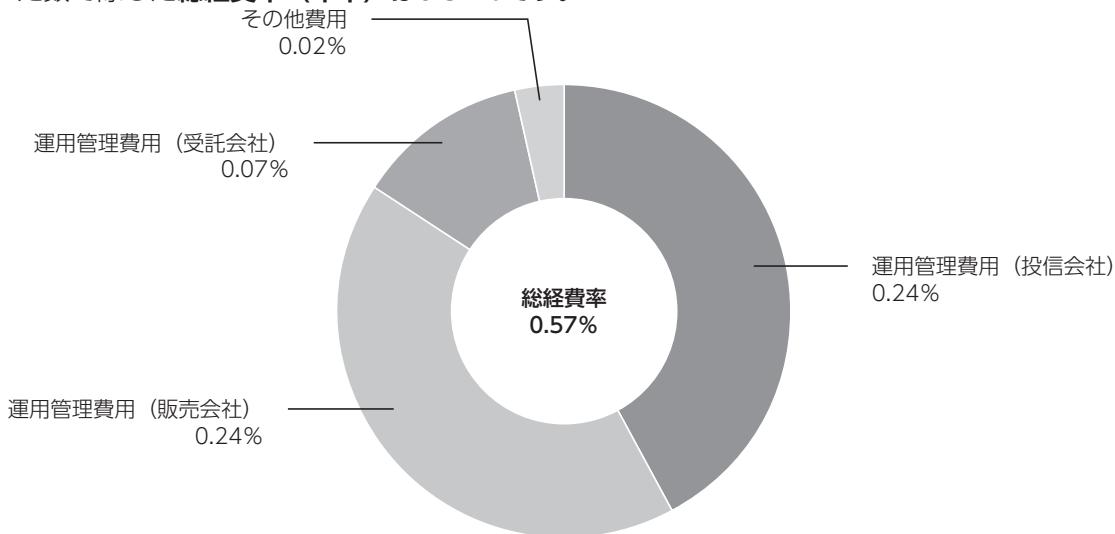
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
 (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。  
 (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## (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（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）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0.57%です。**



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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前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は異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄                  | 設定期       |           | 解約        |             |
|---------------------|-----------|-----------|-----------|-------------|
|                     | 口数        | 金額        | 口数        | 金額          |
| MUAM G-REITマザーファンド  | 千口<br>291 | 千円<br>822 | 千口<br>674 | 千円<br>1,767 |
| 新興国株式インデックススマザーファンド | 209       | 812       | 159       | 625         |
| 東証REIT指数マザーファンド     | 423       | 1,448     | 144       | 502         |
| 新興国債券インデックススマザーファンド | 337       | 618       | 460       | 821         |
| TOPIXマザーファンド        | 1,533     | 4,878     | 556       | 1,846       |
| 外国株式インデックススマザーファンド  | 519       | 3,646     | 487       | 3,454       |
| 日本債券インデックススマザーファンド  | 8,931     | 11,209    | 2,622     | 3,299       |
| 外国債券インデックススマザーファンド  | 1,521     | 4,075     | 238       | 638         |

## ○株式売買比率

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 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                         |                  |                           |
|---------------------|----------------------------|------------------|---------------------------|
|                     | 新興国株式<br>インデックス<br>マザーファンド | TOPIX<br>マザーファンド | 外国株式<br>インデックス<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 405,727,438千円              | 800,722,400千円    | 2,839,642,451千円           |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 837,825,898千円              | 1,488,558,240千円  | 5,640,676,010千円           |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.48                       | 0.53             | 0.50                      |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;e MAXIS マイマネージャー 1970s&gt;

該当事項はございません。

## &lt;MUAM G-REITマザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | 売付額等<br>C |              | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|-----------|--------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    | B<br>A    | C            |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>23,803 | 百万円<br>82          | %<br>0.3  | 百万円<br>7,926 | 百万円<br>82          | %<br>1.0      |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## &lt;新興国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |     | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|-----|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|        |           | 百万円                | 百万円 |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 為替直物取引 | 636,045   | 40,114             | 6.3 | 304,278       | 61        | 0.0                |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## &lt;東証REIT指数マザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|        |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 投資信託証券 | 44,808    | 5,862              | 13.1 | 9,714         | 627       | 6.5                |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## &lt;新興国債券インデックスマザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|        |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 為替先物取引 | 515       | 205                | 39.8 | 521           | 173       | 33.2               |     |               |
| 為替直物取引 | 41,552    | 5,392              | 13.0 | 24,555        | 2,546     | 10.4               |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

| 区分 | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|----|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|    |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 株式 | 506,314   | 56,629             | 11.2 | 294,408       | 29,941    | 10.2               |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## &lt;外国株式インデックスマザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|        |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 為替直物取引 | 2,562,472 | 2,091,683          | 81.6 | 189,587       | 182,592   | 96.3               |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

| 区分  | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|     |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 公社債 | 520,137   | 112,566            | 21.6 | 266,066       | 75,186    | 28.3               |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## &lt;外国債券インデックスマザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|        |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 |               |
| 為替先物取引 | 67,939    | 43,438             | 63.9 | 71,105        | 33,188    | 46.7               |     |               |
| 為替直物取引 | 194,792   | 112,042            | 57.5 | 73,621        | 62,400    | 84.8               |     |               |

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドの親投資信託所有口数の割合。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;TOPIXマザーファンド&gt;

| 種類 | 買付額 | 売付額    | 当期末保有額 | 百万円    |
|----|-----|--------|--------|--------|
|    |     |        |        | 百万円    |
| 株式 |     | 14,591 | 7,201  | 51,783 |

## &lt;日本債券インデックスマザーファンド&gt;

| 種類  | 買付額 | 売付額 | 当期末保有額 | 百万円   |
|-----|-----|-----|--------|-------|
|     |     |     |        | 百万円   |
| 公社債 |     | 890 | 299    | 2,492 |

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

<東証REIT指数マザーファンド>

| 種類     | 買付額          |
|--------|--------------|
| 投資信託証券 | 百万円<br>1,681 |

<TOPIXマザーファンド>

| 種類 | 買付額          |
|----|--------------|
| 株式 | 百万円<br>1,575 |

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 種類  | 買付額           |
|-----|---------------|
| 公社債 | 百万円<br>18,201 |

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)    | 1千円  |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0千円  |
| (B) / (A)        | 0.1% |

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2025年1月27日現在)

## 親投資信託残高

| 銘 柄                    | 期首(前期末)     | 当 期 末       |             |
|------------------------|-------------|-------------|-------------|
|                        | 口 数         | 口 数         | 評 價 額       |
| MUAM G-R E I T マザーファンド | 千口<br>1,574 | 千口<br>1,191 | 千円<br>3,551 |
| 新興国株式インデックスマザーファンド     | 597         | 647         | 2,649       |
| 東証R E I T 指数マザーファンド    | 759         | 1,038       | 3,589       |
| 新興国債券インデックスマザーファンド     | 1,520       | 1,397       | 2,650       |
| T O P I X マザーファンド      | 2,638       | 3,615       | 12,387      |
| 外国株式インデックスマザーファンド      | 1,959       | 1,991       | 16,074      |
| 日本債券インデックスマザーファンド      | 18,465      | 24,774      | 30,680      |
| 外国債券インデックスマザーファンド      | 4,447       | 5,731       | 15,691      |

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

T O P I X マザーファンドにおいて、2025年1月27日現在における貸付株数の総株数は2,766,100株です。

## ○投資信託財産の構成

(2025年1月27日現在)

| 項目                 | 当期末      |        |
|--------------------|----------|--------|
|                    | 評価額      | 比率     |
| MUAM G-REITマザーファンド | 3,551千円  | 4.0%   |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | 2,649千円  | 3.0%   |
| 東証REIT指数マザーファンド    | 3,589千円  | 4.1%   |
| 新興国債券インデックスマザーファンド | 2,650千円  | 3.0%   |
| TOPIXマザーファンド       | 12,387千円 | 14.0%  |
| 外国株式インデックスマザーファンド  | 16,074千円 | 18.2%  |
| 日本債券インデックスマザーファンド  | 30,680千円 | 34.7%  |
| 外国債券インデックスマザーファンド  | 15,691千円 | 17.8%  |
| コール・ローン等、その他       | 1,113千円  | 1.2%   |
| 投資信託財産総額           | 88,384千円 | 100.0% |

(注) MUAM G-REITマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(153,685,501千円)の投資信託財産総額(153,781,510千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 新興国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(1,084,635,679千円)の投資信託財産総額(1,085,462,382千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 新興国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(111,519,105千円)の投資信託財産総額(111,614,672千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(8,002,488,835千円)の投資信託財産総額(8,093,621,386千円)に対する比率は98.9%です。

(注) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(687,469,871千円)の投資信託財産総額(688,191,773千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                     |                    |                      |                        |
|---------------------|--------------------|----------------------|------------------------|
| 1アメリカドル=155.60円     | 1カナダドル=108.23円     | 1アルゼンチンペソ=0.1487円    | 1メキシコペソ=7.6222円        |
| 1ブラジルレアル=26.2999円   | 100チリペソ=15.8366円   | 100コロンビアペソ=3.7226円   | 1ペルーヌエボソル=41.8035円     |
| 1ウルグアイペソ=3.5786円    | 1ドミニカペソ=2.5249円    | 1ユーロ=163.01円         | 1イギリスポンド=193.92円       |
| 1イスラブラン=171.69円     | 1スウェーデンクローネ=14.22円 | 1ノルウェークローネ=13.84円    | 1セルビアディナール=1.393514円   |
| 1デンマーククローネ=21.84円   | 1トルコリラ=4.3662円     | 1チェコクローナ=6.4948円     | 100ハンガリーフォリント=39.9412円 |
| 1ポーランドズロチ=38.6793円  | 1ルーマニアレイ=32.7573円  | 1オーストラリアドル=97.93円    | 1ニュージーランドドル=88.55円     |
| 1香港ドル=19.98円        | 1シンガポールドル=115.51円  | 1マレーシアリンギット=35.4502円 | 1タイバーツ=4.62円           |
| 1フィリピンペソ=2.6672円    | 100インドネシアルピア=0.97円 | 100韓国ウォン=10.93円      | 1ニュー台湾ドル=4.7559円       |
| 1インドルピー=1.81円       | 1中国元=21.471円       | 1オフショア元=21.4372円     | 1アラブ首長国連邦=42.43円       |
| 1クウェートディナール=506.02円 | 1サウジアラビアリヤル=41.56円 | 1イスラエルシェケル=43.4097円  | 1カタールリアル=42.76円        |
| 1南アフリカランド=8.40円     |                    |                      |                        |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月27日現在)

| 項目                          | 当期末         |
|-----------------------------|-------------|
| (A) 資産                      | 円           |
| コレ・ローン等                     | 88,384,422  |
| MU AM G-R E I Tマザーファンド(評価額) | 1,100,964   |
| 新興国株式インデックスマザーファンド(評価額)     | 3,551,459   |
| 東証R E I T指数マザーファンド(評価額)     | 2,649,120   |
| 新興国債券インデックスマザーファンド(評価額)     | 3,589,746   |
| TOP IXマザーファンド(評価額)          | 2,650,065   |
| 外国株式インデックスマザーファンド(評価額)      | 12,387,905  |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額)      | 16,074,707  |
| 外国債券インデックスマザーファンド(評価額)      | 30,680,515  |
| 未収入金                        | 15,691,680  |
| 未収利息                        | 8,248       |
| 未利回り                        | 13          |
| (B) 負債                      | 233,667     |
| 未払解約金                       | 4,001       |
| 未払信託報酬                      | 228,084     |
| その他未払費用                     | 1,582       |
| (C) 純資産総額(A-B)              | 88,150,755  |
| 元本                          | 57,627,993  |
| 次期繰越損益金                     | 30,522,762  |
| (D) 受益権総口数                  | 57,627,993口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)             | 15,297円     |

## &lt;注記事項&gt;

- (1)期首元本額 47,484,368円  
 期中追加設定元本額 15,874,182円  
 期中一部解約元本額 5,730,557円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1,5297円です。

## ○損益の状況 (2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目               | 当期            |
|------------------|---------------|
| (A) 配当等収益        | 円 1,095       |
| 受取利息             | 1,095         |
| (B) 有価証券売買損益     | 5,718,764     |
| 売買益              | 6,872,660     |
| 売買損              | △ 1,153,896   |
| (C) 信託報酬等        | △ 428,939     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 5,290,920     |
| (E) 前期繰越損益金      | 7,798,703     |
| (F) 追加信託差損益金     | 17,433,139    |
| (配当等相当額)         | ( 14,662,747) |
| (売買損益相当額)        | ( 2,770,392)  |
| (G) 計(D+E+F)     | 30,522,762    |
| (H) 収益分配金        | 0             |
| 次期繰越損益金(G+H)     | 30,522,762    |
| 追加信託差損益金         | 17,433,139    |
| (配当等相当額)         | ( 14,679,260) |
| (売買損益相当額)        | ( 2,753,879)  |
| 分配準備積立金          | 13,089,623    |

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

(注) (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。

## ②分配金の計算過程

| 項目                        | 目 | 2024年1月27日～<br>2025年1月27日 |
|---------------------------|---|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額              |   | 1,406,148円                |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 |   | 3,884,772円                |
| 収益調整金額                    |   | 17,433,139円               |
| 分配準備積立金額                  |   | 7,798,703円                |
| 当ファンドの分配対象収益額             |   | 30,522,762円               |
| 1万口当たり収益分配対象額             |   | 5,296円                    |
| 1万口当たり分配金額                |   | －円                        |
| 収益分配金額                    |   | －円                        |

\*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

## [お知らせ]

東京証券取引所の取引時間の延伸に伴い、申込締切時間の変更を行いました。詳細は、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) から当該ファンドページの目論見書をご覧ください。

(2024年11月5日)

## TOPIXマザーファンド

## 《第23期》決算日2024年3月25日

[計算期間：2023年3月28日～2024年3月25日]

「TOPIXマザーファンド」は、3月25日に第23期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第23期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）と連動する投資成果をめざして運用を行います。対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指標先物取引等の買建額を加算し、または株価指標先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は、原則として高位を維持します。 |
| 主要運用対象 | 東京証券取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。  |

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額        | 東証株価指數     |                   | 株組入比率      | 株先物比率     | 純資産額     |                |
|-----------------|-------------|------------|-------------------|------------|-----------|----------|----------------|
|                 |             | 期騰落率       | (TOPIX)<br>(配当込み) |            |           |          |                |
| 19期(2020年3月25日) | 円<br>15,695 | %<br>△ 7.3 | 2,174.58          | %<br>△ 7.4 | %<br>95.4 | %<br>4.2 | 百万円<br>244,088 |
| 20期(2021年3月25日) | 22,066      | 40.6       | 3,057.07          | 40.6       | 98.8      | 0.8      | 506,225        |
| 21期(2022年3月25日) | 22,839      | 3.5        | 3,163.63          | 3.5        | 99.1      | 0.9      | 739,823        |
| 22期(2023年3月27日) | 23,227      | 1.7        | 3,217.73          | 1.7        | 100.8     | 1.4      | 854,874        |
| 23期(2024年3月25日) | 33,729      | 45.2       | 4,671.17          | 45.2       | 99.4      | 0.7      | 1,409,203      |

(注) 東証株価指數（TOPIX）（配当込み）とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指數です。TOPIXの指數値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社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TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日         | 基<br>準<br>価<br>額 | 東<br>証<br>株<br>価<br>指<br>数 |                       | 株<br>組<br>入<br>比<br>率 | 株<br>先<br>物<br>比<br>率 |
|---------------------|------------------|----------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                     |                  | 騰<br>落<br>率                | (T O P I X)<br>(配当込み) |                       |                       |
| (期 首)<br>2023年3月27日 | 円<br>23,227      | %<br>—                     | 3,217.73              | %<br>—                | %<br>100.8            |
| 3月末                 | 24,001           | 3.3                        | 3,324.74              | 3.3                   | 98.1                  |
| 4月末                 | 24,649           | 6.1                        | 3,414.45              | 6.1                   | 98.3                  |
| 5月末                 | 25,540           | 10.0                       | 3,537.93              | 10.0                  | 98.2                  |
| 6月末                 | 27,469           | 18.3                       | 3,805.00              | 18.3                  | 98.3                  |
| 7月末                 | 27,880           | 20.0                       | 3,861.80              | 20.0                  | 99.2                  |
| 8月末                 | 28,000           | 20.5                       | 3,878.51              | 20.5                  | 99.3                  |
| 9月末                 | 28,145           | 21.2                       | 3,898.26              | 21.1                  | 98.0                  |
| 10月末                | 27,305           | 17.6                       | 3,781.64              | 17.5                  | 98.9                  |
| 11月末                | 28,784           | 23.9                       | 3,986.65              | 23.9                  | 98.8                  |
| 12月末                | 28,722           | 23.7                       | 3,977.63              | 23.6                  | 99.9                  |
| 2024年1月末            | 30,966           | 33.3                       | 4,288.36              | 33.3                  | 98.6                  |
| 2月末                 | 32,490           | 39.9                       | 4,499.61              | 39.8                  | 99.1                  |
| (期 末)<br>2024年3月25日 | 33,729           | 45.2                       | 4,671.17              | 45.2                  | 99.4                  |
|                     |                  |                            |                       |                       | 0.7                   |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

#### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ45.2%の上昇となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(45.2%)と同程度となりました。

### 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

**●基準価額の主な変動要因****(上昇要因)**

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

**●投資環境について****◎国内株式市況**

- ・国内株式市況は上昇しました。
- ・日銀の金融緩和継続姿勢、好調な企業業績等を背景に国内株式市況は上昇しました。

**●当該投資信託のポートフォリオについて**

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

**●当該投資信託のベンチマークとの差異について**  
ベンチマークは45.2%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**(主なプラス要因)**

- ・その他の要因※によるものです。  
※貸株収入要因等が含まれます。

**(主なマイナス要因)**

- ・ありません。

**○今後の運用方針**

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2023年3月28日～2024年3月25日)

| 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) | 円<br>0<br>(0) | %<br>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>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| 合計                                | 0             | 0.001                            |  |
| 期中の平均基準価額は、28,090円です。             |               |                                  |  |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2023年3月28日～2024年3月25日)

## 株式

|      | 買付                         |                               | 売付            |                   |
|------|----------------------------|-------------------------------|---------------|-------------------|
|      | 株数                         | 金額                            | 株数            | 金額                |
| 国内上場 | 千株<br>158,320<br>(141,005) | 千円<br>367,806,306<br>(24,138) | 千株<br>103,472 | 千円<br>221,861,655 |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )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。

## 新株予約権証券

|    | 買付                  |                | 売付                  |                |
|----|---------------------|----------------|---------------------|----------------|
|    | 証券数                 | 金額             | 証券数                 | 金額             |
| 国内 | 証券<br>—<br>(63,400) | 千円<br>—<br>(—) | 証券<br>—<br>(63,400) | 千円<br>—<br>(—) |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株主割当および権利行使等による増減分です。

## 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>173,269 | 百万円<br>179,468 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

## ○株式売買比率

(2023年3月28日～2024年3月25日)

### 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       | 589,667,962千円   |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,111,759,436千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.53            |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年3月28日～2024年3月25日)

### 利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|----|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|    |                |                    |               |                |                    |               |
| 株式 | 百万円<br>367,806 | 百万円<br>41,519      | %<br>11.3     | 百万円<br>221,861 | 百万円<br>5,228       | %<br>2.4      |

### 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類 | 買付額          | 売付額          | 当期末保有額        |
|----|--------------|--------------|---------------|
| 株式 | 百万円<br>7,975 | 百万円<br>5,258 | 百万円<br>35,880 |

### 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        |
|----|------------|
| 株式 | 百万円<br>915 |

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<br>目           | 当<br>期  |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A)    | 8,957千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 3千円     |
| (B) / (A)        | 0.0%    |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFG証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年3月25日現在)

## 国内株式

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期末     |           |
|----------------------|---------|---------|-----------|
|                      |         | 株数      | 評価額       |
|                      |         | 千株      | 千円        |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |         |           |
| 極洋                   | 16.3    | 20.6    | 79,516    |
| ニッスイ                 | 429.1   | 499     | 491,664   |
| マルハニチロ               | 63.8    | 74      | 225,774   |
| 雪国まいたけ               | 36.5    | 42.5    | 48,237    |
| カネコ種苗                | 13.1    | 14.1    | 20,360    |
| サカタのタネ               | 48.8    | 56.8    | 210,160   |
| ホクト                  | 38.2    | 40      | 76,160    |
| ホクリヨウ                | 3.9     | 3.1     | 3,478     |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |         |           |
| 住石ホールディングス           | 51      | 56.4    | 94,075    |
| 日鉄鉱業                 | 17.2    | 20      | 99,500    |
| 三井松島ホールディングス         | 19.4    | 29.6    | 86,757    |
| I N P E X            | 1,587.1 | 1,675.7 | 3,812,217 |
| 石油資源開発               | 49.7    | 57.8    | 399,398   |
| K&Oエナジーグループ          | 19.5    | 22.6    | 63,008    |
| <b>建設業 (2.1%)</b>    |         |         |           |
| ショーボンドホールディングス       | 58.5    | 68      | 437,308   |
| ミライト・ワン              | 148.8   | 165     | 314,325   |
| タマホーム                | 27      | 31.4    | 135,334   |
| サンヨーホームズ             | 3.3     | 2.6     | 2,069     |
| 日本アクリア               | 11.6    | 8.8     | 8,632     |
| ファーストコーポレーション        | 7.1     | 5.4     | 4,438     |
| ベステラ                 | 6       | 4.8     | 4,833     |
| R o b o t H o m e    | 73      | —       | —         |
| キャンディル               | 4.3     | 3.5     | 2,072     |
| ダイセキ環境ソリューション        | 5.6     | 4.3     | 4,403     |
| 第一カッター興業             | 11      | 14.4    | 22,867    |
| 安藤・間                 | 248.6   | 289.1   | 359,062   |
| 東急建設                 | 122.2   | 156.3   | 132,542   |
| コムシスホールディングス         | 145.2   | 159.3   | 578,418   |
| ビーアールホールディングス        | 68.1    | 73.1    | 27,851    |
| 高松コンストラクショングループ      | 27.9    | 37.1    | 107,256   |
| 東建コーポレーション           | 12.3    | 12.6    | 126,756   |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当期末     |           |
|---------------|---------|---------|-----------|
|               |         | 株数      | 評価額       |
|               |         | 千株      | 千円        |
| ソネック          | 3       | 2.2     | 2,076     |
| ヤマウラ          | 21.7    | 25.3    | 38,177    |
| オリエンタル白石      | 154.2   | 184.7   | 73,141    |
| 大成建設          | 298.8   | 326.6   | 1,875,337 |
| 大林組           | 1,073.5 | 1,248.3 | 2,362,407 |
| 清水建設          | 902.5   | 989.7   | 1,010,483 |
| 飛島建設          | 33.2    | 36      | 56,592    |
| 長谷工コーポレーション   | 309.8   | 320.2   | 610,781   |
| 松井建設          | 28      | 32.6    | 30,024    |
| 錢高組           | 2.5     | 1.9     | 8,483     |
| 鹿島建設          | 665.6   | 773.9   | 2,428,272 |
| 不動テトラ         | 20.8    | 24.1    | 49,694    |
| 大末建設          | 7.1     | 5.7     | 9,273     |
| 鉄建建設          | 21.5    | 25      | 69,650    |
| 西松建設          | 50.9    | 66.6    | 303,429   |
| 三井住友建設        | 242     | 259.8   | 113,532   |
| 大豊建設          | 12.4    | 12      | 43,560    |
| 佐田建設          | 14.5    | 9.4     | 7,266     |
| ナカノフド一建設      | 16.1    | 10.5    | 6,321     |
| 奥村組           | 48.7    | 56.6    | 296,584   |
| 東鉄工業          | 41.3    | 43.2    | 131,760   |
| イチケン          | 4.9     | 3.6     | 9,000     |
| 富士ビー・エス       | 8.7     | 6.7     | 3,082     |
| 淺沼組           | 24      | 25.8    | 112,488   |
| 戸田建設          | 369.3   | 472.3   | 490,955   |
| 熊谷組           | 52      | 57.6    | 245,952   |
| 北野建設          | 4.1     | 2.8     | 10,430    |
| 植木組           | 5.5     | 4.2     | 7,245     |
| 矢作建設工業        | 40.8    | 47.5    | 75,002    |
| ビーエス三菱        | 38      | 44.2    | 46,719    |
| 日本ハウスホールディングス | 59.5    | 74.5    | 24,063    |
| 新日本建設         | 42.1    | 49      | 79,821    |
| 東亜道路工業        | 6       | 13.9    | 90,489    |
| 日本道路          | 6       | 40.9    | 77,341    |

| 銘柄         | 期首(前期末) | 当期末     |           | 銘柄              | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|------------|---------|---------|-----------|-----------------|---------|-------|-----------|
|            |         | 株数      | 評価額       |                 |         | 株数    | 評価額       |
|            | 千株      | 千株      | 千円        |                 | 千株      | 千株    | 千円        |
| 東亜建設工業     | 25.7    | 26.9    | 137,997   | 日比谷総合設備         | 25.8    | 25.3  | 75,697    |
| 日本国土開発     | 90      | 99.3    | 52,331    | フィル・カンパニー       | 5.3     | 5.4   | 4,773     |
| 若築建設       | 13.4    | 12.1    | 44,346    | テスホールディングス      | 32.3    | 75.2  | 34,667    |
| 東洋建設       | 97.2    | 87.9    | 126,136   | インプロニア・ホールディングス | 314.6   | 402.4 | 598,167   |
| 五洋建設       | 425.6   | 494.8   | 385,053   | 東洋エンジニアリング      | 39.7    | 51.3  | 49,196    |
| 世紀東急工業     | 39.6    | 44.8    | 87,404    | レイズネクスト         | 43.4    | 50.5  | 119,382   |
| 福田組        | 11.3    | 13.2    | 75,108    | 食料品 (3.1%)      |         |       |           |
| 住友林業       | 230.3   | 301.7   | 1,366,399 | ニップン            | 81.2    | 104.9 | 252,599   |
| 日本基礎技術     | 15.7    | 9       | 4,626     | 日清製粉グループ本社      | 278.7   | 324   | 703,890   |
| 巴コーポレーション  | 24.5    | 18.7    | 12,379    | 日東富士製粉          | 5.4     | 6.2   | 33,294    |
| 大和ハウス工業    | 838.9   | 965.2   | 4,366,564 | 昭和産業            | 26.3    | 33.9  | 120,853   |
| ライト工業      | 57.2    | 71.8    | 140,656   | 鳥越製粉            | 15.6    | 12.4  | 8,928     |
| 積水ハウス      | 940.4   | 1,058.6 | 3,614,060 | 中部飼料            | 41.7    | 48.5  | 59,218    |
| 日特建設       | 28.6    | 33.3    | 39,926    | フィード・ワン         | 44      | 51.2  | 51,712    |
| 北陸電気工事     | 20.6    | 23.9    | 28,990    | 東洋精糖            | 3.7     | 2.8   | 7,120     |
| ユアテック      | 66.1    | 76.9    | 113,119   | 日本甜菜製糖          | 17.5    | 20.4  | 44,206    |
| 日本リーテック    | 19.8    | 27.3    | 36,008    | DM三井製糖ホールディングス  | 29.9    | 34.8  | 114,144   |
| 四電工        | 12.6    | 14.6    | 58,911    | 塩水港精糖           | 25.7    | 19.6  | 6,095     |
| 中電工        | 46.6    | 54.2    | 166,123   | ウェルネオシュガー       | 15.6    | 17.5  | 42,017    |
| 関電工        | 164.5   | 218.6   | 377,740   | 森永製菓            | 55.8    | 150   | 397,875   |
| きんでん       | 211.3   | 245.7   | 673,709   | 中村屋             | 7.5     | 8.7   | 28,014    |
| 東京エネシス     | 29.9    | 34.7    | 42,021    | 江崎グリコ           | 86.2    | 100.2 | 431,761   |
| トーエネック     | 10      | 11.6    | 67,512    | 名糖産業            | 11.9    | 13.8  | 25,116    |
| 住友電設       | 28.6    | 33.2    | 111,552   | 井村屋グループ         | 16.5    | 20.9  | 54,319    |
| 日本電設工業     | 49.3    | 65.5    | 136,829   | 不二家             | 20.7    | 24    | 59,688    |
| エクシオグループ   | 138.3   | 170.6   | 564,344   | 山崎製パン           | 201.7   | 234.5 | 920,647   |
| 新日本空調      | 16.7    | 22.6    | 79,891    | 第一屋製パン          | 3.7     | 2.7   | 1,830     |
| 九電工        | 73      | 75.4    | 484,671   | モロゾフ            | 9.7     | 11.3  | 48,646    |
| 三機工業       | 66.6    | 75.4    | 161,431   | 亀田製菓            | 19.2    | 20    | 85,900    |
| 日揮ホールディングス | 296.9   | 345.3   | 521,748   | 寿スピリッツ          | 32.1    | 165.7 | 333,636   |
| 中外炉工業      | 9.8     | 11.4    | 35,397    | カルビー            | 138     | 160.4 | 556,106   |
| ヤマト        | 16.1    | 12.4    | 13,255    | 森永乳業            | 54.8    | 122.4 | 389,599   |
| 太平電業       | 18.6    | 21.7    | 98,084    | 六甲バター           | 22.1    | 25.7  | 35,491    |
| 高砂熱学工業     | 72.4    | 93.5    | 446,930   | ヤクルト本社          | 215.3   | 500.8 | 1,557,988 |
| 三晃金属工業     | 2.7     | 1.9     | 9,918     | 明治ホールディングス      | 186.8   | 429.6 | 1,472,668 |
| 朝日工業社      | 12.5    | 16.3    | 55,746    | 雪印メグミルク         | 72.9    | 84.7  | 230,214   |
| 明星工業       | 51.6    | 67.5    | 91,395    | プリマハム           | 40.5    | 47.1  | 110,449   |
| 大氣社        | 36.1    | 40.2    | 190,950   | 日本ハム            | 117.8   | 150.7 | 787,558   |
| ダイダン       | 19.7    | 45.9    | 112,684   | 林兼産業            | 6.5     | 5     | 2,980     |

| 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 |
|                          | 千株      | 千株      | 千円        |     |                | 千株      | 千株      | 千円        |     |
| 丸大食品                     | 30.3    | 35.3    | 58,174    |     | 永谷園ホールディングス    | 14.8    | 17.2    | 39,078    |     |
| S Foods                  | 33.2    | 38.6    | 129,696   |     | 一正蒲鉾           | 8.3     | 6.4     | 4,755     |     |
| 柿安本店                     | 11.8    | 13.7    | 40,908    |     | フジッコ           | 31      | 36      | 70,416    |     |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 234.2   | 53.5    | 227,107   |     | ロック・フィールド      | 33.7    | 42.8    | 70,834    |     |
| サッポロホールディングス             | 99.2    | 115.3   | 687,072   |     | 日本たばこ産業        | 1,983.9 | 2,129.3 | 8,455,450 |     |
| アサヒグループホールディングス          | 696.3   | 809.7   | 4,393,432 |     | ケンコーマヨネーズ      | 20.7    | 24.1    | 48,947    |     |
| キリンホールディングス              | 1,359.9 | 1,459.7 | 3,059,531 |     | わらべや日洋ホールディングス | 22.2    | 23.5    | 63,614    |     |
| 宝ホールディングス                | 205.7   | 239.2   | 266,468   |     | なとり            | 18.9    | 22      | 47,520    |     |
| オエノンホールディングス             | 90.1    | 104.7   | 37,377    |     | イフジ産業          | 3.7     | 2.8     | 4,132     |     |
| 養命酒製造                    | 9.9     | 11.5    | 21,850    |     | ファーマフーズ        | 46.6    | 50.3    | 46,024    |     |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 236.1   | 274.5   | 625,997   |     | ユーグレナ          | 194     | 218.1   | 134,785   |     |
| ライフレンジ カンパニー             | —       | 5.2     | 23,920    |     | 紀文食品           | 23.5    | 30.4    | 37,908    |     |
| サントリー食品インターナショナル         | 212.2   | 246.7   | 1,284,566 |     | ピックルスホールディングス  | 17.7    | 20.5    | 24,272    |     |
| ダイドーグループホールディングス         | 17.1    | 39.7    | 108,976   |     | ミヨシ油脂          | 6.9     | 5.5     | 6,990     |     |
| 伊藤園                      | 102.1   | 118.7   | 429,575   |     | 理研ビタミン         | 26      | 30.3    | 78,113    |     |
| キーコーヒー                   | 33.8    | 39.3    | 80,486    |     | 繊維製品 (0.4%)    |         |         |           |     |
| ユニカフェ                    | 6.5     | 5       | 4,580     |     | 片倉工業           | 28.2    | 32.8    | 61,139    |     |
| ジャパンフーズ                  | 3.1     | 2.3     | 3,636     |     | グンゼ            | 23      | 25.3    | 140,668   |     |
| 日清オイリオグループ               | 42.4    | 49.4    | 259,350   |     | 東洋紡            | 132.5   | 154.1   | 176,290   |     |
| 不二製油グループ本社               | 70.2    | 81.6    | 213,914   |     | ユニチカ           | 92.5    | 115.3   | 19,370    |     |
| かどや製油                    | 1.9     | 1.5     | 6,045     |     | 富士紡ホールディングス    | 12.1    | 15.6    | 68,952    |     |
| J-オイルミルズ                 | 30.7    | 40.1    | 80,681    |     | 倉敷紡績           | 22.9    | 25.3    | 91,206    |     |
| キッコーマン                   | 199.7   | 232.2   | 2,302,959 |     | シキボウ           | 11      | 18.9    | 23,076    |     |
| 味の素                      | 737.5   | 832.7   | 4,566,526 |     | 日本毛織           | 80.8    | 91.4    | 129,056   |     |
| ブルドックソース                 | 12      | 18.6    | 40,157    |     | ダイトウボウ         | 34.2    | 24.6    | 2,386     |     |
| キユーピー                    | 162     | 188.3   | 531,006   |     | トーア紡コーポレーション   | 7.7     | 6       | 2,688     |     |
| ハウス食品グループ本社              | 92.3    | 120.7   | 374,049   |     | ダイドーリミテッド      | 30.1    | 21.8    | 15,870    |     |
| カゴメ                      | 140.4   | 150.7   | 557,740   |     | 帝国繊維           | 34.6    | 40.2    | 90,691    |     |
| 焼津水産化学工業                 | 8.7     | 6.6     | 9,398     |     | 帝人             | 294.5   | 342.5   | 475,561   |     |
| アリアケジャパン                 | 26.3    | 34.9    | 184,621   |     | 東レ             | 2,054   | 2,388.4 | 1,756,907 |     |
| ピエトロ                     | 2.8     | 2       | 3,720     |     | 住江織物           | 3.6     | 2.8     | 7,084     |     |
| エバラ食品工業                  | 8.1     | 8.4     | 25,200    |     | 日本フエルト         | 11.9    | 8.7     | 3,906     |     |
| やまみ                      | 1.9     | 1.3     | 5,083     |     | イチカワ           | 2.5     | 1.9     | 3,686     |     |
| ニチレイ                     | 138.1   | 160.6   | 660,066   |     | 日東製綱           | 2.3     | 1.6     | 2,694     |     |
| 東洋水産                     | 152.3   | 177.1   | 1,721,766 |     | アツギ            | 15      | 10.3    | 6,324     |     |
| イートアンドホールディングス           | 12.8    | 16.6    | 33,565    |     | ダイニック          | 6.8     | 4.5     | 3,541     |     |
| 大冷                       | 2.4     | 2       | 3,892     |     | セーレン           | 59.2    | 68.8    | 181,150   |     |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス        | 19.1    | 15.9    | 21,003    |     | ソトー            | 7.7     | 4.8     | 3,470     |     |
| 日清食品ホールディングス             | 106     | 369.6   | 1,583,736 |     | 東海染工           | 2.4     | 1.4     | 1,150     |     |

| 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 |
|                | 千株      | 千株      | 千円        |     |              | 千株      | 千株      | 千円         |     |
| 小松マテーレ         | 44.4    | 51.7    | 40,015    |     | ラサ工業         | 11.8    | 13.7    | 36,414     |     |
| ワコールホールディングス   | 59.1    | 73.1    | 273,978   |     | クレハ          | 26.2    | 78      | 217,308    |     |
| ホギメディカル        | 41.1    | 47.1    | 175,918   |     | 多木化学         | 11.9    | 13.8    | 51,405     |     |
| クラウディアホールディングス | 4.5     | 3.5     | 1,477     |     | ティカ          | 20.6    | 30.8    | 48,787     |     |
| T S I ホールディングス | 103.2   | 115.9   | 88,199    |     | 石原産業         | 55.5    | 59.1    | 101,061    |     |
| マツオカコーポレーション   | 6.1     | 4.5     | 7,191     |     | 片倉コーポアグリ     | 4.7     | 3.5     | 3,860      |     |
| ワールド           | 39.4    | 50.3    | 104,070   |     | 日本曹達         | 32.9    | 42.1    | 259,336    |     |
| 三陽商会           | 9.3     | 13.4    | 35,590    |     | 東ソー          | 409.3   | 475.9   | 1,001,055  |     |
| ナイガイ           | 7.1     | 5.1     | 1,310     |     | トクヤマ         | 99      | 115.1   | 310,654    |     |
| オンワードホールディングス  | 198.8   | 210.2   | 111,826   |     | セントラル硝子      | 49.2    | 38.1    | 110,490    |     |
| ルックホールディングス    | 5.7     | 9.9     | 26,225    |     | 東亞合成         | 153.7   | 171.4   | 274,582    |     |
| キムラタン          | 120.7   | 96.3    | 1,733     |     | 大阪ソーダ        | 18.4    | 24.9    | 243,522    |     |
| ゴールドワイン        | 54.3    | 63.1    | 609,230   |     | 関東電化工業       | 59.3    | 68.9    | 69,037     |     |
| デサント           | 52.8    | 61.4    | 212,137   |     | デンカ          | 111.5   | 129.6   | 315,900    |     |
| キング            | 9.9     | 5.7     | 4,104     |     | 信越化学工業       | 509.7   | 3,196.7 | 21,577,725 |     |
| ヤマトイインターナショナル  | 15.6    | 11.9    | 3,665     |     | 日本カーバイド工業    | 7.5     | 15      | 28,170     |     |
| バルブ・紙 (0.2%)   |         |         |           |     | 堺化学工業        | 23.3    | 27.1    | 53,576     |     |
| 特種東海製紙         | 13.7    | 19.5    | 79,657    |     | 第一稀元素化学工業    | 27.9    | 39      | 37,206     |     |
| 王子ホールディングス     | 1,277.1 | 1,485   | 935,995   |     | エア・ウォーター     | 289.3   | 336.3   | 789,800    |     |
| 日本製紙           | 159.7   | 201.1   | 244,336   |     | 日本酸素ホールディングス | 297.4   | 345.8   | 1,663,643  |     |
| 三菱製紙           | 26.9    | 20.3    | 12,464    |     | 日本化学工業       | 10.2    | 13.1    | 31,702     |     |
| 北越コーポレーション     | 193.7   | 175.2   | 433,795   |     | 東邦アセチレン      | 4.2     | 16.6    | 6,673      |     |
| 中越パルプ工業        | 8       | 6       | 11,592    |     | 日本パーカライジング   | 151.8   | 158.8   | 195,959    |     |
| 巴川コーポレーション     | 6.2     | —       | —         |     | 高圧ガス工業       | 44.5    | 51.8    | 47,086     |     |
| 大王製紙           | 135.4   | 157.5   | 189,945   |     | チタン工業        | 2.4     | 2       | 2,198      |     |
| 阿波製紙           | 4.7     | 3.7     | 1,957     |     | 四国化成ホールディングス | 36.4    | 45.6    | 83,356     |     |
| レンゴー           | 279.2   | 324.7   | 379,087   |     | 戸田工業         | 7       | 8.1     | 14,458     |     |
| トモク            | 17.7    | 20.6    | 55,372    |     | ステラ ケミファ     | 18.1    | 19.3    | 72,954     |     |
| ザ・パック          | 22.8    | 26.5    | 97,387    |     | 保土谷化学工業      | 8.7     | 11.2    | 40,152     |     |
| 化学 (5.7%)      |         |         |           |     | 日本触媒         | 46.7    | 51.9    | 310,050    |     |
| 北の達人コーポレーション   | 129.2   | 150.2   | 30,040    |     | 大日精化工業       | 21.3    | 24.8    | 71,473     |     |
| クラレ            | 487.4   | 519.5   | 831,719   |     | カネカ          | 70      | 90.5    | 348,063    |     |
| 旭化成            | 1,914.5 | 2,411.6 | 2,699,786 |     | 三菱瓦斯化学       | 228.9   | 260.2   | 683,415    |     |
| 共和レザー          | 11.4    | 8.7     | 7,229     |     | 三井化学         | 252.8   | 294     | 1,307,712  |     |
| 巴川コーポレーション     | —       | 4.3     | 3,706     |     | J S R        | 286.2   | 388.3   | 1,680,174  |     |
| レゾナック・ホールディングス | 296.3   | 344.5   | 1,233,310 |     | 東京応化工業       | 53.6    | 170.1   | 773,614    |     |
| 住友化学           | 2,274.2 | 2,645.4 | 886,209   |     | 大阪有機化学工業     | 23.1    | 29.8    | 94,019     |     |
| 住友精化           | 12.8    | 16.7    | 86,339    |     | 三菱ケミカルグループ   | 2,068.8 | 2,606   | 2,448,597  |     |
| 日産化学           | 145.6   | 167.4   | 990,171   |     | K H ネオケム     | 51      | 54.4    | 121,312    |     |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当期末     |           | 銘柄               | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|----------------|---------|---------|-----------|------------------|---------|-------|-----------|
|                |         | 株数      | 評価額       |                  |         | 株数    | 千円        |
| ダイセル           | 450.8   | 458.2   | 684,550   | 関西ペイント           | 280.8   | 349.3 | 770,381   |
| 住友ベークライト       | 45.4    | 49.9    | 457,682   | 神東塗料             | 16.5    | 12.5  | 1,625     |
| 積水化学工業         | 627     | 716.3   | 1,595,200 | 中国塗料             | 50.4    | 73.2  | 166,896   |
| 日本ゼオン          | 183.9   | 244.4   | 322,241   | 日本特殊塗料           | 12.6    | 10.7  | 15,236    |
| アイカ工業          | 77.4    | 90      | 338,400   | 藤倉化成             | 41.2    | 41.1  | 19,851    |
| U B E          | 158     | 169.6   | 465,128   | 太陽ホールディングス       | 46.6    | 62.1  | 208,966   |
| 積水樹脂           | 44.6    | 53.2    | 128,531   | D I C            | 119.8   | 139.3 | 404,875   |
| タキロンシーアイ       | 67      | 90.9    | 60,812    | サカタインクス          | 68.2    | 79.3  | 122,835   |
| 旭有機材           | 20.4    | 23.7    | 123,003   | a r t i e n c e  | 60      | 77.6  | 230,006   |
| ニチバン           | 19      | 19.3    | 38,175    | T & K T O K A    | 27.2    | 34.1  | 47,808    |
| リケンテクノス        | 66      | 76.8    | 75,417    | 富士フィルムホールディングス   | 589     | 662.2 | 6,817,349 |
| 大倉工業           | 14.2    | 16.5    | 52,140    | 資生堂              | 640.9   | 745.3 | 3,045,295 |
| 積水化成品工業        | 43      | 50      | 25,500    | ライオン             | 368.3   | 467.2 | 619,273   |
| 群栄化学工業         | 7.2     | 8.4     | 31,542    | 高砂香料工業           | 20.8    | 26.8  | 95,944    |
| タイガースポリマー      | 10.1    | 6.8     | 7,779     | マンダム             | 66.3    | 77.1  | 105,781   |
| ミライアル          | 6.7     | 5.2     | 8,013     | ミルボン             | 45.5    | 48.5  | 156,170   |
| ダイキアクシス        | 7.3     | 5.9     | 4,141     | ファンケル            | 134.3   | 156.1 | 318,912   |
| ダイキヨーニシカワ      | 67.7    | 78.7    | 62,330    | コーセー             | 62.4    | 72.6  | 551,106   |
| 竹本容器           | 6.7     | 5.3     | 4,176     | コタ               | 25.7    | 32.9  | 55,502    |
| 森六ホールディングス     | 15.5    | 18.5    | 51,004    | シーボン             | 2.8     | 2     | 2,998     |
| 恵和             | 19.8    | 25.6    | 28,953    | ボーラ・オルビスホールディングス | 157.4   | 183   | 260,775   |
| 日本化薬           | 234.2   | 272.3   | 358,891   | ノエビアホールディングス     | 27.4    | 31.8  | 166,314   |
| カーリットホールディングス  | 27.5    | 38.4    | 40,588    | アジュバンホールディングス    | 4.8     | 3.6   | 3,290     |
| 日本精化           | 17.4    | 23.6    | 62,492    | 新日本製薬            | 17.5    | 20.4  | 35,006    |
| 扶桑化学工業         | 28.5    | 37.8    | 184,275   | I - n e          | —       | 7.1   | 12,929    |
| トリケミカル研究所      | 40.9    | 43.3    | 216,067   | アクシージア           | 10.5    | 17.6  | 14,044    |
| A D E K A      | 106.9   | 124.3   | 405,590   | エステー             | 23.7    | 27.5  | 43,395    |
| 日油             | 94.8    | 107.6   | 705,318   | アグロ カネショウ        | 12.3    | 14.3  | 17,975    |
| 新日本理化          | 29.8    | 20.8    | 3,910     | コニシ              | 51.3    | 103.1 | 162,898   |
| ハリマ化成グループ      | 13.9    | 22.2    | 20,890    | 長谷川香料            | 63.5    | 68.2  | 207,328   |
| 花王             | 746.5   | 806     | 4,496,674 | 星光PMC            | 10.1    | —     | —         |
| 第一工業製薬         | 11      | 14.2    | 51,759    | 小林製薬             | 89.3    | 103.8 | 524,812   |
| 石原ケミカル         | 14      | 15.9    | 29,971    | 荒川化学工業           | 26      | 30.2  | 35,515    |
| 日華化学           | 8       | 6       | 5,718     | メック              | 25.3    | 29.4  | 120,099   |
| ニイタカ           | 3.9     | 2.8     | 5,499     | 日本高純度化学          | 7.6     | 8.1   | 24,105    |
| 三洋化成工業         | 18.9    | 21.9    | 97,893    | タカラバイオ           | 82.7    | 96.2  | 95,238    |
| 有機合成薬品工業       | 14.7    | 11.7    | 3,755     | J C U            | 34.7    | 39.9  | 153,615   |
| 大日本塗料          | 37.4    | 39.5    | 46,412    | 新田ゼラチン           | 12.3    | 9.9   | 7,405     |
| 日本ペイントホールディングス | 1,356.6 | 1,892.9 | 2,032,028 | O A T アグリオ       | 8.1     | 11.8  | 22,774    |

| 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 |
|                 |         | 千株      | 千株         | 千円  |                  |         | 千株      | 千株         | 千円  |
| デクセリアルズ         | 88.6    | 89.6    | 569,766    |     | 持田製薬             | 36.8    | 41      | 132,635    |     |
| アース製薬           | 27.8    | 32.4    | 138,996    |     | 参天製薬             | 577.7   | 650.5   | 964,366    |     |
| 北興化学工業          | 30.9    | 35.9    | 42,469     |     | 扶桑薬品工業           | 9.7     | 12.6    | 29,219     |     |
| 大成ラミック          | 9.7     | 10.3    | 31,312     |     | 日本ケミファ           | 2.3     | 1.7     | 2,859      |     |
| クミアイ化成工業        | 121.9   | 141.8   | 115,141    |     | ツムラ              | 96.6    | 112.4   | 437,348    |     |
| 日本農薬            | 56.3    | 65.5    | 49,649     |     | キッセイ薬品工業         | 47.4    | 59.1    | 207,441    |     |
| アキレス            | 20      | 22.5    | 35,347     |     | 生化学工業            | 58.5    | 60.5    | 46,464     |     |
| 有沢製作所           | 49.7    | 62.5    | 72,750     |     | 榮研化学             | 49.8    | 65.5    | 128,249    |     |
| 日東電工            | 222.8   | 229.3   | 3,244,595  |     | 鳥居薬品             | 16.5    | 19.2    | 76,992     |     |
| レック             | 43.7    | 45.7    | 52,874     |     | J C R ファーマ       | 103.9   | 120.8   | 105,096    |     |
| 三光合成            | 38.6    | 44.9    | 32,328     |     | 東和薬品             | 47.2    | 54.8    | 159,468    |     |
| きもと             | 32.9    | 25.1    | 5,747      |     | 富士製薬工業           | 19.8    | 26.4    | 42,847     |     |
| 藤森工業            | 24.3    | 28.2    | 120,555    |     | ゼリア新薬工業          | 42.6    | 49.5    | 107,712    |     |
| 前澤化成工業          | 19.8    | 23      | 38,893     |     | そーせいグループ         | 84.8    | 117.2   | 184,941    |     |
| 未来工業            | 11      | 12.8    | 57,344     |     | 第一三共             | 2,674.2 | 3,109.4 | 14,993,526 |     |
| ウェーブロックホールディングス | 7.9     | 5.2     | 3,614      |     | 杏林製薬             | 66.6    | 77.4    | 141,951    |     |
| J S P           | 21.6    | 25.1    | 57,353     |     | 大幸薬品             | 55.6    | 74.1    | 30,084     |     |
| エフピコ            | 58.1    | 67.5    | 185,355    |     | ダイト              | 21.5    | 27.2    | 62,995     |     |
| 天馬              | 26.1    | 25.9    | 60,761     |     | 大塚ホールディングス       | 702.3   | 742.4   | 4,690,483  |     |
| 信越ボリマー          | 56.7    | 77      | 120,736    |     | 大正製薬ホールディングス     | 68.2    | —       | —          |     |
| 東リ              | 49      | 34.9    | 14,623     |     | ペプチドリーム          | 148.8   | 173     | 247,303    |     |
| ニフコ             | 110.7   | 106.7   | 411,755    |     | セルソース            | —       | 9.9     | 14,117     |     |
| バルカー            | 25.7    | 29.8    | 156,748    |     | あすか製薬ホールディングス    | 31.5    | 36.6    | 77,775     |     |
| ユニ・チャーム         | 639.5   | 743.6   | 3,578,203  |     | サワイグループホールディングス  | 70.2    | 81.6    | 492,700    |     |
| ショーエイコーポレーション   | 5.7     | 4.5     | 2,853      |     | 石油・石炭製品 (0.5%)   |         |         |            |     |
| 医薬品 (4.3%)      |         |         |            |     | 日本コータクス工業        | 276.8   | 362.1   | 46,710     |     |
| 協和キリン           | 370.8   | 431.2   | 1,180,841  |     | ニチレイ             | 36.3    | 46.4    | 117,067    |     |
| 武田薬品工業          | 2,716.5 | 3,158.9 | 13,788,598 |     | ユシロ化学工業          | 15.9    | 18.5    | 41,662     |     |
| アステラス製薬         | 2,941.7 | 3,130.9 | 5,176,943  |     | ビービー・カストロール      | 7.7     | 5.9     | 5,811      |     |
| 住友ファーマ          | 227.7   | 264.8   | 106,979    |     | 富士石油             | 62.6    | 104     | 49,504     |     |
| 塩野義製薬           | 392.3   | 450     | 3,515,400  |     | MORESCO          | 7.1     | 5.4     | 7,678      |     |
| わかもと製薬          | 20.9    | 15.9    | 3,529      |     | 出光興産             | 340.9   | 1,982   | 2,089,028  |     |
| 日本新薬            | 72.4    | 93.5    | 427,014    |     | ENEOSホールディングス    | 5,545.8 | 5,650.7 | 4,146,483  |     |
| 中外製薬            | 960.9   | 1,117.3 | 6,536,205  |     | コスモエネルギーホールディングス | 121.3   | 105.8   | 801,011    |     |
| 科研製薬            | 52.6    | 61.1    | 219,410    |     | ゴム製品 (0.7%)      |         |         |            |     |
| エーザイ            | 373.4   | 434.2   | 2,734,157  |     | 横浜ゴム             | 174.7   | 180.5   | 743,660    |     |
| ロート製薬           | 297.3   | 345.7   | 1,092,066  |     | TOYO TIRE        | 176.4   | 205.1   | 576,638    |     |
| 小野薬品工業          | 592.2   | 757.5   | 1,891,477  |     | ブリヂストン           | 980.2   | 1,044.8 | 6,997,025  |     |
| 久光製薬            | 68.2    | 79.3    | 316,010    |     | 住友ゴム工業           | 301.1   | 350.1   | 640,157    |     |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当期末   |           |     |
|------------------------|---------|-------|-----------|-----|
|                        |         | 株数    | 株数        | 評価額 |
|                        | 千株      | 千株    | 千円        |     |
| 藤倉コンポジット               | 17.2    | 27.5  | 39,682    |     |
| オカモト                   | 17      | 16.9  | 85,176    |     |
| フコク                    | 16.1    | 18.7  | 34,576    |     |
| ニッタ                    | 31.2    | 36.3  | 145,926   |     |
| 住友理工                   | 59.5    | 55.4  | 73,792    |     |
| 三ツ星ベルト                 | 44.8    | 43.4  | 212,226   |     |
| バンドー化学                 | 48.6    | 53    | 99,163    |     |
| <b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b> |         |       |           |     |
| 日東紡績                   | 34.5    | 45.2  | 274,364   |     |
| A G C                  | 312.4   | 318.3 | 1,758,607 |     |
| 日本板硝子                  | 156.5   | 170.3 | 89,237    |     |
| 石塚硝子                   | 3.4     | 2.6   | 7,163     |     |
| 日本山村硝子                 | 7.4     | 5.7   | 9,450     |     |
| 日本電気硝子                 | 125.3   | 145.7 | 544,043   |     |
| オハラ                    | 14.6    | 16.9  | 22,020    |     |
| 住友大阪セメント               | 43.2    | 59.4  | 232,254   |     |
| 太平洋セメント                | 195.5   | 211   | 755,169   |     |
| 日本ヒューム                 | 26.9    | 31.2  | 27,830    |     |
| 日本コンクリート工業             | 59.5    | 69.2  | 28,302    |     |
| 三谷セキサン                 | 12.9    | 15    | 84,450    |     |
| アジアパイルホールディングス         | 48      | 50.7  | 40,357    |     |
| 東海カーボン                 | 257.5   | 329.3 | 327,093   |     |
| 日本カーボン                 | 17.6    | 18.9  | 100,737   |     |
| 東洋炭素                   | 19.2    | 25.1  | 202,055   |     |
| ノリタケカンパニーリミテド          | 15.3    | 19.8  | 166,716   |     |
| T O T O                | 202.6   | 235.5 | 972,144   |     |
| 日本碍子                   | 363.2   | 415.2 | 848,253   |     |
| 日本特殊陶業                 | 233.7   | 298.9 | 1,527,976 |     |
| ダントーホールディングス           | 14      | 10    | 11,330    |     |
| MARUWA                 | 11.3    | 13.2  | 418,440   |     |
| 品川リフラクトリーズ             | 8.6     | 43.9  | 85,341    |     |
| 黒崎播磨                   | 6.3     | 7.3   | 104,171   |     |
| ヨータイ                   | 20.5    | 22    | 33,044    |     |
| 東京窯業                   | 21.2    | 16.2  | 7,954     |     |
| ニッカトー                  | 8.9     | 6.7   | 4,100     |     |
| フジミインコーポレーテッド          | 24.4    | 95.9  | 345,719   |     |
| クニミネ工業                 | 6.7     | 4.3   | 4,691     |     |
| エーアンドエーマテリアル           | 3.6     | 2.8   | 3,914     |     |
| ニチアス                   | 77.6    | 90.2  | 368,467   |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末     |           |     |
|--------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                    |         | 株数      | 株数        | 評価額 |
|                    | 千株      | 千株      | 千円        |     |
| ニチハ                | 38.4    | 44.7    | 152,874   |     |
| <b>鉄鋼 (1.0%)</b>   |         |         |           |     |
| 日本製鉄               | 1,414   | 1,644.1 | 6,217,986 |     |
| 神戸製鋼所              | 635.1   | 738.5   | 1,600,329 |     |
| 中山製鋼所              | 65      | 83.9    | 81,970    |     |
| 合同製鐵               | 15.7    | 20.5    | 123,615   |     |
| J F E ホールディングス     | 843.9   | 1,021.2 | 2,665,332 |     |
| 東京製鐵               | 88.7    | 103.2   | 174,614   |     |
| 共英製鋼               | 36      | 41.8    | 99,609    |     |
| 大和工業               | 52.1    | 69.2    | 612,212   |     |
| 東京鐵鋼               | 15      | 16.2    | 89,586    |     |
| 大阪製鐵               | 14.5    | 16.9    | 36,791    |     |
| 淀川製鋼所              | 35.9    | 41.7    | 195,990   |     |
| 中部鋼板               | 25.9    | 24.1    | 63,720    |     |
| 丸一鋼管               | 96.1    | 111.8   | 459,274   |     |
| モリ工業               | 5.2     | 7.4     | 42,328    |     |
| 大同特殊鋼              | 39.8    | 231.3   | 417,959   |     |
| 日本高周波鋼業            | 7.8     | 5.9     | 3,392     |     |
| 日本冶金工業             | 23.1    | 26.8    | 132,928   |     |
| 山陽特殊製鋼             | 31.2    | 36.3    | 83,018    |     |
| 愛知製鋼               | 18.2    | 21.2    | 82,786    |     |
| 日本金属               | 5.3     | 4       | 3,448     |     |
| 大平洋金属              | 22.4    | 31.3    | 41,441    |     |
| 新日本電工              | 201.8   | 182.6   | 57,153    |     |
| 栗本鐵工所              | 15      | 17      | 64,770    |     |
| 虹技                 | 2.7     | 1.9     | 2,844     |     |
| 日本鋳鉄管              | 2.2     | 1.7     | 2,028     |     |
| 三菱製鋼               | 19.8    | 27.2    | 40,881    |     |
| 日亜鋼業               | 24.1    | 15.7    | 5,306     |     |
| 日本精線               | 4.3     | 5.8     | 40,020    |     |
| エンビプロ・ホールディングス     | 14.1    | 28.9    | 15,028    |     |
| シンニッタン             | 25.7    | 19.6    | 5,840     |     |
| 新家工業               | 4.4     | 3.4     | 13,260    |     |
| <b>非鉄金属 (0.7%)</b> |         |         |           |     |
| 大紀アルミニウム工業所        | 44.9    | 46.5    | 58,171    |     |
| 日本軽金属ホールディングス      | 85.1    | 107.3   | 197,646   |     |
| 三井金属鉱業             | 91.9    | 106.9   | 498,795   |     |
| 東邦亜鉛               | 18.7    | 23.5    | 25,333    |     |
| 三菱マテリアル            | 210.7   | 262.5   | 767,287   |     |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当期末     |           | 銘柄               | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|-----------------------------|---------|---------|-----------|------------------|---------|-------|-----------|
|                             |         | 株数      | 評価額       |                  |         | 株数    | 千円        |
| 住友金属鉱山                      | 366.1   | 425.7   | 1,905,433 | L I X I L        | 460.1   | 573.3 | 1,100,736 |
| DOWAホールディングス                | 70.9    | 90.7    | 489,689   | 日本フィルコン          | 13.3    | 10.1  | 5,605     |
| 古河機械金属                      | 46.3    | 48.4    | 88,620    | ノーリツ             | 46.5    | 60.8  | 104,211   |
| エス・サイエンス                    | 94.3    | 75.5    | 1,963     | 長府製作所            | 31.8    | 36.5  | 79,132    |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ              | 46.3    | 63.7    | 166,957   | リンナイ             | 57.3    | 175.7 | 611,787   |
| 東邦チタニウム                     | 57.1    | 75.9    | 116,278   | ダイニチ工業           | 10.1    | 7.7   | 5,551     |
| UACJ                        | 44.3    | 51.5    | 228,145   | 日東精工             | 45.8    | 53.2  | 33,622    |
| CKサンエツ                      | 7.6     | 8.9     | 35,733    | 三洋工業             | 2.6     | 1.8   | 6,183     |
| 古河電気工業                      | 105.1   | 122.3   | 393,683   | 岡部               | 50.8    | 65.6  | 49,856    |
| 住友電気工業                      | 1,090.4 | 1,373.6 | 3,263,673 | ジークト             | 35.2    | 46.8  | 99,169    |
| フジクラ                        | 338.6   | 433.1   | 940,693   | 東プレ              | 55.6    | 64.7  | 165,826   |
| SWCC                        | 35.3    | 41      | 153,340   | 高周波熱鍊            | 51.5    | 56.6  | 63,561    |
| タツタ電線                       | 64.2    | 65.4    | 46,441    | 東京製綱             | 18.6    | 23.8  | 34,129    |
| カナレ電気                       | 3.1     | 2.5     | 4,350     | サンコール            | 18.1    | 32.6  | 15,974    |
| 平河ヒューテック                    | 18.2    | 23.5    | 33,158    | モリテック スチール       | 16.5    | 13.1  | 3,327     |
| リヨービ                        | 33.6    | 39.1    | 115,931   | パイオラックス          | 43.6    | 45.6  | 123,986   |
| アーレスティ                      | 22.6    | 17.1    | 14,158    | エイチワン            | 32.5    | 37.8  | 27,405    |
| AREホールディングス                 | 127.7   | 137.9   | 274,421   | 日本発條             | 279.3   | 324.8 | 487,200   |
| <b>金属製品 (0.5%)</b>          |         |         |           | 中央発條             | 17.5    | 27.2  | 30,736    |
| 稻葉製作所                       | 18.5    | 18.1    | 33,159    | アドバネクス           | 2.8     | 2     | 2,814     |
| 宮地エンジニアリンググループ              | 8.7     | 18.4    | 79,672    | 立川ブラインド工業        | 14.3    | 16.6  | 24,319    |
| トーカロ                        | 86.8    | 105.9   | 185,113   | 三益半導体工業          | 24.4    | 33.1  | 101,286   |
| アルファCo                      | 7.5     | 5.7     | 9,935     | <b>機械 (5.5%)</b> |         |       |           |
| SUMCO                       | 601.2   | 652.4   | 1,581,743 | 日本ドライケミカル        | 4.8     | 3.5   | 9,247     |
| 川田テクノロジーズ                   | 7.4     | 8.7     | 89,871    | 日本製鋼所            | 85.1    | 99    | 317,889   |
| R S T e c h n o l o g i e s | 21.1    | 24.6    | 68,904    | 三浦工業             | 129.1   | 150.1 | 436,415   |
| ジェイテックコーポレーション              | 2.7     | 2       | 3,906     | タクマ              | 95      | 121.5 | 231,943   |
| 信和                          | 13.1    | 9.9     | 7,553     | ツガミ              | 68.7    | 79.9  | 93,163    |
| 東洋製罐グループホールディングス            | 209     | 210.6   | 531,659   | オークマ             | 30.9    | 31.4  | 229,502   |
| ホッカンホールディングス                | 17      | 17.9    | 34,726    | 芝浦機械             | 30.9    | 35.9  | 131,753   |
| コロナ                         | 17.6    | 20.5    | 20,336    | アマダ              | 493.2   | 573.5 | 1,032,586 |
| 横河プリッジホールディングス              | 41.7    | 57.4    | 168,813   | アイダエンジニアリング      | 63.6    | 83.2  | 76,294    |
| 駒井ハルティック                    | 3.3     | 2.7     | 5,788     | TAKI SAWA        | 6.1     | —     | —         |
| 高田機工                        | 1.8     | 1.2     | 4,446     | F U J I          | 134.4   | 169.2 | 453,033   |
| 三和ホールディングス                  | 290.8   | 368.9   | 978,507   | 牧野フライス製作所        | 34.2    | 39.8  | 247,556   |
| 文化シャッター                     | 90.9    | 96.1    | 164,427   | オーエスジー           | 147.6   | 158.4 | 341,035   |
| 三協立山                        | 36.1    | 46.2    | 42,180    | ダイジェット工業         | 2.2     | 1.5   | 1,288     |
| アルインコ                       | 24.1    | 28      | 28,896    | 旭ダイヤモンド工業        | 86.3    | 82.9  | 81,573    |
| 東洋シャッター                     | 4.7     | 3.5     | 2,527     | DMG森精機           | 187.4   | 217.9 | 903,413   |

| 銘柄            | 期首(前期末) | 当期末   |           | 銘柄             | 期首(前期末) | 当期末     |           |         |
|---------------|---------|-------|-----------|----------------|---------|---------|-----------|---------|
|               |         | 株数    | 評価額       |                |         | 株数      | 評価額       |         |
| ソディック         | 千株      | 千株    | 千円        | オカダアイヨン        | 千株      | 千株      | 千円        |         |
| ディスコ          | 85.2    | 87.5  | 63,000    | 6.7            | 5.1     | 15,325  |           |         |
| 日東工器          | 49.6    | 173.1 | 9,416,640 | ワイエイシイホールディングス | 8.5     | 13.5    | 33,898    |         |
| 日進工具          | 15      | 17.4  | 33,077    | 小松製作所          | 1,448.4 | 1,684.8 | 7,477,142 |         |
| パンチ工業         | 25.8    | 33.3  | 33,200    | 住友重機械工業        | 182.9   | 212.6   | 1,008,361 |         |
| 富士ダイス         | 18.2    | 14.6  | 6,643     | 日立建機           | 123.1   | 143.1   | 651,534   |         |
| 豊和工業          | 10.7    | 21.3  | 14,846    | 日工             | 45.8    | 53.2    | 41,708    |         |
| 石川製作所         | 10.9    | 8.3   | 6,889     | 巴工業            | 13.3    | 14      | 58,590    |         |
| リケンN P R      | 5.5     | 3.9   | 5,245     | 井関農機           | 28.9    | 33.6    | 34,608    |         |
| 東洋機械金属        | —       | 39    | 118,170   | T O W A        | 31.5    | 40      | 385,600   |         |
| 津田駒工業         | 13.8    | 11    | 8,800     | 丸山製作所          | 3.3     | 2.6     | 6,502     |         |
| エンシュウ         | 3.6     | 2.7   | 1,282     | 北川鉄工所          | 12.2    | 14.1    | 24,054    |         |
| 島精機製作所        | 4.7     | 3.6   | 2,476     | ローツェ           | 16.2    | 18.8    | 384,084   |         |
| オブトラン         | 49.2    | 57.2  | 78,878    | タカキタ           | 6.5     | 5       | 2,475     |         |
| N C ホールディングス  | 45.7    | 59    | 120,183   | クボタ            | 1,635.8 | 1,879.1 | 4,365,149 |         |
| イワキポンプ        | 5.4     | 3.6   | 6,480     | 荏原実業           | 41.8    | 48.6    | 67,851    |         |
| フリュー          | 20.6    | 23.9  | 65,844    | 三菱化工機          | 22.4    | 25.3    | 50,211    |         |
| ヤマシンフィルタ      | 32.4    | 33.9  | 41,764    | 月島ホールディングス     | 6.2     | 4       | 50,211    |         |
| 日阪製作所         | 73.7    | 86.3  | 38,835    | 帝国電機製作所        | 62.5    | 72.6    | 84,143    |         |
| やまびこ          | 30      | 39.2  | 40,180    | 東京機械製作所        | 29      | 33.7    | 116,939   |         |
| 野村マイクロ・サイエンス  | 50.5    | 58.7  | 116,284   | 新東工業           | 43.7    | 50      | 57,100    |         |
| 平田機工          | 10.5    | 12.2  | 228,384   | 濱谷工業           | 71.6    | 88.5    | 115,492   |         |
| P E G A S U S | 14.8    | 17.2  | 134,332   | アイチ コーポレーション   | 鶴見製作所   | 23.6    | 27.4      | 101,928 |
| マルマエ          | 34.1    | 39.7  | 21,080    | 小森コーポレーション     | 日本ギア工業  | 7.6     | 5.8       | 3,683   |
| タツモ           | 14.9    | 15.6  | 32,354    | ナブテスコ          | 225.6   | 3.5     | 38,360    |         |
| 三井海洋開発        | 17      | 21.7  | 83,545    | 酒井重工業          | 38.7    | 5.6     | 126.5     |         |
| レオン自動機        | 194     | 45.5  | 142,187   | 荏原製作所          | 41.6    | 147.5   | 1,986,825 |         |
| S M C         | 32.5    | 41.6  | 63,273    | 石井鐵工所          | 100.2   | 2.5     | 1.7       |         |
| ホソカワミクロン      | 100.2   | 107.6 | 9,252,524 | 西島製作所          | 23.5    | 1.7     | 4,965     |         |
| ユニオントール       | 23.7    | 23    | 108,100   | 北越工業           | 107.6   | 26.7    | 86,736    |         |
| 瑞光            | 13.6    | 15.8  | 69,046    | ダイキン工業         | 108,100 | 31.1    | 30.9      |         |
| オイレス工業        | —       | 25.9  | 37,451    | オルガノ           | 75.933  | 36.1    | 36.1      |         |
| 日精エー・エス・ピー機械  | 43.2    | 48.7  | 111,425   | トヨーカネツ         | 41.6    | 369     | 71,478    |         |
| サトーホールディングス   | 44      | 51.1  | 120,289   | 栗田工業           | 67,904  | 42.4    | 429.1     |         |
| 技研製作所         | 32.3    | 33.8  | 25.9      | 椿本チエイン         | 15.6    | 43.2    | 8,755,785 |         |
| 日本エーテック       | 32.3    | 33.8  | 37,451    | 大同工業           | 16.8    | 8.7     | 311,040   |         |
| カワタ           | 15.6    | 6.3   | 67,904    | 木村化工機          | 4.7     | 6.7     | 5,366     |         |
| 日精樹脂工業        | 6.3     | 22.9  | 5,052     | アネスト岩田         | 26.7    | 23.6    | 19,426    |         |
|               | 22.9    | 26.7  | 32,680    | ダイフク           | 19.740  | 52.6    | 55.6      |         |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当期末       |         | 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末     |            |
|-----------------|---------|-----------|---------|--------------------|---------|---------|------------|
|                 |         | 株数        | 評価額     |                    |         | 株数      | 評価額        |
| サムコ             | 千株      | 千株        | 千円      | 前澤工業               | 千株      | 千株      | 千円         |
| 加藤製作所           | 10.1    | 9.6       | 47,808  | 日本ピラー工業            | 12.9    | 8.7     | 9,474      |
| 油研工業            | 10.2    | 7.7       | 11,696  | キッツ                | 28.7    | 33.3    | 197,136    |
| タダノ             | 3.3     | 2.5       | 6,145   | マキタ                | 113.8   | 120.3   | 155,668    |
| フジテック           | 163     | 206.8     | 260,257 | 三井E&S              | 384.6   | 409.9   | 1,708,463  |
| CKD             | 113.2   | 84        | 324,408 | 日立造船               | 142.1   | 178.4   | 345,382    |
| 平和              | 85.5    | 99.4      | 303,667 | 三菱重工業              | 253.3   | 317.1   | 414,132    |
| 理想科学工業          | 102.8   | 106.3     | 219,084 | I H I              | 540.6   | 628.6   | 8,542,674  |
| SANKYO          | 27.5    | 28.7      | 90,692  | サノヤスホールディングス       | 194.7   | 267.6   | 985,570    |
| 日本金錢機械          | 60.7    | 413.3     | 700,956 | スター精密              | 24.3    | 19.5    | 3,822      |
| マースグループホールディングス | 34      | 43.4      | 56,463  | 電気機器 (17.3%)       | 58.3    | 66.1    | 122,086    |
| フクシマガリレイ        | 18.2    | 18.1      | 58,372  | 日清紡ホールディングス        | 251.6   | 270.2   | 327,617    |
| オーライズミ          | 22.7    | 23.5      | 140,295 | イビデン               | 177.3   | 187.5   | 1,236,750  |
| ダイイコク電機         | 7.5     | 5.7       | 2,428   | コニカミノルタ            | 690.4   | 802.8   | 398,911    |
| 竹内製作所           | 16.9    | 17.7      | 73,720  | プラザー工業             | 413     | 480.2   | 1,351,042  |
| アマノ             | 56.1    | 65.2      | 373,596 | ミネベアミツミ            | 87.7    | 625.2   | 1,833,399  |
| JUKI            | 87.7    | 102       | 410,652 | 日立製作所              | 1,503.1 | 1,727.5 | 23,865,412 |
| サンデン            | 47.9    | 55.7      | 30,300  | 東芝                 | 29.8    | 594.9   | —          |
| ジャノメ            | 29.8    | 22.7      | 3,859   | 三菱電機               | 3,194.8 | 4,000.6 | 10,183,527 |
| マックス            | 31.3    | 36.4      | 25,916  | 富士電機               | 38.1    | 188     | 218.6      |
| グローリー           | 38.1    | 50.6      | 167,486 | 東洋電機製造             | 80.1    | 7.1     | 5,910      |
| 新晃工業            | 31.1    | 36.2      | 136,836 | 安川電機               | 47.4    | 366.3   | 2,529,011  |
| 大和冷機工業          | 31.1    | 36.2      | 136,836 | シンフォニアテクノロジー       | 47.4    | 34.1    | 123,156    |
| セガサミーホールディングス   | 248.5   | 321       | 599,949 | 明電舎                | 35.3    | 46.9    | 184,948    |
| 日本ピストンリング       | 7.8     | —         | —       | オリジン               | 7.8     | 4.9     | 4,148      |
| リケン             | 12.2    | —         | —       | 山洋電気               | 76.2    | 13.4    | 108,035    |
| TPR             | 212.1   | 1,179,276 | デシヨー    | 76.2               | 23.5    | 27.4    | 64,554     |
| ツバキ・ナカシマ        | 35.3    | 45.6      | 109,440 | PHCホールディングス        | 199     | 43      | 67.2       |
| ホシザキ            | 76.2    | 72        | 58,104  | KOKUSAI ELECTRIC   | 567.9   | 43      | 87,763     |
| 大豊工業            | 212.1   | 58,104    | ソシオネクスト | 76.2               | —       | 138.9   | 520,875    |
| 日本精工            | 26.7    | 31.1      | 29,358  | 東芝テック              | 567.9   | 31.8    | 260.9      |
| NTN             | 275     | 319.8     | 576,302 | 芝浦メカトロニクス          | 609.4   | 46.2    | 1,091,605  |
| ジェイテクト          | 22.8    | 26.5      | 91,955  | マブチモーター            | 779.5   | 5.9     | 46         |
| 不二越             | 275     | 319.8     | 452,836 | ニデック               | 22.8    | 20.5    | 139,150    |
| 日本トムソン          | 75.7    | 97.8      | 65,330  | ユニー・エム・シー・エレクトロニクス | 275     | 76.8    | 134,480    |
| THK             | 178.4   | 207.4     | 694,997 | トレックス・セミコンダクター     | 24.5    | 752.1   | 22.6       |
| ユーシン精機          | 24.5    | 28.5      | 19,693  | 東光高岳               | 21.7    | 14.5    | 8,746      |
| 前澤給装工業          | 21.7    | 25.8      | 33,978  | ダブル・スコーピ           | 34.2    | 18.6    | 33,910     |
| イーグル工業          | 34.2    | 39.7      | 72,849  | ダイヘン               | 34.2    | 101.1   | 21.7       |
|                 |         |           |         |                    |         | 27.9    | 53,034     |
|                 |         |           |         |                    |         | 36.1    | 57,624     |
|                 |         |           |         |                    |         | 342,950 |            |

| 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 |
|                       |         | 千株      | 千株        | 千円  |                |         | 千株      | 千株         | 千円  |
| ヤーマン                  | 53.4    | 69.9    | 68,082    |     | アンリツ           | 217.7   | 253.2   | 318,019    |     |
| JVCケンウッド              | 281.6   | 283.7   | 270,649   |     | 富士通ゼネラル        | 87.6    | 101.9   | 194,629    |     |
| ミマキエンジニアリング           | 29.3    | 34.1    | 37,203    |     | ソニーグループ        | 2,165   | 2,517.4 | 32,852,070 |     |
| I-PLEX                | 17.1    | 24.9    | 44,894    |     | TDK            | 489.5   | 569.1   | 4,226,136  |     |
| 日新電機                  | 72.5    | —       | —         |     | 帝国通信工業         | 13.9    | 15.7    | 29,782     |     |
| 大崎電気工業                | 73.3    | 78.7    | 53,516    |     | タムラ製作所         | 132.6   | 143.2   | 83,199     |     |
| オムロン                  | 283.3   | 274.5   | 1,512,495 |     | アルプスアルパイン      | 276.1   | 321     | 369,792    |     |
| 日東工業                  | 41.7    | 48.5    | 215,097   |     | 池上通信機          | 6.3     | 4.8     | 3,897      |     |
| IDEC                  | 45.6    | 53.1    | 148,892   |     | 日本電波工業         | 37.1    | 43.1    | 55,340     |     |
| 正興電機製作所               | 7.5     | 5.2     | 6,458     |     | 鈴木             | 16.5    | 19.2    | 22,944     |     |
| 不二電機工業                | 4       | 3       | 3,369     |     | マイコー           | 33.7    | 35.7    | 185,640    |     |
| ジー・エス・ユアサ コーポレーション    | 101.5   | 140.3   | 437,736   |     | 日本トリム          | 6.9     | 8.1     | 31,995     |     |
| サクサホールディングス           | 5       | 3.5     | 11,392    |     | ローランド ディー. ジー. | 17.4    | 19.7    | 106,577    |     |
| メルコホールディングス           | 8.2     | 11.3    | 40,171    |     | フォスター電機        | 28.6    | 26.6    | 32,132     |     |
| テクノメディカ               | 7.5     | 8.7     | 15,346    |     | SMK            | 7.4     | 9.6     | 26,044     |     |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディングス | 10.4    | 13.4    | 10,318    |     | ヨコオ            | 24.6    | 31.7    | 48,437     |     |
| 日本電気                  | 437.2   | 472.1   | 5,204,902 |     | ティアップ          | 32.8    | 25      | 2,550      |     |
| 富士通                   | 308     | 330.8   | 8,311,350 |     | ホシデン           | 72.1    | 81.7    | 158,416    |     |
| 沖電気工業                 | 139.8   | 162.5   | 189,475   |     | ヒロセ電機          | 51.1    | 53.1    | 823,581    |     |
| 岩崎通信機                 | 8.7     | 6.9     | 4,809     |     | 日本航空電子工業       | 63.4    | 86      | 219,042    |     |
| 電気興業                  | 12.5    | 16.1    | 34,937    |     | TOA            | 35.2    | 40.9    | 47,075     |     |
| サンケン電気                | 28.7    | 33.4    | 214,628   |     | マクセル           | 67.2    | 79.4    | 126,087    |     |
| ナカヨ                   | 3.5     | 2.4     | 2,880     |     | 古野電気           | 40.2    | 46.7    | 110,772    |     |
| アイホン                  | 18.8    | 19.4    | 59,849    |     | スマダコーポレーション    | 28.3    | 48.1    | 58,922     |     |
| ルネサスエレクトロニクス          | 2,016.9 | 2,345.7 | 6,087,091 |     | アイコム           | 11.9    | 13.8    | 48,852     |     |
| セイコーエプソン              | 411.7   | 461.2   | 1,203,962 |     | リオン            | 12.7    | 14.8    | 43,793     |     |
| ワコム                   | 244.8   | 273.4   | 178,530   |     | 横河電機           | 338.2   | 393.2   | 1,380,525  |     |
| アルパック                 | 73.4    | 78.8    | 772,397   |     | 新電元工業          | 11.8    | 13.8    | 43,401     |     |
| アクセル                  | 8.2     | 14.3    | 28,957    |     | アズビル           | 213.8   | 244.8   | 1,028,894  |     |
| EIZO                  | 22.6    | 26.3    | 138,864   |     | 東亜ディーケーケー      | 10.6    | 7       | 6,545      |     |
| ジャパンディスプレイ            | 1,186.8 | 1,549.3 | 35,633    |     | 日本光電工業         | 141.4   | 152.6   | 601,244    |     |
| 日本信号                  | 70.4    | 81.9    | 86,158    |     | チノー            | 12.7    | 14.8    | 39,767     |     |
| 京三製作所                 | 64.7    | 75.3    | 40,059    |     | 共和電業           | 18.7    | 14      | 5,936      |     |
| 能美防災                  | 41.8    | 48.6    | 109,787   |     | 日本電子材料         | 20.2    | 21.9    | 56,502     |     |
| ホーチキ                  | 23.1    | 26.8    | 59,549    |     | 堀場製作所          | 68.2    | 67.9    | 1,062,974  |     |
| 星和電機                  | 7.9     | 6.3     | 3,433     |     | アドバンテスト        | 241.2   | 1,019.6 | 6,862,927  |     |
| エレコム                  | 73.9    | 85.9    | 134,004   |     | 小野測器           | 7.3     | 5.9     | 3,894      |     |
| パナソニック ホールディングス       | 3,651.4 | 4,246.1 | 6,171,706 |     | エスベック          | 24.5    | 28.5    | 87,067     |     |
| シャープ                  | 372.2   | 605.9   | 498,898   |     | キーエンス          | 306.2   | 356     | 25,051,720 |     |

| 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 |
|                  | 千株      | 千株      | 千円        |     |                      | 千株       | 千株       | 千円         |     |
| 日置電機             | 16.1    | 16.8    | 117,600   |     | ニチコン                 | 62.5     | 93.4     | 121,980    |     |
| シスメックス           | 264     | 307.1   | 2,496,723 |     | 日本ケミコン               | 30.2     | 37.9     | 55,182     |     |
| 日本マイクロニクス        | 50.4    | 63.9    | 524,619   |     | K O A                | 46.3     | 53.9     | 79,987     |     |
| メガチップス           | 25.1    | 28.1    | 110,854   |     | 市光工業                 | 44.1     | 64.1     | 34,934     |     |
| OBARA GROUP      | 14.3    | 19.4    | 72,750    |     | 小糸製作所                | 368.1    | 368.7    | 731,869    |     |
| 澤藤電機             | 2.6     | 1.8     | 2,361     |     | ミツバ                  | 57.4     | 66.7     | 106,586    |     |
| 原田工業             | 10.1    | 6.7     | 5,011     |     | S C R E E N ホールディングス | 52.3     | 121.7    | 2,272,139  |     |
| ヨーセル             | 36.8    | 38      | 57,456    |     | キヤノン電子               | 33.8     | 39.3     | 94,044     |     |
| イリゾ電子工業          | 28.1    | 32.7    | 99,735    |     | キヤノン                 | 1,679.2  | 1,775    | 7,923,600  |     |
| オブテックグループ        | 56.1    | 65.3    | 127,988   |     | リコー                  | 767.4    | 892.3    | 1,191,666  |     |
| 千代田インテグレ         | 10.6    | 13.9    | 37,238    |     | 象印マホービン              | 91.4     | 96.6     | 138,331    |     |
| レーザーテック          | 140.3   | 163.1   | 6,879,558 |     | MUTOH ホールディングス       | 2.7      | 1.9      | 4,489      |     |
| スタンレー電気          | 217.8   | 227.8   | 612,212   |     | 東京エレクトロン             | 215.9    | 753.2    | 29,163,904 |     |
| 岩崎電気             | 9.6     | —       | —         |     | イノテック                | 20.4     | 23.7     | 47,139     |     |
| ウシオ電機            | 159.9   | 180.8   | 364,402   |     | 輸送用機器(9.5%)          |          |          |            |     |
| 岡谷電機産業           | 15.3    | 11.5    | 3,220     |     | トヨタ紡織                | 128.9    | 149.9    | 388,840    |     |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 18.3    | 14.7    | 8,232     |     | 芦森工業                 | 4.1      | 3        | 8,235      |     |
| エノモト             | 5.9     | 4.2     | 6,862     |     | ユニプレス                | 54.9     | 63.9     | 74,507     |     |
| 日本セラミック          | 31.2    | 29      | 78,764    |     | 豊田自動織機               | 223.8    | 303.5    | 4,833,237  |     |
| 遠藤照明             | 9.9     | 6.8     | 10,404    |     | モリタホールディングス          | 53.7     | 62.4     | 102,211    |     |
| 古河電池             | 22.5    | 26.2    | 26,462    |     | 三櫻工業                 | 46.7     | 54.3     | 61,250     |     |
| 双信電機             | 10.3    | 6       | 1,866     |     | デンソー                 | 631.3    | 2,936.2  | 8,544,342  |     |
| 山一電機             | 26.7    | 32      | 74,880    |     | 東海理化電機製作所            | 86.3     | 100.3    | 263,187    |     |
| 図研               | 26.6    | 31      | 143,065   |     | 川崎重工業                | 230.6    | 290.5    | 1,449,885  |     |
| 日本電子             | 76.7    | 89.2    | 558,927   |     | 名村造船所                | 55.4     | 88.6     | 181,364    |     |
| カシオ計算機           | 228     | 257.1   | 330,373   |     | 日本車輌製造               | 11.8     | 11.7     | 28,080     |     |
| ファナック            | 300.4   | 1,735.4 | 7,455,278 |     | 三菱ロジスネクスト            | 48.8     | 56.8     | 102,410    |     |
| 日本シイエムケイ         | 65      | 83.5    | 51,102    |     | 近畿車輛                 | 3.2      | 2        | 5,002      |     |
| エンプラス            | 8.9     | 10.4    | 78,416    |     | 日産自動車                | 4,347.7  | 4,802.7  | 3,020,418  |     |
| 大真空              | 37.3    | 53      | 42,771    |     | いすゞ自動車               | 889.8    | 1,034.6  | 2,169,556  |     |
| ローム              | 141.5   | 658     | 1,651,580 |     | トヨタ自動車               | 16,805.9 | 19,541.3 | 74,843,179 |     |
| 浜松ホトニクス          | 245.6   | 285.6   | 1,535,385 |     | 日野自動車                | 394.6    | 535.3    | 278,623    |     |
| 三井ハイテック          | 31.6    | 31.5    | 275,751   |     | 三菱自動車工業              | 1,194    | 1,388.3  | 689,013    |     |
| 新光電気工業           | 108.3   | 125.9   | 713,097   |     | エフテック                | 13.7     | 10.5     | 8,053      |     |
| 京セラ              | 475.4   | 2,211.2 | 4,594,873 |     | レシップホールディングス         | 8.5      | 6.5      | 4,186      |     |
| 太陽誘電             | 149     | 173.3   | 616,948   |     | G M B                | 3.9      | 2.9      | 3,352      |     |
| 村田製作所            | 928.2   | 3,237.8 | 9,230,967 |     | ファルテック               | 3.7      | 2.7      | 1,533      |     |
| 双葉電子工業           | 58.3    | 67.8    | 34,442    |     | 武蔵精密工業               | 74.8     | 87       | 146,160    |     |
| 北陸電気工業           | 8       | 5.6     | 8,069     |     | 日産車体                 | 54       | 36.1     | 37,977     |     |

| 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 |
|             | 千株      | 千株      | 千円         |     |                   | 千株      | 千株      | 千円         |     |
| 新明和工業       | 96.1    | 102.5   | 128,740    |     | J M S             | 28.3    | 32.9    | 17,700     |     |
| 極東開発工業      | 53.8    | 58.8    | 155,408    |     | クボテック             | 4.6     | 3.6     | 849        |     |
| トピー工業       | 24.8    | 28.8    | 86,112     |     | 長野計器              | 22.2    | 25.9    | 59,052     |     |
| ティラド        | 7.7     | 7.9     | 32,074     |     | ブイ・テクノロジー         | 15      | 18.7    | 46,656     |     |
| 曙ブレーキ工業     | 186.8   | 217.2   | 31,276     |     | 東京計器              | 23.5    | 27.3    | 70,434     |     |
| タチエス        | 48.4    | 65.7    | 133,830    |     | 愛知時計電機            | 11.9    | 15.4    | 36,975     |     |
| NOK         | 118.9   | 138.3   | 296,031    |     | インターパークション        | 14.5    | 21.4    | 26,814     |     |
| フタバ産業       | 82      | 95.4    | 112,953    |     | オーバル              | 19.2    | 13.2    | 7,088      |     |
| カヤバ         | 29.5    | 34.3    | 175,273    |     | 東京精密              | 67.1    | 72.8    | 874,692    |     |
| 大同メタル工業     | 59.8    | 69.6    | 47,188     |     | マニー               | 134.6   | 142.4   | 282,165    |     |
| プレス工業       | 136.7   | 142.2   | 100,393    |     | ニコン               | 475.8   | 514.5   | 809,565    |     |
| ミクニ         | 24.9    | 19      | 9,272      |     | トプロン              | 161.1   | 173     | 305,085    |     |
| 太平洋工業       | 70.2    | 81.6    | 142,065    |     | オリンパス             | 1,913.3 | 2,190.6 | 4,732,791  |     |
| 河西工業        | 26.3    | 21.1    | 5,148      |     | 理研計器              | 19      | 25.2    | 187,992    |     |
| アイシン        | 236.1   | 274.5   | 1,680,763  |     | タムロン              | 22.9    | 21.8    | 148,022    |     |
| マツダ         | 1,012.4 | 1,177.2 | 2,089,530  |     | H O Y A           | 653.7   | 700.6   | 13,363,945 |     |
| 今仙電機製作所     | 14.1    | 9.5     | 6,146      |     | シード               | 10      | 7.5     | 4,957      |     |
| 本田技研工業      | 2,487.9 | 8,678.6 | 16,307,089 |     | ノーリツ鋼機            | 29      | 33.7    | 106,660    |     |
| スズキ         | 562.1   | 653.6   | 4,428,793  |     | A & D ホロンホールディングス | 44.6    | 51.9    | 142,776    |     |
| S U B A R U | 968.4   | 1,103.7 | 3,785,691  |     | 朝日インテック           | 342     | 433.8   | 1,189,696  |     |
| 安永          | 8.6     | 6.6     | 5,042      |     | シチズン時計            | 336.5   | 327.4   | 330,019    |     |
| ヤマハ発動機      | 481     | 1,538.1 | 2,116,425  |     | リズム               | 6.7     | 3.4     | 14,705     |     |
| T B K       | 21.6    | 16.3    | 6,389      |     | 大研医器              | 17      | 13      | 7,527      |     |
| エクセディ       | 50.1    | 58.2    | 179,256    |     | メニコン              | 105.1   | 122.4   | 194,004    |     |
| 豊田合成        | 89.3    | 101.9   | 343,199    |     | シンシア              | 1.8     | 1.4     | 711        |     |
| 愛三工業        | 50.5    | 58.9    | 100,895    |     | 松風                | 13.8    | 16.1    | 48,251     |     |
| 盟和産業        | 3.1     | 2.1     | 2,144      |     | セイコーグループ          | 47.4    | 49.6    | 194,184    |     |
| 日本プラスト      | 15.5    | 12.3    | 6,912      |     | ニプロ               | 255.1   | 296.6   | 355,326    |     |
| ヨロズ         | 28.7    | 33.3    | 33,799     |     | その他製品 (2.3%)      |         |         |            |     |
| エフ・シー・シー    | 54.2    | 63.1    | 141,154    |     | K Y O R I T S U   | 29.4    | 22.5    | 4,207      |     |
| シマノ         | 125.2   | 143.8   | 3,213,211  |     | 中本パックス            | 6       | 4.8     | 7,872      |     |
| ティ・エス・テック   | 140.1   | 126.7   | 256,124    |     | スノーピーク            | 52.4    | 50.8    | 63,347     |     |
| ジャムコ        | 12.5    | 17.2    | 21,482     |     | パラマウントベッドホールディングス | 70.7    | 74      | 195,064    |     |
| 精密機器 (2.2%) |         |         |            |     | トランザクション          | 23.5    | 23.5    | 53,791     |     |
| テルモ         | 941.3   | 995     | 5,504,340  |     | 粧美堂               | 5.3     | 4.1     | 2,402      |     |
| クリエートメディック  | 6.5     | 4.9     | 4,718      |     | ニホンフラッシュ          | 28.7    | 33.4    | 32,598     |     |
| 日機装         | 71.3    | 82.9    | 101,801    |     | 前田工織              | 25.8    | 30.1    | 111,219    |     |
| 日本エム・ディ・エム  | 18.2    | 28.2    | 20,952     |     | 永大産業              | 23.4    | 17.9    | 5,477      |     |
| 島津製作所       | 372.8   | 472.8   | 2,050,060  |     | アートネイチャー          | 31.5    | 32      | 24,992     |     |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当期末     |            |     |
|-----------------------------|---------|---------|------------|-----|
|                             |         | 株数      | 株数         | 評価額 |
|                             | 千株      | 千株      | 千円         |     |
| フルヤ金属                       | —       | 8.4     | 91,812     |     |
| バンダイナムコホールディングス             | 279.5   | 975     | 2,781,675  |     |
| アイフィスジャパン                   | 5.5     | 4.2     | 2,671      |     |
| S H O E I                   | 32.3    | 80.4    | 187,251    |     |
| フランスペッドホールディングス             | 37.9    | 46      | 60,030     |     |
| パイロットコーポレーション               | 47.9    | 50.1    | 194,337    |     |
| 萩原工業                        | 20.5    | 23.8    | 37,723     |     |
| フジシールインターナショナル              | 62      | 72.1    | 139,801    |     |
| タカラトミー                      | 141.3   | 162     | 465,750    |     |
| 広済堂ホールディングス                 | 13.3    | 91.6    | 58,624     |     |
| エステールホールディングス               | 4.6     | 3.6     | 2,509      |     |
| タカノ                         | 7.3     | 5.6     | 6,160      |     |
| プロネクサス                      | 25.4    | 36.9    | 46,088     |     |
| ホクシン                        | 15.1    | 11.6    | 1,461      |     |
| ウッドワン                       | 6.5     | 5.1     | 5,390      |     |
| 大建工業                        | 18.6    | —       | —          |     |
| T O P P A N ホールディングス        | 400.3   | 437.5   | 1,619,187  |     |
| 大日本印刷                       | 363.1   | 388.9   | 1,789,717  |     |
| 共同印刷                        | 8.6     | 10      | 34,500     |     |
| N I S S H A                 | 58.2    | 60.9    | 88,244     |     |
| 光村印刷                        | 1.7     | 1.1     | 1,826      |     |
| T A K A R A & C O M P A N Y | 19.6    | 21      | 57,414     |     |
| アシックス                       | 282.5   | 303.2   | 2,144,230  |     |
| ツツミ                         | 5.4     | 8.3     | 17,670     |     |
| ローランド                       | 22.5    | 26.2    | 121,044    |     |
| 小松ウオール工業                    | 11.2    | 14.5    | 47,705     |     |
| ヤマハ                         | 192.9   | 224.3   | 722,021    |     |
| 河合楽器製作所                     | 8.3     | 10.8    | 39,582     |     |
| クリナップ                       | 34.3    | 34.9    | 27,291     |     |
| ビジョン                        | 194.9   | 226.7   | 336,309    |     |
| 兼松サステック                     | 1.4     | —       | —          |     |
| キングジム                       | 27      | 31.4    | 28,008     |     |
| リンテック                       | 61.4    | 71.4    | 227,766    |     |
| イトーキ                        | 62.7    | 72.9    | 124,659    |     |
| 任天堂                         | 1,932.3 | 2,246.8 | 18,646,193 |     |
| 三菱鉛筆                        | 43.5    | 50.5    | 127,260    |     |
| タカラスタンダード                   | 59.2    | 74.9    | 142,684    |     |
| コクヨ                         | 147.4   | 145.6   | 369,532    |     |
| ナカバヤシ                       | 33      | 38.3    | 21,141     |     |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当期末     |           |     |
|----------------|---------|---------|-----------|-----|
|                |         | 株数      | 株数        | 評価額 |
|                | 千株      | 千株      | 千円        |     |
| グローブライド        | 24.7    | 31.9    | 65,490    |     |
| オカムラ           | 92.1    | 107.1   | 241,510   |     |
| 美津濃            | 30.4    | 35.4    | 224,436   |     |
| 電気・ガス業 (1.4%)  |         |         |           |     |
| 東京電力ホールディングス   | 2,759   | 3,208   | 2,783,581 |     |
| 中部電力           | 1,127.8 | 1,311.4 | 2,625,422 |     |
| 関西電力           | 1,181.9 | 1,374.2 | 2,933,917 |     |
| 中国電力           | 487.4   | 618.3   | 715,682   |     |
| 北陸電力           | 288.9   | 363.9   | 289,773   |     |
| 東北電力           | 748.2   | 937     | 1,129,085 |     |
| 四国電力           | 261.3   | 331.4   | 399,999   |     |
| 九州電力           | 705.5   | 820.4   | 1,133,792 |     |
| 北海道電力          | 295.7   | 343.8   | 286,385   |     |
| 沖縄電力           | 71.7    | 90.9    | 104,171   |     |
| 電源開発           | 230.5   | 292.3   | 745,657   |     |
| エフオン           | 19.8    | 25.9    | 11,214    |     |
| イーレックス         | 54.3    | 63.3    | 44,943    |     |
| レノバ            | 81.5    | 94.9    | 119,858   |     |
| 東京瓦斯           | 647.1   | 752.4   | 2,649,200 |     |
| 大阪瓦斯           | 620     | 720.9   | 2,482,779 |     |
| 東邦瓦斯           | 120.5   | 154.1   | 508,221   |     |
| 北海道瓦斯          | 18.3    | 21.2    | 53,318    |     |
| 広島ガス           | 64.6    | 75.2    | 28,952    |     |
| 西部ガスホールディングス   | 28.7    | 37.1    | 71,232    |     |
| 静岡ガス           | 69.8    | 71      | 67,805    |     |
| メタウォーター        | 38.3    | 42.6    | 96,403    |     |
| 陸運業 (2.6%)     |         |         |           |     |
| S B S ホールディングス | 27.3    | 31.7    | 79,884    |     |
| 東武鉄道           | 336.2   | 390.9   | 1,553,827 |     |
| 相鉄ホールディングス     | 101.1   | 127.4   | 363,854   |     |
| 東急             | 858.2   | 997.9   | 2,075,133 |     |
| 京浜急行電鉄         | 347.2   | 440.4   | 625,368   |     |
| 小田急電鉄          | 463.9   | 588.5   | 1,307,647 |     |
| 京王電鉄           | 161.8   | 171.1   | 737,441   |     |
| 京成電鉄           | 197.3   | 229.5   | 1,459,390 |     |
| 富士急行           | 37.7    | 43.8    | 176,514   |     |
| 東日本旅客鉄道        | 519.1   | 653.8   | 5,948,926 |     |
| 西日本旅客鉄道        | 391     | 422.1   | 2,768,553 |     |
| 東海旅客鉄道         | 235.8   | 1,370.8 | 5,455,784 |     |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期末     |           |     |
|----------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                      |         | 株数      | 株数        | 評価額 |
|                      | 千株      | 千株      | 千円        |     |
| 西武ホールディングス           | 370.2   | 430.5   | 1,031,478 |     |
| 鴻池運輸                 | 52.1    | 60.6    | 128,108   |     |
| 西日本鉄道                | 81.7    | 95.1    | 242,077   |     |
| ハマキヨウレックス            | 23.9    | 30.4    | 115,976   |     |
| サカイ引越センター            | 14.5    | 39.4    | 102,124   |     |
| 近鉄グループホールディングス       | 305.5   | 355.2   | 1,651,324 |     |
| 阪急阪神ホールディングス         | 407.5   | 473.8   | 2,139,680 |     |
| 南海電気鉄道               | 146     | 158.5   | 506,090   |     |
| 京阪ホールディングス           | 126.3   | 195.8   | 675,901   |     |
| 神戸電鉄                 | 8.3     | 9.7     | 28,188    |     |
| 名古屋鉄道                | 337.7   | 366.5   | 809,781   |     |
| 山陽電気鉄道               | 23      | 26.7    | 57,458    |     |
| アルプス物流               | 24.4    | 28.3    | 78,221    |     |
| ヤマトホールディングス          | 391.3   | 454.9   | 1,015,564 |     |
| 山九                   | 77.8    | 90.4    | 490,329   |     |
| 丸運                   | 9.7     | 7.7     | 2,240     |     |
| 丸全昭和運輸               | 18.9    | 22      | 103,290   |     |
| センコーグループホールディングス     | 161.8   | 188.1   | 215,938   |     |
| トナミホールディングス          | 6.7     | 7.8     | 35,685    |     |
| ニッコンホールディングス         | 97.8    | 113.7   | 347,126   |     |
| 日本石油輸送               | 2.2     | 1.5     | 4,402     |     |
| 福山通運                 | 23.2    | 40.5    | 153,090   |     |
| セイノーホールディングス         | 190.2   | 199.8   | 434,964   |     |
| エスライングループ本社          | 5.5     | 4.3     | 3,986     |     |
| 神奈川中央交通              | 8.7     | 10.1    | 32,572    |     |
| AZ-COM丸和ホールディングス     | 73.8    | 90.8    | 126,302   |     |
| C&Fロジホールディングス        | 29.4    | 34.2    | 104,139   |     |
| 九州旅客鉄道               | 216     | 251.2   | 904,571   |     |
| S G ホールディングス         | 586.4   | 596.6   | 1,190,217 |     |
| NIPPON EXPRESSホールディン | 114.1   | 124.4   | 960,492   |     |
| 海運業 (0.7%)           |         |         |           |     |
| 日本郵船                 | 817.5   | 1,018.4 | 4,259,967 |     |
| 商船三井                 | 538.6   | 771.1   | 3,635,736 |     |
| 川崎汽船                 | 260.3   | 285.4   | 1,792,312 |     |
| N S ユナイテッド海運         | 16.5    | 19.1    | 97,219    |     |
| 明海グループ               | 19.2    | 16.3    | 12,730    |     |
| 飯野海運                 | 112.2   | 130.4   | 167,172   |     |
| 共栄タンカー               | 3.6     | 2.8     | 3,082     |     |
| 乾汽船                  | 38.8    | 41.6    | 44,720    |     |

| 銘柄               | 期首(前期末) | 当期末   |       |           |
|------------------|---------|-------|-------|-----------|
|                  |         | 株数    | 株数    | 評価額       |
|                  | 千株      | 千株    | 千円    |           |
| 空運業 (0.4%)       |         |       |       |           |
| 日本航空             |         | 750.5 | 872.7 | 2,536,502 |
| ANAホールディングス      |         | 831.4 | 966.8 | 3,112,129 |
| バスコ              |         | 3.9   | 2.8   | 5,308     |
| 倉庫・運輸関連業 (0.1%)  |         |       |       |           |
| トランコム            |         | 8.9   | 10.3  | 62,315    |
| 日新               |         | 23.2  | 27    | 76,815    |
| 三菱倉庫             |         | 65.7  | 87.3  | 436,849   |
| 三井倉庫ホールディングス     |         | 28.5  | 33.2  | 155,376   |
| 住友倉庫             |         | 83.9  | 95.8  | 248,984   |
| 滋澤倉庫             |         | 12.2  | 16.2  | 49,410    |
| 東陽倉庫             |         | 28.8  | 4     | 6,332     |
| 日本トランスシティ        |         | 61.5  | 71.5  | 48,691    |
| ケイヒン             |         | 3.5   | 2.7   | 5,489     |
| 中央倉庫             |         | 14.7  | 19    | 22,762    |
| 川西倉庫             |         | 3.7   | 2.7   | 3,420     |
| 安田倉庫             |         | 20.8  | 24.2  | 29,983    |
| ファイズホールディングス     |         | 4.3   | 2.1   | 2,465     |
| 東洋埠頭             |         | 5.7   | 4.4   | 6,248     |
| 上組               |         | 146.5 | 164.1 | 559,416   |
| サンリツ             |         | 5.2   | 3.6   | 3,117     |
| キムラユニティー         |         | 10.6  | 7.1   | 12,148    |
| キユースー流通システム      |         | 11.8  | 16.2  | 17,285    |
| 東海運              |         | 11.5  | 8.8   | 2,736     |
| エーアイティー          |         | 19.2  | 22.3  | 39,827    |
| 内外トランスライン        |         | 11    | 14.2  | 34,477    |
| 日本コンセプト          |         | 9.5   | 12.9  | 23,503    |
| 情報・通信業 (7.3%)    |         |       |       |           |
| N E C ネッツエスアイ    |         | 102.5 | 139.1 | 364,859   |
| クロスキャット          |         | 17.5  | 22.6  | 39,572    |
| システナ             |         | 516.1 | 540   | 147,960   |
| デジタルアーツ          |         | 19.4  | 22.6  | 96,954    |
| 日鉄ソリューションズ       |         | 52.4  | 60.9  | 308,763   |
| キューブシステム         |         | 18.3  | 18.9  | 20,997    |
| コア               |         | 13.6  | 15.8  | 30,494    |
| 手間いらす            |         | 5.2   | 6     | 20,070    |
| ラクーンホールディングス     |         | 25.4  | 26.6  | 15,108    |
| ソリトンシステムズ        |         | 15.8  | 18.4  | 23,257    |
| ソフトクリエイトホールディングス |         | 12.6  | 29.3  | 56,314    |

| 銘柄                        | 期首(前期末) | 当期末   |           | 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期末   |         |
|---------------------------|---------|-------|-----------|----------------------|---------|-------|---------|
|                           |         | 株数    | 評価額       |                      |         | 株数    | 評価額     |
|                           | 千株      | 千株    | 千円        |                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| T I S                     | 345     | 390.4 | 1,296,908 | テクマトリックス             | 56      | 65.2  | 122,706 |
| テクミラホールディングス              | 9.7     | 6.9   | 3,208     | プロシップ                | 13.4    | 17.1  | 26,145  |
| グリー                       | 82.3    | 119.6 | 58,125    | ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 93.9    | 92.9  | 219,104 |
| GMOペパボ                    | 4.4     | 4.4   | 6,072     | GMOペイメントゲートウェイ       | 70.1    | 71.3  | 702,376 |
| コーエーテクモホールディングス           | 192.3   | 223.6 | 377,884   | ザッパラス                | 7.3     | 3.6   | 1,760   |
| 三菱総合研究所                   | 15      | 17.5  | 88,025    | システムリサーチ             | 9.6     | 12.2  | 41,236  |
| ボルテージ                     | 5.7     | 4.4   | 1,139     | インターネットイニシアティブ       | 171.3   | 170.6 | 483,053 |
| 電算                        | 2.3     | 1.8   | 2,718     | さくらインターネット           | 34.4    | 40.1  | 263,457 |
| A G S                     | 8.3     | 6.2   | 5,511     | ヴィンクス                | 5.9     | —     | —       |
| ファインデックス                  | 24.4    | 28.3  | 31,413    | GMOグローバルサイン・ホールディングス | 9.4     | 10.9  | 33,844  |
| ブレインパッド                   | 23      | 29.7  | 43,094    | S R A ホールディングス       | 15.7    | 18.3  | 73,474  |
| K L a b                   | 61.1    | 65.6  | 24,796    | システムインテグレータ          | 6.7     | 4.4   | 1,799   |
| ポールトゥワインホールディングス          | 52.4    | 60.9  | 30,389    | 朝日ネット                | 33      | 38.3  | 24,626  |
| ネクソン                      | 793.8   | 799.1 | 2,043,698 | e B A S E            | 43.2    | 50.2  | 37,148  |
| アイスタイル                    | 89.2    | 116.5 | 60,114    | アバントグループ             | 38.8    | 45.1  | 58,584  |
| エムアップホールディングス             | 37.6    | 43.7  | 54,275    | アドソル日進               | 12.9    | 15    | 25,185  |
| エイチーム                     | 22.6    | 21.1  | 13,293    | O D K ソリューションズ       | 4.4     | 2.8   | 1,898   |
| エニグモ                      | 39      | 45.4  | 18,477    | フリー・ピット              | 16.1    | 15.6  | 22,245  |
| テクノスジャパン                  | 16.3    | 13.1  | 8,200     | コムチュア                | 40.6    | 51.5  | 102,588 |
| e n i s h                 | 14.9    | 11.9  | 3,224     | サイバーコム               | 3.2     | —     | —       |
| コロプラ                      | 119     | 138.5 | 83,931    | アステリア                | 24      | 27.9  | 19,195  |
| オルトプラス                    | 15.1    | 12.1  | 1,633     | アイル                  | 17.2    | 16.7  | 50,434  |
| ブロードリーフ                   | 179.3   | 169.4 | 95,033    | マークライズ               | 16.6    | 19.3  | 61,567  |
| クロス・マーケティンググループ           | 8       | 6.4   | 3,513     | メディカル・データ・ビジョン       | 45.8    | 42.6  | 24,878  |
| デジタルハーツホールディングス           | 19.1    | 22.3  | 21,296    | g u m i              | 44.9    | 57.9  | 24,318  |
| システム情報                    | 27.1    | —     | —         | ショーケース               | 4.6     | 3.5   | 1,291   |
| メディアドウ                    | 12.4    | 16.1  | 23,667    | モバイルファクトリー           | 4.1     | 3.2   | 2,374   |
| じげん                       | 89.5    | 104.1 | 64,021    | テラスカイ                | 13.2    | 15.4  | 22,607  |
| ブイキューブ                    | 36.8    | 42.8  | 11,384    | デジタル・インフォメーション・テクノロジ | 17.7    | 18.6  | 33,628  |
| エンカレッジ・テクノロジ              | 4.6     | 3.6   | 2,322     | P C I ホールディングス       | 8.3     | 5.8   | 5,573   |
| サイバーリンクス                  | 6.3     | 5.1   | 4,513     | アイビーシー               | 3.1     | 2.3   | 1,016   |
| ディー・エル・イー                 | 14.1    | 10.7  | 1,936     | ネオジャパン               | 10.2    | 11.9  | 15,017  |
| フィックスターズ                  | 34.6    | 40.3  | 89,103    | P R T I M E S        | 7.7     | 7.2   | 14,788  |
| C A R T A H O L D I N G S | 14.4    | 16.7  | 26,536    | ラクス                  | 145.2   | 168.8 | 348,318 |
| オプティム                     | 25.2    | 36.7  | 37,397    | ランドコンピュータ            | 4.8     | 7.3   | 6,467   |
| セレス                       | 12.3    | 14.4  | 25,516    | ダブルスタンダード            | 12.4    | 10.8  | 20,692  |
| S H I F T                 | 22.4    | 23.7  | 569,155   | オープンドア               | 21.5    | 20.8  | 17,472  |
| ティーガイア                    | 32.1    | 37.3  | 77,621    | マイネット                | 6.4     | 4.9   | 1,710   |
| セック                       | 3.1     | 4.4   | 21,604    | アカツキ                 | 14.6    | 17    | 43,724  |

| 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 |
| ペネフィットジャパン            | 千株<br>1.6 | 千株<br>0.9 | 千円<br>1,142 |     | I P S                 | 千株<br>10 | 千株<br>10.3 | 千円<br>25,338 |     |
| U b i c o mホールディングス   | 9.5       | 11.1      | 14,030      |     | F I G                 | 22.9     | 17.5       | 6,177        |     |
| カナミックネットワーク           | 44.1      | 38.4      | 18,201      |     | システムサポート              | 11.9     | 13.8       | 29,904       |     |
| ノムラシステムコーポレーション       | 18.5      | 14.7      | 1,734       |     | イーソル                  | 19.7     | 25.7       | 21,228       |     |
| チェンジホールディングス          | 75.2      | 77.7      | 98,368      |     | アルテリア・ネットワークス         | 28.6     | —          | —            |     |
| シンクロ・フード              | 10.7      | 8.5       | 5,278       |     | 東海ソフト                 | 3.3      | 2.2        | 2,761        |     |
| オークネット                | 15.1      | 13.2      | 31,363      |     | ウイングアーク 1 s t         | 31.6     | 37.1       | 113,155      |     |
| キャピタル・アセット・ブランディング    | 3.8       | 2.8       | 2,184       |     | ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン  | 8.2      | 9.5        | 10,792       |     |
| セグエグループ               | 5.5       | 12.9      | 7,675       |     | サーバーワークス              | 6.2      | 7.3        | 26,499       |     |
| エイトレッド                | 3         | 2.2       | 3,205       |     | 東名                    | 1.5      | 1.2        | 2,872        |     |
| マクロミル                 | 60.2      | 70        | 53,830      |     | ヴィッツ                  | 1.9      | 1.4        | 1,090        |     |
| ピーグリー                 | 3.3       | 2.7       | 3,075       |     | トビラシステムズ              | 4.9      | 3.9        | 3,143        |     |
| オロ                    | 9.2       | 12.9      | 35,088      |     | S a n s a n           | 100.4    | 117.1      | 205,627      |     |
| ユーザーローカル              | 11        | 15.1      | 35,379      |     | L i n k - U グループ      | 3.8      | 3          | 1,968        |     |
| デモナ                   | 3.8       | 3         | 708         |     | ギフティ                  | 33.4     | 31.3       | 41,879       |     |
| ニーズウェル                | 6.1       | 8.3       | 8,150       |     | メドレー                  | 30.9     | 47.9       | 225,609      |     |
| マネーフォワード              | 73.9      | 79.6      | 517,798     |     | ベース                   | 10.4     | 12.5       | 43,562       |     |
| サインポスト                | 6.8       | 5.4       | 3,493       |     | J M D C               | 50.4     | 60.9       | 218,143      |     |
| Sun A s t e r i s k   | 16.3      | 25.3      | 23,655      |     | フォーカスシステムズ            | 22.4     | 23.9       | 31,309       |     |
| プラスアルファ・コンサルティング      | —         | 21.1      | 49,521      |     | クレスコ                  | 23.7     | 29.3       | 63,200       |     |
| 電算システムホールディングス        | 14.8      | 15.8      | 42,265      |     | フジ・メディア・ホールディングス      | 294.9    | 342.8      | 637,436      |     |
| A p p i e r G r o u p | 87.2      | 122.1     | 195,970     |     | オービック                 | 102.6    | 119.3      | 2,718,847    |     |
| ビジョナル                 | —         | 27.4      | 261,122     |     | ジャストシステム              | 44.1     | 51.3       | 137,022      |     |
| ソルクシーズ                | 16.1      | 12.3      | 4,206       |     | T D C ソフト             | 25.9     | 33.4       | 76,319       |     |
| フェイス                  | 5.5       | 4.3       | 1,999       |     | L I N E ヤフー           | 4,368.4  | 5,081.4    | 1,988,351    |     |
| プロトコーポレーション           | 38.4      | 39.1      | 55,443      |     | トレンドマイクロ              | 177.3    | 168.7      | 1,284,144    |     |
| ハイマックス                | 9.6       | 11.2      | 16,744      |     | I D ホールディングス          | 20.7     | 24         | 36,336       |     |
| 野村総合研究所               | 629.7     | 790.7     | 3,317,777   |     | 日本オラクル                | 58.7     | 68.3       | 778,961      |     |
| サイバネットシステム            | 25.7      | —         | —           |     | アルファンシステムズ            | 9.7      | 9.4        | 30,785       |     |
| C E ホールディングス          | 10.2      | 7.7       | 4,227       |     | フューチャー                | 76.4     | 76.1       | 128,304      |     |
| 日本システム技術              | 7.5       | 13.2      | 50,622      |     | C A C H o l d i n g s | 18.8     | 19.1       | 35,736       |     |
| インテージホールディングス         | 34.7      | 40.4      | 65,044      |     | S B テクノロジー            | 13       | 15.1       | 31,679       |     |
| 東邦システムサイエンス           | 5.5       | 13.3      | 16,837      |     | トーセ                   | 5.2      | 4.2        | 2,977        |     |
| ソースネクスト               | 156.1     | 163.3     | 40,171      |     | オービックビジネスコンサルタント      | 60.4     | 50.2       | 356,369      |     |
| インフォコム                | 39.6      | 46        | 126,500     |     | 伊藤忠テクノソリューションズ        | 164.8    | —          | —            |     |
| シンプルクス・ホールディングス       | 51.6      | 54        | 153,090     |     | アイテイフォー               | 40.4     | 45.7       | 61,740       |     |
| H E R O Z             | 10.3      | 14        | 23,996      |     | 東計電算                  | 4.3      | 10         | 35,600       |     |
| ラクスル                  | 86.8      | 86        | 98,040      |     | エックスマネット              | 3.3      | 2          | 2,432        |     |
| メルカリ                  | 138.5     | 173.7     | 340,799     |     | 大塚商会                  | 174      | 177        | 1,168,377    |     |

| 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 |
|                                   |         | 千株        | 千株         | 千円  |                      |         | 千株      | 千株         | 千円  |
| サイボウズ                             | 42.3    | 49.1      | 86,072     |     | 光通信                  | 36.1    | 36      | 999,720    |     |
| 電通総研                              | 37.3    | 43.4      | 213,962    |     | エムティーアイ              | 28      | 24.5    | 18,399     |     |
| ACCESS                            | 36.3    | 37.1      | 62,513     |     | GMOインターネットグループ       | 114     | 131.9   | 365,297    |     |
| デジタルガレージ                          | 54.5    | 57        | 187,245    |     | ファイバーゲート             | 16.5    | 19.2    | 21,504     |     |
| EMシステムズ                           | 51.2    | 59.5      | 42,840     |     | アイドマーマケティングコミュニケーション | 4.5     | 3.5     | 826        |     |
| ウェザーニューズ                          | 9.5     | 11        | 55,880     |     | KADOKAWA             | 162.3   | 188.7   | 508,546    |     |
| C I J                             | 25.5    | 59.3      | 65,407     |     | 学研ホールディングス           | 51.1    | 59.4    | 55,836     |     |
| ビジネスエンジニアリング                      | 4.8     | 6.7       | 25,795     |     | ゼンリン                 | 52.5    | 61      | 53,192     |     |
| 日本エンタープライズ                        | 20.5    | 15.6      | 2,043      |     | 昭文社ホールディングス          | 8.5     | 6.5     | 2,554      |     |
| WOWOW                             | 17.3    | 26.9      | 30,961     |     | インプレスホールディングス        | 17.5    | 13.9    | 2,376      |     |
| スカラ                               | 28.4    | 33.1      | 24,030     |     | アイネット                | 18.6    | 21.6    | 49,809     |     |
| インテリジェント ウェイブ                     | 10.5    | 8         | 9,208      |     | 松竹                   | 17.5    | 18.5    | 186,850    |     |
| ANYCOLOR                          | —       | 37.8      | 100,170    |     | 東宝                   | 192.1   | 198.6   | 1,016,236  |     |
| WOW WORLD GROUP                   | 2.9     | —         | —          |     | 東映                   | 8.5     | 11.8    | 231,516    |     |
| I M A G I C A G R O U P           | 25.6    | 35.7      | 24,168     |     | N T T データグループ        | 963.1   | 933.3   | 2,297,317  |     |
| ネットワンシステムズ                        | 114.4   | 144.1     | 399,373    |     | ビー・シー・エー             | 17.6    | 20.5    | 36,018     |     |
| システムソフト                           | 106.8   | 124.2     | 7,452      |     | ビジネスプレイン太田昭和         | 13.1    | 14      | 30,478     |     |
| アルゴグラフィックス                        | 28.1    | 32.7      | 141,918    |     | D T S                | 65.4    | 75.2    | 302,680    |     |
| マーべラス                             | 49.8    | 58        | 42,166     |     | スクウェア・エニックス・ホールディングス | 154.3   | 163.1   | 982,025    |     |
| エイベックス                            | 52.1    | 60.8      | 79,222     |     | シーイーシー               | 43      | 45      | 69,795     |     |
| B I P R O G Y                     | 113     | 116.8     | 538,798    |     | カブコン                 | 305     | 319.2   | 1,921,903  |     |
| 兼松エレクトロニクス                        | 19.1    | —         | —          |     | アイ・エス・ピー             | 15.6    | 18.2    | 25,025     |     |
| 都築電気                              | 16.2    | 18.8      | 45,383     |     | ジャステック               | 18.8    | 21.9    | 31,557     |     |
| T B S ホールディングス                    | 157.1   | 179.5     | 748,515    |     | S C S K              | 250.5   | 249.8   | 719,673    |     |
| 日本テレビホールディングス                     | 271.8   | 316       | 702,784    |     | N S W                | 11.9    | 15.9    | 50,323     |     |
| 朝日放送グループホールディングス                  | 28.7    | 33.4      | 22,545     |     | アイネス                 | 21.5    | 27.8    | 43,618     |     |
| テレビ朝日ホールディングス                     | 74.5    | 86.7      | 189,873    |     | T K C                | 55.1    | 56.6    | 209,703    |     |
| スカパーJ SATホールディングス                 | 272.3   | 277.2     | 291,614    |     | 富士ソフト                | 34.7    | 71.8    | 435,108    |     |
| テレビ東京ホールディングス                     | 22.1    | 25.7      | 79,156     |     | N S D                | 109.5   | 127.4   | 381,180    |     |
| 日本B S放送                           | 7.1     | 5.4       | 4,903      |     | コナミグループ              | 131.4   | 133.7   | 1,369,988  |     |
| ビジョン                              | 40.4    | 53.8      | 64,129     |     | 福井コンピュータホールディングス     | 21.3    | 22      | 58,366     |     |
| スマートバリュー                          | 4.8     | 3.6       | 1,494      |     | J B C C ホールディングス     | 22.4    | 23.7    | 79,869     |     |
| U S E N - N E X T H O L D I N G S | 27.5    | 40        | 208,400    |     | ミロク情報サービス            | 27.9    | 32.4    | 58,417     |     |
| ワイヤレスゲート                          | 8.6     | 6.6       | 1,419      |     | ソフトバンクグループ           | 1,774.8 | 1,760.7 | 16,166,747 |     |
| 日本通信                              | 283.3   | 351.4     | 72,388     |     | 卸売業 (7.5%)           |         |         |            |     |
| クロップス                             | 3.9     | 2         | 2,204      |     | 高千穂交易                | 7.5     | 11.9    | 47,778     |     |
| 日本電信電話                            | 3,933.3 | 106,170.2 | 19,429,146 |     | オルバヘルスケアホールディングス     | 3.5     | 2.4     | 4,783      |     |
| K D D I                           | 2,372   | 2,758.1   | 12,450,063 |     | 伊藤忠食品                | 7.3     | 8.5     | 63,325     |     |
| ソフトバンク                            | 4,931.2 | 5,745.2   | 11,648,393 |     | エレマテック               | 29.1    | 33.8    | 66,045     |     |

| 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 |
|                    | 千株      | 千株    | 千円        |     |                  | 千株      | 千株    | 千円      |     |
| あらた                | 24.8    | 57.6  | 185,184   |     | 富士興産             | 5.3     | 4.2   | 8,358   |     |
| トーメンデバイス           | 4.7     | 5.4   | 36,504    |     | 協栄産業             | 2.1     | 1.6   | 4,648   |     |
| 東京エレクトロン デバイス      | 12      | 37.5  | 246,375   |     | フルサト・マルカホールディングス | 32.2    | 33.5  | 73,733  |     |
| 円谷フィールズホールディングス    | 55.6    | 64.7  | 111,154   |     | ヤマエグループホールディングス  | 18.3    | 24.9  | 68,001  |     |
| 双日                 | 343.8   | 419.2 | 1,693,568 |     | 小野建              | 29.7    | 37    | 70,559  |     |
| アルフレッサ ホールディングス    | 325     | 377.9 | 859,722   |     | 南陽               | 4       | 3.2   | 8,460   |     |
| 横浜冷凍               | 88.2    | 102.5 | 109,162   |     | 佐鳥電機             | 13.1    | 21    | 51,534  |     |
| 神栄                 | 3.1     | 2.3   | 3,935     |     | エコートレーディング       | 4.4     | 3     | 3,714   |     |
| ラサ商事               | 9.6     | 15.3  | 31,089    |     | 伯東               | 18.5    | 21.6  | 126,792 |     |
| アルコニックス            | 42.6    | 49.6  | 73,308    |     | コンドーテック          | 24.9    | 28.9  | 36,847  |     |
| 神戸物産               | 250.5   | 291.3 | 1,074,314 |     | 中山福              | 11.1    | 8.4   | 3,208   |     |
| ハイパー               | 3.9     | 3.1   | 951       |     | ナガイレーベン          | 40.9    | 47.6  | 114,811 |     |
| あい ホールディングス        | 51.8    | 60.3  | 144,720   |     | 三菱食品             | 29.9    | 34.8  | 191,052 |     |
| ディープイエックス          | 7.2     | 4.3   | 4,553     |     | 松田産業             | 24.6    | 28.6  | 70,642  |     |
| ダイワボウホールディングス      | 132.3   | 166.7 | 424,751   |     | 第一興商             | 62.6    | 145.7 | 287,976 |     |
| マクニカホールディングス       | 79.4    | 89.1  | 657,201   |     | メディパルホールディングス    | 335.8   | 382.9 | 890,433 |     |
| ラクト・ジャパン           | 12.5    | 14.6  | 34,426    |     | S P K            | 14.4    | 16.7  | 34,068  |     |
| グリムス               | 13.4    | 15.8  | 34,507    |     | 萩原電気ホールディングス     | 12.4    | 16.2  | 72,333  |     |
| バイタルケースケー・ホールディングス | 47.3    | 57    | 71,706    |     | アズワン             | 46.1    | 59    | 315,945 |     |
| 八洲電機               | 26.2    | 30.4  | 49,339    |     | スズデン             | 11.3    | 13.2  | 28,960  |     |
| メディアスホールディングス      | 20.7    | 21.9  | 16,819    |     | 尾家産業             | 4.9     | 3.7   | 6,515   |     |
| レスターホールディングス       | 31      | 32    | 96,640    |     | シモジマ             | 22.2    | 25.2  | 35,985  |     |
| ジオリープグループ          | 4.1     | 3.3   | 4,880     |     | ドウシシャ            | 34.2    | 34.8  | 74,402  |     |
| 大光                 | 8.9     | 6.8   | 4,460     |     | 小津産業             | 4.7     | 3.6   | 6,271   |     |
| O C H I ホールディングス   | 4.7     | 3.5   | 5,999     |     | 高速               | 16.8    | 22.3  | 52,405  |     |
| T O K A I ホールディングス | 159.9   | 204.5 | 205,727   |     | たけびし             | 12.3    | 14.4  | 29,908  |     |
| 黒谷                 | 5.7     | 4.3   | 2,631     |     | リックス             | 4.3     | 7.6   | 31,008  |     |
| C o m i n i x      | 3.7     | 2.9   | 2,769     |     | 丸文               | 28.9    | 33.6  | 51,744  |     |
| 三洋貿易               | 33.2    | 42.5  | 56,865    |     | ハピネット            | 27.5    | 32    | 99,360  |     |
| ピューティガレージ          | 5.1     | 11.9  | 27,465    |     | 橋本総業ホールディングス     | 12.8    | 14.9  | 21,083  |     |
| ワイン・パートナーズ         | 23.6    | 24.4  | 30,573    |     | 日本ライフライン         | 94.9    | 110.4 | 140,097 |     |
| ミタチ産業              | 5.3     | 4     | 4,884     |     | タカショ一            | 28.2    | 32.8  | 17,580  |     |
| シップヘルスケアホールディングス   | 116.4   | 135.3 | 298,201   |     | I D O M          | 97.9    | 99.6  | 104,480 |     |
| 明治電機工業             | 12      | 14    | 21,588    |     | 進和               | 21.4    | 23    | 61,065  |     |
| デリカフーズホールディングス     | 8.2     | 6.6   | 3,900     |     | エスケイジャパン         | 5.1     | 3.8   | 2,800   |     |
| スターティアホールディングス     | 4.8     | 3.6   | 5,479     |     | ダイトロン            | 12.8    | 14.8  | 49,654  |     |
| コメダホールディングス        | 79.3    | 92.3  | 252,717   |     | シークス             | 46.1    | 53.7  | 92,686  |     |
| ビーバンドットコム          | 2.9     | 1.9   | 773       |     | 田中商事             | 6.5     | 4.4   | 4,149   |     |
| アセンテック             | 10.8    | 14.4  | 8,899     |     | オーハシテクニカ         | 16.2    | 19.7  | 33,293  |     |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当期末     |            |
|-----------------|---------|---------|------------|
|                 |         | 株数      | 評価額        |
|                 |         | 千株      | 千円         |
| 白鶴              | 11.7    | 10.6    | 27,761     |
| ダイコー通産          | 2.5     | 1.6     | 2,097      |
| 伊藤忠商事           | 1,995.4 | 2,531.1 | 16,558,456 |
| 丸紅              | 2,556.5 | 3,139.3 | 8,366,234  |
| 高島              | 3       | 9.6     | 12,796     |
| 長瀬産業            | 152.2   | 172.6   | 449,968    |
| 蝶理              | 17.4    | 23.6    | 80,240     |
| 豊田通商            | 283.7   | 329.8   | 3,436,516  |
| 三共生興            | 46.5    | 52.2    | 40,611     |
| 兼松              | 125.7   | 157.4   | 404,203    |
| ツカモトコーポレーション    | 3.5     | 2.2     | 2,981      |
| 三井物産            | 2,369.4 | 2,837   | 20,205,114 |
| 日本紙パルプ商事        | 17.2    | 18      | 95,400     |
| カメイ             | 34.4    | 40      | 81,360     |
| 東都水産            | 1.1     | 0.8     | 5,744      |
| OUGホールディングス     | 3.1     | 2.3     | 6,012      |
| スターゼン           | 24.6    | 26      | 75,764     |
| 山善              | 87.3    | 114.2   | 157,253    |
| 椿本興業            | 5.2     | 7.8     | 56,316     |
| 住友商事            | 2,005.5 | 2,278.8 | 8,420,166  |
| 内田洋行            | 14.3    | 15.3    | 106,029    |
| 三菱商事            | 2,024.7 | 7,230.1 | 25,659,624 |
| 第一実業            | 11.4    | 35.4    | 75,614     |
| キヤノンマーケティングジャパン | 75      | 87.2    | 389,784    |
| 西華産業            | 12.7    | 14.8    | 50,690     |
| 佐藤商事            | 22.5    | 26.1    | 47,371     |
| 菱洋エレクトロ         | 27.6    | 35.7    | 142,621    |
| 東京産業            | 29.5    | 34.3    | 24,936     |
| ユアサ商事           | 29.2    | 29.4    | 151,410    |
| 神鋼商事            | 8.1     | 9.4     | 68,902     |
| トルク             | 11.2    | 8.5     | 2,261      |
| 阪和興業            | 58.1    | 67.6    | 397,488    |
| 正栄食品工業          | 21.5    | 25      | 117,000    |
| カナデン            | 26.2    | 28.3    | 43,468     |
| RYODEN          | 26.1    | 30.4    | 82,779     |
| 岩谷産業            | 73.7    | 85.7    | 671,630    |
| ナイズ             | 6.5     | 5       | 8,750      |
| ニチモウ            | 2.5     | 4       | 9,544      |
| 極東貿易            | 19.3    | 22.5    | 49,837     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末   |         |
|------------------------------|---------|-------|---------|
|                              |         | 株数    | 評価額     |
|                              |         | 千株    | 千円      |
| アステナホールディングス                 | 56      | 70.7  | 34,006  |
| 三愛オブリ                        | 89.4    | 90.5  | 192,222 |
| 稲畑産業                         | 65.4    | 74.4  | 239,568 |
| G S I クレオス                   | 18.8    | 20.2  | 49,288  |
| 明和産業                         | 43      | 44.5  | 30,616  |
| クワザワホールディングス                 | 7.5     | 5.7   | 5,033   |
| ワキタ                          | 59.5    | 62.3  | 97,811  |
| 東邦ホールディングス                   | 80.6    | 104.2 | 368,347 |
| サンゲツ                         | 81.3    | 86.7  | 296,514 |
| ミヅウコグループホールディングス             | 41.6    | 48    | 71,088  |
| シナネンホールディングス                 | 10.5    | 10.4  | 50,544  |
| 伊藤忠エネクス                      | 80.3    | 93.3  | 147,787 |
| サンリオ                         | 91.7    | 106.7 | 968,836 |
| サンワテクノス                      | 16.5    | 19.2  | 46,617  |
| リヨーサン                        | 34.3    | 26.6  | 138,054 |
| 新光商事                         | 43.5    | 50.6  | 61,124  |
| トーホー                         | 13.9    | 14.7  | 42,894  |
| 三信電気                         | 13      | 15.2  | 33,896  |
| 東陽テクニカ                       | 35.8    | 38.2  | 58,331  |
| モスクードサービス                    | 47.6    | 55.4  | 192,792 |
| 加賀電子                         | 26.3    | 34.4  | 222,912 |
| ソーダニッカ                       | 16.9    | 31.8  | 39,750  |
| 立花エレック                       | 23.6    | 25    | 83,500  |
| フォーバル                        | 12.7    | 14.8  | 18,662  |
| P A L T A C                  | 50.9    | 50.7  | 204,625 |
| 三谷産業                         | 56.6    | 65.8  | 27,965  |
| 太平洋興発                        | 7.8     | 6     | 5,154   |
| 西本W i s m e t t a c ホールディングス | 8.2     | 9.6   | 56,160  |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス            | 1.9     | 1.2   | 3,324   |
| ヨーハ商事ホールディングス                | 18.1    | 26.4  | 22,704  |
| K P P グループホールディングス           | 75.4    | 97.5  | 71,565  |
| ヤマタネ                         | 14.3    | 16.6  | 49,202  |
| 丸紅建材リース                      | 1.8     | 1.1   | 3,355   |
| 日鉄物産                         | 22.2    | —     | —       |
| 泉州電業                         | 16.2    | 17.5  | 82,600  |
| トラスコ中山                       | 68      | 79.1  | 193,478 |
| オートバックスセブン                   | 112.7   | 131   | 216,084 |
| モリト                          | 23.2    | 26.9  | 40,242  |
| 加藤産業                         | 39.3    | 46.6  | 216,923 |

| 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 |
|                   |         | 千株    | 千株        | 千円  |                    |         | 千株    | 千株        | 千円  |
| 北恵                | 4.7     | 3.7   | 3,230     |     | ファーマライズホールディングス    | 4.5     | 3.5   | 2,299     |     |
| イエローハット           | 57.1    | 59.8  | 115,115   |     | アルペン               | 26.7    | 31.1  | 61,920    |     |
| J Kホールディングス       | 25.5    | 28.9  | 31,183    |     | ハブ                 | 6.9     | 5.1   | 3,886     |     |
| 日伝                | 19.2    | 25.5  | 70,125    |     | クオールホールディングス       | 44.5    | 51.8  | 92,359    |     |
| 北沢産業              | 11.1    | 8.9   | 3,079     |     | ジンズホールディングス        | 19.2    | 22.3  | 98,231    |     |
| 杉本商事              | 14.4    | 18.2  | 41,405    |     | ピックカメラ             | 215.3   | 200.3 | 257,385   |     |
| 因幡電機産業            | 83.9    | 97.6  | 352,824   |     | D C Mホールディングス      | 197.7   | 199   | 293,525   |     |
| 東テク               | 10.8    | 12.6  | 113,400   |     | ペッパーードサービス         | 69.3    | 87.4  | 10,750    |     |
| ミスミグループ本社         | 488.6   | 568.5 | 1,162,014 |     | M o n o t a R O    | 459.1   | 533.8 | 936,018   |     |
| アルテック             | 11.6    | 8.4   | 2,570     |     | 東京一番フーズ            | 4.8     | 3.6   | 1,882     |     |
| タキヒヨー             | 5.7     | 3.7   | 4,206     |     | D Dグループ            | 11.1    | 8.9   | 11,365    |     |
| 藏王産業              | 4.1     | 2.7   | 6,982     |     | きちらホールディングス        | 5.6     | 3.7   | 3,466     |     |
| スズケン              | 100.7   | 143.3 | 657,890   |     | アークランドサービスホールディングス | 26.5    | —     | —         |     |
| ジェコス              | 20.9    | 22.5  | 26,437    |     | J . フロント リテイリング    | 402.6   | 432.1 | 717,718   |     |
| グローセル             | 22.9    | 44    | 32,824    |     | ドトール・日レスホールディングス   | 57.4    | 66.8  | 138,276   |     |
| <b>小売業 (4.2%)</b> |         |       |           |     | マツキヨコカラ&カンパニー      | 196.4   | 685   | 1,653,247 |     |
| ローソン              | 80.4    | 80.1  | 825,430   |     | プロンコビリー            | 17.3    | 22.1  | 81,880    |     |
| サンエー              | 24.7    | 28.7  | 134,890   |     | Z O Z O            | 214     | 239.9 | 949,044   |     |
| カワチ薬品             | 25.3    | 29.4  | 77,910    |     | トレジャーファクトリー        | 12.4    | 20.7  | 30,077    |     |
| エービーシー・マート        | 47.2    | 164.8 | 474,459   |     | 物語コーポレーション         | 54.1    | 62.9  | 292,799   |     |
| ハードオフコーポレーション     | 9.3     | 13.4  | 23,450    |     | 三越伊勢丹ホールディングス      | 545.1   | 634.2 | 1,582,646 |     |
| アスクル              | 67      | 90.9  | 189,617   |     | H a m e e          | 11.2    | 15.2  | 18,969    |     |
| ゲオホールディングス        | 34.1    | 42.2  | 81,361    |     | マークエットエンタープライズ     | 2.1     | 1.4   | 1,107     |     |
| アダストリア            | 39.1    | 45.5  | 172,672   |     | ウエルシアホールディングス      | 168     | 195.3 | 508,072   |     |
| ジーフット             | 12.7    | 10.1  | 2,878     |     | クリエイトS Dホールディングス   | 53.5    | 53.4  | 173,817   |     |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア    | 3.1     | 2     | 1,444     |     | 丸善C H Iホールディングス    | 24.7    | 18.7  | 6,208     |     |
| くら寿司              | 37.9    | 44.1  | 203,080   |     | ミサワ                | 4.3     | 3.3   | 2,065     |     |
| キャンドゥ             | 11.5    | 13.4  | 36,917    |     | ティーライフ             | 2.8     | 2.1   | 2,816     |     |
| I Kホールディングス       | 6.7     | 5.1   | 1,968     |     | エー・ピー・ホールディングス     | 4.1     | 3.3   | 3,455     |     |
| バルグループホールディングス    | 31.8    | 73.9  | 187,188   |     | チムニー               | 6.5     | 4.9   | 6,894     |     |
| エディオン             | 128.2   | 149.1 | 231,105   |     | シュッピン              | 24.1    | 34    | 41,990    |     |
| サーラコーポレーション       | 68      | 79.1  | 65,969    |     | オイシックス・ラ・大地        | 43.5    | 50.6  | 67,601    |     |
| ワッツ               | 10.2    | 7.7   | 5,028     |     | ネクステージ             | 73.9    | 86    | 237,446   |     |
| ハローズ              | 14.7    | 17.1  | 78,318    |     | ジョイフル本田            | 96.2    | 109.5 | 242,433   |     |
| フジオフードグループ本社      | 26.9    | 42.2  | 58,151    |     | 鳥貴族ホールディングス        | 12      | 13.9  | 66,581    |     |
| あみやき亭             | 7.8     | 9.1   | 46,046    |     | ホットランド             | 24.8    | 28.8  | 55,958    |     |
| ひらまつ              | 44.8    | 35.8  | 10,489    |     | すかいらーくホールディングス     | 442.7   | 514.7 | 1,220,353 |     |
| 大黒天物産             | 9.9     | 11.6  | 115,188   |     | S F Pホールディングス      | 17.7    | 20.6  | 39,531    |     |
| ハニーズホールディングス      | 25.5    | 33.4  | 57,548    |     | 綿半ホールディングス         | 25      | 29.2  | 47,304    |     |

| 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 |
| ヨシックスホールディングス        | 千株      | 千株      | 千円        |     | コジマ                                 | 千株      | 千株    | 千円        |     |
| ユニテッド・スーパーマーケット・ホール  | 4.1     | 7.7     | 23,600    |     | ヒマラヤ                                | 62.4    | 62.2  | 50,879    |     |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 105.5   | 105.1   | 104,679   |     | コーナン商事                              | 6.6     | 5.1   | 4,651     |     |
| B E E N O S          | 14.6    | 17      | 10,336    |     | エコス                                 | 18.3    | 12    | 32,354    |     |
| あさひ                  | 18.3    | 15.4    | 30,892    |     | ワタミ                                 | 10      | 14    | 39,481    |     |
| 日本調剤                 | 27      | 34.9    | 46,347    |     | マルシェ                                | 39.1    | 39.8  | 1,556     |     |
| コスマス薬品               | 22      | 25.6    | 41,395    |     | パン・パシフィック・インターナショナルホ                | 653.6   | 760.4 | 3,037,798 |     |
| トーエル                 | 32      | 31.9    | 454,894   |     | 西松屋チェーン                             | 71.7    | 74.1  | 181,470   |     |
| セブン＆アイ・ホールディングス      | 9.3     | 7       | 5,754     |     | ゼンショーホールディングス                       | 177.2   | 191.7 | 1,217,295 |     |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 1,116   | 3,893   | 8,325,180 |     | 幸楽苑ホールディングス                         | 21.1    | 27.9  | 39,478    |     |
| ツルハホールディングス          | 243.6   | 254.9   | 267,390   |     | ハーカスレイ                              | 8.8     | 5.6   | 5,314     |     |
| サンマルクホールディングス        | 68      | 79.1    | 863,376   |     | サイゼリヤ                               | 26.1    | 53.8  | 284,627   |     |
| フェリシモ                | 26.1    | 30.3    | 67,175    |     | V T ホールディングス                        | 4.7     | 123   | 76,791    |     |
| トリドールホールディングス        | 80.5    | 105.5   | 451,223   |     | 魚力                                  | 27.5    | 10    | 32,343    |     |
| TOKYO BASE           | 33.3    | 42.8    | 13,353    |     | ボブラ                                 | 18.3    | 4.6   | 954       |     |
| ウイルプラスホールディングス       | 4       | 2.6     | 2,631     |     | フジ・コーポレーション                         | 27.5    | 18.3  | 31,325    |     |
| J M ホールディングス         | 2.6     | 28.4    | 74,067    |     | ユナイテッドアローズ                          | 9.5     | 34.6  | 87,913    |     |
| サツドラホールディングス         | 24.2    | 29.3    | 22,238    |     | ハイディ日高                              | 24.2    | 48    | 148,483   |     |
| アレンザホールディングス         | 8.6     | 10      | 17,070    |     | Y U - W A C r e a t i o n H o l d i | 28.9    | 12.4  | 1,557     |     |
| 串かつ田中ホールディングス        | 21      | 29.3    | 2,631     |     | コロワイド                               | 28.9    | 149.2 | 353,346   |     |
| パロックジャパンリミテッド        | 2.6     | 3.5     | 5,868     |     | ビーシーデボコーポレーション                      | 11.2    | 149.2 | 161.9     |     |
| クスリのアオキホールディングス      | 28.9    | 358,594 | 31,767    |     | 壱番屋                                 | 24.2    | 36.1  | —         |     |
| 力の源ホールディングス          | 24.2    | 28.1    | 29,420    |     | トップカルチャー                            | 186     | 25.6  | —         |     |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 8.6     | 19.3    | 17,070    |     | P L A N T                           | 28.9    | 6.7   | 8.9       |     |
| メディカルシステムネットワーク      | 28.1    | 40.8    | 26,968    |     | スギホールディングス                          | 2.6     | 4.9   | 6,332     |     |
| 一家ホールディングス           | 4.5     | 3.5     | 2,534     |     | 葉王堂ホールディングス                         | 28.1    | 227.6 | 579,924   |     |
| ジャパンクラフトホールディングス     | 6.5     | 9.2     | 1,462     |     | ヴィア・ホールディングス                        | 4.5     | 18.1  | 48,962    |     |
| はるやまホールディングス         | 9.9     | 7.6     | 4,993     |     | スクロール                               | 6.5     | 27.8  | 22.2      |     |
| ノジマ                  | 105.7   | 109.2   | 185,094   |     | ヨンドシーホールディングス                       | 9.9     | 48    | 2,997     |     |
| カッパ・クリエイト            | 50.9    | 59.2    | 97,976    |     | 木曽路                                 | 105.7   | 56.1  | 54,865    |     |
| ライトオン                | 50.9    | 59.2    | 5,088     |     | S R S ホールディングス                      | 59.6    | 27.8  | 67,568    |     |
| 良品計画                 | 15.8    | 12      | 983,728   |     | 千趣会                                 | 59.6    | 49    | 152,247   |     |
| パリミキホールディングス         | 26.1    | 19.9    | 8,557     |     | タカキュー                               | 10.6    | 57    | 761       |     |
| アドヴァングループ            | 26.1    | 35.8    | 42,924    |     | リテールパートナーズ                          | 22.8    | 53.4  | 73,526    |     |
| アルビス                 | 30.8    | 12.3    | 34,280    |     | ケーヨー                                | 22.8    | 55.9  | 20,512    |     |
| コナカ                  | 2.6     | 17.3    | 7,266     |     | 上新電機                                | 2.6     | 52.2  | —         |     |
| ハウス オブ ローゼ           | 40.3    | 2       | 3,318     |     | 日本瓦斯                                | 40.3    | 28.8  | —         |     |
| G-7ホールディングス          | 47.9    | 111.3   | 59,081    |     | ロイヤルホールディングス                        | 47.9    | 37.3  | 87,431    |     |
| イオン北海道               | 47.9    | 99,724  |           |     | 東天紅                                 | 47.9    | 173.5 | 199.5     |     |

| 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 |
|                   |         | 千株      | 千株        | 千円  |                     |         | 千株      | 千株        | 千円  |
| いなげや              | 31.5    | 36.6    | 51,313    |     | 愛眼                  | 15.5    | 11.7    | 2,246     |     |
| チヨダ               | 30.9    | 36      | 31,392    |     | ケーユーホールディングス        | 18.9    | 17.6    | 20,891    |     |
| ライフコーポレーション       | 28.3    | 39.5    | 151,877   |     | 吉野家ホールディングス         | 126.7   | 138.7   | 460,622   |     |
| リンガーハット           | 41.8    | 48.6    | 112,606   |     | 松屋フーズホールディングス       | 15.3    | 17.8    | 103,774   |     |
| M r M a x H D     | 45.3    | 47.4    | 29,482    |     | サガミホールディングス         | 52      | 56.5    | 88,196    |     |
| テシアライド            | 21.2    | 17      | 5,304     |     | 関西フードマーケット          | 29.2    | 25.5    | 45,288    |     |
| AOKIホールディングス      | 60.2    | 80.7    | 93,047    |     | 王将フードサービス           | 21.3    | 27.9    | 221,247   |     |
| オーワク              | 51.8    | 54.2    | 45,907    |     | ミニストップ              | 23.5    | 27.4    | 41,154    |     |
| コメリ               | 49.8    | 57.9    | 205,545   |     | アークス                | 59.4    | 69.1    | 215,592   |     |
| 青山商事              | 69.2    | 80.5    | 148,039   |     | パローホールディングス         | 61.8    | 71.8    | 180,864   |     |
| しまむら              | 38      | 88.4    | 788,086   |     | ベルク                 | 16.1    | 18.7    | 127,908   |     |
| はせがわ              | 11.2    | 7.5     | 2,610     |     | 大庄                  | 11.3    | 18.1    | 22,371    |     |
| 高島屋               | 244.1   | 260.2   | 628,903   |     | ファーストリテイリング         | 145.7   | 169.4   | 7,983,822 |     |
| 松屋                | 54.9    | 63.8    | 66,352    |     | サンドラッグ              | 122.9   | 127     | 613,918   |     |
| エイチ・ツー・オー リテイリング  | 157.6   | 166.6   | 327,702   |     | サックスパー ホールディングス     | 30.8    | 31.8    | 29,001    |     |
| 近鉄百貨店             | 10.4    | 16.1    | 38,318    |     | ヤマザワ                | 4.4     | 3.4     | 4,263     |     |
| 丸井グループ            | 238.8   | 249.9   | 620,501   |     | やまや                 | 4.3     | 3.3     | 10,890    |     |
| アクシアル リテイリング      | 22.1    | 25.7    | 107,040   |     | ベルーナ                | 77.9    | 90.6    | 56,806    |     |
| 井筒屋               | 9.9     | 7.5     | 2,827     |     | 銀行業 (7.4%)          |         |         |           |     |
| イオン               | 1,097.8 | 1,276.4 | 4,559,300 |     | いよぎんホールディングス        | 358.7   | 417.1   | 501,562   |     |
| イズミ               | 49.2    | 66.8    | 234,668   |     | しずおかフィナンシャルグループ     | 681.2   | 778.7   | 1,165,713 |     |
| 平和堂               | 54.1    | 62.9    | 126,051   |     | ちゅうぎんフィナンシャルグループ    | 253.8   | 295.1   | 371,826   |     |
| フジ                | 49.7    | 57.8    | 106,698   |     | 楽天銀行                | —       | 121.9   | 379,109   |     |
| ヤオコー              | 36.6    | 44.5    | 420,302   |     | 京都フィナンシャルグループ       | —       | 444.1   | 1,236,818 |     |
| ゼビオホールディングス       | 43.9    | 51      | 50,643    |     | 島根銀行                | 6.7     | 4.3     | 2,515     |     |
| ケーズホールディングス       | 257.5   | 252.9   | 335,345   |     | じもとホールディングス         | 14      | 11.2    | 7,179     |     |
| Olympicグループ       | 9.3     | 6.9     | 3,594     |     | めぶきフィナンシャルグループ      | 1,495.8 | 1,739.2 | 868,382   |     |
| 日産東京販売ホールディングス    | 31.1    | 23.6    | 14,466    |     | 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 38.6    | 44.9    | 212,377   |     |
| シルバーライフ           | 7.4     | 7.2     | 6,696     |     | 九州フィナンシャルグループ       | 530.4   | 678.3   | 780,723   |     |
| Genky Drug Stores | 14.2    | 16.5    | 108,570   |     | ゆうちょ銀行              | 858.3   | 3,851.6 | 6,507,278 |     |
| ナルミヤ・インターナショナル    | 4.5     | 2.6     | 3,133     |     | 富山第一銀行              | 75.1    | 111.3   | 107,293   |     |
| ブックオフグループホールディングス | 12.3    | 21.9    | 31,251    |     | コンコルド・ア・フィナンシャルグループ | 1,661.4 | 1,880.7 | 1,480,675 |     |
| ギフトホールディングス       | 6.8     | 15.9    | 56,842    |     | 西日本フィナンシャルホールディングス  | 190.9   | 197.8   | 382,149   |     |
| AINホールディングス       | 44.6    | 51.9    | 283,841   |     | 三十三フィナンシャルグループ      | 27      | 31.3    | 65,260    |     |
| 元気寿司              | 9.2     | 21.3    | 68,905    |     | 第四北越フィナンシャルグループ     | 47.3    | 55      | 251,625   |     |
| ヤマダホールディングス       | 1,327.8 | 1,158.1 | 516,860   |     | ひろぎんホールディングス        | 393.3   | 498.9   | 554,776   |     |
| アークランズ            | 47.4    | 112     | 196,224   |     | おきなわフィナンシャルグループ     | 28.7    | 29.9    | 79,563    |     |
| ニトリホールディングス       | 131     | 137.1   | 3,302,739 |     | 十六フィナンシャルグループ       | 39.1    | 45.4    | 218,828   |     |
| グルメ杵屋             | 26.2    | 30.5    | 34,068    |     | 北國フィナンシャルホールディングス   | 25.4    | 36.9    | 180,072   |     |

| 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 |
|                   | 千株       | 千株       | 千円         |     |                      | 千株      | 千株      | 千円         |     |
| プロクレアホールディングス     | 36.9     | 40       | 76,400     |     | 宮崎銀行                 | 19.7    | 21.1    | 62,392     |     |
| あいちフィナンシャルグループ    | 42.2     | 53.9     | 147,147    |     | 佐賀銀行                 | 17.7    | 20.5    | 43,993     |     |
| SBI新生銀行           | 88.9     | —        | —          |     | 琉球銀行                 | 69.1    | 74.6    | 90,788     |     |
| あおぞら銀行            | 189.5    | 251.9    | 622,444    |     | セブン銀行                | 1,079.8 | 1,098.6 | 325,515    |     |
| 三井UFJフィナンシャル・グループ | 19,139.1 | 21,345.3 | 33,736,246 |     | みずほフィナンシャルグループ       | 4,359.4 | 4,731.1 | 14,401,468 |     |
| りそなホールディングス       | 3,809.9  | 4,053.6  | 3,842,407  |     | 高知銀行                 | 6.7     | 5.1     | 5,518      |     |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 547.8    | 1,259.6  | 4,238,554  |     | 山口フィナンシャルグループ        | 332.8   | 343.7   | 552,669    |     |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 2,202.8  | 2,492    | 22,305,892 |     | 長野銀行                 | 6.5     | —       | —          |     |
| 千葉銀行              | 840.1    | 976.8    | 1,248,350  |     | 名古屋銀行                | 19.9    | 22.7    | 152,090    |     |
| 群馬銀行              | 584.9    | 680.1    | 600,528    |     | 北洋銀行                 | 456.7   | 531.1   | 239,526    |     |
| 武蔵野銀行             | 38.7     | 48.9     | 146,944    |     | 大光銀行                 | 6.3     | 4.8     | 7,497      |     |
| 千葉興業銀行            | 45.6     | 66.2     | 71,098     |     | 愛媛銀行                 | 40.6    | 47.2    | 54,138     |     |
| 筑波銀行              | 132.3    | 153.8    | 46,909     |     | トマト銀行                | 6.4     | 5.2     | 6,812      |     |
| 七十七銀行             | 96.5     | 102      | 414,630    |     | 京葉銀行                 | 140     | 144.3   | 111,399    |     |
| 秋田銀行              | 20.2     | 23.5     | 49,726     |     | 栃木銀行                 | 138     | 175     | 64,750     |     |
| 山形銀行              | 33.5     | 38.9     | 46,485     |     | 北日本銀行                | 10.6    | 11.4    | 28,819     |     |
| 岩手銀行              | 20.6     | 22.2     | 58,497     |     | 東和銀行                 | 55.3    | 64.3    | 47,582     |     |
| 東邦銀行              | 238.4    | 277.2    | 101,732    |     | 福島銀行                 | 22.4    | 15.5    | 4,836      |     |
| 東北銀行              | 9.5      | 7.2      | 9,345      |     | 大東銀行                 | 9.3     | 6.5     | 5,271      |     |
| ふくおかフィナンシャルグループ   | 240.6    | 305.2    | 1,253,456  |     | トモニホールディングス          | 243.6   | 331.7   | 140,972    |     |
| スルガ銀行             | 265.7    | 308.9    | 275,229    |     | フィデアホールディングス         | 31.1    | 36.2    | 59,730     |     |
| 八十二銀行             | 618.3    | 752.1    | 769,022    |     | 池田泉州ホールディングス         | 386     | 486.2   | 193,021    |     |
| 山梨中央銀行            | 31       | 39.3     | 76,084     |     | 証券、商品先物取引業 (0.9%)    |         |         |            |     |
| 大垣共立銀行            | 57.5     | 66.8     | 152,237    |     | FPG                  | 122.3   | 118.5   | 257,263    |     |
| 福井銀行              | 26.9     | 31.3     | 61,974     |     | ジャパンインベストメントアドバイザー   | 24.6    | 56.8    | 61,571     |     |
| 清水銀行              | 12       | 13.9     | 22,948     |     | マーキュリアホールディングス       | 11.4    | 7.5     | 8,062      |     |
| 富山銀行              | 3.3      | 2.5      | 5,112      |     | SBIホールディングス          | 436.3   | 513.7   | 2,089,217  |     |
| 滋賀銀行              | 50.1     | 58.3     | 247,483    |     | 日本アジア投資              | 16.7    | 10.8    | 2,505      |     |
| 南都銀行              | 45.4     | 52.7     | 165,741    |     | ジャフコ グループ            | 100.6   | 104.4   | 193,087    |     |
| 百五銀行              | 283.6    | 329.7    | 217,931    |     | 大和証券グループ本社           | 2,155.5 | 2,715.2 | 3,232,445  |     |
| 京都銀行              | 95.5     | —        | —          |     | 野村ホールディングス           | 5,551.4 | 5,894.3 | 5,779,950  |     |
| 紀陽銀行              | 107.8    | 125.4    | 238,260    |     | 岡三証券グループ             | 264.6   | 307.7   | 262,468    |     |
| ほくほくフィナンシャルグループ   | 191.6    | 216.9    | 414,821    |     | 丸三証券                 | 100.3   | 116.6   | 136,422    |     |
| 山陰合同銀行            | 188.7    | 219.4    | 275,785    |     | 東洋証券                 | 100     | 93      | 39,804     |     |
| 鳥取銀行              | 6.7      | 5.2      | 8,216      |     | 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 328.1   | 416.2   | 264,287    |     |
| 百十四銀行             | 27.5     | 34.5     | 104,362    |     | 光世証券                 | 4.4     | 3.4     | 3,060      |     |
| 四国銀行              | 47.9     | 51.4     | 62,708     |     | 水戸証券                 | 80.9    | 103.5   | 53,509     |     |
| 阿波銀行              | 44.5     | 49.2     | 140,908    |     | いちよし証券               | 55.5    | 65.6    | 56,088     |     |
| 大分銀行              | 18.1     | 21.1     | 63,405     |     | 松井証券                 | 178     | 172.5   | 149,212    |     |

| 銘柄                        | 期首(前期末) | 当期末     |            |     |
|---------------------------|---------|---------|------------|-----|
|                           |         | 株数      | 株数         | 評価額 |
|                           | 千株      | 千株      | 千円         |     |
| マネックスグループ                 | 336.7   | 343.3   | 311,373    |     |
| 極東証券                      | 37.5    | 48      | 86,784     |     |
| 岩井コスモホールディングス             | 34.4    | 39.9    | 94,243     |     |
| アイザワ証券グループ                | 43.5    | 50.6    | 64,262     |     |
| マネーパートナーズグループ             | 22.5    | 15.5    | 4,448      |     |
| スパークス・グループ                | 33.6    | 39      | 72,969     |     |
| 小林洋行                      | 7.5     | 5.9     | 2,242      |     |
| <b>保険業 (2.7%)</b>         |         |         |            |     |
| かんぽ生命保険                   | 366     | 357     | 1,064,752  |     |
| F Pパートナー                  | —       | 7       | 45,990     |     |
| S O M P O ホールディングス        | 517.3   | 527.3   | 4,970,329  |     |
| アニコム ホールディングス             | 102.4   | 119     | 68,663     |     |
| M S & A D インシュアラנסグループホール | 613.4   | 784.8   | 6,149,692  |     |
| 第一生命ホールディングス              | 1,534.5 | 1,712.5 | 6,666,762  |     |
| 東京海上海上ホールディングス            | 3,035.3 | 3,464.5 | 16,227,718 |     |
| T & D ホールディングス            | 809     | 941.2   | 2,533,710  |     |
| アドバンスクリエイト                | 17.4    | 20.3    | 20,929     |     |
| <b>その他金融業 (1.2%)</b>      |         |         |            |     |
| 全国保証                      | 78.8    | 91.7    | 518,105    |     |
| あんしん保証                    | 8.4     | 6.4     | 1,638      |     |
| ジェイリース                    | 7.1     | 20.9    | 27,002     |     |
| イントラスト                    | 8.9     | 5.7     | 4,816      |     |
| 日本モーゲージサービス               | 11.7    | 8.3     | 4,498      |     |
| C a s a                   | 7.5     | 5.8     | 4,738      |     |
| S B I アルヒ                 | 37.2    | 33.6    | 31,920     |     |
| プレミアグループ                  | 50.6    | 59.2    | 118,163    |     |
| ネットプロテクションズホールディングス       | 99.7    | 116.4   | 25,491     |     |
| クレディセゾン                   | 191     | 222.1   | 725,378    |     |
| 芙蓉総合リース                   | 27.7    | 32.2    | 441,140    |     |
| みずほリース                    | 44.9    | 58.7    | 335,764    |     |
| 東京センチュリー                  | 56.3    | 262     | 423,785    |     |
| 日本証券金融                    | 120.9   | 128.8   | 219,732    |     |
| アイフル                      | 499.2   | 516     | 213,108    |     |
| リコリース                     | 28.6    | 33.3    | 183,150    |     |
| イオンフィナンシャルサービス            | 173.1   | 201.2   | 272,626    |     |
| アコム                       | 538.1   | 625.3   | 249,682    |     |
| ジャックス                     | 32.1    | 37.3    | 208,880    |     |
| オリエントコーポレーション             | 78.7    | 114.4   | 127,784    |     |
| オリックス                     | 1,978.7 | 2,102   | 7,010,170  |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末     |           |     |
|--------------------|---------|---------|-----------|-----|
|                    |         | 株数      | 株数        | 評価額 |
|                    | 千株      | 千株      | 千円        |     |
| 三菱H C キャピタル        | 1,175.3 | 1,561.8 | 1,685,963 |     |
| 九州リースサービス          | 9.1     | 6       | 8,724     |     |
| 日本取引所グループ          | 847     | 914.5   | 3,862,848 |     |
| イー・ギャランティ          | 48.7    | 57      | 104,766   |     |
| アサックス              | 11      | 6.8     | 5,569     |     |
| N E C キャピタルソリューション | 14.8    | 17.2    | 67,940    |     |
| <b>不動産業 (2.0%)</b> |         |         |           |     |
| R o b o t H o m e  | —       | 97      | 16,296    |     |
| 大東建託               | 110.4   | 128.4   | 2,247,000 |     |
| いちご                | 347.1   | 403.5   | 176,329   |     |
| 日本駐車場開発            | 358.9   | 370.9   | 75,292    |     |
| スター・マイカ・ホールディングス   | 27.2    | 40.7    | 25,030    |     |
| S R E ホールディングス     | 14.8    | 15.1    | 60,777    |     |
| A D ワークスグループ       | 47.4    | 37.4    | 9,200     |     |
| ヒューリック             | 703.1   | 817.6   | 1,252,563 |     |
| 三栄建築設計             | 14.6    | —       | —         |     |
| 野村不動産ホールディングス      | 188.4   | 195.1   | 782,741   |     |
| 三重交通グループホールディングス   | 64.5    | 75      | 48,000    |     |
| サムティ               | 47.9    | 55.8    | 146,530   |     |
| ディア・ライフ            | 46.2    | 59.8    | 59,022    |     |
| コーチェアールイー          | 6.2     | 4.7     | 3,717     |     |
| 地主                 | 23      | 26.8    | 62,336    |     |
| ブレサンスコーポレーション      | 39.6    | 55.6    | 97,633    |     |
| T H E グローバル社       | 11.3    | 8.6     | 3,672     |     |
| ハウスコム              | 3.7     | 2.4     | 2,472     |     |
| J P M C            | 15.2    | 20.3    | 25,070    |     |
| サンセイランディック         | 5.7     | 4.4     | 4,598     |     |
| エストラスト             | 2.5     | 1.5     | 994       |     |
| フージャースホールディングス     | 46.5    | 54      | 60,696    |     |
| オーブンハウスグループ        | 110.3   | 128.4   | 610,670   |     |
| 東急不動産ホールディングス      | 906.3   | 1,053.8 | 1,237,161 |     |
| 飯田グループホールディングス     | 264.1   | 335.8   | 664,884   |     |
| イーグランド             | 3       | 2.2     | 3,513     |     |
| ムゲンエステート           | 13      | 9.9     | 15,741    |     |
| ビーロット              | 13.3    | 10.1    | 10,211    |     |
| ファーストブラザーズ         | 3.9     | 2.9     | 3,651     |     |
| A n d D o ホールディングス | 17.9    | 21.2    | 25,885    |     |
| シーアールイー            | 13.7    | 19.5    | 27,690    |     |
| プロパティエージェント        | 2.5     | —       | —         |     |

| 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 |
|                  | 千株      | 千株      | 千円        |     |                   | 千株      | 千株      | 千円      |     |
| ケイアイスター不動産       | 14.5    | 16.9    | 63,037    |     | サンフロンティア不動産       | 50.2    | 51.9    | 92,278  |     |
| アグレ都市デザイン        | 3.5     | 2.7     | 4,463     |     | F J ネクストホールディングス  | 31.7    | 36.9    | 51,180  |     |
| グッドコムアセット        | 28      | 32.5    | 26,000    |     | インテリックス           | 4.7     | 3.5     | 2,152   |     |
| ジェイ・エス・ピー        | 7.5     | 17.4    | 45,414    |     | ランドビジネス           | 7.1     | 5.4     | 1,468   |     |
| ロードスター・キャピタル     | 12.9    | 22.8    | 59,895    |     | サンネクスタグループ        | 6.4     | 4.3     | 4,300   |     |
| テンポイノベーション       | 5.9     | 4.4     | 4,290     |     | グランディハウス          | 14.4    | 26.3    | 17,752  |     |
| グローバル・リンク・マネジメント | 3.7     | 2.7     | 7,673     |     | 日本空港ビルディング        | 106.6   | 124     | 759,748 |     |
| フェイスネットワーク       | 2.7     | 4       | 5,156     |     | サービス業(4.5%)       |         |         |         |     |
| 霞ヶ関キャピタル         | —       | 9.5     | 159,600   |     | 明豊ファシリティワークス      | 9.3     | 7.5     | 6,765   |     |
| パーク24            | 234.9   | 227.6   | 402,965   |     | 日本工営              | 19      | —       | —       |     |
| バラカ              | 10.6    | 12.4    | 24,589    |     | L I F U L L       | 107.6   | 125.1   | 21,642  |     |
| ミガロホールディングス      | —       | 2.3     | 5,106     |     | M I X I           | 71.6    | 78.5    | 210,223 |     |
| 宮越ホールディングス       | 13.7    | 16      | 21,184    |     | ジェイエイシーシーグルートメント  | 28.4    | 132.2   | 101,000 |     |
| 三井不動産            | 1,310.1 | 1,620.9 | 7,730,072 |     | 日本M&Aセンターホールディングス | 539.9   | 582.9   | 560,458 |     |
| 三菱地所             | 1,818.8 | 2,291.1 | 6,081,724 |     | メンバーズ             | 9.2     | 12.5    | 11,262  |     |
| 平和不動産            | 48.9    | 56.9    | 226,462   |     | 中広                | 3.3     | 2.5     | 1,060   |     |
| 東京建物             | 287.3   | 306.2   | 729,674   |     | U T グループ          | 46.2    | 47.1    | 167,440 |     |
| 京阪神ビルディング        | 38      | 65.5    | 99,625    |     | アイティメディア          | 11.9    | 13.9    | 27,730  |     |
| 住友不動産            | 544.9   | 506.9   | 2,666,294 |     | ケアネット             | —       | 56.1    | 37,699  |     |
| テーオーシー           | 54.5    | 62.4    | 42,369    |     | E・J ホールディングス      | 18.4    | 21.4    | 36,915  |     |
| 東京楽天地            | 5.2     | —       | —         |     | オープナップグループ        | 94.3    | 109.9   | 223,426 |     |
| レオパレス21          | 339.3   | 350.7   | 174,297   |     | コシダカホールディングス      | 94.2    | 109.5   | 103,477 |     |
| スタートコーポレーション     | 43.3    | 50.3    | 158,696   |     | アルトナー             | 4.9     | 3.9     | 9,016   |     |
| フジ住宅             | 42.2    | 44.1    | 33,427    |     | パソナグループ           | 38.2    | 44.4    | 123,876 |     |
| 空港施設             | 36.4    | 49.4    | 30,578    |     | C D S             | 5.1     | 3.8     | 6,566   |     |
| 明和地所             | 9.9     | 20      | 22,240    |     | リンクアンドモチベーション     | 90.6    | 105.3   | 58,862  |     |
| ゴールドクリスト         | 28.7    | 28.6    | 71,156    |     | エス・エム・エス          | 119.7   | 128.2   | 321,205 |     |
| エスリード            | 14.2    | 16.5    | 59,317    |     | サニーサイドアップグループ     | 7.1     | 4.6     | 3,468   |     |
| 日神グループホールディングス   | 48.4    | 56.2    | 29,842    |     | バーソルホールディングス      | 352.2   | 3,724.2 | 800,703 |     |
| 日本エスコン           | 67.7    | 65.6    | 67,764    |     | リニカル              | 11.5    | 9.1     | 3,658   |     |
| MIRARTHホールディングス  | 152.3   | 161     | 82,271    |     | タックバッド            | 86.1    | 100.1   | 13,413  |     |
| AVANTIA          | 9.9     | 7.9     | 6,762     |     | エスクリ              | 9.2     | 6.3     | 1,921   |     |
| イオンモール           | 156.3   | 181.7   | 320,246   |     | アイ・ケイ・ケイホールディングス  | 10      | 7.5     | 6,090   |     |
| 毎日コムネット          | 7.2     | 5.4     | 4,201     |     | 学情                | 14.2    | 18.6    | 32,364  |     |
| ファースト住建          | 7.9     | 5.9     | 6,743     |     | スタジオアリス           | 15.7    | 18.3    | 37,606  |     |
| ランド              | 1,814.2 | 1,945.4 | 15,563    |     | シミックホールディングス      | 17.3    | —       | —       |     |
| カチタス             | 81      | 94.2    | 184,820   |     | エプロ               | 4.3     | 3.5     | 2,978   |     |
| トーセイ             | 50.1    | 58.3    | 134,381   |     | N J S             | 6.9     | 8       | 24,800  |     |
| 穴吹興産             | 4.6     | 2.8     | 5,972     |     | 総合警備保障            | 116.8   | 611.1   | 513,262 |     |

| 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 |
|                  |         | 千株    | 千株        | 千円  |                       |         | 千株      | 千株        | 千円  |
| カカクコム            | 230.9   | 241.7 | 459,109   |     | 電通グループ                | 309.2   | 359.5   | 1,516,730 |     |
| アイロムグループ         | 11.3    | 14.8  | 28,504    |     | テイクアンドギヴ・ニーズ          | 9.3     | 14      | 15,974    |     |
| セントケア・ホールディング    | 20      | 26.6  | 23,886    |     | びあ                    | 10.5    | 12.5    | 41,125    |     |
| サイネックス           | 3.5     | 2.7   | 2,243     |     | イオンファンタジー             | 13.6    | 13.2    | 31,046    |     |
| ルネサンス            | 22      | 28.5  | 30,609    |     | シーティーエス               | 34.8    | 46.2    | 36,590    |     |
| ディップ             | 55.1    | 56    | 153,944   |     | N E X Y Z . G r o u p | 6.3     | 4.8     | 2,889     |     |
| デジタルホールディングス     | 24.5    | 19    | 20,995    |     | H. U. グループホールディングス    | 92.1    | 107.1   | 275,086   |     |
| 新日本科学            | 33.4    | 33.2  | 50,962    |     | アルプス技研                | 27.4    | 34.7    | 94,939    |     |
| キャリアデザインセンター     | 4.2     | 3.2   | 5,625     |     | サニックス                 | 50.4    | 58.6    | 19,045    |     |
| ベネフィット・ワン        | 145.8   | 127.1 | 274,599   |     | 日本空調サービス              | 33.8    | 39.3    | 35,212    |     |
| エムスリー            | 621.7   | 723   | 1,525,891 |     | オリエンタルランド             | 333     | 1,936.1 | 9,595,311 |     |
| ツカダ・グローバルホールディング | 13.1    | 10    | 4,410     |     | ダスキン                  | 70      | 81.4    | 272,120   |     |
| プラス              | 2.7     | 1.8   | 1,220     |     | 明光ネットワークジャパン          | 41.4    | 44.4    | 31,968    |     |
| アウトソーシング         | 187.4   | 234.8 | 410,547   |     | ファルコホールディングス          | 14.2    | 16.5    | 38,775    |     |
| ウェルネット           | 18.1    | 11.8  | 6,560     |     | 秀英予備校                 | 4.5     | 3.5     | 1,095     |     |
| ワールドホールディングス     | 14.1    | 16.5  | 41,695    |     | 田谷                    | 3.7     | 2.6     | 1,084     |     |
| ディー・エヌ・エー        | 134.1   | 130   | 192,465   |     | ラウンドワン                | 263.1   | 344.3   | 273,718   |     |
| 博報堂DYホールディングス    | 401.3   | 466.6 | 630,376   |     | リゾートトラスト              | 124.2   | 158.9   | 425,136   |     |
| ぐるなび             | 57.8    | 68.2  | 21,073    |     | ビー・エム・エル              | 39      | 45      | 135,225   |     |
| タカミヤ             | 42.7    | 49.6  | 28,123    |     | りらいあコミュニケーションズ        | 51.9    | —       | —         |     |
| ジャパンベストレスキューシステム | 19.5    | —     | —         |     | リソー教育                 | 143     | 187.1   | 42,097    |     |
| ファンコミュニケーションズ    | 61.6    | 51.2  | 20,684    |     | 早稲田カデミー               | 17.4    | 20.2    | 32,966    |     |
| ライク              | 11.7    | 13.6  | 21,991    |     | ユー・エス・エス              | 323.6   | 410.4   | 1,038,312 |     |
| A o b a - B B T  | 7.6     | 5.8   | 2,256     |     | 東京個別指導学院              | 37.3    | 43.4    | 18,662    |     |
| エスプール            | 90.4    | 105.1 | 32,581    |     | サイバーエージェント            | 752.9   | 808.5   | 895,009   |     |
| W D B ホールディングス   | 16.1    | 18.7  | 43,365    |     | 楽天グループ                | 1,456.6 | 3,136.5 | 2,768,902 |     |
| ティア              | 11.9    | 9.2   | 4,305     |     | クリーク・アンド・リバー社         | 18.4    | 18.4    | 34,978    |     |
| C D G            | 2.2     | 1.7   | 2,104     |     | S B I グローバルアセットマネジメント | 51.3    | 71.6    | 55,346    |     |
| アドウェイズ           | 43.3    | 50.3  | 21,880    |     | テー・オー・ダブリュー           | 61.7    | 71.7    | 26,672    |     |
| バリューコマース         | 23.7    | 32.1  | 34,956    |     | 山田コンサルティンググループ        | 15.9    | 15.9    | 28,794    |     |
| インフォマート          | 326.6   | 379.8 | 155,718   |     | セントラルスポーツ             | 11.8    | 13.7    | 35,181    |     |
| J P ホールディングス     | 90.5    | 93.5  | 49,835    |     | フルキャストホールディングス        | 30      | 34.9    | 50,709    |     |
| エコナックホールディングス    | 35.3    | 13.4  | 1,929     |     | エン・ジャパン               | 56.9    | 59.5    | 164,458   |     |
| C L ホールディングス     | 8.7     | 8.7   | 10,944    |     | リソルホールディングス           | 2.2     | 1.3     | 7,475     |     |
| プレステージ・インターナショナル | 132.3   | 171.2 | 113,848   |     | テクノプロ・ホールディングス        | 186.1   | 214.2   | 668,732   |     |
| アミューズ            | 17.1    | 22.3  | 34,698    |     | アトラグループ               | 4.6     | 3.6     | 633       |     |
| ドリームインキュベータ      | 9.6     | 12.5  | 35,237    |     | インターワークス              | 5.9     | —       | —         |     |
| クイック             | 24      | 25.4  | 59,131    |     | アイ・アールジャパンホールディングス    | 16.3    | 19      | 25,460    |     |
| T A C            | 11.1    | 7.6   | 1,474     |     | K e e P e r 技研        | 19.4    | 22.6    | 113,452   |     |

| 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 |
|                     | 千株      | 千株      | 千円         |     |                       | 千株      | 千株    | 千円      |     |
| ファーストロジック           | 3.1     | 3.5     | 1,925      |     | Orchestra Holdings    | 6.7     | 7.8   | 7,488   |     |
| 三機サービス              | 3.5     | 2.3     | 3,466      |     | アイモバイル                | 16.3    | 46.4  | 19,070  |     |
| Gunosy              | 25      | 29      | 23,780     |     | キャリアインデックス            | 7       | 5.2   | 1,045   |     |
| デザインワン・ジャパン         | 6.1     | 3.8     | 528        |     | MS-Japan              | 8.3     | 13.3  | 16,132  |     |
| イー・ガーディアン           | 11.9    | 13.8    | 18,671     |     | 船場                    | 3.5     | 2.7   | 3,545   |     |
| リブセンス               | 9.4     | 7.1     | 1,654      |     | ジャパンエレベーターサービスホールディング | 112.1   | 118.5 | 293,287 |     |
| ジャパンマテリアル           | 96.3    | 111.9   | 264,084    |     | フルテック                 | 2.9     | 2.1   | 2,366   |     |
| ベクトル                | 49.4    | 44.9    | 52,577     |     | グリーンズ                 | 7.7     | 5.6   | 14,028  |     |
| ウチヤマホールディングス        | 10.1    | 6.6     | 2,514      |     | ツナググループ・ホールディングス      | 5.7     | 4.3   | 3,147   |     |
| チャーム・ケア・コーポレーション    | 26.2    | 30.5    | 47,153     |     | Game With             | 6.1     | 4.6   | 1,398   |     |
| キャリアリンク             | 11.5    | 13.4    | 36,059     |     | MS & Consulting       | 3       | 2     | 1,214   |     |
| IBJ                 | 19.2    | 27.9    | 15,400     |     | ウェルビー                 | 23.1    | 18.3  | 19,690  |     |
| アサンテ                | 15.5    | 18.1    | 30,661     |     | エル・ティー・エス             | 4       | 4.3   | 9,933   |     |
| バリューHR              | 27.5    | 32      | 42,560     |     | ミダックホールディングス          | 19.1    | 22.2  | 36,519  |     |
| M&Aキャピタルパートナーズ      | 29.1    | 29.6    | 67,310     |     | 日総工産                  | 23.6    | —     | —       |     |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 11.2    | 14.5    | 16,211     |     | キューピーネットホールディングス      | 14.9    | 20.9  | 25,644  |     |
| ERIホールディングス         | 5.7     | 3.9     | 7,047      |     | RPAホールディングス           | 42.6    | 49.7  | 14,562  |     |
| アビスト                | 3.2     | 2.4     | 7,932      |     | スプリックス                | 7       | 4.4   | 3,643   |     |
| シグマクシス・ホールディングス     | 47.7    | 49.3    | 85,338     |     | マネジメントソリューションズ        | 17.3    | 15.7  | 33,111  |     |
| ウィルグループ             | 26.2    | 30.5    | 34,068     |     | プロレド・パートナーズ           | 7.7     | 8.9   | 4,850   |     |
| エスクロー・エージェント・ジャパン   | 21.3    | 17.1    | 2,462      |     | and factory           | 5.9     | 4.5   | 1,413   |     |
| メドピア                | 24.8    | 32.1    | 22,823     |     | テノ・ホールディングス           | 2.5     | 2     | 950     |     |
| レアジョブ               | 3.9     | 2.9     | 2,340      |     | フロンティア・マネジメント         | 10.5    | 9.2   | 15,189  |     |
| リクルートホールディングス       | 2,329.3 | 2,708.5 | 17,605,250 |     | ピアラ                   | 3.3     | 2.7   | 850     |     |
| エラン                 | 41.6    | 48.4    | 42,688     |     | コプロ・ホールディングス          | 4       | 5.1   | 9,190   |     |
| 土木管理総合試験所           | 8.5     | 6.7     | 2,257      |     | ギークス                  | 3.5     | 2     | 956     |     |
| 日本郵政                | 4,123.5 | 4,299   | 6,598,965  |     | アンビスホールディングス          | 26.5    | 39.2  | 93,844  |     |
| ベルシステム24ホールディングス    | 42.2    | 39.3    | 61,386     |     | カーブスホールディングス          | 96.7    | 99.9  | 80,719  |     |
| 鎌倉新書                | 35.7    | 31.2    | 24,367     |     | フォーラムエンジニアリング         | 18.3    | 49.8  | 48,057  |     |
| SMN                 | 4.7     | 2.9     | 1,151      |     | Fast Fitness Japan    | 10.7    | 12.5  | 13,875  |     |
| 一蔵                  | 2.6     | 2       | 1,234      |     | ダイレクトマーケティングミックス      | 37.6    | 37.7  | 11,762  |     |
| グローバルキッズCOMPANY     | 3.1     | 2.5     | 1,702      |     | ボピンズ                  | 4.7     | 5.4   | 8,159   |     |
| エアトリ                | 20.3    | 26.8    | 45,506     |     | LITALICO              | 24.5    | 28.5  | 60,277  |     |
| アトラエ                | 24.7    | 21.6    | 9,568      |     | コンフィデンス・インターワークス      | —       | 1.4   | 2,384   |     |
| ストライク               | 15.5    | 15.5    | 74,322     |     | アドバンテッジリスクマネジメント      | 10.3    | 7.9   | 3,278   |     |
| ソラスト                | 86.7    | 100.8   | 54,028     |     | リログループ                | 175.1   | 183.3 | 225,275 |     |
| セラク                 | 11.2    | 11.2    | 12,532     |     | 東洋                    | 21.9    | 25.5  | 19,915  |     |
| インソース               | 78.1    | 79.4    | 71,301     |     | ID&Eホールディングス          | —       | 22.1  | 93,593  |     |
| ペイカレント・コンサルティング     | 249     | 268.9   | 788,683    |     | ピー・ウイズ                | 5.9     | 7.5   | 16,050  |     |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末   |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    |         | 株数    | 評価額     |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| TREホールディングス        | 66.2    | 70    | 85,820  |
| 人・夢・技術グループ         | 14      | 13.8  | 23,984  |
| NISSOホールディングス      | —       | 31.7  | 27,515  |
| 大栄環境               | 60      | 66.5  | 178,818 |
| 日本管財ホールディングス       | —       | 38.4  | 98,880  |
| M&A総研ホールディングス      | —       | 17.5  | 112,525 |
| エイチ・アイ・エス          | 82.3    | 106.3 | 206,328 |
| ラックランド             | 9.8     | 16.6  | 36,935  |
| 共立メンテナンス           | 53.9    | 57.4  | 411,787 |
| イチネンホールディングス       | 33.3    | 38.7  | 67,183  |
| 建設技術研究所            | 16.2    | 18.8  | 104,340 |
| スペース               | 22.8    | 23.9  | 24,760  |
| 燐ホールディングス          | 13.9    | 34.3  | 36,358  |
| スバル興業              | 1.3     | 11.3  | 30,250  |
| 東京アトール             | 7.5     | 5.7   | 6,509   |
| タナベコンサルティンググループ    | 7.9     | 12.6  | 13,356  |
| ナガワ                | 8.4     | 11.4  | 86,754  |
| 東京都競馬              | 26.3    | 30.6  | 134,946 |
| 常磐興産               | 7.1     | 5.7   | 7,125   |
| カナモト               | 57.6    | 56.7  | 151,105 |
| ニシオホールディングス        | 29.2    | 34    | 131,410 |
| アゴーラ ホスピタリティー グループ | 112.7   | 90.1  | 4,955   |
| トランス・コスマス          | 39.1    | 45.5  | 144,917 |
| 乃村工藝社              | 137.2   | 159.6 | 145,076 |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当期末     |                       |
|--------------------|---------|---------|-----------------------|
|                    |         | 株数      | 評価額                   |
|                    | 千株      | 千株      | 千円                    |
| 藤田観光               | 14      | 14.6    | 109,792               |
| KNT-C Tホールディングス    | 18.8    | 21.8    | 30,411                |
| 日本管財               | 33      | —       | —                     |
| トーカイ               | 27.8    | 32.4    | 69,692                |
| 白洋舎                | 1.9     | 1.5     | 4,306                 |
| セコム                | 320.4   | 372.6   | 4,147,038             |
| セントラル警備保障          | 17      | 19.7    | 52,480                |
| 丹青社                | 61      | 70.9    | 61,683                |
| マイティックグループホールディングス | 125.4   | 131.8   | 397,772               |
| 応用地質               | 29.4    | 34.2    | 75,547                |
| 船井総研ホールディングス       | 65.5    | 76.1    | 196,718               |
| 進学会ホールディングス        | 6.7     | 4.1     | 1,148                 |
| オオバ                | 12.8    | 9.6     | 9,744                 |
| いであ                | 4.5     | 3.5     | 8,267                 |
| 学究社                | 12.6    | 14.6    | 31,287                |
| ペネッセホールディングス       | 117.4   | 122.9   | 317,696               |
| イオンディライト           | 34.8    | 39.3    | 138,336               |
| ナック                | 13.9    | 31      | 18,104                |
| ダイセキ               | 64.2    | 74.7    | 280,498               |
| ステップ               | 12.9    | 13.3    | 26,812                |
| 合計                 | 株数・金額   | 356,823 | 552,676,1,400,111,695 |
|                    | 銘柄数<比率> | 2,162   | <99.4%>               |

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の&lt; &gt;内は、純資産総額に対する評価額の比率。

### 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別      | 当期末   |              |
|----|--------|-------|--------------|
|    |        | 買建額   | 売建額          |
| 国内 | 株式先物取引 | TOPIX | 百万円<br>9,575 |

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2024年3月25日現在)

| 区分            | 分 | 当期末 |           |
|---------------|---|-----|-----------|
|               |   | 数量  | 株         |
| 貸付有価証券＜株式＞総株数 |   |     | 4,006,500 |

## ○投資信託財産の構成

(2024年3月25日現在)

| 項目           | 当期末                 |           |
|--------------|---------------------|-----------|
|              | 評価額                 | 比率        |
| 株式           | 千円<br>1,400,111,695 | %<br>98.0 |
| コール・ローン等、その他 | 28,095,299          | 2.0       |
| 投資信託財産総額     | 1,428,206,994       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年3月25日現在)

| 項目              | 当期末                         |
|-----------------|-----------------------------|
| (A) 資産          | 円                           |
| コレ・ローン等         | 1,427,857,312,196           |
| 株式(評価額)         | 25,523,880,695              |
| 未収入金            | 1,400,111,695,310           |
| 未収配当金           | 198,464,200                 |
| 未収利息            | 1,828,554,601               |
| その他未収益          | 49,236                      |
| 差入委託証拠金         | 12,600,294                  |
| (B) 負債          | 182,067,860                 |
| 未払金             | 18,653,673,727              |
| 未払解約金           | 4,301,999,593               |
| 未払利息            | 3,143,876,446               |
| 受入担保金           | △ 49,010                    |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 11,207,846,698              |
| 元本              | 1,409,203,638,469           |
| 次期繰越損益金         | 417,799,026,755             |
| (D) 受益権総口数      | 991,404,611,714             |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 417,799,026,755口<br>33,729円 |

## ○損益の状況 (2023年3月28日～2024年3月25日)

| 項目               | 当期                |
|------------------|-------------------|
| (A) 配当等収益        | 円                 |
| 受取配当金            | 25,749,274,564    |
| 受取利息             | 25,498,739,108    |
| その他収益金           | 865,911           |
| 支払利息             | 258,094,107       |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 8,424,562       |
| 売買益              | 392,002,229,952   |
| 売買損              | 414,235,168,587   |
| (C) 先物取引等取引損益    | △ 22,232,938,635  |
| 取引益              | 4,186,689,950     |
| 取引損              | 5,471,590,350     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 1,284,900,400   |
| (E) 前期繰越損益金      | 421,938,194,466   |
| (F) 追加信託差損益金     | 486,823,937,205   |
| (G) 解約差損益金       | 331,730,852,401   |
| (H) 計(D+E+F+G)   | △ 249,088,372,358 |
| 次期繰越損益金(H)       | 991,404,611,714   |
|                  | 991,404,611,714   |

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

(注) (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。

## &lt;注記事項&gt;

①期首元本額 368,050,508,229円

期中追加設定元本額 189,492,510,991円

期中一部解約元本額 139,743,992,465円

また、1口当たり純資産額は、期末3,3729円です。

②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

三菱UFJ DC国内株式インデックスファンド

60,261,389,716円

eMAXIS Slim 国内株式（TOPIX）

45,769,439,392円

MUAM 日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）

42,107,182,840円

三菱UFJ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）

41,228,603,366円

三菱UFJ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）

33,431,662,331円

国内株式インデックス・オーブン（ラップ向け）

19,774,641,561円

MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド（適格機関投資家限定）

15,997,652,781円

eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）

9,842,629,411円

つみたて日本株式（TOPIX）

9,374,088,149円

三菱UFJ DCトピックスオーブン

7,975,520,853円

ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）

7,501,458,030円

eMAXIS TOPIXインデックス

6,970,895,688円

三菱UFJ トピックスインデックスオーブン

6,408,022,027円

三菱UFJ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）

5,783,116,677円

三菱UFJ TOPIX・ファンド

5,395,696,129円

つみたて8資産均等バランス

4,899,120,960円

国内株式セレクション（ラップ向け）

4,508,676,412円

三菱UFJ DC年金インデックス（国内株式）

4,307,593,384円

ラップ向けインデックスf 国内株式

4,162,521,320円

三菱UFJ トピックスインデックスファンドVA（適格機関投資家限定）

4,073,317,793円

三菱UFJ DC年金バランス（株式65）

4,036,615,450円

MUAM インデックスファンドTOPIXi（適格機関投資家限定）

3,710,359,900円

三菱UFJ トピックスオーブン（確定拠出年金）

3,638,706,598円

三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定成長型）

3,604,456,152円

三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）

3,577,144,220円

三菱UFJ バランスマネジメント40VA（適格機関投資家限定）

3,509,064,128円

MUKAM 日本株式インデックスファンド2（適格機関投資家限定）

3,427,279,710円

日本株式インデックスファンドS

3,053,696,643円

MUKAM バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）

2,818,566,421円

MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）

2,709,130,896円

三菱UFJ プライムバランス（8資産）（確定拠出年金）

2,707,213,649円

MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）

2,480,373,508円

三菱UFJ バランスマネジメント・イノベーション（株式重視型）

2,014,569,502円

eMAXIS Slim バランス（8資産均等型）

1,904,309,584円

つみたて4資産均等バランス

1,788,869,687円

三菱UFJ DC年金バランス（株式40）

1,692,892,104円

MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）

1,649,565,627円

三菱UFJ <DC>TOPIX・ファンド

1,592,337,026円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）

1,323,355,728円

eMAXIS Slim 全世界株式（3地域均等型）

1,306,655,998円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）

1,289,803,467円

三菱UFJ DCバランス・イノベーション（KAKUSHIN）

1,241,261,360円

三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）

1,231,533,621円

三菱UFJ バランスマネジメントVA 40型（適格機関投資家限定）

1,194,730,419円

eMAXIS 最適化バランス（マイストライカー）

1,086,012,345円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040（確定拠出年金）

1,049,994,537円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）

1,036,749,488円

三菱UFJ トピックスオーブン

959,622,139円

|  |                |
|--|----------------|
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（株式抑制型）                | 946, 644, 595円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付） | 907, 115, 263円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）         | 879, 784, 114円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030（確定拠出年金）         | 814, 541, 328円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（安定型）                   | 774, 900, 721円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）               | 741, 796, 236円 |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                      | 721, 206, 408円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035（確定拠出年金）         | 680, 833, 857円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）         | 641, 911, 321円 |
| ファンド・マネジャー（国内株式）                         | 631, 923, 047円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                  | 605, 548, 444円 |
| MUKAM 日米コアバランス（除く米国株）2022-03（適格機関投資家限定）  | 593, 183, 237円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）         | 588, 271, 646円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式15）                     | 516, 485, 838円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）    | 472, 323, 007円 |
| 三菱UFJ TOPPIX・ファンドVA1                     | 458, 835, 259円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）               | 348, 947, 964円 |
| 三菱UFJ バランスファンド20VA（適格機関投資家限定）            | 323, 786, 179円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）      | 305, 182, 950円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）      | 300, 146, 196円 |
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（債券重視型）                | 278, 943, 505円 |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07（適格機関投資家限定）        | 276, 751, 535円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）         | 274, 697, 620円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）                   | 231, 358, 251円 |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                        | 213, 586, 608円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 50型（適格機関投資家限定）          | 190, 411, 797円 |
| 三菱UFJ バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）            | 189, 058, 842円 |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド                   | 180, 968, 375円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）                | 178, 808, 520円 |
| MUKAM バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）  | 154, 775, 849円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）                     | 153, 620, 932円 |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（保守型）                | 140, 973, 962円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）                | 139, 050, 237円 |
| 日米コアバランス（FOFs用）（適格機関投資家限定）               | 103, 773, 309円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）                 | 99, 154, 817円  |
| MUKAM 米国国債プラス日本株式ファンド2020-07（適格機関投資家限定）  | 92, 748, 992円  |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）                | 85, 902, 173円  |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）               | 85, 069, 311円  |
| 三菱UFJ TOPPIX・ファンドVA                      | 70, 966, 779円  |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）          | 61, 040, 996円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式80）                     | 49, 338, 673円  |
| 三菱UFJ トピックスオーブンVA（適格機関投資家限定）             | 47, 451, 882円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定）  | 40, 598, 807円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定）  | 40, 180, 532円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定）  | 40, 095, 797円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定）  | 39, 980, 785円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定）  | 39, 815, 667円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定）  | 35, 980, 732円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定）  | 35, 950, 680円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定）  | 35, 822, 253円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定）  | 35, 818, 860円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定）  | 35, 768, 349円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定）  | 35, 501, 352円  |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定）  | 35, 434, 968円  |

|  |                  |
|--|------------------|
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)     | 35,329,633円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)     | 35,160,631円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)     | 34,885,307円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)     | 34,844,004円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)     | 34,367,095円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)     | 34,332,624円      |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)                     | 30,030,006円      |
| MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) 2 (適格機関投資家転売制限付) | 26,771,348円      |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)                  | 24,392,144円      |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド                        | 22,276,331円      |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)                      | 14,794,195円      |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)                  | 14,166,250円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                        | 8,463,611円       |
| 三菱UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)               | 7,400,376円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定成長型) VA               | 6,185,847円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (積極型) VA                 | 5,548,310円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                        | 5,168,933円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                        | 2,927,638円       |
| 三菱UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)                  | 2,830,121円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (安定型) VA                 | 2,557,949円       |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070 (確定拠出年金)            | 1,586,659円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド (成長型) VA                 | 1,422,380円       |
| 三菱UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)                  | 1,354,897円       |
| グローバルバランスオーブンV (適格機関投資家限定)                   | 746,960円         |
| マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)                  | 287,191円         |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)               | 207,949円         |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型 (適格機関投資家限定)             | 120,282円         |
| 合計   | 417,799,026,755円 |

## [ お 知 ら せ ]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10月1日)

# 外国株式インデックスマザーファンド

**《第23期》決算日2024年5月13日**

**[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]**

「外国株式インデックスマザーファンド」は、5月13日に第23期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第23期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主要運用対象 | MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。   |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |

## ○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>(配当込み、円換算ベース) |              | 株組入比率   | 株式先物比率 | 投資信託組入比率 | 純資産額              |
|-----------------|----------|----------------------------------|--------------|---------|--------|----------|-------------------|
|                 |          | 期中騰落率                            | 期中騰落率        |         |        |          |                   |
| 19期(2020年5月12日) | 円 26,834 | % △ 3.2                          | % 740,810.97 | % △ 3.4 | % 93.7 | % 4.0    | % 2.4 百万円 449,841 |
| 20期(2021年5月12日) | 39,579   | 47.5                             | 1,089,727.74 | 47.1    | 93.4   | 4.5      | 2.1 974,704       |
| 21期(2022年5月12日) | 43,788   | 10.6                             | 1,203,027.98 | 10.4    | 94.9   | 2.9      | 2.3 1,466,498     |
| 22期(2023年5月12日) | 49,148   | 12.2                             | 1,345,185.94 | 11.8    | 92.9   | 5.1      | 2.0 2,421,812     |
| 23期(2024年5月13日) | 70,682   | 43.8                             | 1,930,303.97 | 43.5    | 96.6   | 1.7      | 1.8 5,475,076     |

(注) MSCIコクサイ・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したもので、また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(注) 外国の指標は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日        | 基<br>準<br>価<br>額 | MSCIコクサイ・インデックス |               | 株<br>組<br>入<br>比<br>率 | 株<br>先<br>物<br>比<br>率 | 投<br>資<br>信<br>託<br>券<br>組<br>入<br>比<br>率 |
|--------------------|------------------|-----------------|---------------|-----------------------|-----------------------|---|
|                    |                  | 騰<br>落<br>率     | (配当込み、円換算ベース) |                       |                       |   |
| (期首)<br>2023年5月12日 | 円<br>49,148      | %<br>—          | 1,345,185.94  | %<br>—                | %<br>92.9             | %<br>5.1                                  |
| 5月末                | 51,311           | 4.4             | 1,403,796.77  | 4.4                   | 94.8                  | 3.5                                       |
| 6月末                | 55,346           | 12.6            | 1,514,642.38  | 12.6                  | 93.7                  | 4.2                                       |
| 7月末                | 56,190           | 14.3            | 1,537,595.03  | 14.3                  | 94.2                  | 3.8                                       |
| 8月末                | 57,170           | 16.3            | 1,563,696.72  | 16.2                  | 95.2                  | 3.2                                       |
| 9月末                | 55,794           | 13.5            | 1,525,543.98  | 13.4                  | 95.7                  | 2.6                                       |
| 10月末               | 53,918           | 9.7             | 1,474,377.61  | 9.6                   | 97.0                  | 1.1                                       |
| 11月末               | 58,148           | 18.3            | 1,589,254.60  | 18.1                  | 94.3                  | 3.7                                       |
| 12月末               | 59,177           | 20.4            | 1,618,877.40  | 20.3                  | 92.6                  | 5.5                                       |
| 2024年1月末           | 62,795           | 27.8            | 1,715,649.43  | 27.5                  | 96.3                  | 1.7                                       |
| 2月末                | 65,829           | 33.9            | 1,798,552.31  | 33.7                  | 95.4                  | 2.8                                       |
| 3月末                | 68,573           | 39.5            | 1,873,700.26  | 39.3                  | 95.6                  | 2.6                                       |
| 4月末                | 69,487           | 41.4            | 1,898,034.99  | 41.1                  | 95.3                  | 2.9                                       |
| (期末)<br>2024年5月13日 | 70,682           | 43.8            | 1,930,303.97  | 43.5                  | 96.6                  | 1.7                                       |
|                    |                  |                 |               |                       |                       | 1.8                                       |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

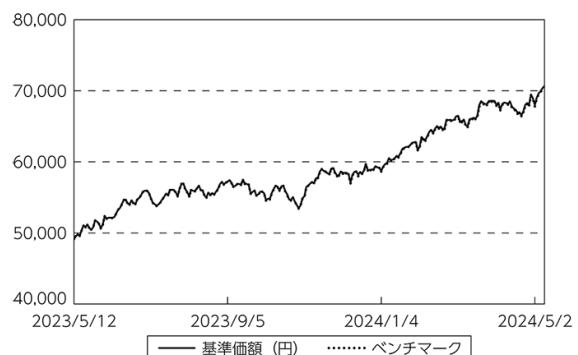
### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ43.8%の上昇となりました。

### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(43.5%)を0.3%上回りました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

## ●基準価額の主な変動要因

### (上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

## ●投資環境について

### ◎外国株式市況

外国株式市況は上昇しました。

- ・世界的なインフレや金融引き締めへの警戒等を受けて外国株式市況は下落する局面もありましたが、その後は主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて外国株式市況は上昇しました。

### ◎為替市況

米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。

- ・為替市況は、期間の初めに比べて円安・米ドル高、円安・ユーロ高となりました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

## ●当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは43.5%の上昇になったため、カイ離は0.3%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

### (主なプラス要因)

- ・その他の要因<sup>\*</sup>によるものです。

<sup>\*</sup>その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

### (主なマイナス要因)

- ・組入要因によるものです。

## ○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2023年5月13日～2024年5月13日)

| 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>（投資信託証券）<br>（先物・オプション） | 円<br>1<br>(0)<br>(0) | %<br>0.002<br>(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>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (b) 有価証券取引税<br>（株式）<br>（投資信託証券）               | 11<br>(11)<br>(0)    | 0.018<br>(0.018)<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>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (c) その他の費用<br>（保管費用）<br>（その他）                 | 12<br>(11)<br>(0)    | 0.020<br>(0.019)<br>(0.000)                 | (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>有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計  | 24                   | 0.040                                       |   |
| 期中の平均基準価額は、59,101円です。                         |                      |   |   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 株式

|        |         | 買付                         |                                  | 売付                       |                                 |
|--------|---------|----------------------------|----------------------------------|--------------------------|---------------------------------|
|        |         | 株数                         | 金額                               | 株数                       | 金額                              |
| 外<br>国 | アメリカ    | 百株<br>833,222<br>( 27,992) | 千アメリカドル<br>9,723,396<br>( 7,871) | 百株<br>60,894<br>( 8,979) | 千アメリカドル<br>450,726<br>( 68,684) |
|        | カナダ     | 98,412<br>( 861)           | 千カナダドル<br>598,280<br>( —)        | 6,442                    | 千カナダドル<br>12,021                |
|        | ユーロ     |                            | 千ユーロ                             |                          | 千ユーロ                            |
|        | ドイツ     | 56,538<br>( —)             | 290,797<br>(△ 2,196)             | 6,121                    | 10,021                          |
|        | イタリア    | 85,840<br>( —)             | 66,018<br>(△ 4)                  | 7,623                    | 5,612                           |
|        | フランス    | 56,385<br>( —)             | 371,690<br>(△ 858)               | 6,090                    | 16,219                          |
|        | オランダ    | 47,986<br>( 5,590)         | 221,695<br>( 5,060)              | 11,336                   | 18,392                          |
|        | スペイン    | 98,376<br>( 48,319)        | 85,263<br>(△ 4,079)              | 59,336                   | 8,210                           |
|        | ベルギー    | 4,033<br>( 291)            | 26,654<br>( —)                   | 411                      | 1,630                           |
|        | オーストリア  | 1,782                      | 7,119                            | 162                      | 491                             |
|        | ルクセンブルク | 2,816                      | 6,907                            | 4,059                    | 994                             |
|        | フィンランド  | 40,652<br>( 1,768)         | 46,608<br>( —)                   | 2,165                    | 1,095                           |
|        | アイルランド  | 10,621                     | 20,433                           | 157<br>( 3,713)          | 1,029<br>( 28,176)              |
|        | ポルトガル   | 8,909                      | 5,805                            | —                        | —                               |
|        | スイス     | 502<br>( —)                | 4,807<br>(△ 273)                 | —                        | —                               |
|        | バミューダ   | 2,671                      | 1,391                            | —                        | —                               |
|        | イギリス    | 608,361<br>( 3,473)        | 千イギリスポンド<br>427,509<br>( 22,943) | 17,260                   | 千イギリスポンド<br>6,946               |
|        | スイス     | 36,079<br>( 1,638)         | 千スイスフラン<br>329,390<br>(△ 970)    | 13,947                   | 千スイスフラン<br>16,250               |
|        | スウェーデン  | 77,297<br>( 6,233)         | 千スウェーデンクローネ<br>1,274,453<br>( —) | 28,251                   | 千スウェーデンクローネ<br>282,746          |
|        | ノルウェー   | 14,192<br>( —)             | 千ノルウェークローネ<br>244,191<br>(△ 117) | 2,344                    | 千ノルウェークローネ<br>30,768            |

|        |          | 買付                       |                                    | 売付                  |                                   |
|--------|----------|--------------------------|------------------------------------|---------------------|-----------------------------------|
|        |          | 株数                       | 金額                                 | 株数                  | 金額                                |
| 外<br>国 | デンマーク    | 百株<br>14,177<br>( 7,297) | 千デンマーククローネ<br>858,629<br>( 27,989) | 百株<br>783<br>( 526) | 千デンマーククローネ<br>50,248<br>( 27,989) |
|        | オーストラリア  | 168,426<br>(△ 1,882)     | 千オーストラリアドル<br>400,014<br>( — )     | 11,220              | 千オーストラリアドル<br>16,187              |
|        | ニュージーランド | 12,982                   | 千ニュージーランドドル<br>10,539              | —                   | 千ニュージーランドドル<br>—                  |
|        | 香港       | 159,130                  | 千香港ドル<br>572,138                   | 29,263              | 千香港ドル<br>45,733                   |
|        | シンガポール   | 68,467<br>(△149,035)     | 千シンガポールドル<br>55,173<br>( — )       | 3,769<br>( — )      | 千シンガポールドル<br>3,489<br>( 93)       |
|        | イスラエル    | 13,153                   | 千イスラエルシェケル<br>48,244               | 6,321               | 千イスラエルシェケル<br>10,013              |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )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。

## 投資信託証券

| 銘柄                           | 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 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 266   | 4,799   | —   | —       |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 45    | 5,514   | —   | —       |
| PROLOGIS INC                 | 216   | 26,816  | —   | —       |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 35    | 3,759   | —   | —       |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 74    | 10,026  | —   | —       |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 46    | 3,087   | 8   | 530     |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 15    | 3,711   | —   | —       |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 76    | 11,194  | —   | —       |
| WELLTOWER INC                | 155   | 13,713  | —   | —       |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 57    | 3,456   | 11  | 545     |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | —     | —       | 177 | 1,466   |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 21    | 2,984   | —   | —       |
| REALTY INCOME CORP           | 268   | 14,873  | —   | —       |
| REGENCY CENTERS CORP         | 36    | 2,315   | —   | —       |
| SUN COMMUNITIES INC          | 31    | 3,897   | —   | —       |
| UDR INC                      | 69    | 2,670   | —   | —       |
| VENTAS INC                   | 102   | 4,746   | —   | —       |
| WEYERHAEUSER CO              | 171   | 5,630   | —   | —       |
| AMERICAN TOWER CORP          | 108   | 21,053  | —   | —       |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | —     | —       | 140 | 2,151   |
| WP CAREY INC                 | 47    | 3,012   | —   | —       |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 62    | 2,160   | —   | —       |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 52    | 2,494   | —   | —       |
| IRON MOUNTAIN INC            | 70    | 4,673   | —   | —       |
| EQUINIX INC                  | 22    | 17,876  | —   | —       |
| CROWN CASTLE INC             | 103   | 11,087  | —   | —       |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 81    | 5,021   | —   | —       |
| INVITATION HOMES INC         | 151   | 5,133   | —   | —       |
| VICI PROPERTIES INC          | 261   | 7,979   | —   | —       |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 23    | 5,115   | —   | —       |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY    | —     | —       | 5   | 63      |
|                              | ( 5)  | ( —)    |     |         |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 134   | 2,435   | —   | —       |
| PUBLIC STORAGE               | 37    | 10,809  | —   | —       |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 78    | 10,456  | 5   | 546     |
| KIMCO REALTY CORP            | 182   | 3,483   | —   | —       |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 32    | 5,800   | —   | —       |
| 小計                           | 3,144 | 241,790 | 349 | 5,304   |
|                              | ( 5)  | ( —)    |     |         |
| カナダ                          |       | 千カナダドル  |     | 千カナダドル  |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 12    | 649     | —   | —       |
| 小計                           | 12    | 649     | —   | —       |

| 銘柄                                     | 買付               |                 | 売付  |            |
|--|------------------|-----------------|-----|------------|
|  | 口数               | 金額              | 口数  | 金額         |
| ユーロ                                    | 千口               | 千ユーロ            | 千口  | 千ユーロ       |
| フランス                                   |                  |                 |     |            |
| GECINA SA                              | 8                | 872             | —   | —          |
| KLEPIERRE                              | 57               | 1,393           | —   | —          |
| ( — )                                  | (△ 60)           |                 |     |            |
| COVIVIO                                | 13               | 581             | —   | —          |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE           | 29               | 1,692           | —   | —          |
| 小計                                     | 108<br>( — )     | 4,540<br>(△ 60) | —   | —          |
| ベルギー                                   |                  |                 |     |            |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA                 | 48               | 1,211           | —   | —          |
| 小計                                     | 48               | 1,211           | —   | —          |
| ユーロ 計                                  | 156<br>( — )     | 5,752<br>(△ 60) | —   | —          |
| イギリス                                   |                  | 千イギリスポンド        |     | 千イギリスポンド   |
| BRITISH LAND CO PLC                    | —                | —               | 317 | 1,025      |
| LAND SECURITIES GROUP PLC              | 101              | 581             | —   | —          |
| SEGRO PLC                              | 323              | 2,769           | —   | —          |
| 小計                                     | 424              | 3,350           | 317 | 1,025      |
| オーストラリア                                |                  | 千オーストラリアドル      |     | 千オーストラリアドル |
| VICINITY CENTRES                       | 528              | 986             | —   | —          |
| SCENTRE GROUP                          | 1,800            | 5,456           | —   | —          |
| DEXUS/AU                               | 190              | 1,454           | —   | —          |
| GPT GROUP                              | 234              | 986             | —   | —          |
| MIRVAC GROUP                           | 693              | 1,409           | —   | —          |
| STOCKLAND                              | 504              | 2,233           | —   | —          |
| GOODMAN GROUP                          | 378              | 9,659           | —   | —          |
| 小計                                     | 4,329            | 22,187          | —   | —          |
| 香港                                     |                  | 千香港ドル           |     | 千香港ドル      |
| LINK REIT                              | 470              | 18,223          | —   | —          |
| 小計                                     | 470              | 18,223          | —   | —          |
| シンガポール                                 |                  | 千シンガポールドル       |     | 千シンガポールドル  |
| KEPPEL REIT                            | —<br>( 116 )     | —<br>( 93 )     | 116 | 93         |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST                | —                | —               | 45  | 48         |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 441<br>( — )     | 732<br>(△ 53)   | —   | —          |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST           | 1,571<br>( — )   | 2,330<br>(△ 16) | 439 | 724        |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,097<br>( — )   | 2,158<br>(△ 10) | —   | —          |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT               | 1,094<br>( — )   | 3,064<br>(△ 42) | —   | —          |
| 小計                                     | 4,203<br>( 116 ) | 8,285<br>(△ 29) | 601 | 866        |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 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>2,000,279 | 百万円<br>2,069,787 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○株式売買比率

(2023年5月13日～2024年5月13日)

### 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       | 2,027,437,449千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 3,476,070,858千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.58            |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年5月13日～2024年5月13日)

### 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B |      | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |     | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|------|---------------|-----------|--------------------|-----|---------------|
|        |           | 百万円                | 百万円  |               |           | %                  | 百万円 | 百万円           |
| 為替直物取引 | 1,861,388 | 1,660,833          | 89.2 | 140,109       | 119,614   | 85.4               |     |               |

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年5月13日現在)

## 外国株式

| 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 | 外貨建額<br>邦貨換算額 |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株     | 千アメリカドル     | 千円            |                        |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 2,148   | 3,326  | 80,591      | 12,570,647    | 金融サービス                 |
| ABBOTT LABORATORIES          | 5,891   | 9,886  | 103,549     | 16,151,720    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 997     | 1,680  | 25,168      | 3,925,715     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    | 1,400   | 2,306  | 56,947      | 8,882,654     | 商業・専門サービス              |
| AES CORP                     | 2,363   | 3,539  | 7,058       | 1,100,938     | 公益事業                   |
| AFLAC INC                    | 2,004   | 3,196  | 27,515      | 4,291,890     | 保険                     |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 2,516   | 4,061  | 32,538      | 5,075,395     | 保険                     |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 5,452   | 9,191  | 139,634     | 21,780,123    | 半導体・半導体製造装置            |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 2,130   | 3,570  | 109,380     | 17,061,096    | ソフトウェア・サービス            |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 749     | 1,239  | 31,051      | 4,843,360     | 素材                     |
| ELEVANCE HEALTH INC          | 807     | 1,318  | 71,070      | 11,085,644    | ヘルスケア機器・サービス           |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       | 4,818   | 8,234  | 60,679      | 9,464,790     | ヘルスケア機器・サービス           |
| BAXTER INTERNATIONAL INC     | 1,740   | 2,771  | 9,892       | 1,542,990     | ヘルスケア機器・サービス           |
| BOEING CO/THE                | 1,915   | 3,234  | 57,739      | 9,006,138     | 資本財                    |
| BECTON DICKINSON AND CO      | 955     | 1,632  | 38,464      | 5,999,751     | ヘルスケア機器・サービス           |
| BEST BUY CO INC              | 703     | 1,022  | 7,587       | 1,183,466     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      | 7,187   | 11,477 | 51,579      | 8,045,416     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                | 507     | 849    | 67,652      | 10,552,424    | 金融サービス                 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC   | 14,219  | 23,901 | 96,560      | 15,061,542    | 電気通信サービス               |
| BALL CORP                    | 1,108   | 1,816  | 12,561      | 1,959,379     | 素材                     |
| ALLSTATE CORP                | 897     | 1,504  | 25,978      | 4,052,129     | 保険                     |
| AVERY DENNISON CORP          | 278     | 474    | 10,695      | 1,668,318     | 素材                     |
| CHUBB LTD                    | 1,402   | 2,321  | 59,172      | 9,229,738     | 保険                     |
| ANALOG DEVICES INC           | 1,719   | 2,825  | 58,536      | 9,130,500     | 半導体・半導体製造装置            |
| AUTOZONE INC                 | 64      | 95     | 28,532      | 4,450,569     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| CVS HEALTH CORP              | 4,446   | 7,229  | 40,352      | 6,294,252     | ヘルスケア機器・サービス           |
| CORNING INC                  | 2,710   | 4,751  | 16,234      | 2,532,269     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| JPMORGAN CHASE & CO          | 9,920   | 16,422 | 326,422     | 50,915,378    | 銀行                     |
| CHARLES RIVER LABORATORIES   | 181     | 298    | 6,800       | 1,060,810     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CATERPILLAR INC              | 1,760   | 2,900  | 102,894     | 16,049,471    | 資本財                    |
| COCA-COLA CO/THE             | 13,892  | 23,292 | 147,351     | 22,983,860    | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   | 1,298   | 2,116  | 30,174      | 4,706,668     | 金融サービス                 |
| CAMPBELL SOUP CO             | 674     | 1,203  | 5,530       | 862,653       | 食品・飲料・タバコ              |
| CSX CORP                     | 7,115   | 11,317 | 38,909      | 6,069,071     | 運輸                     |
| CHEVRON CORP                 | 6,208   | 10,157 | 168,425     | 26,270,962    | エネルギー                  |
| CONOCOPHILLIPS               | 4,204   | 6,748  | 82,276      | 12,833,499    | エネルギー                  |
| CME GROUP INC                | 1,216   | 2,018  | 42,082      | 6,564,084     | 金融サービス                 |
| CARDINAL HEALTH INC          | 895     | 1,367  | 13,615      | 2,123,699     | ヘルスケア機器・サービス           |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 2,684   | 4,365  | 41,511      | 6,474,968     | 家庭用品・パーソナル用品           |
| DOMINION ENERGY INC          | 2,822   | 4,683  | 24,854      | 3,876,835     | 公益事業                   |
| DEVON ENERGY CORP            | 2,126   | 3,743  | 18,764      | 2,926,930     | エネルギー                  |
| DEERE & CO                   | 969     | 1,516  | 61,862      | 9,649,270     | 資本財                    |
| DANAHER CORP                 | 2,338   | 4,006  | 101,522     | 15,835,404    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WALT DISNEY CO/THE           | 6,165   | 10,445 | 110,504     | 17,236,463    | メディア・娯楽                |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 417     | 696    | 10,326      | 1,610,797     | 消費者サービス                |
| DUKE ENERGY CORP             | 2,602   | 4,403  | 45,211      | 7,052,082     | 公益事業                   |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |         |            |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数     | 株数      | 評価額        |        |                        |  |
|                              |         |        |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株     | 百株      | 千アメリカドル    | 千円     |                        |  |
| DR HORTON INC                | 1,103   | 1,698  | 25,464  | 3,972,016  |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| DICK'S SPORTING GOODS INC    | —       | 335    | 6,581   | 1,026,531  |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| TARGET CORP                  | 1,555   | 2,601  | 42,439  | 6,619,673  |        | 生活必需品流通・小売り            |  |
| DAVITA INC                   | 166     | 295    | 4,061   | 633,536    |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| DOVER CORP                   | 491     | 817    | 15,170  | 2,366,276  |        | 資本財                    |  |
| DTE ENERGY COMPANY           | 636     | 1,176  | 13,589  | 2,119,722  |        | 公益事業                   |  |
| EXXON MOBIL CORP             | 13,919  | 25,480 | 300,573 | 46,883,494 |        | エネルギー                  |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 2,084   | 3,498  | 30,335  | 4,731,761  |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| EOG RESOURCES INC            | 1,980   | 3,275  | 42,614  | 6,646,951  |        | エネルギー                  |  |
| EMERSON ELECTRIC CO          | 1,999   | 3,161  | 36,529  | 5,697,945  |        | 資本財                    |  |
| EXELON CORP                  | 3,358   | 5,539  | 20,866  | 3,254,804  |        | 公益事業                   |  |
| ECOLAB INC                   | 866     | 1,475  | 34,462  | 5,375,447  |        | 素材                     |  |
| EQUIFAX INC                  | 418     | 728    | 17,603  | 2,745,862  |        | 商業・専門サービス              |  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A  | 782     | 1,286  | 16,986  | 2,649,480  |        | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| EATON CORP PLC               | 1,341   | 2,238  | 73,996  | 11,542,016 |        | 資本財                    |  |
| EDISON INTERNATIONAL         | 1,319   | 2,153  | 16,129  | 2,515,915  |        | 公益事業                   |  |
| ENTERGY CORP                 | 666     | 1,158  | 12,968  | 2,022,887  |        | 公益事業                   |  |
| EVEREST GROUP LTD            | 127     | 228    | 8,751   | 1,365,056  |        | 保険                     |  |
| NEXTERA ENERGY INC           | 6,719   | 11,688 | 86,252  | 13,453,740 |        | 公益事業                   |  |
| FEDEX CORP                   | 836     | 1,357  | 36,060  | 5,624,694  |        | 運輸                     |  |
| FORD MOTOR CO                | 13,346  | 22,345 | 26,792  | 4,179,141  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| FIRST HORIZON CORP           | 1,735   | —      | —       | —          |        | 銀行                     |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 957     | 1,527  | 3,625   | 565,453    |        | 金融サービス                 |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 123     | 219    | 9,637   | 1,503,304  |        | 金融サービス                 |  |
| FIRSTENERGY CORP             | 1,779   | 3,139  | 12,539  | 1,955,908  |        | 公益事業                   |  |
| FREEPORT-MCMORAN INC         | 4,841   | 8,126  | 41,924  | 6,559,377  |        | 素材                     |  |
| GENERAL MILLS INC            | 2,007   | 3,135  | 22,170  | 3,458,137  |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GENERAL DYNAMICS CORP        | 788     | 1,304  | 38,675  | 6,032,625  |        | 資本財                    |  |
| WW GRAINGER INC              | 155     | 252    | 24,247  | 3,782,186  |        | 資本財                    |  |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 3,693   | 6,201  | 101,312 | 15,802,712 |        | 資本財                    |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC          | 917     | 1,514  | 16,540  | 2,580,018  |        | 金融サービス                 |  |
| GENUINE PARTS CO             | 481     | 837    | 13,003  | 2,028,221  |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| GRACO INC                    | 561     | 888    | 7,425   | 1,158,264  |        | 資本財                    |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC      | 1,145   | 1,860  | 84,584  | 13,193,463 |        | 金融サービス                 |  |
| HALLIBURTON CO               | 2,978   | 5,006  | 18,559  | 2,894,986  |        | エネルギー                  |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 2,272   | 3,750  | 76,099  | 11,869,962 |        | 資本財                    |  |
| HP INC                       | 3,420   | 5,280  | 15,694  | 2,448,084  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP  | 1,108   | 1,673  | 17,050  | 2,659,612  |        | 保険                     |  |
| HERSHEY CO/THE               | 498     | 818    | 16,751  | 2,612,885  |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HOME DEPOT INC               | 3,446   | 5,667  | 196,332 | 30,624,016 |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| HASBRO INC                   | 425     | 693    | 4,164   | 649,631    |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| TRANX TECHNOLOGIES PLC       | 778     | 1,282  | 42,573  | 6,640,658  |        | 資本財                    |  |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 3,056   | 5,199  | 86,912  | 13,556,609 |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| INTERNATIONAL PAPER CO       | 1,116   | 1,973  | 7,613   | 1,187,546  |        | 素材                     |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS          | 1,036   | 1,681  | 42,091  | 6,565,391  |        | 資本財                    |  |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 1,287   | 2,390  | 7,447   | 1,161,704  |        | メディア・娯楽                |  |
| IDEX CORP                    | 244     | 399    | 9,025   | 1,407,812  |        | 資本財                    |  |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES    | 835     | 1,459  | 14,186  | 2,212,845  |        | 素材                     |  |
| JOHNSON & JOHNSON            | 8,839   | 13,685 | 205,162 | 32,001,313 |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| JABIL INC                    | —       | 665    | 7,852   | 1,224,836  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| KELLANOVA                    | 848     | 1,552  | 9,602   | 1,497,725  |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP          | 1,142   | 1,856  | 25,365  | 3,956,581  |        | 家庭用品・パーソナル用品           |  |

| 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         |                        |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 4,615   | 7,657  | 54,524  | 8,504,758  | 8,504,758  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KROGER CO                    | 2,314   | 3,876  | 21,668  | 3,379,785  | 3,379,785  | 生活必需品流通・小売り            |  |
| ELI LILLY & CO               | 2,731   | 4,587  | 348,669 | 54,385,509 | 54,385,509 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 290     | 507    | 10,547  | 1,645,143  | 1,645,143  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        | 503     | 705    | 1,929   | 300,909    | 300,909    | 運輸                     |  |
| LENNAR CORP-A                | 838     | 1,427  | 23,255  | 3,627,340  | 3,627,340  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| LOWE'S COS INC               | 2,043   | 3,285  | 77,207  | 12,042,876 | 12,042,876 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| BATH & BODY WORKS INC        | 841     | 1,303  | 6,198   | 966,897    | 966,897    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 1,182   | 2,259  | 10,513  | 1,639,914  | 1,639,914  | 消費者サービス                |  |
| LOCKHEED MARTIN CORP         | 797     | 1,251  | 58,657  | 9,149,447  | 9,149,447  | 資本財                    |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC     | 114     | 170    | 8,425   | 1,314,280  | 1,314,280  | 資本財                    |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 905     | 1,453  | 34,962  | 5,453,435  | 5,453,435  | 消費者サービス                |  |
| MCDONALD'S CORP              | 2,473   | 4,128  | 113,534 | 17,709,080 | 17,709,080 | 消費者サービス                |  |
| S&P GLOBAL INC               | 1,125   | 1,847  | 79,736  | 12,437,222 | 12,437,222 | 金融サービス                 |  |
| MEDTRONIC PLC                | 4,492   | 7,590  | 62,878  | 9,807,833  | 9,807,833  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| MERCK & CO. INC.             | 8,572   | 14,422 | 187,582 | 29,259,044 | 29,259,044 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| MICRON TECHNOLOGY INC        | 3,677   | 6,283  | 76,178  | 11,882,301 | 11,882,301 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| 3M CO                        | 1,869   | 3,122  | 30,893  | 4,818,778  | 4,818,778  | 資本財                    |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 564     | 912    | 33,111  | 5,164,790  | 5,164,790  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 1,040   | 1,549  | 6,285   | 980,401    | 980,401    | 消費者サービス                |  |
| MASCO CORP                   | 739     | 1,358  | 9,824   | 1,532,454  | 1,532,454  | 資本財                    |  |
| M & T BANK CORP              | 601     | 930    | 14,291  | 2,229,181  | 2,229,181  | 銀行                     |  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 1,673   | 2,760  | 56,734  | 8,849,475  | 8,849,475  | 保険                     |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 192     | 315    | 11,194  | 1,746,042  | 1,746,042  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| MOHAWK INDUSTRIES INC        | 165     | —      | —       | —          | —          | 耐久消費財・アパレル             |  |
| MORGAN STANLEY               | 4,285   | 7,032  | 69,113  | 10,780,361 | 10,780,361 | 金融サービス                 |  |
| MCKESSON CORP                | 479     | 764    | 42,831  | 6,680,934  | 6,680,934  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| METLIFE INC                  | 2,257   | 3,634  | 26,433  | 4,123,040  | 4,123,040  | 保険                     |  |
| MOODY'S CORP                 | 557     | 929    | 37,206  | 5,803,536  | 5,803,536  | 金融サービス                 |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 784     | 1,304  | 30,050  | 4,687,211  | 4,687,211  | 運輸                     |  |
| BANK OF AMERICA CORP         | 24,429  | 40,535 | 155,859 | 24,310,970 | 24,310,970 | 銀行                     |  |
| NISOURCE INC                 | 1,357   | 2,607  | 7,477   | 1,166,301  | 1,166,301  | 公益事業                   |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 494     | 822    | 39,060  | 6,092,710  | 6,092,710  | 資本財                    |  |
| NEWMONT CORP                 | 2,696   | 6,758  | 28,715  | 4,479,111  | 4,479,111  | 素材                     |  |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS  | 850     | 1,485  | 11,309  | 1,764,066  | 1,764,066  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| MARKEL GROUP INC             | 45      | 72     | 12,023  | 1,875,379  | 1,875,379  | 保険                     |  |
| NUCOR CORP                   | 870     | 1,385  | 24,181  | 3,771,809  | 3,771,809  | 素材                     |  |
| NEWELL BRANDS INC            | 1,306   | —      | —       | —          | —          | 耐久消費財・アパレル             |  |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    | 2,455   | 3,729  | 23,706  | 3,697,763  | 3,697,763  | エネルギー                  |  |
| OMNICOM GROUP                | 692     | 1,132  | 10,850  | 1,692,395  | 1,692,395  | メディア・娯楽                |  |
| PEPSICO INC                  | 4,658   | 7,807  | 140,370 | 21,894,934 | 21,894,934 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    | 308     | 552    | 9,904   | 1,544,847  | 1,544,847  | 素材                     |  |
| ALTRIA GROUP INC             | 6,060   | 10,083 | 45,273  | 7,061,771  | 7,061,771  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE      | 8,013   | 13,383 | 223,306 | 34,831,379 | 34,831,379 | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 1,367   | 2,293  | 36,140  | 5,637,146  | 5,637,146  | 銀行                     |  |
| PFIZER INC                   | 18,986  | 32,283 | 90,425  | 14,104,608 | 14,104,608 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 1,248   | 2,119  | 25,187  | 3,928,737  | 3,928,737  | 保険                     |  |
| PULTEGROUP INC               | 763     | 1,245  | 14,659  | 2,286,517  | 2,286,517  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 433     | 725    | 40,684  | 6,345,916  | 6,345,916  | 資本財                    |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 761     | —      | —       | —          | —          | エネルギー                  |  |
| CITIGROUP INC                | 6,558   | 10,679 | 67,845  | 10,582,605 | 10,582,605 | 銀行                     |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 828     | 1,421  | 11,936  | 1,861,791  | 1,861,791  | 保険                     |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末) | 当期末    |         |            |        | 業種等                    |  |
|--------------------------------|---------|--------|---------|------------|--------|------------------------|--|
|                                |         | 株数     | 株数      | 評価額        |        |                        |  |
|                                |         |        |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (アメリカ)                         |         | 百株     | 百株      | 千アメリカドル    | 千円     |                        |  |
| PPG INDUSTRIES INC             | 800     | 1,365  | 18,474  | 2,881,643  |        | 素材                     |  |
| PENTAIR PLC                    | 535     | 902    | 7,523   | 1,173,509  |        | 資本財                    |  |
| P G & E CORP                   | 5,060   | 11,583 | 20,653  | 3,221,572  |        | 公益事業                   |  |
| PPL CORP                       | 2,406   | 4,216  | 12,287  | 1,916,612  |        | 公益事業                   |  |
| PROGRESSIVE CORP               | 1,976   | 3,277  | 70,720  | 11,030,919 |        | 保険                     |  |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP   | 1,708   | 2,723  | 20,152  | 3,143,452  |        | 公益事業                   |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD    | 793     | 1,389  | 19,591  | 3,055,895  |        | 消費者サービス                |  |
| REPUBLIC SERVICES INC          | 759     | 1,211  | 22,916  | 3,574,588  |        | 商業・専門サービス              |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP         | 3,040   | 5,267  | 10,446  | 1,629,408  |        | 銀行                     |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC         | 358     | 613    | 32,114  | 5,009,158  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC         | 2,149   | 3,545  | 10,531  | 1,642,675  |        | 公益事業                   |  |
| ROBERT HALF INC                | 383     | 578    | 4,091   | 638,200    |        | 商業・専門サービス              |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC        | 392     | 663    | 18,144  | 2,830,177  |        | 資本財                    |  |
| SCHLUMBERGER LTD               | 4,800   | 8,065  | 39,117  | 6,101,491  |        | エネルギー                  |  |
| STRYKER CORP                   | 1,148   | 1,916  | 63,362  | 9,883,298  |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP          | 4,913   | 8,434  | 64,194  | 10,013,002 |        | 金融サービス                 |  |
| SEMPRA                         | 1,062   | 3,646  | 28,140  | 4,389,406  |        | 公益事業                   |  |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE        | 832     | 1,394  | 44,755  | 6,980,909  |        | 素材                     |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC     | 492     | 856    | 7,698   | 1,200,766  |        | 資本財                    |  |
| TRAVELERS COS INC/THE          | 791     | 1,295  | 28,315  | 4,416,604  |        | 保険                     |  |
| SOUTHERN CO/THE                | 3,678   | 6,076  | 47,483  | 7,406,511  |        | 公益事業                   |  |
| AT&T INC                       | 24,114  | 40,687 | 69,860  | 10,896,911 |        | 電気通信サービス               |  |
| WESTERN DIGITAL CORP           | 1,047   | 1,882  | 13,475  | 2,101,949  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| STATE STREET CORP              | 1,260   | 1,739  | 13,323  | 2,078,182  |        | 金融サービス                 |  |
| SYSCO CORP                     | 1,711   | 2,805  | 21,367  | 3,332,869  |        | 生活必需品流通・小売り            |  |
| SEALED AIR CORP                | 494     | —      | —       | —          |        | 素材                     |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC          | 3,067   | 5,153  | 96,405  | 15,037,253 |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| TERADYNE INC                   | 529     | 858    | 10,556  | 1,646,563  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| GLOBE LIFE INC                 | 302     | 497    | 4,300   | 670,727    |        | 保険                     |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 2,323   | 3,919  | 25,710  | 4,010,343  |        | 資本財                    |  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC   | 1,326   | 2,204  | 130,708 | 20,387,920 |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| TEXTRON INC                    | 681     | 1,134  | 10,042  | 1,566,408  |        | 資本財                    |  |
| UNION PACIFIC CORP             | 2,079   | 3,468  | 85,818  | 13,386,024 |        | 運輸                     |  |
| RTX CORP                       | 4,970   | 8,202  | 87,204  | 13,602,176 |        | 資本財                    |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC         | 3,160   | 5,264  | 269,983 | 42,111,976 |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| US BANCORP                     | 4,774   | 8,805  | 36,852  | 5,748,289  |        | 銀行                     |  |
| MARATHON OIL CORP              | 2,173   | 3,550  | 9,441   | 1,472,664  |        | エネルギー                  |  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B     | 2,468   | 4,059  | 59,826  | 9,331,779  |        | 運輸                     |  |
| VALERO ENERGY CORP             | 1,299   | 1,886  | 29,460  | 4,595,294  |        | エネルギー                  |  |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B       | 2,175   | 3,172  | 4,139   | 645,689    |        | メディア・娯楽                |  |
| VF CORP                        | 1,216   | —      | —       | —          |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| VULCAN MATERIALS CO            | 462     | 748    | 20,351  | 3,174,450  |        | 素材                     |  |
| WILLIAMS COS INC               | 4,120   | 6,997  | 27,739  | 4,326,877  |        | エネルギー                  |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 2,551   | 3,878  | 6,666   | 1,039,884  |        | 生活必需品流通・小売り            |  |
| WEC ENERGY GROUP INC           | 1,081   | 1,785  | 15,252  | 2,379,058  |        | 公益事業                   |  |
| WALMART INC                    | 5,043   | 25,190 | 152,353 | 23,764,160 |        | 生活必需品流通・小売り            |  |
| WELLS FARGO & CO               | 12,890  | 20,649 | 127,802 | 19,934,659 |        | 銀行                     |  |
| WASTE MANAGEMENT INC           | 1,381   | 2,303  | 48,707  | 7,597,349  |        | 商業・専門サービス              |  |
| WATERS CORP                    | 193     | 351    | 12,350  | 1,926,398  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WHIRLPOOL CORP                 | 204     | —      | —       | —          |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| XCEL ENERGY INC                | 1,853   | 3,226  | 17,891  | 2,790,743  |        | 公益事業                   |  |
| KEYCORP                        | 3,060   | 4,887  | 7,370   | 1,149,660  |        | 銀行                     |  |

| 銘柄                          | 期首(前期末) | 当期末    |           |             |                        | 業種等 |  |
|-----------------------------|---------|--------|-----------|-------------|------------------------|-----|--|
|                             |         | 株数     | 株数        | 評価額         |                        |     |  |
|                             |         |        |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (アメリカ)                      |         | 百株     | 百株        | 千アメリカドル     | 千円                     |     |  |
| CARMAX INC                  | 499     | 845    | 6,063     | 945,819     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC  | 726     | 1,175  | 14,258    | 2,223,989   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| YUM! BRANDS INC             | 948     | 1,595  | 21,950    | 3,423,907   | 消費者サービス                |     |  |
| TJX COMPANIES INC           | 3,920   | 6,403  | 63,268    | 9,868,580   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| CLOROX COMPANY              | 405     | 702    | 10,073    | 1,571,218   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| CELANESE CORP               | 355     | 555    | 8,700     | 1,357,034   | 素材                     |     |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC      | 926     | 1,557  | 44,782    | 6,985,127   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CARNIVAL CORP               | 3,229   | 5,252  | 7,579     | 1,182,322   | 消費者サービス                |     |  |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 2,011   | 3,364  | 25,113    | 3,917,137   | 金融サービス                 |     |  |
| CONAGRA BRANDS INC          | 1,589   | 2,846  | 8,861     | 1,382,196   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC     | 1,198   | 2,021  | 19,754    | 3,081,284   | 公益事業                   |     |  |
| FIFTH THIRD BANCORP         | 2,367   | 3,940  | 15,279    | 2,383,365   | 銀行                     |     |  |
| INTEL CORP                  | 13,962  | 24,006 | 71,658    | 11,177,363  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| CISCO SYSTEMS INC           | 13,889  | 23,045 | 110,756   | 17,275,840  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| CINTAS CORP                 | 308     | 507    | 35,531    | 5,542,234   | 商業・専門サービス              |     |  |
| COSTCO WHOLESALE CORP       | 1,495   | 2,522  | 198,545   | 30,969,058  | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| APPLIED MATERIALS INC       | 2,904   | 4,723  | 99,072    | 15,453,323  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| ELECTRONIC ARTS INC         | 933     | 1,467  | 18,660    | 2,910,698   | メディア・娯楽                |     |  |
| TYSON FOODS INC-CL A        | 990     | 1,659  | 9,901     | 1,544,368   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| GEN DIGITAL INC             | 2,121   | 2,920  | 6,851     | 1,068,769   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| ROSS STORES INC             | 1,182   | 1,952  | 26,061    | 4,065,000   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC    | 1,856   | 3,097  | 28,338    | 4,420,276   | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| NIKE INC -CL B              | 4,259   | 6,951  | 63,213    | 9,860,081   | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| EXACT SCIENCES CORP         | 566     | 1,034  | 5,533     | 863,068     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| AMGEN INC                   | 1,803   | 3,053  | 94,706    | 14,772,315  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NORTHERN TRUST CORP         | 683     | 1,206  | 10,463    | 1,632,052   | 金融サービス                 |     |  |
| MICROSOFT CORP              | 23,955  | 40,110 | 1,663,529 | 259,477,283 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| ANSYS INC                   | 294     | 506    | 16,640    | 2,595,554   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CENTENE CORP                | 1,921   | 2,978  | 23,168    | 3,613,763   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| STARBUCKS CORP              | 3,876   | 6,369  | 48,481    | 7,562,138   | 消費者サービス                |     |  |
| ORACLE CORP                 | 5,470   | 9,382  | 109,470   | 17,075,231  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| NETFLIX INC                 | 1,505   | 2,490  | 152,114   | 23,726,830  | メディア・娯楽                |     |  |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC     | 211     | 334    | 34,083    | 5,316,318   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC     | 2,645   | —      | —         | —           | メディア・娯楽                |     |  |
| MANHATTAN ASSOCIATES INC    | —       | 381    | 8,295     | 1,293,968   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC      | 553     | 965    | 8,897     | 1,387,872   | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| HENRY SCHEIN INC            | 473     | 708    | 5,194     | 810,288     | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY      | 362     | 635    | 17,240    | 2,689,118   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| POOL CORP                   | 129     | 217    | 8,139     | 1,269,648   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| LAM RESEARCH CORP           | 460     | 739    | 67,734    | 10,565,254  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| COPART INC                  | 1,440   | 4,987  | 27,299    | 4,258,132   | 商業・専門サービス              |     |  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC  | 317     | 518    | 7,086     | 1,105,335   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| WYNN RESORTS LTD            | 384     | 543    | 5,239     | 817,327     | 消費者サービス                |     |  |
| COMCAST CORP-CLASS A        | 14,592  | 22,901 | 90,027    | 14,042,511  | メディア・娯楽                |     |  |
| PACCAR INC                  | 1,768   | 2,902  | 31,687    | 4,942,689   | 資本財                    |     |  |
| DENTSPLY SIRONA INC         | 776     | —      | —         | —           | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC        | 254     | 395    | 10,741    | 1,675,399   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| GILEAD SCIENCES INC         | 4,235   | 7,145  | 47,132    | 7,351,739   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC      | 1,193   | 2,008  | 77,686    | 12,117,597  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| INTUIT INC                  | 902     | 1,597  | 101,016   | 15,756,566  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| DECKERS OUTDOOR CORP        | —       | 150    | 13,011    | 2,029,571   | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| PAYCHEX INC                 | 1,097   | 1,876  | 22,995    | 3,586,842   | 商業・専門サービス              |     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |           |             |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|--------|-----------|-------------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数     | 株数        | 評価額         |        |                        |  |
|                              |         |        |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株     | 百株        | 千アメリカドル     | 千円     |                        |  |
| ON SEMICONDUCTOR             | 1,475   | 2,474  | 17,434    | 2,719,441   |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH    | 332     | 532    | 8,076     | 1,259,758   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 320     | 1,120  | 20,729    | 3,233,383   |        | 運輸                     |  |
| AUTODESK INC                 | 730     | 1,245  | 27,124    | 4,230,854   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 556     | —      | —         | —           |        | 電気通信サービス               |  |
| SALESFORCE INC               | 3,382   | 5,512  | 152,504   | 23,787,589  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| AXON ENTERPRISE INC          | 222     | 396    | 12,038    | 1,877,731   |        | 資本財                    |  |
| ALPHABET INC-CL A            | 20,192  | 33,631 | 567,187   | 88,469,852  |        | メディア・娯楽                |  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 180     | 305    | 9,634     | 1,502,827   |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 123     | 181    | 3,743     | 583,858     |        | 金融サービス                 |  |
| UNITED THERAPEUTICS CORP     | 150     | 245    | 6,497     | 1,013,537   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| GARMIN LTD                   | 539     | 862    | 14,562    | 2,271,423   |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| TRIMBLE INC                  | 814     | 1,304  | 7,407     | 1,155,450   |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| QUALCOMM INC                 | 3,790   | 6,353  | 115,685   | 18,044,557  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| HOLOGIC INC                  | 845     | 1,442  | 10,836    | 1,690,342   |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SYNOPSYS INC                 | 516     | 869    | 48,432    | 7,554,438   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| AMAZON.COM INC               | 31,060  | 52,843 | 990,700   | 154,529,473 |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 779     | 1,253  | 13,985    | 2,181,421   |        | 金融サービス                 |  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 371     | 685    | 9,481     | 1,478,988   |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| KLA CORP                     | 478     | 774    | 55,608    | 8,673,808   |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| STEEL DYNAMICS INC           | 607     | 872    | 11,793    | 1,839,509   |        | 素材                     |  |
| VERISIGN INC                 | 327     | 553    | 9,483     | 1,479,221   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 875     | 1,424  | 23,850    | 3,720,223   |        | 商業・専門サービス              |  |
| EBAY INC                     | 1,833   | 2,983  | 15,213    | 2,373,058   |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| NVIDIA CORP                  | 8,321   | 14,032 | 1,261,204 | 196,722,747 |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| DOLLAR TREE INC              | 756     | 1,159  | 14,037    | 2,189,605   |        | 生活必需品流通・小売り            |  |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 131     | 199    | 75,981    | 11,851,640  |        | 消費者サービス                |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  | 4,402   | 7,442  | 306,657   | 47,832,372  |        | 金融サービス                 |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 4,500   | 7,691  | 30,358    | 4,735,258   |        | 銀行                     |  |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 2,603   | 4,284  | 25,037    | 3,905,386   |        | 金融サービス                 |  |
| BORGWARNER INC               | 787     | 1,212  | 4,546     | 709,198     |        | 自動車・自動車部品              |  |
| JM SMUCKER CO/THE            | 373     | 550    | 6,343     | 989,526     |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CENCORA INC                  | 537     | 948    | 21,308    | 3,323,625   |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ASSURANT INC                 | 182     | 284    | 5,028     | 784,398     |        | 保険                     |  |
| AMEREN CORPORATION           | 846     | 1,427  | 10,624    | 1,657,135   |        | 公益事業                   |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 1,736   | 2,924  | 26,787    | 4,178,342   |        | 公益事業                   |  |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    | 1,857   | 2,965  | 18,679    | 2,913,577   |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HESS CORP                    | 939     | 1,521  | 24,410    | 3,807,595   |        | エネルギー                  |  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 1,054   | 1,702  | 5,896     | 919,777     |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| F5 INC                       | 201     | 359    | 6,172     | 962,730     |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| DISH NETWORK CORP-A          | 844     | —      | —         | —           |        | メディア・娯楽                |  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC      | 545     | 905    | 8,254     | 1,287,582   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| PLUG POWER INC               | 1,707   | —      | —         | —           |        | 資本財                    |  |
| NETAPP INC                   | 715     | 1,217  | 13,208    | 2,060,273   |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| INCYTE CORP                  | 666     | 1,152  | 6,113     | 953,512     |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ENTEGRIS INC                 | 536     | 855    | 11,255    | 1,755,702   |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| BIOGEN INC                   | 487     | 812    | 18,004    | 2,808,292   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ILLUMINA INC                 | 534     | 910    | 10,066    | 1,570,227   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ADOBE INC                    | 1,572   | 2,574  | 124,143   | 19,363,958  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 866     | 1,447  | 61,191    | 9,544,582   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   | 3,603   | 6,084  | 9,887     | 1,542,266   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WOLFSPEED INC                | 409     | —      | —         | —           |        | 半導体・半導体製造装置            |  |

| 銘柄                                 | 期首(前期末) | 当期末    |           |             |             | 業種等                |  |
|------------------------------------|---------|--------|-----------|-------------|-------------|--------------------|--|
|                                    |         | 株数     | 株数        | 評価額         |             |                    |  |
|                                    |         |        |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額      |                    |  |
| (アメリカ)                             |         | 百株     | 百株        | 千円          | 千円          |                    |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A         | 1,760   | 2,889  | 19,355    | 3,019,119   | 3,019,119   | ソフトウェア・サービス        |  |
| EXPEDITORS INTL WASH INC           | 518     | 856    | 10,138    | 1,581,405   | 1,581,405   | 運輸                 |  |
| FASTENAL CO                        | 1,964   | 3,192  | 21,670    | 3,380,162   | 3,380,162   | 資本財                |  |
| FISERV INC                         | 2,039   | 3,369  | 51,958    | 8,104,449   | 8,104,449   | 金融サービス             |  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC             | 2,346   | 3,342  | 1,012     | 157,982     | 157,982     | メディア・娯楽            |  |
| APPLE INC                          | 53,813  | 83,440 | 1,527,387 | 238,241,845 | 238,241,845 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP          | 516     | 897    | 10,666    | 1,663,733   | 1,663,733   | 保険                 |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC          | 5,054   | 7,848  | 11,034    | 1,721,137   | 1,721,137   | 銀行                 |  |
| COSTAR GROUP INC                   | 1,399   | 2,328  | 20,932    | 3,265,025   | 3,265,025   | 不動産管理・開発           |  |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC        | 404     | 754    | 6,242     | 973,777     | 973,777     | 運輸                 |  |
| ONEOK INC                          | 1,528   | 3,354  | 26,861    | 4,189,841   | 4,189,841   | エネルギー              |  |
| CLEVELAND-CLIFFS INC               | 1,710   | 2,758  | 4,778     | 745,331     | 745,331     | 素材                 |  |
| BUNGE LTD                          | 491     | —      | —         | —           | —           | 食品・飲料・タバコ          |  |
| ADVANCE AUTO PARTS INC             | 191     | —      | —         | —           | —           | 一般消費財・サービス流通・小売り   |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A         | 562     | 909    | 23,820    | 3,715,509   | 3,715,509   | 食品・飲料・タバコ          |  |
| NVR INC                            | 10      | 18     | 13,948    | 2,175,627   | 2,175,627   | 耐久消費財・アパレル         |  |
| COOPER COS INC/THE                 | 169     | 1,191  | 11,288    | 1,760,702   | 1,760,702   | ヘルスケア機器・サービス       |  |
| EQT CORP                           | 1,169   | 2,278  | 8,868     | 1,383,306   | 1,383,306   | エネルギー              |  |
| AMPHENOL CORP-CL A                 | 2,001   | 3,413  | 43,548    | 6,792,765   | 6,792,765   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| WR BERKLEY CORP                    | 700     | 1,231  | 9,822     | 1,532,068   | 1,532,068   | 保険                 |  |
| WILLIAMS-SONOMA INC                | —       | 323    | 10,207    | 1,592,197   | 1,592,197   | 一般消費財・サービス流通・小売り   |  |
| HUBBELL INC                        | 175     | 318    | 12,953    | 2,020,443   | 2,020,443   | 資本財                |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP              | 2,644   | 4,485  | 24,873    | 3,879,825   | 3,879,825   | 食品・飲料・タバコ          |  |
| EXPEDIA GROUP INC                  | 534     | 790    | 8,922     | 1,391,746   | 1,391,746   | 消費者サービス            |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 693     | 1,012  | 7,489     | 1,168,155   | 1,168,155   | 素材                 |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC- C              | 829     | —      | —         | —           | —           | 電気通信サービス           |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC           | 363     | 561    | 24,359    | 3,799,517   | 3,799,517   | 金融サービス             |  |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL        | 866     | 1,520  | 7,834     | 1,221,955   | 1,221,955   | 保険                 |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN       | 1,888   | 3,210  | 43,021    | 6,710,432   | 6,710,432   | 金融サービス             |  |
| NASDAQ INC                         | 1,175   | 1,971  | 11,959    | 1,865,468   | 1,865,468   | 金融サービス             |  |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN       | 574     | 960    | 9,321     | 1,453,920   | 1,453,920   | メディア・娯楽            |  |
| CBRE GROUP INC - A                 | 1,073   | 1,691  | 15,261    | 2,380,422   | 2,380,422   | 不動産管理・開発           |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC         | 93      | 156    | 50,852    | 7,931,999   | 7,931,999   | 消費者サービス            |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B          | 1,050   | 1,857  | 9,125     | 1,423,420   | 1,423,420   | 食品・飲料・タバコ          |  |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC       | 154     | 268    | 18,834    | 2,937,788   | 2,937,788   | 半導体・半導体製造装置        |  |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP         | —       | 719    | 5,003     | 780,423     | 780,423     | 半導体・半導体製造装置        |  |
| ARROW ELECTRONICS INC              | 224     | —      | —         | —           | —           | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| BROWN & BROWN INC                  | 835     | 1,422  | 12,381    | 1,931,257   | 1,931,257   | 保険                 |  |
| CUMMINS INC                        | 481     | 780    | 23,320    | 3,637,585   | 3,637,585   | 資本財                |  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS          | 216     | 346    | 21,145    | 3,298,243   | 3,298,243   | 素材                 |  |
| ALLIANT ENERGY CORP                | 876     | 1,494  | 7,673     | 1,196,932   | 1,196,932   | 公益事業               |  |
| MASTERCARD INC - A                 | 2,903   | 4,754  | 217,271   | 33,890,023  | 33,890,023  | 金融サービス             |  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                | 429     | 767    | 11,321    | 1,765,965   | 1,765,965   | 商業・専門サービス          |  |
| FIRST SOLAR INC                    | 329     | 535    | 10,237    | 1,596,861   | 1,596,861   | 半導体・半導体製造装置        |  |
| AERCAP HOLDINGS NV                 | 568     | 1,205  | 10,992    | 1,714,532   | 1,714,532   | 資本財                |  |
| MOSAIC CO/THE                      | 1,130   | 1,740  | 5,121     | 798,823     | 798,823     | 素材                 |  |
| HEICO CORP                         | 154     | 232    | 5,003     | 780,494     | 780,494     | 資本財                |  |
| TRANSDIGM GROUP INC                | 174     | 312    | 40,927    | 6,383,935   | 6,383,935   | 資本財                |  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 389     | 663    | 12,988    | 2,025,890   | 2,025,890   | 商業・専門サービス          |  |
| INSULTEC CORP                      | 237     | 413    | 6,855     | 1,069,266   | 1,069,266   | ヘルスケア機器・サービス       |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC           | 372     | 575    | 14,795    | 2,307,853   | 2,307,853   | 保険                 |  |
| BLACKSTONE INC                     | 2,373   | 4,080  | 50,610    | 7,894,156   | 7,894,156   | 金融サービス             |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末   |         |            |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|-------|---------|------------|------------------------|-----|--|
|                              |         | 株数    | 株数      | 評価額        |                        |     |  |
|                              |         |       |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株    | 百株      | 千アメリカドル    | 千円                     |     |  |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 1,072   | 1,785 | 26,096  | 4,070,512  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  | 937     | 1,470 | 18,144  | 2,830,196  | 金融サービス                 |     |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 392     | 653   | 23,080  | 3,600,136  | 耐久消費財・アパレル             |     |  |
| MERCADOLIBRE INC             | 153     | 257   | 43,567  | 6,795,614  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| VMWARE INC-CLASS A           | 730     | —     | —       | —          | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| LOEWS CORP                   | 658     | 1,135 | 8,850   | 1,380,549  | 保険                     |     |  |
| SEAGEN INC                   | 480     | —     | —       | —          | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| AECOM                        | 435     | 820   | 7,633   | 1,190,636  | 資本財                    |     |  |
| MASIMO CORP                  | 165     | —     | —       | —          | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| ULTA BEAUTY INC              | 177     | 262   | 10,558  | 1,646,931  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| LKQ CORP                     | 898     | 1,570 | 6,943   | 1,083,100  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| HORMEL FOODS CORP            | 1,045   | 1,891 | 6,740   | 1,051,341  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 833     | 1,468 | 5,762   | 898,873    | 公益事業                   |     |  |
| EASTMAN CHEMICAL CO          | 402     | 729   | 7,372   | 1,149,909  | 素材                     |     |  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC    | 647     | 1,058 | 23,244  | 3,625,667  | 資本財                    |     |  |
| HUMANA INC                   | 428     | 718   | 24,123  | 3,762,791  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| NRG ENERGY INC               | 777     | 1,275 | 10,666  | 1,663,715  | 公益事業                   |     |  |
| INVESCO LTD                  | 1,158   | —     | —       | —          | 金融サービス                 |     |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 633     | 992   | 8,044   | 1,254,843  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 392     | 601   | 4,119   | 642,552    | 金融サービス                 |     |  |
| MSCI INC                     | 270     | 458   | 22,268  | 3,473,418  | 金融サービス                 |     |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 628     | 996   | 5,886   | 918,132    | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  | 5,242   | 8,826 | 87,960  | 13,720,065 | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 5,507   | 8,987 | 252,316 | 39,356,324 | 金融サービス                 |     |  |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 2,687   | 6,251 | 21,272  | 3,318,125  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| COTTERRA ENERGY INC          | 2,742   | 4,440 | 12,469  | 1,945,038  | エネルギー                  |     |  |
| T-MOBILE US INC              | 2,105   | 2,946 | 48,383  | 7,546,807  | 電気通信サービス               |     |  |
| RESMED INC                   | 493     | 816   | 17,463  | 2,723,962  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| SUPER MICRO COMPUTER INC     | —       | 288   | 23,031  | 3,592,396  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| GARTNER INC                  | 267     | 428   | 18,821  | 2,935,830  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| AMETEK INC                   | 781     | 1,337 | 22,836  | 3,562,112  | 資本財                    |     |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 1,281   | 2,140 | 21,414  | 3,340,249  | 保険                     |     |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | 825     | 1,388 | 14,902  | 2,324,435  | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC  | 285     | 427   | 7,286   | 1,136,614  | 運輸                     |     |  |
| QUANTA SERVICES INC          | 488     | 833   | 22,623  | 3,528,773  | 資本財                    |     |  |
| FMC CORP                     | 435     | 668   | 4,511   | 703,721    | 素材                     |     |  |
| WABTEC CORP                  | 566     | 1,026 | 17,275  | 2,694,667  | 資本財                    |     |  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 1,201   | 2,116 | 13,104  | 2,044,011  | 公益事業                   |     |  |
| CROWN HOLDINGS INC           | 436     | 629   | 5,290   | 825,269    | 素材                     |     |  |
| DELTA AIR LINES INC          | 535     | 962   | 5,063   | 789,736    | 運輸                     |     |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 652     | 1,080 | 14,634  | 2,282,674  | 公益事業                   |     |  |
| VERISK ANALYTICS INC         | 537     | 814   | 20,227  | 3,155,098  | 商業・専門サービス              |     |  |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 761     | 1,269 | 17,896  | 2,791,571  | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| FORTINET INC                 | 2,244   | 3,766 | 21,904  | 3,416,665  | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 75      | 121   | 18,340  | 2,860,747  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| GENERAL MOTORS CO            | 4,796   | 7,850 | 35,490  | 5,535,805  | 自動車・自動車部品              |     |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 875     | 1,458 | 38,165  | 5,953,131  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A     | 899     | 1,545 | 15,664  | 2,443,396  | 素材                     |     |  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 133     | 256   | 6,459   | 1,007,478  | 資本財                    |     |  |
| NORDSON CORP                 | 166     | 285   | 7,951   | 1,240,220  | 資本財                    |     |  |
| HCA HEALTHCARE INC           | 717     | 1,152 | 37,635  | 5,870,406  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP      | 1,577   | 2,146 | 38,546  | 6,012,511  | エネルギー                  |     |  |

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末    |         |            |            | 業種等                    |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------|------------|------------|------------------------|--|
|                               |         | 株数     | 株数      | 評価額        |            |                        |  |
|                               |         |        |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |                        |  |
| (アメリカ)                        |         | 百株     | 百株      | 千円         | 千円         |                        |  |
| ATMOS ENERGY CORP             | 491     | 910    | 10,670  | 1,664,443  | 1,664,443  | 公益事業                   |  |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I  | 473     | 735    | 5,541   | 864,401    | 864,401    | 資本財                    |  |
| DEXCOM INC                    | 1,304   | 2,221  | 28,220  | 4,401,769  | 4,401,769  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| XYLEM INC                     | 590     | 1,358  | 19,432  | 3,031,157  | 3,031,157  | 資本財                    |  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC      | 209     | 319    | 3,504   | 546,587    | 546,587    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 361     | 612    | 59,641  | 9,302,858  | 9,302,858  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| PHILLIPS 66                   | 1,593   | 2,527  | 36,800  | 5,740,149  | 5,740,149  | エネルギー                  |  |
| META PLATFORMS INC-CLASS A    | 7,607   | 12,613 | 600,656 | 93,690,443 | 93,690,443 | メディア・娯楽                |  |
| CMS ENERGY CORP               | 1,006   | 1,731  | 10,897  | 1,699,845  | 1,699,845  | 公益事業                   |  |
| ALBEMARLE CORP                | 402     | 620    | 8,044   | 1,254,838  | 1,254,838  | 素材                     |  |
| KINDER MORGAN INC             | 6,893   | 11,563 | 22,062  | 3,441,265  | 3,441,265  | エネルギー                  |  |
| APTIV PLC                     | 930     | 1,620  | 13,416  | 2,092,677  | 2,092,677  | 自動車・自動車部品              |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING  | 473     | —      | —       | —          | —          | 資本財                    |  |
| SPLUNK INC                    | 536     | —      | —       | —          | —          | ソフトウェア・サービス            |  |
| HEICO CORP-CLASS A            | 227     | 471    | 8,117   | 1,266,123  | 1,266,123  | 資本財                    |  |
| ABBVIE INC                    | 5,979   | 10,051 | 161,574 | 25,202,463 | 25,202,463 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC     | 162     | 275    | 10,859  | 1,693,870  | 1,693,870  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| TESLA INC                     | 9,079   | 16,267 | 274,058 | 42,747,603 | 42,747,603 | 自動車・自動車部品              |  |
| CHENIERE ENERGY INC           | 759     | 1,353  | 21,264  | 3,316,780  | 3,316,780  | エネルギー                  |  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 661     | 1,113  | 13,991  | 2,182,439  | 2,182,439  | 金融サービス                 |  |
| ZOETIS INC                    | 1,575   | 2,636  | 44,574  | 6,952,729  | 6,952,729  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES  | 253     | 430    | 15,680  | 2,445,797  | 2,445,797  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| NEWS CORP - CLASS A           | 1,306   | 2,055  | 5,144   | 802,363    | 802,363    | メディア・娯楽                |  |
| WATSCO INC                    | —       | 201    | 9,647   | 1,504,817  | 1,504,817  | 資本財                    |  |
| SNAP-ON INC                   | 184     | 316    | 8,887   | 1,386,305  | 1,386,305  | 資本財                    |  |
| REVVITY INC                   | 415     | 767    | 8,047   | 1,255,230  | 1,255,230  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CNH INDUSTRIAL NV             | —       | 5,294  | 6,099   | 951,438    | 951,438    | 資本財                    |  |
| BIO-TECHNE CORP               | 548     | 846    | 6,852   | 1,068,804  | 1,068,804  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 242     | 373    | 6,313   | 984,779    | 984,779    | 金融サービス                 |  |
| WORKDAY INC-CLASS A           | 680     | 1,192  | 29,371  | 4,581,422  | 4,581,422  | ソフトウェア・サービス            |  |
| SERVICENOW INC                | 684     | 1,155  | 84,360  | 13,158,598 | 13,158,598 | ソフトウェア・サービス            |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B   | 202     | 318    | 5,678   | 885,800    | 885,800    | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| CORPAY INC                    | 230     | 409    | 11,602  | 1,809,776  | 1,809,776  | 金融サービス                 |  |
| ALLEGION PLC                  | 310     | 471    | 5,936   | 925,959    | 925,959    | 資本財                    |  |
| DARLING INGREDIENTS INC       | 525     | 883    | 4,093   | 638,452    | 638,452    | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ALPHABET INC-CL C             | 18,544  | 29,269 | 498,438 | 77,746,409 | 77,746,409 | メディア・娯楽                |  |
| UNITED RENTALS INC            | 234     | 385    | 26,915  | 4,198,202  | 4,198,202  | 資本財                    |  |
| WESTLAKE CORP                 | 130     | 254    | 4,027   | 628,275    | 628,275    | 素材                     |  |
| IQVIA HOLDINGS INC            | 629     | 1,071  | 25,070  | 3,910,559  | 3,910,559  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ALLY FINANCIAL INC            | 928     | 1,500  | 5,914   | 922,536    | 922,536    | 金融サービス                 |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN  | 927     | 1,439  | 29,945  | 4,670,821  | 4,670,821  | 消費者サービス                |  |
| DIAMONDBACK ENERGY INC        | 565     | 986    | 19,949  | 3,111,688  | 3,111,688  | エネルギー                  |  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN      | 602     | 1,023  | 15,371  | 2,397,613  | 2,397,613  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| LIBERTY BROADBAND-C           | 436     | 643    | 3,416   | 532,852    | 532,852    | メディア・娯楽                |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 548     | 951    | 13,886  | 2,166,056  | 2,166,056  | メディア・娯楽                |  |
| OWENS CORNING                 | 299     | 536    | 9,482   | 1,479,079  | 1,479,079  | 資本財                    |  |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 1,022   | 1,804  | 53,665  | 8,370,817  | 8,370,817  | ソフトウェア・サービス            |  |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 1,546   | 2,292  | 10,482  | 1,634,989  | 1,634,989  | 金融サービス                 |  |
| QORVO INC                     | 331     | 592    | 5,789   | 903,122    | 903,122    | 半導体・半導体製造装置            |  |
| REPLICEN CORP                 | 174     | 276    | 4,609   | 719,009    | 719,009    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 711     | 1,227  | 30,790  | 4,802,649  | 4,802,649  | 保険                     |  |
| ARAMARK                       | 729     | —      | —       | —          | —          | 消費者サービス                |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末   |        |           |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数    | 株数     | 評価額       |        |                        |  |
|                              |         |       |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株    | 百株     | 千アメリカドル   | 千円     |                        |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 1,710   | 2,566 | 9,254  | 1,443,507 |        | 銀行                     |  |
| LEAR CORP                    | 202     | 365   | 4,796  | 748,118   |        | 自動車・自動車部品              |  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 428     | 739   | 11,132 | 1,736,450 |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| TARGA RESOURCES CORP         | 760     | 1,153 | 13,061 | 2,037,257 |        | エネルギー                  |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 147     | 218   | 5,098  | 795,206   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| WESTROCK CO                  | 817     | 1,510 | 7,799  | 1,216,581 |        | 素材                     |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE           | 2,524   | 4,981 | 18,053 | 2,815,928 |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PAYPAL HOLDINGS INC          | 3,666   | 5,873 | 36,961 | 5,765,195 |        | 金融サービス                 |  |
| EPAM SYSTEMS INC             | 200     | 295   | 5,426  | 846,444   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 168     | 350   | 6,081  | 948,589   |        | 商業・専門サービス              |  |
| ZILLLOW GROUP INC - C        | 517     | 821   | 3,478  | 542,605   |        | 不動産管理・開発               |  |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 737     | —     | —      | —         |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 4,206   | 7,303 | 12,459 | 1,943,483 |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CDW CORP/DE                  | 470     | 742   | 16,513 | 2,575,729 |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC   | 195     | —     | —      | —         |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ARISTA NETWORKS INC          | 826     | 1,511 | 47,467 | 7,403,983 |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| COGNEX CORP                  | 567     | —     | —      | —         |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| TRANSUNION                   | 632     | 1,066 | 8,316  | 1,297,270 |        | 商業・専門サービス              |  |
| GODADDY INC - CLASS A        | 505     | 715   | 9,582  | 1,494,680 |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| PAYLOCITY HOLDING CORP       | 139     | 248   | 4,063  | 633,876   |        | 商業・専門サービス              |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 509     | —     | —      | —         |        | メディア・娯楽                |  |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A | 229     | —     | —      | —         |        | メディア・娯楽                |  |
| LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C  | 651     | —     | —      | —         |        | メディア・娯楽                |  |
| VAIL RESORTS INC             | 126     | 206   | 4,099  | 639,399   |        | 消費者サービス                |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 80      | 117   | 3,305  | 515,520   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| DOMINO'S PIZZA INC           | 124     | 204   | 10,621 | 1,656,731 |        | 消費者サービス                |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 368     | 534   | 14,736 | 2,298,585 |        | メディア・娯楽                |  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 279     | 480   | 24,488 | 3,819,666 |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SMITH (A.O.) CORP            | 410     | 753   | 6,508  | 1,015,245 |        | 資本財                    |  |
| UGI CORP                     | 776     | —     | —      | —         |        | 公益事業                   |  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 667     | 1,167 | 8,618  | 1,344,378 |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| FORTIVE CORP                 | 1,136   | 2,056 | 15,806 | 2,465,550 |        | 資本財                    |  |
| ATLASSIAN CORP-CL A          | 518     | 896   | 16,121 | 2,514,674 |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS   | 803     | 1,327 | 8,358  | 1,303,730 |        | 商業・専門サービス              |  |
| HOWMET AEROSPACE INC         | 1,217   | 2,198 | 17,780 | 2,773,336 |        | 資本財                    |  |
| ALCOA CORP                   | 659     | —     | —      | —         |        | 素材                     |  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | 464     | 793   | 6,759  | 1,054,411 |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TELEFLEX INC                 | 151     | 251   | 5,122  | 798,946   |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 475     | 885   | 18,043 | 2,814,456 |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| TWILIO INC - A               | 584     | 1,012 | 6,086  | 949,439   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC      | 351     | 623   | 11,294 | 1,761,776 |        | 金融サービス                 |  |
| SNAP INC - A                 | 3,503   | 6,137 | 9,825  | 1,532,628 |        | メディア・娯楽                |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 233     | 362   | 4,763  | 743,037   |        | 保険                     |  |
| ROLLINS INC                  | 791     | 1,506 | 7,025  | 1,095,809 |        | 商業・専門サービス              |  |
| FAIR ISAAC CORP              | 81      | 143   | 19,062 | 2,973,430 |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| BAKER HUGHES CO              | 3,444   | 5,937 | 19,200 | 2,994,926 |        | エネルギー                  |  |
| OKTA INC                     | 535     | 929   | 9,059  | 1,413,157 |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| DUPONT DE NEMOURS INC        | 1,681   | 2,507 | 19,748 | 3,080,349 |        | 素材                     |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 491     | 862   | 4,298  | 670,552   |        | 運輸                     |  |
| BLACK KNIGHT INC             | 514     | —     | —      | —         |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| SEA LTD-ADR                  | 1,247   | 2,128 | 13,818 | 2,155,408 |        | メディア・娯楽                |  |
| BLOCK INC                    | 1,828   | 3,207 | 22,872 | 3,567,580 |        | 金融サービス                 |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |         |            |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数     | 株数      | 評価額        |        |                        |  |
|                              |         |        |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株     | 百株      | 千アメリカドル    | 千円     |                        |  |
| VISTRA CORP                  | 1,196   | 1,887  | 17,628  | 2,749,743  |        | 公益事業                   |  |
| INGERSOLL-RAND INC           | 1,372   | 2,358  | 21,519  | 3,356,664  |        | 資本財                    |  |
| NOVOCURE LTD                 | 308     | —      | —       | —          |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| HUBSPOT INC                  | 160     | 279    | 16,733  | 2,610,111  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 133     | 243    | 11,809  | 1,842,004  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| PTC INC                      | 364     | 650    | 11,711  | 1,826,706  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| ZSCALER INC                  | 286     | 534    | 9,333   | 1,455,829  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| BROADCOM INC                 | 1,409   | 2,526  | 336,789 | 52,532,384 |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| EVERGY INC                   | 802     | 1,389  | 7,700   | 1,201,132  |        | 公益事業                   |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | 1,519   | 2,550  | 22,254  | 3,471,206  |        | メディア・娯楽                |  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 96      | 129    | 5,274   | 822,705    |        | 保険                     |  |
| DOCUSIGN INC                 | 705     | 1,177  | 6,835   | 1,066,187  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| WIX.COM LTD                  | 219     | 303    | 3,709   | 578,606    |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 1,364   | 1,944  | 7,746   | 1,208,316  |        | 金融サービス                 |  |
| BURLINGTON STORES INC        | 211     | 372    | 7,084   | 1,105,114  |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| KKR & CO INC                 | 1,918   | 3,323  | 34,279  | 5,346,913  |        | 金融サービス                 |  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 1,486   | —      | —       | —          |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| THE CIGNA GROUP              | 1,034   | 1,643  | 57,242  | 8,928,641  |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| DELL TECHNOLOGIES -C         | 820     | 1,305  | 17,339  | 2,704,614  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 675     | 1,150  | 4,162   | 649,290    |        | 消費者サービス                |  |
| MONGODB INC                  | 225     | 408    | 14,437  | 2,252,013  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| FOX CORP - CLASS A           | 941     | 1,202  | 4,016   | 626,423    |        | メディア・娯楽                |  |
| FOX CORP - CLASS B           | 508     | 886    | 2,742   | 427,788    |        | メディア・娯楽                |  |
| DOW INC                      | 2,378   | 4,051  | 24,068  | 3,754,136  |        | 素材                     |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 761     | 1,405  | 8,709   | 1,358,509  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 1,054   | 1,430  | 3,308   | 516,123    |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| STERIS PLC                   | 340     | 560    | 12,968  | 2,022,840  |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 5,061   | 10,560 | 70,743  | 11,034,521 |        | 運輸                     |  |
| CORTEVA INC                  | 2,413   | 4,130  | 23,740  | 3,703,034  |        | 素材                     |  |
| AMCOR PLC                    | 5,235   | 8,307  | 8,606   | 1,342,376  |        | 素材                     |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 690     | 1,309  | 41,997  | 6,550,808  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 371     | 566    | 6,250   | 975,009    |        | 金融サービス                 |  |
| ROKU INC                     | 389     | 599    | 3,469   | 541,137    |        | メディア・娯楽                |  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 463     | 751    | 11,732  | 1,830,025  |        | 商業・専門サービス              |  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC   | 260     | 420    | 11,301  | 1,762,794  |        | 金融サービス                 |  |
| DATADOG INC - CLASS A        | 860     | 1,531  | 18,220  | 2,842,014  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| PINTEREST INC- CLASS A       | 1,993   | 3,319  | 13,941  | 2,174,533  |        | メディア・娯楽                |  |
| CHEWY INC - CLASS A          | 310     | —      | —       | —          |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| ETSY INC                     | 411     | 607    | 3,759   | 586,450    |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| AVANTOR INC                  | 2,172   | 3,890  | 9,645   | 1,504,472  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| MODERNA INC                  | 1,104   | 1,793  | 21,039  | 3,281,675  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CLARIVATE PLC                | 1,157   | —      | —       | —          |        | 商業・専門サービス              |  |
| DAYFORCE INC                 | 462     | 812    | 4,930   | 769,046    |        | 商業・専門サービス              |  |
| DYNATRACE INC                | 716     | 1,441  | 6,659   | 1,038,721  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A     | 845     | 1,666  | 11,983  | 1,869,201  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| RPM INTERNATIONAL INC        | 457     | 771    | 8,706   | 1,358,111  |        | 素材                     |  |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 1,478   | 2,695  | 5,383   | 839,651    |        | 金融サービス                 |  |
| BILL HOLDINGS INC            | 289     | 417    | 2,358   | 367,912    |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 210     | —      | —       | —          |        | 資本財                    |  |
| AON PLC-CLASS A              | 699     | 1,146  | 33,593  | 5,239,892  |        | 保険                     |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 1,413   | 2,317  | 22,507  | 3,510,657  |        | 資本財                    |  |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 2,829   | 4,519  | 29,603  | 4,617,524  |        | 資本財                    |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |        |           |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|--------|--------|-----------|------------------------|-----|--|
|                              |         | 株数     | 株数     | 評価額       |                        |     |  |
|                              |         |        |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株     | 百株     | 千アメリカドル   | 千円                     |     |  |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 609     | 1,262  | 5,366  | 837,109   | 金融サービス                 |     |  |
| CATALENT INC                 | 561     | 930    | 5,191  | 809,831   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |     |  |
| MATCH GROUP INC              | 892     | 1,347  | 4,134  | 644,865   | メディア・娯楽                |     |  |
| VERTIV HOLDINGS CO-A         | —       | 2,033  | 19,397 | 3,025,620 | 資本財                    |     |  |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC    | 901     | —      | —      | —         | メディア・娯楽                |     |  |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A        | 767     | 1,593  | 25,034 | 3,904,851 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| ROYALTY PHARMA PLC- CL A     | 1,255   | 2,083  | 5,852  | 912,902   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |     |  |
| UNITY SOFTWARE INC           | 819     | 1,327  | 2,879  | 449,208   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 5,861   | 10,361 | 21,344 | 3,329,270 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| VIATRIS INC                  | 4,318   | 6,293  | 7,024  | 1,095,616 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |     |  |
| ENPHASE ENERGY INC           | 459     | 800    | 8,668  | 1,352,051 | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| DOORDASH INC - A             | 772     | 1,454  | 16,707 | 2,606,107 | 消費者サービス                |     |  |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 1,278   | 2,461  | 36,019 | 5,618,381 | 消費者サービス                |     |  |
| ARES MANAGEMENT CORP - A     | 511     | 981    | 13,963 | 2,177,984 | 金融サービス                 |     |  |
| TORO CO                      | 346     | 518    | 4,530  | 706,592   | 資本財                    |     |  |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B  | 619     | 1,157  | 6,419  | 1,001,258 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| ALBERTSONS COS INC - CLASS A | —       | 1,834  | 3,805  | 593,517   | 生活必需品流通・小売             |     |  |
| APA CORP                     | 1,156   | 2,206  | 6,703  | 1,045,621 | エネルギー                  |     |  |
| ROBLOX CORP -CLASS A         | 1,162   | 2,429  | 7,641  | 1,191,945 | メディア・娯楽                |     |  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 2,894   | 4,946  | 33,865 | 5,282,335 | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC     | —       | 714    | 11,936 | 1,861,928 | 資本財                    |     |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | 702     | 1,165  | 10,961 | 1,709,770 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR        | 200     | 370    | 2,549  | 397,639   | 金融サービス                 |     |  |
| MONDAY.COM LTD               | —       | 144    | 2,617  | 408,253   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| CONFLUENT INC-CLASS A        | —       | 902    | 2,654  | 414,096   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| UIPATH INC - CLASS A         | —       | 1,989  | 3,822  | 596,298   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| APPLOVIN CORP-CLASS A        | —       | 1,021  | 8,832  | 1,377,659 | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 1,084   | 3,517  | 3,514  | 548,129   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 413     | 985    | 19,790 | 3,086,972 | 金融サービス                 |     |  |
| LUCID GROUP INC              | 1,730   | —      | —      | —         | 自動車・自動車部品              |     |  |
| ROBINHOOD MARKETS INC - A    | —       | 2,273  | 3,689  | 575,503   | 金融サービス                 |     |  |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 3,673   | 12,173 | 4,260  | 664,574   | 運輸                     |     |  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 1,389   | 2,302  | 25,806 | 4,025,371 | 金融サービス                 |     |  |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A   | 37      | 55     | 9,618  | 1,500,364 | 銀行                     |     |  |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | 578     | —      | —      | —         | 銀行                     |     |  |
| HYATT HOTELS CORP - CL A     | —       | 243    | 3,711  | 578,974   | 消費者サービス                |     |  |
| CONSTELLATION ENERGY         | 1,130   | 1,827  | 39,279 | 6,126,754 | 公益事業                   |     |  |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    | 7,866   | 13,444 | 10,957 | 1,709,167 | メディア・娯楽                |     |  |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP       | 374     | 583    | 5,085  | 793,283   | エネルギー                  |     |  |
| HF SINCLAIR CORP             | 472     | 778    | 4,410  | 687,898   | エネルギー                  |     |  |
| DRAFTKINGS INC-CL A          | —       | 2,391  | 10,347 | 1,613,935 | 消費者サービス                |     |  |
| FERGUSON PLC                 | 714     | 1,150  | 25,491 | 3,976,122 | 資本財                    |     |  |
| OVINTIV INC                  | 829     | 1,561  | 7,799  | 1,216,609 | エネルギー                  |     |  |
| RELIANCE INC                 | 193     | 327    | 9,591  | 1,496,139 | 素材                     |     |  |
| CARLISLE COS INC             | 166     | 288    | 12,032 | 1,876,794 | 資本財                    |     |  |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP      | 21      | 96     | 6,038  | 941,843   | エネルギー                  |     |  |
| JACOBS SOLUTIONS INC         | 407     | 742    | 10,331 | 1,611,524 | 商業・専門サービス              |     |  |
| COREBRIDGE FINANCIAL INC     | —       | 1,356  | 4,009  | 625,386   | 金融サービス                 |     |  |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING | 274     | 556    | 3,704  | 577,823   | 運輸                     |     |  |
| ASPEN TECHNOLOGY INC         | 107     | 163    | 3,421  | 533,732   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| TOAST INC-CLASS A            | 718     | 1,729  | 4,639  | 723,719   | 金融サービス                 |     |  |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY     | 1,234   | 2,330  | 19,433 | 3,031,177 | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        | 当期末       |            |                 | 業種等              |  |
|------------------------------|---------|--------|-----------|------------|-----------------|------------------|--|
|                              | 株数      | 株数     | 評価額       |            | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                  |  |
|                              |         |        | 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         |                 |                  |  |
| SAMSARA INC-CL A             | —       | 920    | 3,666     | 571,977    |                 | ソフトウェア・サービス      |  |
| LINDE PLC                    | 1,669   | 2,759  | 119,848   | 18,693,922 |                 | 素材               |  |
| KENVUE INC                   | —       | 10,097 | 20,739    | 3,234,915  |                 | 家庭用品・パーソナル用品     |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW | —       | 919    | 2,271     | 354,247    |                 | メディア・娯楽          |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C | —       | 1,099  | 7,699     | 1,200,955  |                 | メディア・娯楽          |  |
| GLOBAL-E ONLINE LTD          | —       | 656    | 1,938     | 302,364    |                 | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| CELSIUS HOLDINGS INC         | —       | 803    | 6,656     | 1,038,347  |                 | 食品・飲料・タバコ        |  |
| VERALTO CORP                 | —       | 1,330  | 12,836    | 2,002,226  |                 | 商業・専門サービス        |  |
| BUNGE GLOBAL SA              | —       | 835    | 8,862     | 1,382,325  |                 | 食品・飲料・タバコ        |  |
| LIBERTY GLOBAL LTD-C         | —       | 1,107  | 1,908     | 297,620    |                 | 電気通信サービス         |  |
| SOLVENTUM CORP               | —       | 739    | 4,713     | 735,153    |                 | ヘルスケア機器・サービス     |  |
| GE VERNONA INC               | —       | 1,545  | 25,844    | 4,031,155  |                 | 資本財              |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 3,561   | 4,871  | 1,631     | 254,525    |                 | 不動産管理・開発         |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 524     | 841    | 3,400     | 530,357    |                 | 資本財              |  |
| 小計                           | 株数      | 金額     | 1,145,404 | 1,936,745  | 25,518,640      | 3,980,397,563    |  |
| 銘柄                           | 株数      | 比<br>率 | 601       | 591        | —               | <72.7%>          |  |
| (カナダ)                        |         |        | 千カナダドル    |            |                 |                  |  |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 4,673   | 8,093  | 114,176   | 13,018,352 |                 | 銀行               |  |
| IMPERIAL OIL LTD             | 755     | 1,068  | 10,192    | 1,162,204  |                 | エネルギー            |  |
| THOMSON REUTERS CORP         | 550     | 889    | 20,408    | 2,326,933  |                 | 商業・専門サービス        |  |
| TC ENERGY CORP               | 3,423   | 5,774  | 30,475    | 3,474,779  |                 | エネルギー            |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS INC-B  | 1,233   | 2,174  | 11,752    | 1,340,036  |                 | 電気通信サービス         |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 2,019   | 3,223  | 22,080    | 2,517,649  |                 | 保険               |  |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     | 1,553   | 2,609  | 18,445    | 2,103,170  |                 | 素材               |  |
| BARRICK GOLD CORP            | 6,056   | 9,937  | 22,994    | 2,621,800  |                 | 素材               |  |
| BCE INC                      | 226     | 579    | 2,685     | 306,255    |                 | 電気通信サービス         |  |
| BANK OF MONTREAL             | 2,292   | 4,138  | 53,032    | 6,046,777  |                 | 銀行               |  |
| BROOKFIELD CORP              | 4,806   | 7,914  | 47,851    | 5,455,978  |                 | 金融サービス           |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA          | 4,034   | 6,935  | 45,542    | 5,192,715  |                 | 銀行               |  |
| CAE INC                      | 978     | 1,661  | 4,753     | 542,026    |                 | 資本財              |  |
| CAMECO CORP                  | 1,426   | 2,535  | 17,643    | 2,011,723  |                 | エネルギー            |  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  | 3,080   | 5,391  | 36,416    | 4,152,175  |                 | 銀行               |  |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   | 3,732   | 6,141  | 64,228    | 7,323,358  |                 | エネルギー            |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     | 1,944   | 3,078  | 53,621    | 6,113,961  |                 | 運輸               |  |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A   | 191     | 253    | 3,644     | 415,599    |                 | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| ENBRIDGE INC                 | 6,831   | 12,204 | 63,058    | 7,189,880  |                 | エネルギー            |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD  | 74      | 120    | 18,852    | 2,149,532  |                 | 保険               |  |
| CGI INC                      | 691     | 1,107  | 15,486    | 1,765,819  |                 | ソフトウェア・サービス      |  |
| IGM FINANCIAL INC            | 207     | 394    | 1,482     | 169,048    |                 | 金融サービス           |  |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 563     | 928    | 14,487    | 1,651,914  |                 | 生活必需品流通・小売り      |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 6,385   | 10,336 | 36,796    | 4,195,498  |                 | 保険               |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 889     | 1,622  | 10,398    | 1,185,653  |                 | 自動車・自動車部品        |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 1,105   | 1,917  | 22,241    | 2,535,922  |                 | 銀行               |  |
| ONEX CORPORATION             | 243     | 417    | 3,975     | 453,259    |                 | 金融サービス           |  |
| POWER CORP OF CANADA         | 1,883   | 3,056  | 12,260    | 1,397,961  |                 | 保険               |  |
| SUNCOR ENERGY INC            | 4,574   | 7,445  | 40,791    | 4,651,007  |                 | エネルギー            |  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 257     | 360    | 6,842     | 780,135    |                 | 生活必需品流通・小売り      |  |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 3,148   | 5,350  | 60,636    | 6,913,819  |                 | 運輸               |  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD       | 1,651   | 2,810  | 26,285    | 2,997,092  |                 | 素材               |  |
| KINROSS GOLD CORP            | 3,922   | 6,776  | 7,033     | 801,958    |                 | 素材               |  |
| GREAT-WEST LIFECO INC        | 860     | 1,768  | 7,651     | 872,470    |                 | 保険               |  |
| TMX GROUP LTD                | 196     | 1,763  | 6,431     | 733,310    |                 | 金融サービス           |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |        |           |        | 業種等              |  |
|------------------------------|---------|--------|--------|-----------|--------|------------------|--|
|                              |         | 株数     | 株数     | 評価額       |        |                  |  |
|                              |         |        |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |                  |  |
| (カナダ)                        |         | 百株     | 百株     | 千カナダドル    | 千円     |                  |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 571     | 743    | 3,412  | 389,104   |        | 耐久消費財・アパレル       |  |
| SAPUTO INC                   | 956     | 1,503  | 4,095  | 466,988   |        | 食品・飲料・タバコ        |  |
| TELUS CORP                   | 1,451   | 2,312  | 5,088  | 580,214   |        | 電気通信サービス         |  |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   | 1,936   | 4,004  | 7,303  | 832,721   |        | 素材               |  |
| FORTIS INC                   | 1,640   | 2,762  | 15,519 | 1,769,553 |        | 公益事業             |  |
| LUNDIN MINING CORP           | 2,221   | 3,621  | 5,815  | 663,063   |        | 素材               |  |
| PAN AMERICAN SILVER CORP     | 751     | 2,433  | 6,778  | 772,866   |        | 素材               |  |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 6,133   | 10,003 | 77,403 | 8,825,514 |        | 銀行               |  |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 664     | 1,161  | 20,288 | 2,313,291 |        | 素材               |  |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 1,530   | 2,780  | 20,880 | 2,380,803 |        | 素材               |  |
| EMPIRE CO LTD 'A'            | 553     | 1,080  | 3,546  | 404,397   |        | 生活必需品流通・小売り      |  |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     | 380     | 585    | 1,862  | 212,311   |        | 公益事業             |  |
| METRO INC/CN                 | 840     | 1,190  | 8,815  | 1,005,145 |        | 生活必需品流通・小売り      |  |
| OPEN TEXT CORP               | 918     | 1,449  | 6,007  | 684,981   |        | ソフトウェア・サービス      |  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 595     | 1,043  | 23,853 | 2,719,765 |        | 保険               |  |
| RB GLOBAL INC                | 577     | 946    | 9,888  | 1,127,491 |        | 商業・専門サービス        |  |
| CENOVUS ENERGY INC           | 4,974   | 8,015  | 22,498 | 2,565,233 |        | エネルギー            |  |
| MEG ENERGY CORP              | —       | 1,370  | 4,247  | 484,242   |        | エネルギー            |  |
| ARC RESOURCES LTD            | 1,927   | 3,120  | 7,959  | 907,498   |        | エネルギー            |  |
| TOURALINE OIL CORP           | 1,048   | 2,004  | 13,044 | 1,487,280 |        | エネルギー            |  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 1,932   | 3,519  | 17,719 | 2,020,408 |        | エネルギー            |  |
| DOLLARAMA INC                | 951     | 1,535  | 18,162 | 2,070,844 |        | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| KEYERA CORP                  | 767     | 1,249  | 4,438  | 506,128   |        | エネルギー            |  |
| ALTAGAS LTD                  | 946     | 1,726  | 5,278  | 601,809   |        | 公益事業             |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 68      | 116    | 43,341 | 4,941,749 |        | ソフトウェア・サービス      |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERN     | 1,007   | 1,687  | 16,897 | 1,926,709 |        | 消費者サービス          |  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD    | 182     | 266    | 2,846  | 324,523   |        | 素材               |  |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    | 505     | 825    | 5,835  | 665,332   |        | 素材               |  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 1,158   | 2,114  | 4,764  | 543,300   |        | 商業・専門サービス        |  |
| HYDRO ONE LTD                | 1,101   | 1,699  | 6,875  | 783,984   |        | 公益事業             |  |
| EMERA INC                    | 891     | 1,606  | 7,805  | 889,944   |        | 公益事業             |  |
| IVANHOE MINES LTD-CL A       | 1,931   | 3,296  | 6,479  | 738,842   |        | 素材               |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 4,030   | 6,800  | 54,794 | 6,247,657 |        | ソフトウェア・サービス      |  |
| NUTRIEN LTD                  | 1,765   | 2,758  | 21,922 | 2,499,605 |        | 素材               |  |
| WSP GLOBAL INC               | 443     | 684    | 14,981 | 1,708,207 |        | 資本財              |  |
| IA FINANCIAL CORP INC        | 341     | 588    | 5,371  | 612,511   |        | 保険               |  |
| QUEBECOR INC -CL B           | 556     | 980    | 3,004  | 342,593   |        | 電気通信サービス         |  |
| AIR CANADA                   | 622     | 622    | 1,169  | 133,330   |        | 運輸               |  |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 2,415   | —      | —      | —         |        | 公益事業             |  |
| PARKLAND CORP                | 426     | 592    | 2,368  | 269,999   |        | エネルギー            |  |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 393     | 949    | 4,074  | 464,552   |        | 公益事業             |  |
| FIRSTSERVICE CORP            | 139     | 241    | 4,964  | 566,063   |        | 不動産管理・開発         |  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 620     | 1,203  | 5,316  | 606,136   |        | 商業・専門サービス        |  |
| NORTHLAND POWER INC          | 796     | 1,482  | 3,212  | 366,343   |        | 公益事業             |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      | 283     | 491    | 6,103  | 695,934   |        | 資本財              |  |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG   | 178     | —      | —      | —         |        | 金融サービス           |  |
| TFI INTERNATIONAL INC        | 259     | 428    | 8,057  | 918,670   |        | 運輸               |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 2,737   | 4,438  | 33,591 | 3,830,071 |        | 生活必需品流通・小売り      |  |
| BRP INC/CA- SUB VOTING       | 157     | 157    | 1,510  | 172,226   |        | 耐久消費財・アパレル       |  |
| DESCARTES SYSTEMS GRP/THE    | 292     | 506    | 6,734  | 767,851   |        | ソフトウェア・サービス      |  |
| BROOKFIELD ASSET MGMT-A      | 1,137   | 1,871  | 10,173 | 1,160,001 |        | 金融サービス           |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末)   |            | 当期末             |              |                 | 業種等                    |  |
|--------------------------------|-----------|------------|-----------------|--------------|-----------------|------------------------|--|
|                                | 株数        | 株数         | 評価額             |              | 外貨建金額<br>千カナダドル |                        |  |
|                                |           |            | 外貨換算金額<br>千円    | 邦貨換算金額<br>千円 |                 |                        |  |
| (カナダ)<br>STANTEC INC           | 百株<br>—   | 百株<br>657  | 千カナダドル<br>7,265 | 828,442      |                 | 資本財                    |  |
| 小計                             | 株数<br>銘柄数 | 金額<br><比率> | 135,146         | 227,977      | 1,538,028       | 175,366,037            |  |
| (ユーロ…ドイツ)                      |           |            | 85              | 85           | <3.2%>          |                        |  |
| COMMERZBANK AG                 | 3,506     | 6,261      | 8,768           | 1,472,807    |                 | 銀行                     |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED    | 7,244     | 10,955     | 17,395          | 2,921,802    |                 | 金融サービス                 |  |
| SIEMENS AG-REG                 | 2,586     | 4,334      | 81,668          | 13,717,116   |                 | 資本財                    |  |
| RWE AG                         | 2,176     | 3,622      | 12,497          | 2,099,083    |                 | 公益事業                   |  |
| BASF SE                        | 3,110     | 5,231      | 25,530          | 4,288,148    |                 | 素材                     |  |
| VOLKSWAGEN AG                  | 89        | 192        | 2,592           | 435,437      |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG         | 2,707     | 4,559      | 31,090          | 5,221,979    |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF   | 640       | 1,026      | 8,447           | 1,418,915    |                 | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| E.ON SE                        | 7,604     | 12,481     | 16,469          | 2,766,150    |                 | 公益事業                   |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG    | 1,135     | 1,766      | 17,947          | 3,014,451    |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| BAYER AG-REG                   | 3,324     | 5,484      | 15,880          | 2,667,213    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |  |
| ALLIANZ SE-REG                 | 1,364     | 2,201      | 58,444          | 9,816,385    |                 | 保険                     |  |
| CONTINENTAL AG                 | 344       | 694        | 4,227           | 710,000      |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG       | 4,417     | 7,479      | 28,421          | 4,773,667    |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF     | 546       | 833        | 4,108           | 690,047      |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG         | 2,271     | 3,382      | 2,255           | 378,825      |                 | 運輸                     |  |
| DHL GROUP                      | 3,359     | 5,687      | 22,510          | 3,780,868    |                 | 運輸                     |  |
| SAP SE                         | 3,530     | 5,951      | 104,782         | 17,599,203   |                 | ソフトウェア・サービス            |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG             | 646       | 1,088      | 20,396          | 3,425,879    |                 | 金融サービス                 |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG      | 678       | 1,024      | 4,138           | 695,155      |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ADIDAS AG                      | 564       | 892        | 20,023          | 3,363,136    |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG        | 10,987    | 18,443     | 40,519          | 6,805,731    |                 | 電気通信サービス               |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG     | 473       | 785        | 35,783          | 6,010,121    |                 | 保険                     |  |
| BEIERSDORF AG                  | 334       | 563        | 8,293           | 1,393,011    |                 | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| HEIDELBERG MATERIALS AG        | 472       | 738        | 7,600           | 1,276,647    |                 | 素材                     |  |
| MERCK KGAA                     | 446       | 702        | 10,918          | 1,833,912    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF             | 636       | 1,178      | 13,783          | 2,315,134    |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| PUMA SE                        | 325       | 706        | 3,590           | 603,074      |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA         | 1,489     | 2,468      | 7,077           | 1,188,704    |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| GEA GROUP AG                   | 521       | 883        | 3,389           | 569,311      |                 | 資本財                    |  |
| SYMRISE AG                     | 472       | 706        | 7,202           | 1,209,793    |                 | 素材                     |  |
| HENKEL AG & CO KGAA            | 346       | 579        | 4,237           | 711,773      |                 | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| RHEINMETALL AG                 | 142       | 242        | 13,002          | 2,183,949    |                 | 資本財                    |  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE   | 300       | —          | —               | —            |                 | 電気通信サービス               |  |
| RATIONAL AG                    | 20        | 33         | 2,684           | 450,823      |                 | 資本財                    |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF   | 182       | 400        | 3,871           | 650,230      |                 | 自動車・自動車部品              |  |
| HANNOVER RUECK SE              | 200       | 339        | 8,064           | 1,354,457    |                 | 保険                     |  |
| BRENNTAG SE                    | 495       | 718        | 5,585           | 938,186      |                 | 資本財                    |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR     | 152       | 226        | 2,141           | 359,632      |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING | 2,978     | —          | —               | —            |                 | 電気通信サービス               |  |
| LEG IMMOBILIEN SE              | 217       | 418        | 3,439           | 577,780      |                 | 不動産管理・開発               |  |
| VONOVIA SE                     | 2,370     | 4,316      | 11,922          | 2,002,522    |                 | 不動産管理・開発               |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG           | 769       | 1,233      | 2,504           | 420,657      |                 | 素材                     |  |
| ZALANDO SE                     | 722       | 1,251      | 3,158           | 530,579      |                 | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| COVESTRO AG                    | 643       | 1,040      | 5,018           | 842,893      |                 | 素材                     |  |
| MTU AERO ENGINES AG            | 177       | 282        | 6,591           | 1,107,060    |                 | 資本財                    |  |
| DELIVERY HERO SE               | 544       | 1,042      | 2,631           | 442,028      |                 | 消費者サービス                |  |
| SCOUT24 SE                     | 272       | 415        | 2,955           | 496,453      |                 | メディア・娯楽                |  |

| 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<br>邦貨換算金額        |             |  |
|                              |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                        |             |  |
| (ユーロ…ドイツ)                    |         |        | 百株      | 百株         | 千ユーロ<br>千円             |             |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG          | 84      | 129    | 3,607   | 605,991    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG      | 925     | 1,677  | 8,818   | 1,481,129  | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| NEMETSCHEK SE                | 206     | 325    | 2,781   | 467,175    | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| BECHTLE AG                   | 267     | 399    | 1,822   | 306,152    | ソフトウェア・サービス            |             |  |
| KNORR-BREMSE AG              | 258     | 408    | 3,048   | 512,077    | 資本財                    |             |  |
| HELLOFRESH SE                | 457     | —      | —       | —          | 生活必需品流通・小売             |             |  |
| SIEMENS ENERGY AG            | 1,766   | 3,007  | 7,302   | 1,226,495  | 資本財                    |             |  |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG     | 1,479   | 2,979  | 12,361  | 2,076,270  | 資本財                    |             |  |
| DR ING HC F PORSCHE AG       | 384     | 587    | 4,792   | 804,882    | 自動車・自動車部品              |             |  |
| TALANX AG                    | —       | 408    | 2,849   | 478,566    | 保険                     |             |  |
| 小計                           | 株数      | ・金額    | 84,376  | 134,793    | 770,954                | 129,489,491 |  |
| 銘柄                           | 数       | <比率>   | 57      | 55         | —                      | <2.4%>      |  |
| (ユーロ…イタリア)                   |         |        |         |            |                        |             |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 3,810   | 5,610  | 13,690  | 2,299,411  | 保険                     |             |  |
| INTESA SANPAOLO              | 54,578  | 84,010 | 30,248  | 5,080,480  | 銀行                     |             |  |
| TELECOM ITALIA SPA           | 36,308  | 36,308 | 821     | 137,944    | 電気通信サービス               |             |  |
| ENI SPA                      | 8,462   | 12,795 | 19,423  | 3,262,329  | エネルギー                  |             |  |
| UNICREDIT SPA                | 6,531   | 8,853  | 31,895  | 5,357,172  | 銀行                     |             |  |
| ENEL SPA                     | 27,376  | 45,668 | 30,849  | 5,181,408  | 公益事業                   |             |  |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA  | 321     | 585    | 2,973   | 499,408    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| MEDIOBANCA SPA               | 1,814   | 2,982  | 4,310   | 723,934    | 銀行                     |             |  |
| SNAM SPA                     | 6,937   | 10,235 | 4,530   | 760,923    | 公益事業                   |             |  |
| LEONARDO SPA                 | —       | 2,408  | 5,481   | 920,694    | 資本財                    |             |  |
| TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA | 4,690   | 7,321  | 5,763   | 968,090    | 公益事業                   |             |  |
| PRYSMIAN SPA                 | 816     | 1,398  | 7,831   | 1,315,320  | 資本財                    |             |  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 1,140   | 1,800  | 1,867   | 313,606    | 電気通信サービス               |             |  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 1,880   | 2,694  | 3,315   | 556,794    | 保険                     |             |  |
| BANCO BPM SPA                | —       | 7,233  | 4,505   | 756,684    | 銀行                     |             |  |
| FINECOBANK SPA               | 2,185   | 3,260  | 4,940   | 829,723    | 銀行                     |             |  |
| MONCLER SPA                  | 706     | 1,210  | 7,679   | 1,289,897  | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| DIASORIN SPA                 | 91      | 91     | 897     | 150,661    | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| AMPLIFON SPA                 | 428     | 686    | 2,367   | 397,692    | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| NEXI SPA                     | 2,247   | 3,388  | 2,108   | 354,190    | 金融サービス                 |             |  |
| 小計                           | 株数      | ・金額    | 160,329 | 238,545    | 185,498                | 31,156,369  |  |
| 銘柄                           | 数       | <比率>   | 18      | 20         | —                      | <0.6%>      |  |
| (ユーロ…フランス)                   |         |        |         |            |                        |             |  |
| MICHELIN (CGDE)              | 2,319   | 3,769  | 13,993  | 2,350,266  | 自動車・自動車部品              |             |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 935     | 1,576  | 124,284 | 20,874,768 | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| AXA SA                       | 6,359   | 10,204 | 34,410  | 5,779,664  | 保険                     |             |  |
| DANONE                       | 2,177   | 3,567  | 21,228  | 3,565,613  | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| CARREFOUR SA                 | 1,973   | 3,308  | 5,455   | 916,311    | 生活必需品流通・小売             |             |  |
| VIVENDI SE                   | 2,365   | 4,043  | 4,024   | 675,987    | メディア・娯楽                |             |  |
| SOCIETE GENERALE SA          | 2,818   | 4,374  | 11,339  | 1,904,579  | 銀行                     |             |  |
| AIR LIQUIDE SA               | 1,769   | 3,038  | 56,710  | 9,525,106  | 素材                     |             |  |
| TOTALENERGIES SE             | 8,403   | 12,382 | 85,040  | 14,283,466 | エネルギー                  |             |  |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN    | 1,683   | 2,556  | 20,637  | 3,466,336  | 資本財                    |             |  |
| VINCI SA                     | 1,819   | 2,893  | 33,444  | 5,617,293  | 資本財                    |             |  |
| SANOFI                       | 3,858   | 6,534  | 61,635  | 10,352,331 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT         | 2,186   | 3,963  | 11,600  | 1,948,423  | 公益事業                   |             |  |
| L'OREAL                      | 817     | 1,350  | 61,244  | 10,286,595 | 家庭用品・パーソナル用品           |             |  |
| ACCOR SA                     | 570     | 1,034  | 4,286   | 719,990    | 消費者サービス                |             |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 1,835   | 3,118  | 72,977  | 12,257,275 | 資本財                    |             |  |

| 銘柄                         | 期首(前期末)     | 当期末         |         |           |             | 業種等                    |
|----------------------------|-------------|-------------|---------|-----------|-------------|------------------------|
|                            |             | 株数          | 株数      | 評価額       | 外貨建金額       |                        |
|                            |             |             |         | 邦貨換算金額    |             |                        |
| (ユーロ…フランス)                 |             |             |         | 千ユーロ      | 千円          |                        |
| BNP PARIBAS                | 百株<br>3,764 | 百株<br>5,938 | 42,279  | 7,101,310 |             | 銀行                     |
| ESSILORLUXOTTICA           | 982         | 1,662       | 34,221  | 5,747,861 |             | ヘルスケア機器・サービス           |
| CAPGEMINI SE               | 561         | 860         | 17,675  | 2,968,706 |             | ソフトウェア・サービス            |
| VALEO                      | 720         | —           | —       | —         |             | 自動車・自動車部品              |
| HERMES INTERNATIONAL       | 106         | 178         | 40,981  | 6,883,219 |             | 耐久消費財・アパレル             |
| SODEXO SA                  | 321         | 451         | 3,720   | 624,830   |             | 消費者サービス                |
| KERING                     | 253         | 416         | 13,842  | 2,325,051 |             | 耐久消費財・アパレル             |
| DASSAULT SYSTEMES SE       | 2,300       | 3,928       | 14,990  | 2,517,818 |             | ソフトウェア・サービス            |
| ORANGE                     | 6,597       | 10,943      | 11,572  | 1,943,695 |             | 電気通信サービス               |
| SAFRAN SA                  | 1,156       | 1,980       | 42,089  | 7,069,415 |             | 資本財                    |
| RENAULT SA                 | 698         | 1,141       | 5,512   | 925,827   |             | 自動車・自動車部品              |
| PUBLICIS GROUPE            | 753         | 1,292       | 13,967  | 2,345,998 |             | メディア・娯楽                |
| BOUYGUES SA                | 699         | 1,036       | 3,721   | 625,147   |             | 資本財                    |
| THALES SA                  | 366         | 529         | 8,854   | 1,487,195 |             | 資本財                    |
| PERNOD RICARD SA           | 698         | 1,211       | 18,099  | 3,040,004 |             | 食品・飲料・タバコ              |
| CREDIT AGRICOLE SA         | 4,183       | 6,174       | 9,539   | 1,602,211 |             | 銀行                     |
| ENGIE                      | 6,268       | 9,995       | 15,832  | 2,659,259 |             | 公益事業                   |
| ALSTOM                     | 1,149       | 1,924       | 3,293   | 553,171   |             | 資本財                    |
| ARKEMA                     | 190         | 356         | 3,492   | 586,522   |             | 素材                     |
| LEGRAND SA                 | 929         | 1,490       | 15,404  | 2,587,326 |             | 資本財                    |
| ADP                        | 102         | 171         | 2,146   | 360,479   |             | 運輸                     |
| WENDEL                     | 93          | —           | —       | —         |             | 金融サービス                 |
| BUREAU VERITAS SA          | 948         | 2,013       | 5,667   | 951,839   |             | 商業・専門サービス              |
| EURAZEO SE                 | 116         | 196         | 1,679   | 282,069   |             | 金融サービス                 |
| EIFFAGE                    | 279         | 385         | 4,051   | 680,512   |             | 資本財                    |
| BIOMERIEUX                 | 138         | 225         | 2,239   | 376,181   |             | ヘルスケア機器・サービス           |
| GETLINK SE                 | 1,626       | 1,725       | 2,863   | 480,875   |             | 運輸                     |
| EDENRED                    | 816         | 1,466       | 6,911   | 1,160,859 |             | 金融サービス                 |
| REMY COINTREAU             | 67          | 96          | 930     | 156,262   |             | 食品・飲料・タバコ              |
| REXEL SA                   | —           | 1,223       | 3,424   | 575,141   |             | 資本財                    |
| BOLLORE SE                 | 2,719       | 4,163       | 2,562   | 430,463   |             | メディア・娯楽                |
| DASSAULT AVIATION SA       | 92          | 92          | 1,916   | 321,846   |             | 資本財                    |
| SEB SA                     | 96          | 96          | 1,123   | 188,708   |             | 耐久消費財・アパレル             |
| IPSEN                      | 138         | 217         | 2,603   | 437,204   |             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMUNDI SA                  | 218         | 425         | 3,022   | 507,642   |             | 金融サービス                 |
| TELEPERFORMANCE            | 195         | 295         | 3,026   | 508,381   |             | 商業・専門サービス              |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH   | 100         | 139         | 2,876   | 483,103   |             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WORLDLINE SA               | 763         | 933         | 1,085   | 182,294   |             | 金融サービス                 |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 378         | 688         | 2,347   | 394,268   |             | 消費者サービス                |
| 小計                         | 株数・金額       | 83,491      | 133,786 | 991,883   | 166,596,719 |                        |
|                            | 銘柄数 <比率>    | 54          | 53      | <3.0%>    |             |                        |
| (ユーロ…オランダ)                 |             |             |         |           |             |                        |
| QIAGEN N.V.                | 733         | 1,316       | 5,380   | 903,728   |             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CNH INDUSTRIAL NV          | 3,576       | —           | —       | —         |             | 資本財                    |
| STELLANTIS NV              | 7,633       | 12,610      | 25,574  | 4,295,506 |             | 自動車・自動車部品              |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV   | 1,560       | 3,678       | 3,613   | 606,917   |             | 食品・飲料・タバコ              |
| FERRARI NV                 | 412         | 721         | 27,025  | 4,539,252 |             | 自動車・自動車部品              |
| AIRBUS SE                  | 2,000       | 3,333       | 53,275  | 8,948,174 |             | 資本財                    |
| STMICROELECTRONICS NV      | 2,308       | 3,754       | 14,135  | 2,374,255 |             | 半導体・半導体製造装置            |
| EURONEXT NV                | 285         | 493         | 4,296   | 721,556   |             | 金融サービス                 |
| WOLTERS KLUWER             | 870         | 1,428       | 20,985  | 3,524,697 |             | 商業・専門サービス              |
| KONINKLIJKE KPN NV         | 10,657      | 17,789      | 6,062   | 1,018,268 |             | 電気通信サービス               |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |         | 当期末     |            |                 | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|---------|---------|------------|-----------------|------------------------|--|
|                              | 株数      | 株数      | 評価額     |            | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                        |  |
|                              |         |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                 |                        |  |
| (ユーロ…オランダ)                   | 百株      | 百株      | 千ユーロ    | 千円         |                 |                        |  |
| AKZO NOBEL N.V.              | 587     | 919     | 5,798   | 973,852    |                 | 素材                     |  |
| HEINEKEN NV                  | 889     | 1,576   | 14,778  | 2,482,125  |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV       | 3,155   | 4,451   | 11,074  | 1,860,116  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| AEGON LTD                    | 5,895   | —       | —       | —          |                 | 保険                     |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 3,552   | 5,484   | 16,282  | 2,734,739  |                 | 生活必需品流通・小売り            |  |
| RANDSTAD NV                  | 403     | 528     | 2,597   | 436,229    |                 | 商業・専門サービス              |  |
| HEINEKEN HOLDING NV          | 381     | 656     | 5,095   | 855,805    |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ING GROEP NV                 | 12,659  | 19,088  | 30,651  | 5,148,246  |                 | 銀行                     |  |
| ASML HOLDING NV              | 1,363   | 2,293   | 198,241 | 33,296,718 |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| OCI NV                       | 349     | 805     | 1,989   | 334,170    |                 | 素材                     |  |
| NN GROUP NV                  | 910     | 1,603   | 7,335   | 1,232,040  |                 | 保険                     |  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA         | 1,332   | 2,902   | 4,710   | 791,251    |                 | 銀行                     |  |
| IMCD NV                      | 180     | 298     | 4,401   | 739,246    |                 | 資本財                    |  |
| ASR NEDERLAND NV             | —       | 952     | 4,636   | 778,718    |                 | 保険                     |  |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 153     | 264     | 16,430  | 2,759,657  |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES  | —       | 462     | 6,171   | 1,036,599  |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ADYEN NV                     | 73      | 119     | 14,903  | 2,503,125  |                 | 金融サービス                 |  |
| JUST EAT TAKEAWAY            | 578     | —       | —       | —          |                 | 消費者サービス                |  |
| PROSUS NV                    | 2,711   | 8,417   | 28,586  | 4,801,418  |                 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| JDE PEET'S NV                | 354     | 536     | 1,123   | 188,695    |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV     | 2,484   | 4,573   | 12,810  | 2,151,611  |                 | メディア・娯楽                |  |
| EXOR NV                      | 354     | 496     | 5,081   | 853,419    |                 | 金融サービス                 |  |
| FERROVIAL SE                 | —       | 3,037   | 10,503  | 1,764,098  |                 | 資本財                    |  |
| ARGENX SE                    | 186     | 345     | 12,026  | 2,019,921  |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 68,594  | 104,939 | 575,578    | 96,674,167      |                        |  |
|                              | 銘柄数比率   | 31      | 31      | —          | <1.8%>          |                        |  |
| (ユーロ…スペイン)                   |         |         |         |            |                 |                        |  |
| ENDESA SA                    | 1,088   | 1,991   | 3,581   | 601,621    |                 | 公益事業                   |  |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 806     | 1,294   | 5,048   | 847,961    |                 | 資本財                    |  |
| IBERDROLA SA                 | 20,807  | 34,248  | 41,817  | 7,023,637  |                 | 公益事業                   |  |
| TELEFONICA SA                | 17,879  | 27,839  | 11,442  | 1,921,805  |                 | 電気通信サービス               |  |
| BANCO SANTANDER SA           | 56,978  | 92,925  | 43,995  | 7,389,509  |                 | 銀行                     |  |
| REPSOL SA                    | 4,800   | 6,731   | 9,989   | 1,677,756  |                 | エネルギー                  |  |
| ACCIONA SA                   | 83      | 131     | 1,597   | 268,261    |                 | 公益事業                   |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 20,454  | 33,128  | 32,167  | 5,402,913  |                 | 銀行                     |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 452     | —       | —       | —          |                 | 公益事業                   |  |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL   | 3,722   | 6,198   | 26,578  | 4,464,100  |                 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| FERROVIAL SA                 | 1,579   | —       | —       | —          |                 | 資本財                    |  |
| ENAGAS SA                    | 828     | 1,208   | 1,751   | 294,161    |                 | 公益事業                   |  |
| REDEIA CORP SA               | 1,310   | 2,208   | 3,632   | 610,082    |                 | 公益事業                   |  |
| CAIXABANK SA                 | 14,579  | 22,124  | 10,903  | 1,831,284  |                 | 銀行                     |  |
| GRIFOLS SA                   | 825     | 1,265   | 1,191   | 200,162    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| AMADEUS IT GROUP SA          | 1,548   | 2,548   | 15,865  | 2,664,711  |                 | 消費者サービス                |  |
| AENA SME SA                  | 242     | 404     | 7,114   | 1,195,002  |                 | 運輸                     |  |
| CELLNEX TELECOM SA           | 1,852   | 2,756   | 9,229   | 1,550,242  |                 | 電気通信サービス               |  |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA | 192     | —       | —       | —          |                 | 公益事業                   |  |
| EDP RENOVAVEIS SA            | 967     | 2,319   | 3,389   | 569,217    |                 | 公益事業                   |  |
| EDP RENOVAVEIS SA-BONUS-RTS  | 967     | —       | —       | —          |                 | 公益事業                   |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 151,966 | 239,325 | 229,295    | 38,512,432      |                        |  |
|                              | 銘柄数比率   | 21      | 17      | —          | <0.7%>          |                        |  |
| (ユーロ…ベルギー)                   |         |         |         |            |                 |                        |  |
| AGEAS                        |         | 519     | 851     | 3,903      | 655,587         | 保険                     |  |

| 銘柄                          | 期首(前期末) |        | 当期末    |           |                        | 業種等        |  |
|-----------------------------|---------|--------|--------|-----------|------------------------|------------|--|
|                             | 株数      | 株数     | 評価額    |           | 外貨建金額<br>邦貨換算金額        |            |  |
|                             |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |            |  |
| (ユーロ…ベルギー)                  |         |        |        |           |                        |            |  |
| UCB SA                      | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                        |            |  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV | 424     | 683    | 8,410  | 1,412,585 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |            |  |
| UMICORE                     | 320     | 586    | 4,141  | 695,571   | 金融サービス                 |            |  |
| D' IETEREN GROUP            | 778     | 1,186  | 2,587  | 434,539   | 素材                     |            |  |
| KBC GROUP NV                | 82      | 133    | 2,885  | 484,593   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |            |  |
| SOLVAY SA                   | 869     | 1,373  | 9,803  | 1,646,519 | 銀行                     |            |  |
| SOFINA                      | 241     | —      | —      | —         | 素材                     |            |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV  | 52      | 96     | 2,159  | 362,726   | 金融サービス                 |            |  |
| ELIA GROUP SA/NV            | 2,939   | 4,778  | 28,421 | 4,773,686 | 食品・飲料・タバコ              |            |  |
| LOTUS BAKERIES              | 106     | 179    | 1,790  | 300,750   | 公益事業                   |            |  |
| SYENSQO SA                  | —       | 2      | 2,753  | 462,516   | 食品・飲料・タバコ              |            |  |
|                             | —       | 377    | 3,550  | 596,354   | 素材                     |            |  |
| 小計                          | 株数      | ・金額    | 6,335  | 10,249    | 70,406                 | 11,825,431 |  |
|                             | 銘柄数     | <比率>   | 10     | 11        | —                      | <0.2%>     |  |
| (ユーロ…オーストリア)                |         |        |        |           |                        |            |  |
| ERSTE GROUP BANK AG         | 1,103   | 2,025  | 9,255  | 1,554,535 | 銀行                     |            |  |
| VERBUND AG                  | 226     | 484    | 3,450  | 579,556   | 公益事業                   |            |  |
| OMV AG                      | 557     | 763    | 3,576  | 600,758   | エネルギー                  |            |  |
| VOESTALPINE AG              | 390     | 624    | 1,590  | 267,082   | 素材                     |            |  |
| 小計                          | 株数      | ・金額    | 2,278  | 3,897     | 17,872                 | 3,001,933  |  |
|                             | 銘柄数     | <比率>   | 4      | 4         | —                      | <0.1%>     |  |
| (ユーロ…ルクセンブルク)               |         |        |        |           |                        |            |  |
| AROUNDOWN SA                | 3,791   | —      | —      | —         | 不動産管理・開発               |            |  |
| TENARIS SA                  | 1,692   | 2,608  | 4,163  | 699,261   | エネルギー                  |            |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC         | 449     | 698    | 4,025  | 676,128   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |            |  |
| ARCELORMITTAL               | 1,724   | 3,107  | 7,421  | 1,246,566 | 素材                     |            |  |
| 小計                          | 株数      | ・金額    | 7,657  | 6,414     | 15,610                 | 2,621,956  |  |
|                             | 銘柄数     | <比率>   | 4      | 3         | —                      | <0.0%>     |  |
| (ユーロ…フィンランド)                |         |        |        |           |                        |            |  |
| NOKIA OYJ                   | 18,766  | 31,497 | 10,958 | 1,840,525 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |            |  |
| STORA ENSO OYJ-R SHS        | 1,844   | 2,983  | 3,913  | 657,294   | 素材                     |            |  |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 1,750   | 3,117  | 10,742 | 1,804,314 | 素材                     |            |  |
| FORTUM OYJ                  | 1,363   | 2,545  | 3,412  | 573,093   | 公益事業                   |            |  |
| KESKO OYJ-B SHS             | 934     | 1,333  | 2,194  | 368,544   | 生活必需品流通・小売り            |            |  |
| KONE OYJ-B                  | 1,158   | 1,804  | 8,896  | 1,494,208 | 資本財                    |            |  |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 1,643   | 2,689  | 10,603 | 1,780,893 | 保険                     |            |  |
| WARTSILA OYJ ABP            | 1,610   | 2,961  | 5,534  | 929,514   | 資本財                    |            |  |
| ELISA OYJ                   | 513     | 884    | 3,726  | 625,892   | 電気通信サービス               |            |  |
| NESTE OYJ                   | 1,449   | 2,404  | 5,399  | 906,823   | エネルギー                  |            |  |
| ORION OYJ-CLASS B           | 348     | 501    | 1,889  | 317,411   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |            |  |
| NORDEA BANK ABP             | —       | 17,594 | 19,952 | 3,351,176 | 銀行                     |            |  |
| METSO CORP                  | 2,267   | 3,587  | 4,062  | 682,395   | 資本財                    |            |  |
| 小計                          | 株数      | ・金額    | 33,651 | 73,905    | 91,284                 | 15,332,088 |  |
|                             | 銘柄数     | <比率>   | 12     | 13        | —                      | <0.3%>     |  |
| (ユーロ…アイルランド)                |         |        |        |           |                        |            |  |
| KERRY GROUP PLC-A           | 526     | 868    | 6,948  | 1,167,066 | 食品・飲料・タバコ              |            |  |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 511     | 924    | 8,244  | 1,384,746 | 資本財                    |            |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC   | 575     | —      | —      | —         | 消費者サービス                |            |  |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC   | 3,518   | 6,394  | 6,298  | 1,057,928 | 銀行                     |            |  |
| AIB GROUP PLC               | 2,972   | 8,651  | 4,313  | 724,498   | 銀行                     |            |  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 818     | 1,346  | 5,891  | 989,485   | 素材                     |            |  |

| 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<br>邦貨換算金額              |        |  |
|  |                       |                          | 外貨建金額                   | 邦貨換算金額                          |                              |        |  |
| (ユーロ…アイルランド)<br>CRH PLC  | 百株<br>2,513           | 百株<br>—                  | 千ユーロ<br>—               | 千円<br>—                         | —                            | 素材     |  |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数 <比率>     | 11,435                   | 18,185                  | 31,696                          | 5,323,725                    | <0.1%> |  |
| (ユーロ…ポルトガル)<br>EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA<br>JERONIMO MARTINS<br>GALP ENERGIA SGPS SA | 9,858<br>956<br>1,513 | 17,094<br>1,699<br>2,442 | 6,574<br>3,464<br>4,870 | 1,104,286<br>581,859<br>817,969 | 公益事業<br>生活必需品流通・小売り<br>エネルギー |        |  |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数 <比率>     | 12,327                   | 21,237                  | 14,908                          | 2,504,115                    | <0.0%> |  |
| (ユーロ…スイス)<br>DSM-FIRMENICH AG  | 591                   | 1,094                    | 11,279                  | 1,894,582                       | 素材                           |        |  |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数 <比率>     | 591                      | 1,094                   | 11,279                          | 1,894,582                    | <0.0%> |  |
| (ユーロ…パミューダ)<br>AEGON LTD   | —                     | 8,566                    | 5,256                   | 882,908                         | 保険                           |        |  |
| 小計   | 株数・金額<br>銘柄数 <比率>     | —                        | 8,566                   | 5,256                           | 882,908                      | <0.0%> |  |
| ユーロ計   | 株数・金額<br>銘柄数 <比率>     | 623,035                  | 994,941                 | 3,011,526                       | 505,815,924                  | <9.2%> |  |
| (イギリス)   |                       |                          | 千イギリスポンド                |                                 |                              |        |  |
| BARCLAYS PLC   | 54,039                | 83,590                   | 17,884                  | 3,491,690                       | 銀行                           |        |  |
| BP PLC   | 61,267                | 95,841                   | 48,514                  | 9,472,013                       | エネルギー                        |        |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC   | 228,464               | 349,672                  | 18,987                  | 3,707,063                       | 銀行                           |        |  |
| ASTRAZENECA PLC  | 5,241                 | 8,841                    | 109,364                 | 21,352,258                      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス       |        |  |
| SMITHS GROUP PLC   | 1,132                 | 1,807                    | 3,121                   | 609,499                         | 資本財                          |        |  |
| NEXT PLC   | 414                   | 736                      | 6,844                   | 1,336,242                       | 一般消費財・サービス流通・小売り             |        |  |
| DIAGEO PLC   | 7,699                 | 12,826                   | 36,554                  | 7,136,839                       | 食品・飲料・タバコ                    |        |  |
| BAE SYSTEMS PLC  | 10,470                | 17,597                   | 24,530                  | 4,789,399                       | 資本財                          |        |  |
| UNILEVER PLC   | 8,579                 | 14,266                   | 61,173                  | 11,943,432                      | 家庭用品・パーソナル用品                 |        |  |
| TESCO PLC  | 25,022                | 40,281                   | 12,555                  | 2,451,406                       | 生活必需品流通・小売り                  |        |  |
| RELEX PLC  | 6,467                 | 10,831                   | 37,466                  | 7,314,899                       | 商業・専門サービス                    |        |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 2,425                 | 4,166                    | 19,151                  | 3,739,222                       | 家庭用品・パーソナル用品                 |        |  |
| HALMA PLC  | 1,210                 | 2,073                    | 4,827                   | 942,508                         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器           |        |  |
| PRUDENTIAL PLC   | 9,312                 | 15,638                   | 12,539                  | 2,448,140                       | 保険                           |        |  |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC  | 20,509                | 33,285                   | 8,274                   | 1,615,569                       | 保険                           |        |  |
| SAGE GROUP PLC/THE   | 3,583                 | 5,959                    | 7,139                   | 1,394,012                       | ソフトウェア・サービス                  |        |  |
| HSBC HOLDINGS PLC  | 67,567                | 109,185                  | 75,993                  | 14,836,931                      | 銀行                           |        |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC   | 7,207                 | 11,591                   | 28,201                  | 5,506,001                       | 食品・飲料・タバコ                    |        |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 2,324                 | 3,661                    | 4,007                   | 782,490                         | 公益事業                         |        |  |
| SCHRODERS PLC  | 3,219                 | 4,652                    | 1,735                   | 338,786                         | 金融サービス                       |        |  |
| NATWEST GROUP PLC  | 18,187                | 30,440                   | 9,719                   | 1,897,642                       | 銀行                           |        |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC  | 2,948                 | 4,753                    | 8,879                   | 1,733,593                       | 食品・飲料・タバコ                    |        |  |
| WPP PLC  | 3,571                 | 5,743                    | 4,856                   | 948,278                         | メディア・娯楽                      |        |  |
| CENTRICA PLC   | —                     | 28,623                   | 3,935                   | 768,414                         | 公益事業                         |        |  |
| BT GROUP PLC   | 24,296                | 34,958                   | 3,684                   | 719,383                         | 電気通信サービス                     |        |  |
| SSE PLC  | 3,770                 | 6,271                    | 11,363                  | 2,218,539                       | 公益事業                         |        |  |
| STANDARD CHARTERED PLC   | 8,055                 | 13,275                   | 10,288                  | 2,008,727                       | 銀行                           |        |  |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC   | 29,347                | 47,795                   | 20,246                  | 3,952,862                       | 資本財                          |        |  |
| COMPASS GROUP PLC  | 5,965                 | 9,951                    | 22,968                  | 4,484,410                       | 消費者サービス                      |        |  |
| KINGFISHER PLC   | 7,262                 | 10,646                   | 2,785                   | 543,791                         | 一般消費財・サービス流通・小売り             |        |  |
| PEARSON PLC  | 1,946                 | 3,227                    | 3,220                   | 628,700                         | 消費者サービス                      |        |  |
| SEVERN TRENT PLC   | 837                   | 1,479                    | 3,827                   | 747,229                         | 公益事業                         |        |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |         | 当期末      |            |                 | 業種等                    |             |
|------------------------------|---------|---------|----------|------------|-----------------|------------------------|-------------|
|                              | 株数      | 株数      | 評価額      |            | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                        |             |
|                              |         |         | 外貨建金額    | 邦貨換算金額     |                 |                        |             |
| (イギリス)                       | 百株      | 百株      | 千イギリスポンド | 千円         |                 |                        |             |
| RIO TINTO PLC                | 3,810   | 6,324   | 35,450   | 6,921,290  |                 | 素材                     |             |
| GSK PLC                      | 13,768  | 23,091  | 41,553   | 8,112,943  |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |
| 3I GROUP PLC                 | 3,197   | 5,312   | 15,146   | 2,957,276  |                 | 金融サービス                 |             |
| VODAFONE GROUP PLC           | 89,321  | 122,203 | 8,480    | 1,655,812  |                 | 電気通信サービス               |             |
| SAINSBURY (J) PLC            | 6,208   | 8,640   | 2,384    | 465,586    |                 | 生活必需品流通・小売             |             |
| AVIVA PLC                    | 9,344   | 14,665  | 7,190    | 1,403,875  |                 | 保険                     |             |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 588     | —       | —        | —          |                 | 素材                     |             |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 8,856   | 14,268  | 6,064    | 1,183,958  |                 | 商業・専門サービス              |             |
| WHITBREAD PLC                | 651     | 1,099   | 3,374    | 658,781    |                 | 消費者サービス                |             |
| NATIONAL GRID PLC            | 12,410  | 21,088  | 23,555   | 4,599,036  |                 | 公益事業                   |             |
| BUNZL PLC                    | 1,115   | 2,054   | 6,542    | 1,277,385  |                 | 資本財                    |             |
| ANGLO AMERICAN PLC           | 4,318   | 7,081   | 19,641   | 3,834,803  |                 | 素材                     |             |
| INTERTEK GROUP PLC           | 552     | 825     | 4,125    | 805,472    |                 | 商業・専門サービス              |             |
| BURBERRY GROUP PLC           | 1,262   | 2,239   | 2,631    | 513,828    |                 | 耐久消費財・アパレル             |             |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 571     | 886     | 6,991    | 1,365,094  |                 | 消費者サービス                |             |
| PERSIMMON PLC                | 1,037   | 1,510   | 2,151    | 420,129    |                 | 耐久消費財・アパレル             |             |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP  | 1,280   | 2,368   | 21,622   | 4,221,505  |                 | 金融サービス                 |             |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 323     | 650     | 3,412    | 666,287    |                 | 耐久消費財・アパレル             |             |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     | 3,782   | 5,199   | 2,566    | 501,152    |                 | 耐久消費財・アパレル             |             |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 2,827   | 5,439   | 5,464    | 1,066,847  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |             |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 11,805  | 25,055  | 3,615    | 705,884    |                 | 耐久消費財・アパレル             |             |
| ABRDN PLC                    | 5,908   | 8,055   | 1,275    | 248,956    |                 | 金融サービス                 |             |
| EXPERIAN PLC                 | 3,117   | 5,398   | 18,642   | 3,639,789  |                 | 商業・専門サービス              |             |
| MONDI PLC                    | 1,619   | 2,398   | 3,778    | 737,641    |                 | 素材                     |             |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 1,192   | 1,789   | 4,835    | 944,151    |                 | 食品・飲料・タバコ              |             |
| ANTOFAGASTA PLC              | 1,240   | 2,297   | 5,180    | 1,011,493  |                 | 素材                     |             |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 630     | 1,452   | 3,994    | 779,877    |                 | 保険                     |             |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 1,997   | 3,122   | 1,513    | 295,536    |                 | 金融サービス                 |             |
| GLENCORE PLC                 | 34,863  | 60,681  | 28,884   | 5,639,428  |                 | 素材                     |             |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 246     | 462     | 4,323    | 844,053    |                 | 資本財                    |             |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 1,233   | 2,082   | 1,794    | 350,431    |                 | 金融サービス                 |             |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 453     | 819     | 3,988    | 778,737    |                 | 素材                     |             |
| MELROSE INDUSTRIES PLC       | —       | 8,185   | 4,921    | 960,846    |                 | 資本財                    |             |
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 615     | 1,397   | 3,794    | 740,932    |                 | 食品・飲料・タバコ              |             |
| ASHTEAD GROUP PLC            | 1,514   | 2,478   | 14,686   | 2,867,327  |                 | 資本財                    |             |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 541     | 722     | 1,441    | 281,438    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |
| OCADO GROUP PLC              | 1,644   | 2,327   | 810      | 158,244    |                 | 生活必需品流通・小売             |             |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | 3,339   | 5,208   | 3,897    | 760,854    |                 | メディア・娯楽                |             |
| DCC PLC                      | 303     | 564     | 3,304    | 645,111    |                 | 資本財                    |             |
| ENTAIN PLC                   | 1,987   | 3,187   | 2,482    | 484,648    |                 | 消費者サービス                |             |
| INFORMA PLC                  | 4,689   | 8,612   | 7,321    | 1,429,535  |                 | メディア・娯楽                |             |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 2,939   | 4,278   | 2,227    | 434,838    |                 | 保険                     |             |
| M&G PLC                      | 7,256   | 12,115  | 2,489    | 486,091    |                 | 金融サービス                 |             |
| JD SPORTS FASHION PLC        | 9,694   | 14,583  | 1,777    | 347,085    |                 | 一般消費財・サービス流通・小売        |             |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | —       | 1,028   | 16,707   | 3,261,876  |                 | 消費者サービス                |             |
| SHELL PLC                    | 23,851  | 37,059  | 109,176  | 21,315,687 |                 | エネルギー                  |             |
| WISE PLC - A                 | —       | 3,041   | 2,428    | 474,234    |                 | 金融サービス                 |             |
| HALEON PLC                   | 17,231  | 40,035  | 13,123   | 2,562,271  |                 | 家庭用品・パーソナル用品           |             |
| ENDEAVOUR MINING PLC         | —       | 1,068   | 1,841    | 359,603    |                 | 素材                     |             |
| CRH PLC                      | —       | 3,932   | 26,664   | 5,205,954  |                 | 素材                     |             |
| 小計                           | 株数      | ・       | 金額       | 937,496    | 1,532,070       | 1,163,919              | 227,243,616 |
|                              | 銘柄      | 数       | 比        | < 76       | 81              | —                      | < 4.2% >    |

| 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<br>邦貨換算金額 |                        |  |
|                              |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |                 |                        |  |
| (スイス)                        | 百株      | 百株     | 千スイスフラン     | 千円         |                 |                        |  |
| NESTLE SA-REG                | 9,301   | 15,197 | 144,653     | 24,884,679 |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1,762   | 3,088  | 41,847      | 7,199,033  |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 11,982  | —      | —           | —          |                 | 金融サービス                 |  |
| HOLCIM LTD                   | 1,879   | 2,890  | 23,588      | 4,057,890  |                 | 素材                     |  |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2,367   | 4,028  | 90,683      | 15,600,215 |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| GIVAUDAN-REG                 | 31      | 52     | 21,403      | 3,682,111  |                 | 素材                     |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG        | 174     | 309    | 8,375       | 1,440,839  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 507     | 824    | 37,702      | 6,485,893  |                 | 保険                     |  |
| BACHEM HOLDING AG            | 126     | 126    | 1,053       | 181,235    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 367     | 651    | 7,767       | 1,336,237  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| LONZA GROUP AG-REG           | 251     | 424    | 22,346      | 3,844,296  |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SWATCH GROUP AG/THE-REG      | 179     | 267    | 1,057       | 181,846    |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT  | 149     | 226    | 5,382       | 926,004    |                 | 資本財                    |  |
| GEBERIT AG-REG               | 118     | 203    | 11,188      | 1,924,799  |                 | 資本財                    |  |
| SWISS RE AG                  | 1,034   | 1,750  | 18,558      | 3,192,661  |                 | 保険                     |  |
| SWATCH GROUP AG/THE-BR       | 95      | 151    | 2,960       | 509,308    |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| NOVARTIS AG-REG              | 7,314   | 11,690 | 107,925     | 18,566,343 |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ADECCO GROUP AG-REG          | 555     | 892    | 3,075       | 529,105    |                 | 商業・専門サービス              |  |
| SWISSCOM AG-REG              | 89      | 150    | 7,543       | 1,297,631  |                 | 電気通信サービス               |  |
| ABB LTD-REG                  | 5,302   | 9,174  | 43,264      | 7,442,846  |                 | 資本財                    |  |
| CLARIANT AG-REG              | 604     | 990    | 1,405       | 241,856    |                 | 素材                     |  |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 551     | 899    | 6,925       | 1,191,417  |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ROCHE HOLDING AG-BR          | 98      | 171    | 4,229       | 727,543    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SGS SA-REG                   | 560     | 791    | 6,512       | 1,120,317  |                 | 商業・専門サービス              |  |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG     | 72      | 110    | 2,542       | 437,371    |                 | 資本財                    |  |
| TEMENOS AG - REG             | 229     | 345    | 1,878       | 323,099    |                 | ソフトウェア・サービス            |  |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG   | 176     | 283    | 7,067       | 1,215,824  |                 | 運輸                     |  |
| BALOISE HOLDING AG - REG     | 157     | 247    | 3,606       | 620,452    |                 | 保険                     |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG    | 104     | 171    | 11,134      | 1,915,503  |                 | 保険                     |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 0.37    | 0.69   | 7,327       | 1,260,601  |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD        | 740     | 1,237  | 6,693       | 1,151,507  |                 | 金融サービス                 |  |
| SIKA AG-REG                  | 493     | 847    | 23,557      | 4,052,609  |                 | 素材                     |  |
| SWISS PRIME SITE-REG         | 287     | 411    | 3,520       | 605,611    |                 | 不動産管理・開発               |  |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 3       | 5      | 5,433       | 934,721    |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 77      | 133    | 16,789      | 2,888,323  |                 | 金融サービス                 |  |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG       | 12      | 18     | 2,783       | 478,919    |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 92      | 148    | 1,427       | 245,647    |                 | 銀行                     |  |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG    | 23      | 48     | 3,701       | 636,813    |                 | 素材                     |  |
| UBS GROUP AG-REG             | 11,320  | 18,837 | 50,766      | 8,733,369  |                 | 金融サービス                 |  |
| AVOLTA AG                    | —       | 581    | 2,184       | 375,809    |                 | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| HELVETIA HOLDING AG-REG      | —       | 208    | 2,604       | 447,985    |                 | 保険                     |  |
| VAT GROUP AG                 | 87      | 143    | 6,762       | 1,163,338  |                 | 資本財                    |  |
| ALCON INC                    | 1,702   | 2,846  | 20,952      | 3,604,411  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SIG GROUP AG                 | 1,036   | 1,807  | 3,468       | 596,701    |                 | 素材                     |  |
| BKW AG                       | 64      | 93     | 1,324       | 227,822    |                 | 公益事業                   |  |
| SANDOZ GROUP AG              | —       | 2,379  | 7,743       | 1,332,189  |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| 小計                           | 株数      | ・      | 金額          | 85,860     | 812,723         | 139,812,755            |  |
| 銘柄                           | 株数      | < 比率 > |             | 43         | 45              | <2.6%>                 |  |
| (スウェーデン)                     |         |        |             |            |                 |                        |  |
| ELECTROLUX AB-B              | 841     | —      | 千スウェーデンクローネ | —          | —               | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ERICSSON LM-B SHS            | 9,502   | 15,314 | 89,127      | 1,281,659  |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ATLAS COPCO AB-B SHS         | 5,368   | 8,599  | 151,098     | 2,172,801  |                 | 資本財                    |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        | 当期末         |           |                 | 業種等                   |  |
|------------------------------|---------|--------|-------------|-----------|-----------------|-----------------------|--|
|                              | 株数      | 株数     | 評価額         |           | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                       |  |
|                              |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                 |                       |  |
| (スウェーデン)                     | 百株      | 百株     | 千スウェーデンクローネ | 千円        |                 |                       |  |
| SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A | 5,253   | 9,079  | 139,051     | 1,999,562 |                 | 銀行                    |  |
| INVESTOR AB-B SHS            | 6,179   | 9,663  | 272,837     | 3,923,409 |                 | 金融サービス                |  |
| GETINGE AB-B SHS             | 859     | 1,311  | 27,783      | 399,526   |                 | ヘルスケア機器・サービス          |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS  | 5,153   | 8,039  | 79,028      | 1,136,433 |                 | 銀行                    |  |
| ATLAS COPCO AB-A SHS         | 8,865   | 15,801 | 319,973     | 4,601,218 |                 | 資本財                   |  |
| SKF AB-B SHARES              | 1,396   | 2,083  | 49,535      | 712,313   |                 | 資本財                   |  |
| ASSA ABLOY AB-B              | 3,489   | 6,003  | 189,348     | 2,722,835 |                 | 資本財                   |  |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS    | 2,609   | 3,751  | 63,979      | 920,019   |                 | 一般消費財・サービス流通・小売り      |  |
| SANDVIK AB                   | 3,705   | 6,417  | 149,603     | 2,151,292 |                 | 資本財                   |  |
| SWEDBANK AB - A SHARES       | 2,948   | 4,875  | 106,975     | 1,538,304 |                 | 銀行                    |  |
| SECURITAS AB-B SHS           | 1,568   | 2,359  | 25,610      | 368,273   |                 | 商業・専門サービス             |  |
| SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B   | 1,895   | 3,046  | 50,350      | 724,043   |                 | 素材                    |  |
| HOLMEN AB-B SHARES           | 330     | 330    | 14,705      | 211,468   |                 | 素材                    |  |
| SKANSKA AB-B SHS             | 1,047   | 2,097  | 40,326      | 579,897   |                 | 資本財                   |  |
| TELE2 AB-B SHS               | 1,982   | 3,677  | 38,443      | 552,824   |                 | 電気通信サービス              |  |
| TELIA CO AB                  | 9,106   | 12,842 | 33,172      | 477,017   |                 | 電気通信サービス              |  |
| VOLVO AB-A SHS               | 624     | 1,291  | 37,803      | 543,621   |                 | 資本財                   |  |
| VOLVO AB-B SHS               | 5,151   | 8,728  | 246,654     | 3,546,898 |                 | 資本財                   |  |
| ALFA LAVAL AB                | 924     | 1,592  | 77,541      | 1,115,052 |                 | 資本財                   |  |
| BOLIDEN AB                   | 899     | 1,421  | 52,489      | 754,802   |                 | 素材                    |  |
| BOLIDEN AB RED SHS           | 899     | —      | —           | —         |                 | 素材                    |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS           | 1,592   | 1,592  | 14,276      | 205,299   |                 | 資本財                   |  |
| HEXAGON AB-B SHS             | 6,737   | 11,871 | 144,891     | 2,083,535 |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| KINNEVIK AB - B              | 809     | —      | —           | —         |                 | 金融サービス                |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS      | 536     | 891    | 32,520      | 467,649   |                 | 金融サービス                |  |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS  | 1,473   | 2,963  | 21,337      | 306,826   |                 | 不動産管理・開発              |  |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 4,952   | 7,458  | 42,665      | 613,528   |                 | 資本財                   |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS           | 242     | 436    | 24,856      | 357,440   |                 | 金融サービス                |  |
| SAAB AB-B                    | —       | 1,604  | 36,298      | 521,972   |                 | 資本財                   |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B          | 2,118   | 3,635  | 101,479     | 1,459,277 |                 | 家庭用品・パーソナル用品          |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS      | 448     | 914    | 33,362      | 479,751   |                 | 金融サービス                |  |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB  | 607     | 937    | 27,003      | 388,313   |                 | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| EPIROC AB-B                  | 1,323   | 2,104  | 41,508      | 596,885   |                 | 資本財                   |  |
| EPIROC AB-A                  | 2,355   | 4,110  | 89,600      | 1,288,456 |                 | 資本財                   |  |
| NORDEA BANK ABP              | 11,273  | —      | —           | —         |                 | 銀行                    |  |
| EQT AB                       | 1,177   | 2,127  | 69,268      | 996,085   |                 | 金融サービス                |  |
| EVOLUTION AB                 | 634     | 1,041  | 129,160     | 1,857,333 |                 | 消費者サービス               |  |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 584     | 584    | 17,017      | 244,710   |                 | 資本財                   |  |
| BEIJER REF AB                | —       | 2,229  | 37,547      | 539,933   |                 | 資本財                   |  |
| EMBRACER GROUP AB            | 2,304   | —      | —           | —         |                 | メディア・娯楽               |  |
| INVESTOR AB-A SHS            | 1,783   | —      | —           | —         |                 | 金融サービス                |  |
| LIFCO AB-B SHS               | 717     | 1,302  | 36,091      | 518,994   |                 | 資本財                   |  |
| SAGAX AB-B                   | 647     | 1,051  | 29,901      | 429,988   |                 | 不動産管理・開発              |  |
| INDUTRADE AB                 | 838     | 1,507  | 41,110      | 591,175   |                 | 資本財                   |  |
| VOLVO CAR AB-B               | 2,075   | 4,422  | 15,506      | 222,980   |                 | 自動車・自動車部品             |  |
| 小計                           | 株数      | 金額     | 125,835     | 181,114   | 3,240,849       | 46,603,415            |  |
|                              | 銘柄数     | <比率>   | 46          | 42        | <0.9%>          |                       |  |
| (ノルウェー)                      |         |        | 千ノルウェークローネ  |           |                 |                       |  |
| NORSK HYDRO ASA              | 4,348   | 7,012  | 46,701      | 670,631   |                 | 素材                    |  |
| ORKLA ASA                    | 2,508   | 4,938  | 40,765      | 585,392   |                 | 食品・飲料・タバコ             |  |
| EQUINOR ASA                  | 3,275   | 4,963  | 155,232     | 2,229,134 |                 | エネルギー                 |  |
| TELENOR ASA                  | 2,116   | 3,333  | 42,105      | 604,638   |                 | 電気通信サービス              |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末) |        | 当期末        |            |                 | 業種等                    |  |
|--------------------------------|---------|--------|------------|------------|-----------------|------------------------|--|
|                                | 株数      | 株数     | 評価額        |            | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                        |  |
|                                |         |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |                 |                        |  |
| (ノルウェー)                        |         |        |            |            |                 |                        |  |
| YARA INTERNATIONAL ASA         | 百株      | 百株     | 千ノルウェーキローネ | 千円         |                 |                        |  |
| MOWI ASA                       | 610     | 834    | 26,782     | 384,603    |                 | 素材                     |  |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA      | 1,357   | 2,511  | 49,511     | 710,984    |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| AKER BP ASA                    | 692     | 1,147  | 21,426     | 307,687    |                 | 保険                     |  |
| SALMAR ASA                     | 1,038   | 1,660  | 45,807     | 657,790    |                 | エネルギー                  |  |
| ADEVINTA ASA                   | 258     | 405    | 27,500     | 394,905    |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| DNB BANK ASA                   | 1,068   | —      | —          | —          |                 | メディア・娯楽                |  |
| KONGSBERG GRUPPEN ASA          | 3,158   | 5,332  | 108,625    | 1,559,867  |                 | 銀行                     |  |
|                                | 325     | 467    | 38,831     | 557,613    |                 | 資本財                    |  |
| 小計                             | 株数・金額   | 20,759 | 32,606     | 603,290    | 8,663,250       |                        |  |
| 銘柄数 <比率>                       |         | 12     | 11         |            | <0.2%>          |                        |  |
| (デンマーク)                        |         |        | 千デンマーククローネ |            |                 |                        |  |
| NOVO NORDISK A/S-B             | 5,597   | 18,259 | 1,612,640  | 36,316,656 |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| NOVONESIS (NOVOZYMES) B        | 718     | 2,117  | 88,594     | 1,995,148  |                 | 素材                     |  |
| DANSKE BANK A/S                | 2,214   | 4,068  | 77,599     | 1,747,533  |                 | 銀行                     |  |
| DEMANT A/S                     | 342     | 606    | 19,419     | 437,325    |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S        | 3,416   | 5,442  | 103,978    | 2,341,597  |                 | 資本財                    |  |
| CARLSBERG AS-B                 | 347     | 585    | 56,000     | 1,261,138  |                 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| COLOPLAST-B                    | 397     | 707    | 59,814     | 1,347,029  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| DSV A/S                        | 639     | 1,003  | 102,237    | 2,302,377  |                 | 運輸                     |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B         | 18      | 28     | 29,572     | 665,979    |                 | 運輸                     |  |
| TRYG A/S                       | 1,142   | 1,862  | 26,601     | 599,056    |                 | 保険                     |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A         | 10      | 8      | 8,839      | 199,058    |                 | 運輸                     |  |
| PANDORA A/S                    | 308     | 448    | 50,724     | 1,142,304  |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CHR HANSEN HOLDING A/S         | 333     | —      | —          | —          |                 | 素材                     |  |
| GENMAB A/S                     | 222     | 395    | 79,288     | 1,785,582  |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ORSTED A/S                     | 607     | 948    | 40,910     | 921,314    |                 | 公益事業                   |  |
| ROCKWOOL A/S-B SHS             | 35      | 35     | 9,018      | 203,098    |                 | 資本財                    |  |
| 小計                             | 株数・金額   | 16,352 | 36,518     | 2,365,239  | 53,265,203      |                        |  |
| 銘柄数 <比率>                       |         | 16     | 15         |            | <1.0%>          |                        |  |
| (オーストラリア)                      |         |        | 千オーストラリアドル |            |                 |                        |  |
| BHP GROUP LTD                  | 17,119  | 29,245 | 125,492    | 12,910,675 |                 | 素材                     |  |
| CSL LTD                        | 1,626   | 2,780  | 77,619     | 7,985,530  |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD      | 6,400   | 10,539 | 30,174     | 3,104,391  |                 | エネルギー                  |  |
| RIO TINTO LTD                  | 1,255   | 2,079  | 27,041     | 2,781,982  |                 | 素材                     |  |
| QBE INSURANCE GROUP LTD        | 4,886   | 8,161  | 14,372     | 1,478,636  |                 | 保険                     |  |
| LENDLEASE GROUP                | 2,447   | —      | —          | —          |                 | 不動産管理・開発               |  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 5,721   | 9,452  | 111,105    | 11,430,534 |                 | 銀行                     |  |
| WESTPAC BANKING CORP           | 11,816  | 20,159 | 53,745     | 5,529,289  |                 | 銀行                     |  |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    | 10,626  | 17,978 | 60,786     | 6,253,752  |                 | 銀行                     |  |
| BRAMBLES LTD                   | 4,609   | 8,597  | 12,311     | 1,266,575  |                 | 商業・専門サービス              |  |
| QANTAS AIRWAYS LTD             | 3,182   | 6,580  | 4,106      | 422,476    |                 | 運輸                     |  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD           | 4,151   | 7,002  | 21,510     | 2,213,036  |                 | 生活必需品流通・小売             |  |
| COMPUTERSHARE LTD              | 1,691   | 2,881  | 7,713      | 793,582    |                 | 商業・専門サービス              |  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 1,968   | 3,160  | 12,459     | 1,281,851  |                 | 消費者サービス                |  |
| MACQUARIE GROUP LTD            | 1,237   | 2,132  | 41,208     | 4,239,545  |                 | 金融サービス                 |  |
| ASX LTD                        | 709     | 1,136  | 7,297      | 750,791    |                 | 金融サービス                 |  |
| COCHLEAR LTD                   | 234     | 381    | 12,231     | 1,258,341  |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI    | 1,475   | 2,635  | 14,652     | 1,507,442  |                 | 素材                     |  |
| NEWCREST MINING LTD            | 2,946   | —      | —          | —          |                 | 素材                     |  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP      | 7,625   | 12,215 | 7,646      | 786,707    |                 | 保険                     |  |
| ORIGIN ENERGY LTD              | 5,401   | 10,482 | 10,409     | 1,070,890  |                 | 公益事業                   |  |
| ORICA LTD                      | 1,583   | 2,254  | 4,125      | 424,384    |                 | 素材                     |  |

| 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<br>邦貨換算金額 |                  |  |
|                               |         |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額      |                 |                  |  |
| (オーストラリア)                     | 百株      | 百株     | 千オーストラリアドル | 千円          |                 |                  |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD          | 1,636   | 2,527  | 6,762      | 695,739     |                 | ヘルスケア機器・サービス     |  |
| SANTOS LTD                    | 10,458  | 18,895 | 14,852     | 1,527,981   |                 | エネルギー            |  |
| SUNCORP GROUP LTD             | 4,047   | 6,763  | 10,990     | 1,130,690   |                 | 保険               |  |
| TRANSURBAN GROUP              | 10,640  | 18,184 | 23,294     | 2,396,530   |                 | 運輸               |  |
| WESFARMERS LTD                | 3,852   | 6,365  | 43,253     | 4,449,913   |                 | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| BLUESCOPE STEEL LTD           | 1,570   | 2,465  | 5,440      | 559,759     |                 | 素材               |  |
| AMPOL LTD                     | 823     | 1,680  | 6,075      | 625,026     |                 | エネルギー            |  |
| FORTESCUE LTD                 | 5,747   | 9,395  | 24,625     | 2,533,484   |                 | 素材               |  |
| AURIZON HOLDINGS LTD          | 6,070   | 13,669 | 5,207      | 535,788     |                 | 運輸               |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD     | 2,458   | 4,769  | 5,599      | 576,026     |                 | 食品・飲料・タバコ        |  |
| APA GROUP                     | 3,970   | 7,371  | 6,472      | 665,855     |                 | 公益事業             |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD        | 665     | 1,295  | 6,492      | 667,933     |                 | ヘルスケア機器・サービス     |  |
| SEEK LTD                      | 1,110   | 1,994  | 4,675      | 481,013     |                 | メディア・娯楽          |  |
| REA GROUP LTD                 | 165     | 324    | 6,076      | 625,166     |                 | メディア・娯楽          |  |
| IGO LTD                       | 2,319   | —      | —          | —           |                 | 素材               |  |
| MEDIBANK PRIVATE LTD          | 9,363   | 15,174 | 5,538      | 569,830     |                 | 保険               |  |
| SOUTH32 LTD                   | 15,079  | 24,645 | 8,995      | 925,451     |                 | 素材               |  |
| CAR GROUP LTD                 | —       | 2,367  | 8,263      | 850,132     |                 | メディア・娯楽          |  |
| PILBARA MINERALS LTD          | 9,247   | 15,409 | 6,379      | 656,346     |                 | 素材               |  |
| IDP EDUCATION LTD             | 662     | 980    | 1,592      | 163,790     |                 | 消費者サービス          |  |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD   | 3,697   | 5,688  | 8,345      | 858,581     |                 | 素材               |  |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON  | 648     | 1,388  | 4,526      | 465,672     |                 | 金融サービス           |  |
| COLES GROUP LTD               | 4,651   | 7,252  | 11,778     | 1,211,766   |                 | 生活必需品流通・小売り      |  |
| WISETECH GLOBAL LTD           | 556     | 853    | 8,250      | 848,782     |                 | ソフトウェア・サービス      |  |
| MINERAL RESOURCES LTD         | 627     | 957    | 7,380      | 759,341     |                 | 素材               |  |
| XERO LTD                      | 427     | 755    | 9,476      | 974,977     |                 | ソフトウェア・サービス      |  |
| REECE LTD                     | 818     | 1,306  | 3,579      | 368,259     |                 | 資本財              |  |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 4,499   | 8,016  | 4,168      | 428,848     |                 | 生活必需品流通・小売り      |  |
| LOTTERY CORP LTD/THE          | 8,200   | 11,656 | 5,921      | 609,189     |                 | 消費者サービス          |  |
| TELSTRA GROUP LTD             | 13,294  | 21,808 | 7,981      | 821,162     |                 | 電気通信サービス         |  |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD        | 10,077  | 16,688 | 48,547     | 4,994,586   |                 | 銀行               |  |
| SEVEN GROUP HOLDINGS LTD      | —       | 921    | 3,682      | 378,844     |                 | 資本財              |  |
| 小計                            | 株数      | 金額     | 236,107    | 391,431     | 980,238         | 100,846,892      |  |
|                               | 銘柄数     | <比率>   | 52         | 51          | <1.8%>          |                  |  |
| (ニュージーランド)                    |         |        |            | 千ニュージーランドドル |                 |                  |  |
| SPARK NEW ZEALAND LTD         | 6,304   | 10,733 | 4,701      | 441,015     |                 | 電気通信サービス         |  |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD     | 4,180   | 7,432  | 5,789      | 543,128     |                 | 運輸               |  |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C  | 2,059   | 3,132  | 9,038      | 847,912     |                 | ヘルスケア機器・サービス     |  |
| MERIDIAN ENERGY LTD           | 4,450   | 7,659  | 4,725      | 443,334     |                 | 公益事業             |  |
| MERCURY NZ LTD                | 2,167   | 2,880  | 1,843      | 172,941     |                 | 公益事業             |  |
| EBOS GROUP LTD                | 547     | 854    | 2,976      | 279,196     |                 | ヘルスケア機器・サービス     |  |
| 小計                            | 株数      | 金額     | 19,709     | 32,692      | 29,075          | 2,727,529        |  |
|                               | 銘柄数     | <比率>   | 6          | 6           | <0.0%>          |                  |  |
| (香港)                          |         |        |            | 千香港ドル       |                 |                  |  |
| WHARF HOLDINGS LTD            | —       | 5,270  | 13,148     | 262,447     |                 | 不動産管理・開発         |  |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A      | 1,450   | 2,215  | 15,361     | 306,606     |                 | 不動産管理・開発         |  |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD     | 8,838   | 15,158 | 62,377     | 1,245,064   |                 | 資本財              |  |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES       | 4,775   | 7,615  | 58,635     | 1,170,364   |                 | 不動産管理・開発         |  |
| MTR CORP                      | 5,520   | 10,065 | 28,031     | 559,499     |                 | 運輸               |  |
| HONG KONG & CHINA GAS         | 36,033  | 58,213 | 36,558     | 729,698     |                 | 公益事業             |  |
| NEW WORLD DEVELOPMENT         | 5,522   | —      | —          | —           |                 | 不動産管理・開発         |  |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD     | 5,145   | 6,755  | 31,545     | 629,655     |                 | 公益事業             |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末) |        | 当期末     |           |                 | 業種等                |  |
|--------------------------------|---------|--------|---------|-----------|-----------------|--------------------|--|
|                                | 株数      | 株数     | 評価額     |           | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                    |  |
|                                |         |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額    |                 |                    |  |
| (香港)                           |         |        |         |           |                 |                    |  |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR    | 百株      | 百株     | 千香港ドル   | 千円        |                 |                    |  |
|                                | 4,089   | 7,268  | 207,719 | 4,146,080 |                 | 金融サービス             |  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD       | 7,240   | 7,240  | 5,878   | 117,342   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| CLP HOLDINGS LTD               | 5,460   | 8,550  | 56,002  | 1,117,809 |                 | 公益事業               |  |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT     | 5,596   | 9,656  | 23,947  | 478,000   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| HANG SENG BANK LTD             | 2,493   | 4,961  | 54,124  | 1,080,325 |                 | 銀行                 |  |
| SINO LAND CO                   | 12,474  | 17,734 | 15,215  | 303,706   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 2,530   | 4,530  | 21,291  | 424,968   |                 | 公益事業               |  |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD     | 13,210  | 19,920 | 50,098  | 999,972   |                 | 銀行                 |  |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD   | 4,515   | 7,870  | 88,144  | 1,759,354 |                 | 資本財                |  |
| XINYI GLASS HOLDINGS LTD       | 6,560   | —      | —       | —         |                 | 資本財                |  |
| SANDS CHINA LTD                | 7,756   | 12,656 | 25,375  | 506,490   |                 | 消費者サービス            |  |
| AIA GROUP LTD                  | 40,074  | 63,884 | 410,135 | 8,186,300 |                 | 保険                 |  |
| SWIRE PROPERTIES LTD           | 5,008   | 5,008  | 7,532   | 150,339   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD | 7,670   | 11,630 | 43,379  | 865,862   |                 | 消費者サービス            |  |
| HKT TRUST AND HKT LTD-SS       | 11,650  | 21,890 | 19,701  | 393,231   |                 | 電気通信サービス           |  |
| SITC INTERNATIONAL HOLDINGS    | 3,520   | 6,220  | 11,979  | 239,115   |                 | 運輸                 |  |
| WH GROUP LTD                   | 28,460  | 39,530 | 22,690  | 452,896   |                 | 食品・飲料・タバコ          |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD          | 6,528   | 13,813 | 47,864  | 955,373   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT   | 5,340   | 11,100 | 28,138  | 561,644   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LTD  | 5,620   | —      | —       | —         |                 | 食品・飲料・タバコ          |  |
| ESR GROUP LTD                  | 6,328   | 10,520 | 10,520  | 209,979   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| 小計                             | 株数      | ・金額    | 259,406 | 389,273   | 1,395,397       | 27,852,128         |  |
|                                | 銘柄数     | <比率>   | 28      | 26        | —               | <0.5%>             |  |
| (シンガポール)                       |         |        |         |           |                 |                    |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP   | 11,525  | 19,439 | 27,447  | 3,160,073 |                 | 銀行                 |  |
| SEMCORP INDUSTRIES LTD         | —       | 7,487  | 3,960   | 455,986   |                 | 公益事業               |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD          | 1,181   | 2,241  | 1,340   | 154,287   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD   | 302     | 1,002  | 2,709   | 311,934   |                 | 資本財                |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD         | 6,147   | 11,168 | 39,535  | 4,551,754 |                 | 銀行                 |  |
| KEPPEL LTD                     | 4,775   | 8,016  | 5,394   | 621,099   |                 | 資本財                |  |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD       | 4,074   | 7,383  | 22,400  | 2,578,914 |                 | 銀行                 |  |
| VENTURE CORP LTD               | 769     | —      | —       | —         |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING     | 5,296   | 7,542  | 3,001   | 345,587   |                 | 資本財                |  |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS   | 28,882  | 44,133 | 10,592  | 1,219,464 |                 | 電気通信サービス           |  |
| SINGAPORE AIRLINES LTD         | 4,616   | 8,609  | 5,811   | 669,060   |                 | 運輸                 |  |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD         | 3,035   | 4,090  | 3,799   | 437,449   |                 | 金融サービス             |  |
| SEATRIUM LTD                   | 157,948 | 7,897  | 1,389   | 160,024   |                 | 資本財                |  |
| UOL GROUP LTD                  | 1,940   | —      | —       | —         |                 | 不動産管理・開発           |  |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD       | 6,706   | 8,970  | 2,852   | 328,403   |                 | 食品・飲料・タバコ          |  |
| GENTING SINGAPORE LTD          | 19,145  | 27,725 | 2,453   | 282,490   |                 | 消費者サービス            |  |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI   | 8,020   | 14,321 | 3,709   | 427,033   |                 | 不動産管理・開発           |  |
| 小計                             | 株数      | ・金額    | 264,362 | 180,024   | 136,398         | 15,703,562         |  |
|                                | 銘柄数     | <比率>   | 16      | 15        | —               | <0.3%>             |  |
| (イスラエル)                        |         |        |         |           |                 |                    |  |
| ICL GROUP LTD                  | 2,117   | 5,472  | 9,631   | 404,548   |                 | 素材                 |  |
| BANK HAPOALIM BM               | 4,452   | 6,156  | 20,882  | 877,156   |                 | 銀行                 |  |
| NICE LTD                       | 221     | 324    | 27,462  | 1,153,550 |                 | ソフトウェア・サービス        |  |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL           | 5,209   | 9,007  | 26,534  | 1,114,571 |                 | 銀行                 |  |
| ELBIT SYSTEMS LTD              | 101     | 144    | 10,721  | 450,350   |                 | 資本財                |  |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A         | 4,037   | 7,599  | 14,514  | 609,691   |                 | 銀行                 |  |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO   | 5,724   | —      | —       | —         |                 | 電気通信サービス           |  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD       | 482     | 1,071  | 14,678  | 616,546   |                 | 銀行                 |  |

| 銘柄  | 期首(前期末)                 |                     | 当期末                            |                   |                               | 業種等 |  |
|---|-------------------------|---------------------|--------------------------------|-------------------|-------------------------------|-----|--|
|   | 株数                      | 株数                  | 評価額                            |                   | 千円                            |     |  |
|   |                         |                     | 外貨建金額                          | 邦貨換算金額            |                               |     |  |
| (イスラエル)<br>AZRIELI GROUP LTD<br>TOWER SEMICONDUCTOR LTD<br>FIRST INTL BANK ISRAEL | 百株<br>148<br>357<br>240 | 百株<br>148<br>—<br>— | 千イスラエルシェkel<br>3,583<br>—<br>— | 150,503<br>—<br>— | 不動産管理・開発<br>半導体・半導体製造装置<br>銀行 |     |  |
| 小計  | 株数<br>銘柄数 <比率>          | 23,091<br>11        | 29,924<br>8                    | 128,008<br>—      | 5,376,919<br><0.1%>           |     |  |
| 合計  | 株数<br>銘柄数 <比率>          | 3,868,798<br>1,214  | 6,051,181<br>1,193             | —<br>—            | 5,289,674,799<br><96.6%>      |     |  |

(注) 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) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |       | 当期末     |           |            | 比率  |  |
|------------------------------|----------|-------|---------|-----------|------------|-----|--|
|                              | 口数       | 口数    | 評価額     |           |            |     |  |
|                              |          |       | 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        |            | %   |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 171      | 437   | 8,559   | 1,335,077 | 0.0        |     |  |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 53       | 99    | 12,074  | 1,883,417 | 0.0        |     |  |
| PROLOGIS INC                 | 311      | 528   | 56,760  | 8,853,439 | 0.2        |     |  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 32       | 68    | 7,294   | 1,137,728 | 0.0        |     |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 99       | 174   | 24,638  | 3,843,071 | 0.1        |     |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 57       | 94    | 5,963   | 930,164   | 0.0        |     |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 21       | 37    | 9,705   | 1,513,855 | 0.0        |     |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 45       | 122   | 17,983  | 2,805,135 | 0.1        |     |  |
| WELLTOWER INC                | 161      | 316   | 31,249  | 4,874,289 | 0.1        |     |  |
| BOSTON PROPERTIES INC        | 47       | 93    | 5,733   | 894,353   | 0.0        |     |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 177      | —     | —       | —         | —          |     |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 39       | 61    | 8,378   | 1,306,949 | 0.0        |     |  |
| REALTY INCOME CORP           | 212      | 480   | 26,449  | 4,125,622 | 0.1        |     |  |
| REGENCY CENTERS CORP         | 55       | 92    | 5,504   | 858,648   | 0.0        |     |  |
| SUN COMMUNITIES INC          | 43       | 75    | 8,849   | 1,380,346 | 0.0        |     |  |
| UDR INC                      | 113      | 183   | 7,145   | 1,114,486 | 0.0        |     |  |
| VENTAS INC                   | 137      | 240   | 11,417  | 1,780,892 | 0.0        |     |  |
| WEYERHAEUSER CO              | 241      | 413   | 12,798  | 1,996,301 | 0.0        |     |  |
| AMERICAN TOWER CORP          | 157      | 266   | 49,118  | 7,661,521 | 0.1        |     |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 140      | —     | —       | —         | —          |     |  |
| WP CAREY INC                 | 68       | 115   | 6,770   | 1,056,016 | 0.0        |     |  |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A     | 107      | 170   | 6,164   | 961,584   | 0.0        |     |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 85       | 138   | 6,121   | 954,904   | 0.0        |     |  |
| IRON MOUNTAIN INC            | 93       | 164   | 13,091  | 2,041,992 | 0.0        |     |  |
| EQUINIX INC                  | 31       | 53    | 40,673  | 6,344,295 | 0.1        |     |  |
| CROWN CASTLE INC             | 146      | 250   | 24,890  | 3,882,456 | 0.1        |     |  |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 123      | 205   | 13,710  | 2,138,490 | 0.0        |     |  |
| INVITATION HOMES INC         | 202      | 353   | 12,307  | 1,919,684 | 0.0        |     |  |
| VICI PROPERTIES INC          | 330      | 591   | 17,462  | 2,723,859 | 0.0        |     |  |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 37       | 60    | 12,000  | 1,871,901 | 0.0        |     |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 236      | 370   | 6,787   | 1,058,672 | 0.0        |     |  |
| PUBLIC STORAGE               | 53       | 91    | 25,175  | 3,926,899 | 0.1        |     |  |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 111      | 184   | 27,246  | 4,249,887 | 0.1        |     |  |
| KIMCO REALTY CORP            | 206      | 388   | 7,377   | 1,150,784 | 0.0        |     |  |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 47       | 80    | 15,762  | 2,458,622 | 0.0        |     |  |
| 小計                           | 口数・金額    | 4,203 | 7,004   | 545,168   | 85,035,357 |     |  |
|                              | 銘柄数 <比率> | 35    | 33      | —         | <1.6%>     |     |  |
| (カナダ)                        |          |       | 千カナダドル  |           |            |     |  |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA |          | 23    | 36      | 1,663     | 189,629    | 0.0 |  |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  |          | 58    | 58      | 1,037     | 118,330    | 0.0 |  |
| 小計                           | 口数・金額    | 81    | 94      | 2,700     | 307,960    |     |  |
|                              | 銘柄数 <比率> | 2     | 2       | —         | <0.0%>     |     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |        |            |            | 比率  |  |
|------------------------------|---------|--------|--------|------------|------------|-----|--|
|                              |         | 口数     | 口数     | 評価額        |            |     |  |
|                              |         |        |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |     |  |
| (ユーロ…フランス)                   |         | 千口     | 千口     | 千ユーロ       | 千円         | %   |  |
| GECINA SA                    |         | 16     | 24     | 2,451      | 411,787    | 0.0 |  |
| KLEPIERRE                    |         | 71     | 129    | 3,292      | 552,986    | 0.0 |  |
| COVIVIO                      |         | 13     | 26     | 1,283      | 215,523    | 0.0 |  |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE |         | 35     | 64     | 5,154      | 865,832    | 0.0 |  |
| 小計                           | 口数・金額   | 136    | 245    | 12,182     | 2,046,129  |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 4      | 4      | —          | <0.0%>     |     |  |
| (ユーロ…ベルギー)                   |         |        |        |            |            |     |  |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA       |         | 50     | 98     | 2,556      | 429,464    | 0.0 |  |
| 小計                           | 口数・金額   | 50     | 98     | 2,556      | 429,464    |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 1      | 1      | —          | <0.0%>     |     |  |
| ユ一口計                         | 口数・金額   | 187    | 344    | 14,739     | 2,475,594  |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 5      | 5      | —          | <0.0%>     |     |  |
| (イギリス)                       |         |        |        | 千イギリスポンド   | —          |     |  |
| BRITISH LAND CO PLC          |         | 317    | —      | —          | —          | —   |  |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |         | 250    | 352    | 2,353      | 459,584    | 0.0 |  |
| SEGRO PLC                    |         | 403    | 726    | 6,398      | 1,249,304  | 0.0 |  |
| 小計                           | 口数・金額   | 971    | 1,079  | 8,752      | 1,708,889  |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 3      | 2      | —          | <0.0%>     |     |  |
| (オーストラリア)                    |         |        |        | 千オーストラリアドル |            |     |  |
| VICINITY CENTRES             |         | 1,315  | 1,843  | 3,538      | 364,089    | 0.0 |  |
| SCENTRE GROUP                |         | 1,734  | 3,534  | 11,205     | 1,152,778  | 0.0 |  |
| DEXUS/AU                     |         | 413    | 603    | 4,306      | 443,010    | 0.0 |  |
| GPT GROUP                    |         | 656    | 891    | 3,814      | 392,411    | 0.0 |  |
| MIRVAC GROUP                 |         | 1,521  | 2,214  | 4,629      | 476,263    | 0.0 |  |
| STOCKLAND                    |         | 815    | 1,319  | 6,032      | 620,596    | 0.0 |  |
| GOODMAN GROUP                |         | 587    | 965    | 32,492     | 3,342,836  | 0.1 |  |
| 小計                           | 口数・金額   | 7,044  | 11,373 | 66,018     | 6,791,985  |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 7      | 7      | —          | <0.1%>     |     |  |
| (香港)                         |         |        |        | 千香港ドル      |            |     |  |
| LINK REIT                    |         | 865    | 1,336  | 47,294     | 943,996    | 0.0 |  |
| 小計                           | 口数・金額   | 865    | 1,336  | 47,294     | 943,996    |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 1      | 1      | —          | <0.0%>     |     |  |
| (シンガポール)                     |         |        |        | 千シンガポールドル  |            |     |  |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST      |         | 45     | —      | —          | —          | —   |  |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST    |         | 1,029  | 1,470  | 2,014      | 231,970    | 0.0 |  |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST |         | 650    | 1,782  | 2,210      | 254,500    | 0.0 |  |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER |         | 1,879  | 2,977  | 5,805      | 668,385    | 0.0 |  |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT     |         | 1,134  | 2,228  | 5,793      | 667,014    | 0.0 |  |
| 小計                           | 口数・金額   | 4,740  | 8,458  | 15,824     | 1,821,871  |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 5      | 4      | —          | <0.0%>     |     |  |
| 合計                           | 口数・金額   | 18,094 | 29,691 | —          | 99,085,654 |     |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 58     | 54     | —          | <1.8%>     |     |  |

(注) 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) 比率および合計欄の&lt;&gt;内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別  |        |          | 当 期 末  |       |     |
|--------|--------|----------|--------|-------|-----|
|        |        |          | 買 建 額  | 売 建 額 |     |
| 外<br>国 | 株式先物取引 | SP EMINI |        | 百万円   | 百万円 |
|        |        | SP/TSE60 | 69,188 |       | —   |
|        |        | SWISS IX | 2,779  |       | —   |
|        |        | EURO ST  | 2,221  |       | —   |
|        |        | SPI 200  | 11,204 |       | —   |
|        |        | FTSE100  | 3,101  |       | —   |
|        |        |          | 3,976  |       | —   |

(注) 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。

## ○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

| 項 目          | 当 期 末         |     |       |
|--------------|---------------|-----|-------|
|              | 評 價 額         | 比 率 | %     |
| 株式           | 千円            |     |       |
|              | 5,289,674,799 |     | 94.9  |
| 投資証券         | 99,085,654    |     | 1.8   |
| コール・ローン等、その他 | 186,512,974   |     | 3.3   |
| 投資信託財産総額     | 5,575,273,427 |     | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産（5,470,881,392千円）の投資信託財産総額（5,575,273,427千円）に対する比率は98.1%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                      |                     |                    |                    |
|----------------------|---------------------|--------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=155.98円     | 1 カナダドル=114.02円     | 1 ユーロ=167.96円      | 1 イギリスポンド=195.24円  |
| 1 スイスフラン=172.03円     | 1 スウェーデンクローネ=14.38円 | 1 ノルウェークローネ=14.36円 | 1 デンマーククローネ=22.52円 |
| 1 オーストラリアドル=102.88円  | 1 ニュージーランドドル=93.81円 | 1 香港ドル=19.96円      | 1 シンガポールドル=115.13円 |
| 1 イスラエルシェケル=42.0043円 |                     |                    |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

| 項目              | 当期末               |
|-----------------|-------------------|
| (A) 資産          | 円                 |
| コール・ローン等        | 5,586,789,538,911 |
| 株式(評価額)         | 107,748,369,250   |
| 投資証券(評価額)       | 5,289,674,799,903 |
| 未収入金            | 99,085,654,413    |
| 未収配当金           | 12,758,274,513    |
| 未利利息            | 6,436,782,471     |
| 差入委託証拠金         | 13,996            |
|                 | 71,085,644,365    |
| (B) 負債          | 111,712,763,854   |
| 未払金             | 107,832,547,555   |
| 未払解約金           | 3,880,216,299     |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 5,475,076,775,057 |
| 元本              | 774,611,668,743   |
| 次期繰越損益金         | 4,700,465,106,314 |
| (D) 受益権総口数      | 774,611,668,743口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 70,682円           |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 492,758,095,240円  
 期中追加設定元本額 352,635,498,102円  
 期中一部解約元本額 70,781,924,599円  
 また、1口当たり純資産額は、期末7,0682円です。

## ○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項目                 | 当期                |
|--------------------|-------------------|
| (A) 配当等収益          | 円                 |
| 受取配当金              | 71,241,999,723    |
| 受取利息               | 67,067,138,701    |
| その他収益金             | 4,121,399,572     |
| 支払利息               | 55,641,570        |
|                    | △ 2,180,120       |
| (B) 有価証券売買損益       | 1,246,597,473,474 |
| 売買益                | 1,355,889,221,128 |
| 売買損                | △ 109,291,747,654 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 20,167,731,950    |
| 取引益                | 30,927,401,024    |
| 取引損                | △ 10,759,669,074  |
| (D) 保管費用等          | △ 697,769,017     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 1,337,309,436,130 |
| (F) 前期繰越損益金        | 1,929,054,490,769 |
| (G) 追加信託差損益金       | 1,781,623,932,516 |
| (H) 解約差損益金         | △ 347,522,753,101 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 4,700,465,106,314 |
| 次期繰越損益金(I)         | 4,700,465,106,314 |

(注) (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算によるものを含みます。

(注) (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) (H) 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。

## ②期末における元本の内訳 (当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

|   |                  |
|---|------------------|
| e MAX I S S 1 i m 全世界株式 (オール・カントリー)         | 396,564,089,032円 |
| e MAX I S S 1 i m 先進国株式インデックス               | 103,891,413,789円 |
| e MAX I S S 1 i m 全世界株式 (除く日本)              | 61,520,603,152円  |
| つみたて先進国株式                                   | 34,443,030,510円  |
| 三菱UFJ DC海外株式インデックスファンド                      | 33,493,006,523円  |
| e MAX I S 先進国株式インデックス                       | 13,965,558,508円  |
| 三菱UFJ ブライムバランス (成長型) (確定拠出年金)               | 10,009,880,008円  |
| MUAM 外国株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)             | 8,795,121,217円   |
| 海外株式インデックスファンドS                             | 8,360,393,838円   |
| MUKAM 下方リスク抑制型ダイナミックアロケーションファンド (適格機関投資家限定) | 8,359,055,960円   |
| 三菱UFJ ブライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)             | 8,215,040,381円   |
| 三菱UFJ <DC>外国株式インデックスファンド                    | 7,097,334,937円   |
| e MAX I S 全世界株式インデックス                       | 6,578,209,797円   |
| MAX I S全世界株式 (オール・カントリー) 上場投信               | 5,891,799,426円   |
| e MAX I S S 1 i m バランス (8資産均等型)             | 4,946,100,414円   |
| MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)       | 4,776,531,798円   |
| 三菱UFJ D C年金インデックス (先進国株式)                   | 4,771,299,276円   |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド (適格機関投資家限定)            | 4,162,118,971円   |
| MAX I S 海外株式 (MSCIコクサイ) 上場投信                | 3,034,428,477円   |
| 三菱UFJ 外国株式インデックスファンド                        | 2,924,353,561円   |
| ダイナミックアロケーションファンド (ラップ向け)                   | 2,889,476,184円   |

|  |                |
|--|----------------|
| ラップ向けインデックス f 先進国株式                        | 2,774,559,091円 |
| 三菱UF J バランスマネジメント4 O V A (適格機関投資家限定)       | 2,774,378,925円 |
| つみたて全世界株式                                  | 2,595,955,425円 |
| MUKAM 外国株式インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)          | 2,574,905,062円 |
| つみたて8資産均等バランス                              | 2,468,461,341円 |
| 海外株式セレクション (ラップ向け)                         | 2,155,934,851円 |
| MUKAM バランス・イノベーション (株式抑制型) (適格機関投資家転売制限付)  | 1,718,105,228円 |
| 三菱UF J プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)             | 1,634,797,228円 |
| MUKAM 下方リスク抑制型バランスファンド (適格機関投資家限定)         | 1,504,011,958円 |
| 三菱UF J DC年金バランス (株式65)                     | 1,423,269,015円 |
| 三菱UF J プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)             | 1,282,188,995円 |
| 三菱UF J バランス・イノベーション (株式重視型)                | 1,242,558,534円 |
| 三菱UF J 外国株式ファンドV A (適格機関投資家限定)             | 1,159,859,644円 |
| e MAX I S バランスマネジメント (8資産均等型)              | 938,554,076円   |
| つみたて4資産均等バランス                              | 914,754,080円   |
| e MAX I S 最適化バランス (マイストライカー)               | 905,109,245円   |
| 三菱UF J ライフセレクトファンド (安定成長型)                 | 893,008,302円   |
| 三菱UF J ライフセレクトファンド (成長型)                   | 878,561,528円   |
| 三菱UF J DCバランス・イノベーション (KAKUSHIN)           | 751,025,076円   |
| e MAX I S S l i m 全世界株式 (3地域均等型)           | 707,849,391円   |
| 三菱UF J バランスマネジメントVA 40型 (適格機関投資家限定)        | 566,476,024円   |
| 三菱UF J バランス・イノベーション (株式抑制型)                | 539,658,586円   |
| MUKAM バランス・イノベーション (リスク抑制型) (適格機関投資家転売制限付) | 539,064,955円   |
| e MAX I S 最適化バランス (マイミッドフィルダー)             | 512,237,230円   |
| 三菱UF J DC年金バランス (株式40)                     | 487,748,865円   |
| 三菱UF J バランスマネジメント5 0 V A (適格機関投資家限定)       | 451,419,128円   |
| e MAX I S 最適化バランス (マイフォワード)                | 437,696,236円   |
| e MAX I S バランスマネジメント (4資産均等型)              | 383,171,553円   |
| 三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)      | 374,680,568円   |
| 三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)      | 358,685,869円   |
| 三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型)    | 321,266,335円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)         | 269,526,947円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)         | 252,504,051円   |
| 外国株式インデックスオーブンV (適格機関投資家限定)                | 231,260,768円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)         | 220,684,878円   |
| 三菱UF J バランスマネジメント (新興国投資型)                 | 209,645,008円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)         | 195,803,100円   |
| 三菱UF J ライフセレクトファンド (安定型)                   | 171,073,754円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)         | 167,216,984円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付)     | 163,183,895円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)         | 157,763,789円   |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)         | 150,858,029円   |
| 三菱UF J バランスマネジメント (債券重視型)                  | 133,788,927円   |
| 全世界株式インデックスファンドV (適格機関投資家限定)               | 122,902,019円   |
| e MAX I S 最適化バランス (マイディフェンダー)              | 116,954,168円   |
| 三菱UF J 6資産バランスファンド (成長型)                   | 112,470,690円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)       | 82,874,954円    |
| e MAX I S バランスマネジメント (波乗り型)                | 82,496,909円    |
| e MAX I S 最適化バランス (マイゴールキーパー)              | 79,078,211円    |
| ラップ向けダイナミックアロケーションファンド                     | 75,454,408円    |
| MUKAM バランスマネジメント (債券重視型) (適格機関投資家転売制限付)    | 74,150,341円    |
| 三菱UF J <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)      | 74,062,642円    |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)         | 71,658,696円    |
| 三菱UF J DC年金バランス (株式15)                     | 60,071,509円    |

|   |                  |
|---|------------------|
| 三義UFJ DC年金バランス（株式80）                      | 56,059,955円      |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                | 53,264,440円      |
| アドバンスト・バランスII（FOFs用）（適格機関投資家限定）           | 47,833,270円      |
| 三義UFJ DC年金バランス（株式25）                      | 41,591,609円      |
| 三義UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）                 | 41,384,222円      |
| 三義UFJ バランスファンドVA 20型（適格機関投資家限定）           | 28,240,118円      |
| 全世界株式（除く日本）インデックスファンドV（適格機関投資家限定）         | 27,797,533円      |
| 三義UFJ 外国株式インデックスファンドVA                    | 20,214,208円      |
| MUKAM バランス・イノベーション（リスク抑制型）2（適格機関投資家転売制限付） | 15,832,711円      |
| アドバンスト・バランスI（FOFs用）（適格機関投資家限定）            | 7,524,849円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                     | 7,068,306円       |
| 三義UFJ バランスVA 60G（適格機関投資家限定）               | 6,840,467円       |
| 三義UFJ バランスVA 60D（適格機関投資家限定）               | 5,943,134円       |
| 三義UFJ バランスファンド45VA（適格機関投資家限定）             | 4,334,601円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                     | 3,391,309円       |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                     | 1,890,733円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA                | 1,689,831円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA              | 1,500,623円       |
| グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）                 | 1,020,334円       |
| ファンド・マネジャー（海外株式）                          | 777,391円         |
| 三義UFJ バランスVA 30D（適格機関投資家限定）               | 686,006円         |
| 三義UFJ バランスVA 30G（適格機関投資家限定）               | 659,162円         |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA                | 618,598円         |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金）          | 568,491円         |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA                | 396,072円         |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）                | 199,817円         |
| 三義UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）           | 58,173円          |
| 合計  | 774,611,668,743円 |

## [ お知らせ ]

- ①委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三義UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)
- ②信託金限度額の引き上げを行うため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2024年2月29日)

# 新興国株式インデックスマザーファンド

**《第15期》決算日2024年5月13日**

**[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]**

「新興国株式インデックスマザーファンド」は、5月13日に第15期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 新興国の株式等（D R（預託証書）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式等の組入比率は原則として高位を保ちます。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主要運用対象 | 新興国の株式等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制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。   |

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | MSCIエマージング・マーケット・インデックス<br>(配当込み、円換算ベース) |             | 株式組入比率  | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額              |
|-----------------|----------|--|-------------|---------|--------|------------|-------------------|
|                 |          | 期中騰落率                                    | 期中騰落率       |         |        |            |                   |
| 11期(2020年5月12日) | 円 21,268 | % △11.3                                  | % 46,859.15 | % △10.9 | % 94.8 | % 5.4      | % 0.1 百万円 104,071 |
| 12期(2021年5月12日) | 31,925   | 50.1                                     | 70,251.29   | 49.9    | 94.5   | 5.4        | 0.1 219,059       |
| 13期(2022年5月12日) | 29,503   | △ 7.6                                    | 65,180.75   | △ 7.2   | 95.3   | 4.4        | 0.1 295,087       |
| 14期(2023年5月12日) | 30,486   | 3.3                                      | 67,352.97   | 3.3     | 98.1   | 1.5        | 0.1 419,560       |
| 15期(2024年5月13日) | 39,657   | 30.1                                     | 87,810.97   | 30.4    | 96.3   | 3.6        | 0.1 819,032       |

(注) MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み）とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(注) 外国の指數は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日         | 基<br>準<br>価<br>額 | M S C I エマージング・マーケット・インデックス<br>(配当込み、円換算ベース) |                | 株<br>組<br>入<br>比<br>率 | 株<br>先<br>物<br>比<br>率 | 投<br>資<br>信<br>託<br>證<br>組<br>入<br>比<br>率 |
|---------------------|------------------|--|----------------|-----------------------|-----------------------|---|
|                     |                  | 騰<br>落<br>率                                  | 騰<br>落<br>率    |                       |                       |   |
| (期 首)<br>2023年5月12日 | 円<br>30,486      | %<br>—                                       | %<br>67,352.97 | %<br>—                | %<br>98.1             | %<br>1.5                                  |
| 5月末                 | 31,500           | 3.3  | 69,490.71      | 3.2                   | 97.9                  | 2.4                                       |
| 6月末                 | 33,382           | 9.5  | 73,692.91      | 9.4                   | 96.1                  | 3.8                                       |
| 7月末                 | 34,463           | 13.0   | 76,068.40      | 12.9                  | 95.5                  | 4.4                                       |
| 8月末                 | 33,932           | 11.3   | 74,900.75      | 11.2                  | 95.7                  | 4.2                                       |
| 9月末                 | 33,220           | 9.0  | 73,348.35      | 8.9                   | 95.4                  | 4.6                                       |
| 10月末                | 32,412           | 6.3  | 71,634.43      | 6.4                   | 96.3                  | 4.2                                       |
| 11月末                | 34,035           | 11.6   | 75,243.22      | 11.7                  | 96.4                  | 3.8                                       |
| 12月末                | 34,206           | 12.2   | 75,649.14      | 12.3                  | 93.6                  | 6.3                                       |
| 2024年1月末            | 34,132           | 12.0   | 75,477.28      | 12.1                  | 95.6                  | 4.9                                       |
| 2月末                 | 36,223           | 18.8   | 80,166.84      | 19.0                  | 96.1                  | 3.9                                       |
| 3月末                 | 37,284           | 22.3   | 82,516.03      | 22.5                  | 97.3                  | 2.6                                       |
| 4月末                 | 39,105           | 28.3   | 86,560.95      | 28.5                  | 97.9                  | 1.9                                       |
| (期 末)<br>2024年5月13日 | 39,657           | 30.1   | 87,810.97      | 30.4                  | 96.3                  | 3.6                                       |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

#### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ30.1%の上昇となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(30.4%)を0.3%下回りました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

## ●基準価額の主な変動要因

### (上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

## ●投資環境について

### ◎新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

- ・主要国の長期金利の上昇などを受けて新興国株式市況は下落する場面がみられたものの、主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて上昇して期間を終えました。

### ◎為替市況

米ドル、香港ドルは対円で上昇しました。

- ・為替市況は、期間の初めに比べて円安・米ドル高、円安・香港ドル高となりました。

## ●当該投資信託の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（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式等（先物・不動産投資信託証券（REIT）を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

- ・株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは30.4%の上昇になったため、カイ離は△0.3%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

### (主なプラス要因)

- ・銘柄選択要因によるものです。

### (主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

## ○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2023年5月13日～2024年5月13日)

| 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>（投資信託証券）<br>（先物・オプション） | 円<br>11<br>(9)<br>(0)<br>(2) | %<br>0.033<br>(0.027)<br>(0.000)<br>(0.005) | (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>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (b) 有価証券取引税<br>（株式）<br>（投資信託証券）               | 11<br>(11)<br>(0)            | 0.033<br>(0.033)<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>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (c) その他の費用<br>（保管費用）<br>（その他）                 | 43<br>(37)<br>(6)            | 0.124<br>(0.107)<br>(0.017)                 | (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>有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計  | 65                           | 0.190                                       |   |
| 期中の平均基準価額は、34,329円です。                         |                              |   |   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 株式

|        |        | 買付                        |                                   | 売付                       |                               |
|--------|--------|---------------------------|-----------------------------------|--------------------------|-------------------------------|
|        |        | 株数                        | 金額                                | 株数                       | 金額                            |
| 外<br>国 | アメリカ   | 百株<br>40,774<br>( 16,440) | 千アメリカドル<br>46,697<br>( —)         | 百株<br>11,477<br>( 3,474) | 千アメリカドル<br>4,954<br>( 10,989) |
|        | メキシコ   | 162,900<br>( 15,319)      | 千メキシコペソ<br>744,928<br>( —)        | 104,821                  | 千メキシコペソ<br>162,090            |
|        | ブラジル   | 181,111<br>( 15,389)      | 千ブラジルレアル<br>468,416<br>(△ 283)    | 28,358                   | 千ブラジルレアル<br>61,321            |
|        | チリ     | 1,508,024<br>( 92)        | 千チリペソ<br>8,011,096<br>( —)        | 41,952                   | 千チリペソ<br>840,178              |
|        | コロンビア  | 1,750                     | 千コロンビアペソ<br>5,438,397             | 328                      | 千コロンビアペソ<br>1,038,335         |
|        | ユーロ    |                           | 千ユーロ                              |                          | 千ユーロ                          |
|        | ギリシャ   | 24,411<br>( —)            | 9,614<br>(△ 39)                   | 3,293                    | 1,714                         |
|        | トルコ    | 49,743<br>( 35,194)       | 千トルコリラ<br>438,405<br>( —)         | 16,611                   | 千トルコリラ<br>122,132             |
|        | チェコ    | 1,716                     | 千チェコクロナ<br>79,487                 | 727                      | 千チェコクロナ<br>15,351             |
|        | ハンガリー  | 1,537                     | 千ハンガリーフォリント<br>902,839            | —                        | 千ハンガリーフォリント<br>—              |
|        | ポーランド  | 8,193                     | 千ポーランドズロチ<br>62,083               | 2,014                    | 千ポーランドズロチ<br>4,691            |
|        | 香港     | 1,931,477<br>( 17,716)    | 千香港ドル<br>2,757,897<br>( 84,589)   | 483,803<br>( 9,275)      | 千香港ドル<br>312,609<br>( 3,083)  |
|        | マレーシア  | 255,068                   | 千マレーシアリンギット<br>119,989            | 84,887                   | 千マレーシアリンギット<br>21,796         |
|        | タイ     | 443,362                   | 千タイバーツ<br>1,061,975               | 158,316                  | 千タイバーツ<br>280,770             |
|        | フィリピン  | 65,742                    | 千フィリピンペソ<br>573,128               | 54,171<br>( 950)         | 千フィリピンペソ<br>146,364<br>( —)   |
|        | インドネシア | 8,686,784<br>( 38,667)    | 千インドネシアルピア<br>562,668,715<br>( —) | 110,670                  | 千インドネシアルピア<br>58,418,703      |

|        |          | 買付                     |  | 売付                  |   |
|--------|----------|------------------------|--|---------------------|---|
|        |          | 株数                     | 金額   | 株数                  | 金額  |
| 外<br>国 | 韓国       | 百株<br>39,871<br>( 739) | 千韓国ウォン<br>301,107,372<br>( 58,163)               | 百株<br>7,010<br>( —) | 千韓国ウォン<br>31,753,346<br>( 84,065)               |
|        | 台湾       | 851,160<br>( 11,668)   | 千ニュー台灣ドル<br>8,632,742<br>(△ 21,561)              | 74,235              | 千ニュー台灣ドル<br>711,856                             |
|        | インド      | 522,770<br>( 31,843)   | 千インドルピー <sup>一</sup><br>27,520,580<br>( 332,465) | 18,879<br>( 48)     | 千インドルピー <sup>一</sup><br>1,924,086<br>( 333,930) |
|        | 中国オフショア  | 599,766<br>( 6,074)    | 千オフショア元<br>713,891<br>( —)                       | 142,610             | 千オフショア元<br>160,810                              |
|        | アラブ首長国連邦 | 85,056<br>( 16,945)    | 千アラブディルハム<br>68,702<br>( —)                      | 8,664               | 千アラブディルハム<br>1,969                              |
|        | クウェート    | 57,636<br>( 9,629)     | 千クウェートディナール<br>4,265<br>( —)                     | 12,200              | 千クウェートディナール<br>514                              |
|        | サウジアラビア  | 62,910<br>( 9,298)     | 千サウジアラビアリヤル<br>286,486<br>( —)                   | 8,897               | 千サウジアラビアリヤル<br>22,710                           |
|        | カタール     | 101,750                | 千カタールリアル<br>53,774                               | —                   | 千カタールリアル<br>—                                   |
|        | 南アフリカ    | 77,805<br>( —)         | 千南アフリカランド<br>983,656<br>(△ 3,661)                | 17,275              | 千南アフリカランド<br>244,393                            |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )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。

## 投資信託証券

| 銘柄     | 買付                            |             | 売付             |       |           |
|--------|-------------------------------|-------------|----------------|-------|-----------|
|        | 口数                            | 金額          | 口数             | 金額    |           |
| 外<br>国 | メキシコ                          | 千口          | 千メキシコペソ        | 千口    | 千メキシコペソ   |
|        | TRUST FIBRA UNO               | 237         | 6,963          | —     | —         |
|        | PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA   | 691<br>( 9) | 51,008<br>( —) | —     | —         |
|        | 小計                            | 929<br>( 9) | 57,971<br>( —) | —     | —         |
|        | 香港                            |             | 千香港ドル          |       | 千香港ドル     |
|        | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT | —<br>( 47)  | —<br>( 87)     | 47    | 73        |
|        | 小計                            | —<br>( 47)  | —<br>( 87)     | 47    | 73        |
|        | 南アフリカ                         |             | 千南アフリカランド      |       | 千南アフリカランド |
|        | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD    | —           | —              | 1,670 | 17,705    |
|        | 小計                            | —           | —              | 1,670 | 17,705    |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## 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>352,466 | 百万円<br>333,382 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○株式売買比率

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 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       | 299,019,967千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 554,197,122千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.53          |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|        |                |                    |               |                |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>478,680 | 百万円<br>3,971       | 0.8           | 百万円<br>238,287 | 百万円<br>153         | 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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年5月13日現在)

## 外国株式

| 銘<br>柄                         | 期首(前期末)<br>株<br>数 | 当<br>期<br>末 |             |                 | 業<br>種<br>等            |
|--------------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------|------------------------|
|                                |                   | 株<br>数      | 評<br>価<br>額 | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |                        |
| (アメリカ)                         | 百株                | 百株          | 千アメリカドル     | 千円              |                        |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR         | 2,565             | —           | —           | —               | 消費者サービス                |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR   | 1,303             | 1,303       | 2,266       | 353,500         | 素材                     |
| MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO   | 1,728             | 1,728       | —           | —               | 電気通信サービス               |
| SOUTHERN COPPER CORP           | 404               | 551         | 6,552       | 1,022,078       | 素材                     |
| CREDICORP LTD                  | 342               | 485         | 8,500       | 1,325,976       | 銀行                     |
| H WORLD GROUP LTD-ADR          | 928               | 1,342       | 5,365       | 836,870         | 消費者サービス                |
| YANDEX NV-A                    | 925               | 925         | —           | —               | メディア・娯楽                |
| JOYY INC-ADR                   | 204               | —           | —           | —               | メディア・娯楽                |
| TAL EDUCATION GROUP- ADR       | 2,297             | 2,672       | 3,585       | 559,325         | 消費者サービス                |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ   | 4,251             | 4,251       | —           | —               | 金融サービス                 |
| AUTOHOME INC-ADR               | 387               | 387         | 1,128       | 176,073         | メディア・娯楽                |
| MMC NORILSK NICKEL PJSC        | 194               | 19,483      | —           | —               | 素材                     |
| TATNEFT PJSC                   | 4,557             | 4,557       | —           | —               | エネルギー                  |
| ROSNEFT OIL CO PJSC            | 3,849             | 3,849       | —           | —               | エネルギー                  |
| VTB BANK PJSC                  | 13,059,900        | 13,059,900  | —           | —               | 銀行                     |
| SURGUTNEfteGAS PJSC            | 24,053            | 24,053      | —           | —               | エネルギー                  |
| SURGUTNEfteGAS-PREFERENCE      | 23,150            | 23,150      | —           | —               | エネルギー                  |
| SEVERSTAL PJSC                 | 628               | 628         | —           | —               | 素材                     |
| ALROSA PJSC                    | 7,459             | 7,459       | —           | —               | 素材                     |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR     | 2,005             | 2,104       | 3,346       | 522,054         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| WEIBO CORP-SPON ADR            | 332               | —           | —           | —               | メディア・娯楽                |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR     | 1,998             | 2,999       | 6,253       | 975,378         | 運輸                     |
| YUM CHINA HOLDINGS INC         | 1,967             | 2,951       | 11,170      | 1,742,300       | 消費者サービス                |
| INTER RAO UES PJSC             | 122,390           | 122,390     | —           | —               | 公益事業                   |
| NOVOLIPETSK STEEL PJSC         | 4,390             | 4,390       | —           | —               | 素材                     |
| IQIYI INC-ADR                  | 1,860             | 2,416       | 1,181       | 184,330         | メディア・娯楽                |
| PDD HOLDINGS INC               | 2,384             | 4,065       | 55,407      | 8,642,422       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| TECENT MUSIC ENTERTAINM-ADR    | 3,520             | 5,510       | 7,350       | 1,146,562       | メディア・娯楽                |
| NIO INC - ADR                  | 6,550             | 8,405       | 4,261       | 664,730         | 自動車・自動車部品              |
| ZAI LAB LTD-ADR                | 439               | —           | —           | —               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KE HOLDINGS INC-ADR            | 3,145             | 4,685       | 8,012       | 1,249,775       | 不動産管理・開発               |
| LUFAX HOLDING LTD-ADR          | 2,586             | —           | —           | —               | 金融サービス                 |
| VK CO LTD                      | 346               | —           | —           | —               | メディア・娯楽                |
| DAQO NEW ENERGY CORP-ADR       | 303               | —           | —           | —               | 半導体・半導体製造装置            |
| QIFU TECHNOLOGY INC            | 542               | 1,020       | 2,108       | 328,858         | 金融サービス                 |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR        | 204               | 204         | —           | —               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| LEGEND BIOTECH CORP-ADR        | 274               | 487         | 2,105       | 328,460         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KANZHUN LTD - ADR              | 923               | 1,502       | 3,119       | 486,625         | メディア・娯楽                |
| UNITED CO RUSAL INTERNATIONALA | 10,718            | 10,718      | —           | —               | 素材                     |
| POLYUS PJSC                    | 108               | 108         | —           | —               | 素材                     |
| LUKOIL PJSC                    | 1,226             | 1,226       | —           | —               | エネルギー                  |
| MAGNIT PJSC                    | 235               | 235         | —           | —               | 生活必需品流通・小売り            |
| NOVATEK PJSC                   | 2,827             | 2,827       | —           | —               | エネルギー                  |
| GAZPROM PJSC                   | 35,873            | 35,873      | —           | —               | エネルギー                  |
| MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR   | 469               | —           | —           | —               | 一般消費財・サービス流通・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     |              |  |
| (アメリカ)                       |         | 百株         | 百株         | 千アメリカドル   | 千円         |              |  |
| VK IPJSC                     | —       | 346        | —          | —         | —          | ソフトウェア・サービス  |  |
| X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | 342     | 342        | —          | —         | —          | 生活必需品流通・小売   |  |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS    | 0.02    | —          | —          | —         | —          | 生活必需品流通・小売   |  |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 7,966   | 7,966      | —          | —         | —          | 銀行           |  |
| COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 15,707  | 34,422     | 5,314      | 828,998   | —          | 銀行           |  |
| PHOSAGRO PJSC-GDR REG S      | 539     | 539        | —          | —         | —          | 素材           |  |
| TCS GROUP HOLDING-GDR REG S  | 382     | 382        | —          | —         | —          | 銀行           |  |
| INNER MONGOLIA YITAI COAL-B  | 5,352   | 5,352      | 1,027      | 160,199   | —          | エネルギー        |  |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B | 2,673   | 5,805      | 1,225      | 191,076   | —          | ソフトウェア・サービス  |  |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 4,025   | —          | —          | —         | —          | 不動産管理・開発     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 13,383,749 | 13,426,013 | 139,284   | 21,725,598 |              |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 54         | 45         | —         | <2.7%>     |              |  |
| (メキシコ)                       |         |            |            | 千メキシコペソ   |            |              |  |
| ALFA S.A.B.-A                | 15,319  | 15,319     | 19,470     | 181,067   | —          | 資本財          |  |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 2,054   | 3,701      | 55,196     | 513,307   | —          | 資本財          |  |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A   | 7,126   | 8,195      | 29,887     | 277,938   | —          | 家庭用品・パーソナル用品 |  |
| WALMART DE MEXICO SAB DE CV  | 24,610  | 34,721     | 239,574    | 2,227,950 | —          | 生活必需品流通・小売   |  |
| CEMEX SAB-CPO                | 70,806  | 108,049    | 143,598    | 1,335,404 | —          | 素材           |  |
| GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO   | 10,368  | —          | —          | —         | —          | メディア・娯楽      |  |
| GRUPO BIMBO SAB-SERIES A     | 6,200   | 7,820      | 54,700     | 508,696   | —          | 食品・飲料・タバコ    |  |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O   | 12,293  | 17,398     | 305,735    | 2,843,213 | —          | 銀行           |  |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 9,119   | 12,980     | 263,584    | 2,451,233 | —          | 食品・飲料・タバコ    |  |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 649     | 1,028      | 25,884     | 240,713   | —          | 素材           |  |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 4,680   | 6,730      | 19,627     | 182,528   | —          | 素材           |  |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 14,724  | 21,548     | 223,783    | 2,081,094 | —          | 素材           |  |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O   | 9,914   | 13,933     | 70,361     | 654,335   | —          | 銀行           |  |
| GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 1,743   | 3,034      | 95,444     | 887,593   | —          | 運輸           |  |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV   | 2,020   | 3,638      | 62,665     | 582,759   | —          | 食品・飲料・タバコ    |  |
| GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B | 888     | 1,752      | 102,563    | 953,803   | —          | 運輸           |  |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 1,187   | 1,064      | 20,348     | 189,234   | —          | 運輸           |  |
| GRUMA S.A.B.-B               | 891     | 1,084      | 35,857     | 333,460   | —          | 食品・飲料・タバコ    |  |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT | —       | 1,833      | 34,167     | 317,740   | —          | 運輸           |  |
| BANCO DEL BAJIO SA           | 3,573   | 4,696      | 29,209     | 271,633   | —          | 銀行           |  |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV    | 2,701   | 4,200      | 70,665     | 657,156   | —          | 食品・飲料・タバコ    |  |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B | 129,429 | 130,967    | 222,512    | 2,069,281 | —          | 電気通信サービス     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 330,298    | 403,695    | 2,124,838 | 19,760,145 |              |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 21         | 21         | —         | <2.4%>     |              |  |
| (ブラジル)                       |         |            |            | 千ブラジルレアル  |            |              |  |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 7,779   | 15,664     | 15,868     | 479,768   | —          | 公益事業         |  |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 1,037   | 1,424      | 5,976      | 180,694   | —          | 公益事業         |  |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 22,899  | 31,887     | 132,586    | 4,008,609 | —          | エネルギー        |  |
| CIA SANAMENTO BASICO DE SP   | 1,554   | 2,414      | 18,928     | 572,274   | —          | 公益事業         |  |
| GERDAU SA-PREF               | 5,859   | 9,685      | 18,537     | 560,461   | —          | 素材           |  |
| COMPANHIA PARANAENSE -PREF B | —       | 6,169      | 5,632      | 170,286   | —          | 公益事業         |  |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 22,917  | 33,874     | 110,599    | 3,343,867 | —          | 銀行           |  |
| COSAN SA                     | 5,608   | 12,147     | 17,345     | 524,436   | —          | エネルギー        |  |
| JBS SA                       | 3,998   | 5,183      | 12,760     | 385,802   | —          | 食品・飲料・タバコ    |  |
| VALE SA                      | 18,055  | 23,526     | 151,250    | 4,572,908 | —          | 素材           |  |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA    | 3,068   | 5,937      | 14,533     | 439,414   | —          | エネルギー        |  |
| ENGIE BRASIL ENERGIA SA      | 965     | 965        | 4,151      | 125,520   | —          | 公益事業         |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |           | 当期末       |           | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|------------------------|--|
|                              | 株数      | 株数        | 評価額       |           |                        |  |
|                              |         |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |                        |  |
| (ブラジル)                       | 百株      | 百株        |           | 千円        |                        |  |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | 17,223  | 25,878    | 114,199   | 3,452,711 | エネルギー                  |  |
| LOJAS RENNER S.A.            | 5,031   | 7,004     | 10,576    | 319,766   | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| ITAUSA SA                    | 23,391  | 33,950    | 34,086    | 1,030,568 | 銀行                     |  |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 5,991   | 8,553     | 32,390    | 979,285   | 公益事業                   |  |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA  | 3,107   | 4,212     | 5,829     | 176,246   | 素材                     |  |
| CPFL ENERGIA SA              | 1,047   | 1,047     | 3,396     | 102,688   | 公益事業                   |  |
| CCR SA                       | 5,278   | 5,278     | 6,676     | 201,862   | 運輸                     |  |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO    | 28,920  | 37,892    | 41,454    | 1,253,323 | 金融サービス                 |  |
| BANCO BRADESCO SA-PREF       | 25,052  | 38,055    | 50,880    | 1,538,326 | 銀行                     |  |
| BANCO DO BRASIL S.A.         | 3,923   | 12,088    | 33,387    | 1,009,424 | 銀行                     |  |
| BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT  | 1,774   | 1,774     | 5,055     | 152,860   | 銀行                     |  |
| HYPERA SA                    | 2,058   | 3,792     | 11,387    | 344,285   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BANCO BRADESCO S.A.          | 7,634   | 6,530     | 7,803     | 235,939   | 銀行                     |  |
| WEG SA                       | 7,909   | 11,525    | 44,916    | 1,358,001 | 資本財                    |  |
| LOCALIZA RENT A CAR          | 3,537   | 6,371     | 29,944    | 905,336   | 運輸                     |  |
| ENEVA SA                     | 3,830   | 4,830     | 6,023     | 182,099   | 公益事業                   |  |
| RAIA DROGASIL SA             | 4,853   | 9,710     | 24,906    | 753,021   | 生活必需品流通・小売             |  |
| TOTVS SA                     | 2,477   | 3,136     | 8,780     | 265,478   | ソフトウェア・サービス            |  |
| TELEFONICA BRASIL S.A.       | 2,313   | 3,124     | 14,095    | 426,170   | 電気通信サービス               |  |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD  | 4,879   | 8,114     | 24,828    | 750,675   | 公益事業                   |  |
| PRIOR SA                     | 3,221   | 5,981     | 28,110    | 849,898   | エネルギー                  |  |
| MAGAZINE LUIZA SA            | 14,975  | 14,975    | 2,306     | 69,724    | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES  | 3,150   | 4,573     | 15,150    | 458,055   | 保険                     |  |
| AMBEV SA                     | 21,997  | 31,146    | 37,499    | 1,133,768 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| KLABIN SA - UNIT             | 3,972   | 5,799     | 12,485    | 377,491   | 素材                     |  |
| ENERGISA SA-UNITS            | 861     | 1,796     | 8,541     | 258,252   | 公益事業                   |  |
| RUMO SA                      | 5,929   | 10,230    | 21,462    | 648,898   | 運輸                     |  |
| ATACADAQ SA                  | 3,439   | 3,439     | 3,827     | 115,723   | 生活必需品流通・小売             |  |
| SUZANO SA                    | 3,386   | 5,641     | 29,165    | 881,777   | 素材                     |  |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 24,719  | 28,309    | 11,465    | 346,645   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| VIBRA ENERGIA SA             | 5,695   | 7,776     | 18,569    | 561,417   | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT    | 5,728   | 7,478     | 25,066    | 757,853   | 金融サービス                 |  |
| NATURA & CO HOLDING SA       | 4,184   | 5,259     | 9,071     | 274,276   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| TIM SA                       | 3,823   | 4,949     | 8,256     | 249,618   | 電気通信サービス               |  |
| SENDAS DISTRIBUIDORA SA      | 5,796   | 8,325     | 11,163    | 337,527   | 生活必需品流通・小売             |  |
| CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO | —       | 4,809     | 7,732     | 233,795   | 保険                     |  |
| REDE D'OR SAO LUIZ SA        | 2,645   | 3,405     | 10,426    | 315,223   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| 小計                           | 株数      | 金額        | 367,493   | 535,636   | 1,279,092              |  |
| 銘柄                           | 株数      | 比<br>率    | 47        | 49        | 38,672,067             |  |
| (チリ)                         |         |           |           |           | <4.7%>                 |  |
| BANCO DE CREDITO E INVERSION | 313     | 516       | 1,396,038 | 234,869   | 銀行                     |  |
| CENCOSUD SA                  | 6,860   | 6,860     | 1,184,193 | 199,228   | 生活必需品流通・小売             |  |
| EMPRESAS CMPC SA             | 5,441   | 8,767     | 1,657,894 | 278,924   | 素材                     |  |
| EMPRESAS COPEC SA            | 1,795   | 2,311     | 1,664,524 | 280,039   | エネルギー                  |  |
| FALABELLA SA                 | 2,900   | 9,066     | 2,492,342 | 419,311   | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| LATAM AIRLINES GROUP SA      | —       | 1,032,104 | 1,357,216 | 228,338   | 運輸                     |  |
| BANCO SANTANDER CHILE        | 340,545 | 569,885   | 2,506,356 | 421,669   | 銀行                     |  |
| SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 692     | 950       | 4,152,045 | 698,540   | 資本財                    |  |
| ENEL AMERICAS SA             | 105,259 | 141,413   | 1,323,634 | 222,688   | 公益事業                   |  |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS SA    | 716     | —         | —         | —         | 食品・飲料・タバコ              |  |

| 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   |   |  |
| (チリ)<br>BANCO DE CHILE<br>ENEL CHILE SA<br>CIA SUD AMERICANA DE VAPORES  |         | 百株<br>202,820<br>122,118<br>65,029   | 百株<br>293,715<br>137,988<br>117,078   | 千チリペソ<br>3,163,314<br>809,991<br>873,753  | 千円<br>532,196<br>136,273<br>147,000  | 銀行<br>公益事業<br>運輸  |  |
| 小計   | 株数・金額   | 854,494  | 2,320,658   | 22,581,306  | 3,799,078  |   |  |
|  | 銘柄数<比率> | 12   | 12  |   | <0.5%>   |   |  |
| (コロンビア)<br>BANCOLOMBIA SA-PREF<br>INTERCONEXION ELECTRICA SA<br>BANCOLOMBIA SA   |         | 1,906<br>2,416<br>1,147  | 2,375<br>2,416<br>2,100   | 千コロンビアペソ<br>7,934,504<br>4,513,723<br>7,288,873   | 318,022<br>180,914<br>292,145  | 銀行<br>公益事業<br>銀行  |  |
| 小計   | 株数・金額   | 5,470  | 6,892   | 19,737,100  | 791,082  |   |  |
|  | 銘柄数<比率> | 3  | 3   | —   | <0.1%>   |   |  |
| (ユーロ…ギリシャ)<br>HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA<br>ALPHA SERVICES AND HOLDINGS<br>NATIONAL BANK OF GREECE<br>EUROBANK ERGASIAS SERVICES A<br>PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S<br>PUBLIC POWER CORP<br>OPAP SA<br>MOTOR OIL (HELLAS) SA<br>FF GROUP<br>JUMBO SA<br>MYTILINEOS S.A.<br>TERNA ENERGY SA  |         | 950<br>9,741<br>2,013<br>12,049<br>—<br>1,118<br>886<br>272<br>58<br>668<br>653<br>320   | 1,758<br>11,844<br>6,479<br>19,077<br>6,801<br>1,118<br>1,035<br>409<br>58<br>668<br>599<br>—   | 千ユーロ<br>2,537<br>1,947<br>5,248<br>3,966<br>2,625<br>1,307<br>1,596<br>1,124<br>—<br>1,844<br>2,339<br>—  | 426,159<br>327,069<br>881,471<br>666,166<br>440,939<br>219,674<br>268,092<br>188,936<br>—<br>309,831<br>392,992<br>—   | 電気通信サービス<br>銀行<br>銀行<br>銀行<br>銀行<br>公益事業<br>消費者サービス<br>エネルギー<br>一般消費財・サービス流通・小売り<br>一般消費財・サービス流通・小売り<br>資本財<br>公益事業   |  |
| ユーロ計   | 株数・金額   | 28,733   | 49,851  | 24,537  | 4,121,333  |   |  |
|  | 銘柄数<比率> | 11   | 11  | —   | <0.5%>   |   |  |
| (トルコ)<br>AKBANK T. A. S.<br>TURKIYE IS BANKASI-C<br>TURKCELL ILETISIM HIZMET AS<br>YAPI VE KREDI BANKASI<br>TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE<br>HACI OMER SABANCI HOLDING<br>EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK<br>KOC HOLDING AS<br>TURK SISE VE CAM FABRIKALARI<br>FORD OTOMOTIV SANAYI AS<br>TURK HAVA YOLLARI AO<br>TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA<br>COCA-COLA ICECEK AS<br>BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS<br>KOZA ALTIN ISLETMELERI AS<br>ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI<br>HEKTAS TICARET T. A. S<br>SASA POLYESTER SANAYI<br>PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS |         | 13,300<br>15,417<br>6,504<br>13,483<br>4,922<br>4,788<br>6,318<br>3,986<br>6,881<br>320<br>2,572<br>—<br>—<br>2,060<br>4,918<br>3,187<br>4,736<br>1,890<br>238 | 22,967<br>49,251<br>6,504<br>19,483<br>7,546<br>5,607<br>8,848<br>5,754<br>14,074<br>414<br>3,998<br>535<br>677<br>3,236<br>—<br>7,155<br>—<br>7,557<br>238 | 千トルコリラ<br>132,751<br>66,538<br>54,633<br>60,437<br>141,279<br>54,227<br>41,447<br>136,506<br>74,525<br>47,649<br>127,145<br>14,615<br>50,101<br>137,450<br>—<br>45,364<br>—<br>33,784<br>23,897 | 641,798<br>321,685<br>264,132<br>292,188<br>683,027<br>262,168<br>200,383<br>659,953<br>360,301<br>230,364<br>614,699<br>70,657<br>242,219<br>664,519<br>—<br>219,318<br>—<br>163,333<br>115,536 | 銀行<br>銀行<br>電気通信サービス<br>銀行<br>エネルギー<br>銀行<br>素材<br>資本財<br>資本財<br>自動車・自動車部品<br>運輸<br>自動車・自動車部品<br>食品・飲料・タバコ<br>生活必需品流通・小売り<br>素材<br>資本財<br>資本財<br>自動車部品<br>運輸<br>自動車部品<br>食品・飲料・タバコ<br>生活必需品流通・小売り<br>素材<br>資本財<br>資本財<br>運輸 |  |
| 小計   | 株数・金額   | 95,526   | 163,853   | 1,242,354   | 6,006,288  |   |  |
|  | 銘柄数<比率> | 17   | 17  | —   | <0.7%>   |   |  |
| (チェコ)<br>CEZ AS  |         | 750  | 1,447   | 千チェコクロナ<br>130,632  | 880,462  | 公益事業  |  |

| 銘柄                           |                  | 期首(前期末) |         | 当期末        |           | 業種等                    |  |
|------------------------------|------------------|---------|---------|------------|-----------|------------------------|--|
|                              |                  | 株数      | 株数      | 評価額        |           |                        |  |
|                              |                  |         |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                        |  |
| (チェコ)                        |                  | 百株      | 百株      | 千円         |           |                        |  |
| KOMERCI BANKA AS             |                  | 399     | 399     | 31,826     | 214,510   | 銀行                     |  |
| MONETA MONEY BANK AS         |                  | 1,453   | 1,745   | 16,963     | 114,333   | 銀行                     |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 2,602   | 3,592   | 179,422    | 1,209,306 |                        |  |
| (ハンガリー)                      |                  |         |         | 千ハンガリーフォント |           |                        |  |
| RICHTER GEDEON NYRT          |                  | 652     | 787     | 760,371    | 329,222   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| OTP BANK PLC                 |                  | 1,104   | 1,416   | 2,594,154  | 1,123,206 | 銀行                     |  |
| MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL |                  | 1,897   | 2,986   | 918,758    | 397,800   | エネルギー                  |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 3,653   | 5,191   | 4,273,284  | 1,850,229 |                        |  |
| (ポーランド)                      |                  |         |         | 千ポーランドズロチ  |           |                        |  |
| ORLEN SA                     |                  | 2,965   | 4,192   | 28,648     | 1,118,217 | エネルギー                  |  |
| PKO BANK POLSKI SA           |                  | 4,008   | 6,221   | 35,811     | 1,397,797 | 銀行                     |  |
| BANK PEKAO SA                |                  | 842     | 1,358   | 22,395     | 874,160   | 銀行                     |  |
| KGHM POLSKA MIEDZ SA         |                  | 664     | 1,132   | 16,984     | 662,950   | 素材                     |  |
| SANTANDER BANK POLSKA SA     |                  | 173     | 235     | 12,822     | 500,495   | 銀行                     |  |
| MBANK SA                     |                  | 57      | 86      | 5,728      | 223,580   | 銀行                     |  |
| BUDIMEX                      |                  | —       | 78      | 5,818      | 227,113   | 資本財                    |  |
| CYFROWY POLSAT SA            |                  | 1,505   | —       | —          | —         | メディア・娯楽                |  |
| PGE SA                       |                  | 4,229   | 4,229   | 2,963      | 115,659   | 公益事業                   |  |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE |                  | 2,724   | 4,573   | 23,964     | 935,382   | 保険                     |  |
| LPP SA                       |                  | 5       | 6       | 11,397     | 444,852   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CD PROJEKT SA                |                  | 393     | 393     | 5,178      | 202,124   | メディア・娯楽                |  |
| DINO POLSKA SA               |                  | 221     | 320     | 12,545     | 489,686   | 生活必需品流通・小売り            |  |
| ALLEGRO. EU SA               |                  | 1,799   | 2,940   | 11,174     | 436,148   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| PEPCO GROUP NV               |                  | 652     | 652     | 1,356      | 52,959    | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| 小計                           | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 20,242  | 26,421  | 196,790    | 7,681,128 |                        |  |
| (香港)                         |                  |         |         | 千香港ドル      |           |                        |  |
| PETROCHINA CO LTD-H          |                  | 96,090  | 141,250 | 108,480    | 2,165,260 | エネルギー                  |  |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H |                  | 121,260 | 177,740 | 90,469     | 1,805,774 | エネルギー                  |  |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H   |                  | 5,480   | 5,480   | 5,984      | 119,443   | 消費者サービス                |  |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE  |                  | —       | 16,940  | 11,095     | 221,470   | 自動車・自動車部品              |  |
| CITIC LTD                    |                  | 28,200  | 43,750  | 35,962     | 717,811   | 資本財                    |  |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO-H   |                  | 6,580   | 18,210  | 35,764     | 713,858   | エネルギー                  |  |
| BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H |                  | 10,180  | —       | —          | —         | 運輸                     |  |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H     |                  | 6,060   | 10,340  | 5,376      | 107,320   | 運輸                     |  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING |                  | 7,640   | 13,220  | 50,434     | 1,006,668 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO |                  | 9,040   | 11,380  | 11,095     | 221,466   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING |                  | 8,440   | 7,880   | 9,062      | 180,877   | 運輸                     |  |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD     |                  | 10,620  | 6,540   | 3,394      | 67,749    | 運輸                     |  |
| BYD CO LTD-H                 |                  | 3,915   | 6,970   | 155,709    | 3,107,967 | 自動車・自動車部品              |  |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H |                  | —       | 6,280   | 6,430      | 128,357   | エネルギー                  |  |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS    |                  | 2,060   | 2,885   | 7,919      | 158,069   | 公益事業                   |  |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H     |                  | 8,060   | 8,060   | 6,722      | 134,171   | 運輸                     |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H |                  | 6,180   | —       | —          | —         | 運輸                     |  |
| HUANENG POWER INTL INC-H     |                  | 17,000  | 23,480  | 11,951     | 238,548   | 公益事業                   |  |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  |                  | 6,280   | 9,115   | 17,920     | 357,684   | 素材                     |  |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT |                  | 43,318  | 70,538  | 48,389     | 965,851   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| LENOVO GROUP LTD             |                  | 33,200  | 56,960  | 57,643     | 1,150,564 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末     |           |            |  | 業種等                   |  |
|------------------------------|---------|---------|-----------|------------|--|-----------------------|--|
|                              |         | 株数      | 評価額       | 外貨建金額      |  |                       |  |
|                              |         |         |           | 邦貨換算金額     |  |                       |  |
| (香港)                         |         |         |           |            |  |                       |  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 百株      | 百株      | 千香港ドル     | 千円         |  |                       |  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H    | 7,232   | 7,232   | 5,828     | 116,346    |  | 保険                    |  |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 2,700   | 4,560   | 28,408    | 567,039    |  | 食品・飲料・タバコ             |  |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H   | 18,200  | 20,180  | 11,199    | 223,550    |  | 素材                    |  |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H   | 12,470  | 12,470  | 4,688     | 93,586     |  | 資本財                   |  |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD     | 33,320  | 49,940  | 51,338    | 1,024,712  |  | 保険                    |  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H    | 610     | 680     | 8,806     | 175,767    |  | 運輸                    |  |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD       | 34,820  | 53,760  | 62,146    | 1,240,445  |  | 保険                    |  |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 3,060   | 4,090   | 7,991     | 159,517    |  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| LI NING CO LTD               | 9,320   | 11,100  | 23,421    | 467,483    |  | 公益事業                  |  |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO       | 11,140  | 15,065  | 33,594    | 670,555    |  | 耐久消費財・アパレル            |  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 14,970  | 26,010  | 44,112    | 880,494    |  | 食品・飲料・タバコ             |  |
| AIR CHINA LTD-H              | 29,995  | 47,770  | 197,051   | 3,933,142  |  | 保険                    |  |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 7,580   | 12,200  | 4,953     | 98,865     |  | 運輸                    |  |
| CHINA OILFIELD SERVICES-H    | 50,205  | 62,755  | 19,516    | 389,555    |  | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| TECENT HOLDINGS LTD          | 8,240   | 11,040  | 9,406     | 187,745    |  | エネルギー                 |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H  | 29,389  | 45,332  | 1,681,817 | 33,569,071 |  | メディア・娯楽               |  |
| ZTE CORP-H                   | 44,829  | 58,619  | 35,230    | 703,191    |  | 銀行                    |  |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 5,011   | 4,095   | 7,052     | 140,760    |  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 25,860  | 39,980  | 72,443    | 1,445,977  |  | 素材                    |  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 454,295 | 662,395 | 373,591   | 7,456,877  |  | 銀行                    |  |
| CHINA POWER INTERNATIONAL    | 3,846   | 6,017   | 51,866    | 1,035,256  |  | 耐久消費財・アパレル            |  |
| MINTH GROUP LTD              | 22,920  | 22,920  | 7,792     | 155,544    |  | 公益事業                  |  |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H  | 3,640   | —       | —         | —          |  | 自動車・自動車部品             |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 12,360  | 12,360  | 3,720     | 74,258     |  | 自動車・自動車部品             |  |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS  | 16,175  | 22,925  | 83,676    | 1,670,177  |  | エネルギー                 |  |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H      | 7,220   | —       | —         | —          |  | 素材                    |  |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 4,600   | 6,790   | 11,801    | 235,548    |  | 素材                    |  |
| BANK OF CHINA LTD-H          | 12,320  | 20,872  | 11,333    | 226,216    |  | ヘルスケア機器・サービス          |  |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 376,070 | 546,430 | 204,364   | 4,079,121  |  | 銀行                    |  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 19,581  | —       | —         | —          |  | 商業・専門サービス             |  |
| CHINA MERCHANTS BANK-H       | 3,835   | 3,835   | 10,412    | 207,824    |  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 18,605  | 25,655  | 97,106    | 1,938,237  |  | 銀行                    |  |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD      | 266,833 | 451,473 | 204,517   | 4,082,169  |  | 銀行                    |  |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 3,766   | 5,206   | 39,903    | 796,483    |  | 公益事業                  |  |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 4,495   | —       | —         | —          |  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| CHINA COAL ENERGY CO-H       | 11,320  | 11,320  | 4,369     | 87,215     |  | 資本財                   |  |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS       | 11,490  | 11,490  | 10,168    | 202,966    |  | エネルギー                 |  |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 8,160   | —       | —         | —          |  | 運輸                    |  |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H  | 18,375  | 27,910  | 42,981    | 857,908    |  | 不動産管理・開発              |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 39,500  | 60,400  | 29,354    | 585,913    |  | 銀行                    |  |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 5,738   | 8,908   | 82,131    | 1,639,349  |  | 耐久消費財・アパレル            |  |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD     | 15,860  | 22,850  | 9,642     | 192,468    |  | 資本財                   |  |
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 3,025   | 4,830   | 13,789    | 275,241    |  | 家庭用品・パーソナル用品          |  |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD     | 15,100  | 22,500  | 72,225    | 1,441,611  |  | 不動産管理・開発              |  |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD      | 14,340  | 21,540  | 9,908     | 197,771    |  | 公益事業                  |  |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 13,245  | 13,245  | 6,529     | 130,334    |  | 資本財                   |  |
| WEICHAI POWER CO LTD-H       | 20,360  | 46,740  | 15,844    | 316,263    |  | 素材                    |  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 7,568   | 13,038  | 22,008    | 439,282    |  | 資本財                   |  |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 15,156  | 21,166  | 24,764    | 494,293    |  | 運輸                    |  |
|                              | 25,140  | 34,430  | 15,803    | 315,435    |  | 食品・飲料・タバコ             |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末     |        |           |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|---------|--------|-----------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数      | 株数     | 評価額       |        |                        |  |
|                              |         |         |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (香港)                         |         | 百株      | 百株     | 千香港ドル     | 千円     |                        |  |
| KUNLUN ENERGY CO LTD         | 19,920  | 25,880  | 20,781 | 414,801   |        | 公益事業                   |  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 54,702  | —       | —      | —         |        | 不動産管理・開発               |  |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 4,214   | 6,170   | 16,782 | 334,976   |        | 公益事業                   |  |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 14,880  | 19,300  | 4,323  | 86,291    |        | 公益事業                   |  |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 29,420  | 39,790  | 39,352 | 785,472   |        | 自動車・自動車部品              |  |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 15,110  | 19,030  | 12,407 | 247,654   |        | 公益事業                   |  |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 29,193  | 38,508  | 11,513 | 229,818   |        | 銀行                     |  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 12,560  | 18,148  | 35,678 | 712,152   |        | 保険                     |  |
| CRRC CORP LTD - H            | 19,340  | 25,190  | 11,763 | 234,804   |        | 資本財                    |  |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H | 2,580   | 2,683   | 8,102  | 161,729   |        | 資本財                    |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 138,230 | 175,520 | 65,644 | 1,310,263 |        | 銀行                     |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 8,889   | 14,589  | 4,887  | 97,553    |        | 自動車・自動車部品              |  |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 6,124   | 9,584   | 20,605 | 411,287   |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD       | 12,958  | 19,042  | 15,443 | 308,243   |        | 公益事業                   |  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 8,775   | 17,590  | 22,093 | 440,977   |        | 不動産管理・開発               |  |
| SUNNY OPTICAL TECH           | 3,493   | 4,784   | 20,164 | 402,484   |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CHINA RESOURCES BUILDING MAT | 9,140   | —       | —      | —         |        | 素材                     |  |
| GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD  | 92,800  | 142,120 | 18,759 | 374,446   |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-H    | 12,780  | 12,780  | 15,975 | 318,861   |        | 自動車・自動車部品              |  |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP  | 26,600  | —       | —      | —         |        | 不動産管理・開発               |  |
| ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H  | 6,600   | 6,600   | 9,002  | 179,687   |        | 素材                     |  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 5,700   | 5,700   | 5,255  | 104,897   |        | 資本財                    |  |
| KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR  | 12,790  | 23,540  | 22,174 | 442,606   |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H    | 9,070   | 16,765  | 21,895 | 437,025   |        | 金融サービス                 |  |
| DONGYUE GROUP                | 8,040   | —       | —      | —         |        | 素材                     |  |
| FAR EAST HORIZON LTD         | 8,160   | 12,460  | 7,762  | 154,941   |        | 金融サービス                 |  |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD       | 7,680   | 8,000   | 4,368  | 87,185    |        | 不動産管理・開発               |  |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS | 5,610   | —       | —      | —         |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS    | 2,965   | 6,385   | 9,590  | 191,421   |        | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H   | 2,653   | 2,653   | 3,157  | 63,015    |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD      | 14,620  | 21,440  | 9,819  | 195,997   |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU | 8,746   | 14,804  | 15,751 | 314,399   |        | 一般消費財・サービス流通・小売        |  |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H  | 17,988  | 15,312  | 6,048  | 120,722   |        | 金融サービス                 |  |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS     | 5,255   | —       | —      | —         |        | 不動産管理・開発               |  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 5,324   | 4,459   | 7,473  | 149,166   |        | 保険                     |  |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 33,920  | 43,920  | 12,209 | 243,706   |        | 保険                     |  |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 16,215  | 44,405  | 19,671 | 392,641   |        | 金融サービス                 |  |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 6,330   | 7,810   | 6,005  | 119,877   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD     | 10,770  | 14,205  | 16,591 | 331,165   |        | 素材                     |  |
| BYD ELECTRONIC INTL CO LTD   | 3,475   | 4,390   | 14,530 | 290,036   |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACUTI-H  | 2,405   | 2,405   | 3,213  | 64,133    |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS  | 3,390   | 3,390   | 9,068  | 181,002   |        | 資本財                    |  |
| CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS | 3,720   | 3,720   | —      | —         |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HANERGY THIN FILM POWER GROU | 9,600   | 9,600   | 3,753  | 74,921    |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| KINGSOFT CORP LTD            | 4,686   | 5,680   | 15,023 | 299,871   |        | メディア・娯楽                |  |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 55,720  | 55,720  | 4,290  | 85,637    |        | 金融サービス                 |  |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 7,755   | —       | —      | —         |        | 資本財                    |  |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD     | 22,380  | 34,060  | 19,652 | 392,266   |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION T | 22,660  | 53,420  | 16,934 | 338,005   |        | 生活必需品流通・小売             |  |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 11,890  | 14,640  | 3,674  | 73,345    |        | 銀行                     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末     |         |            |       | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|---------|---------|------------|-------|------------------------|--|
|                              |         | 株数      | 評価額     | 外貨建替額      |       |                        |  |
|                              |         |         |         | 外貨建替額      | 邦貨換算額 |                        |  |
| (香港)                         |         | 百株      | 百株      | 千香港ドル      | 千円    |                        |  |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 10,725  | 27,238  | 13,564  | 270,752    |       | 不動産管理・開発               |  |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS  | 5,490   | —       | —       | —          |       | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE ME | 13,060  | —       | —       | —          |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CGN POWER CO LTD-H           | 51,630  | 71,150  | 20,135  | 401,903    |       | 公益事業                   |  |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD   | 2,510   | 3,820   | 6,883   | 137,397    |       | 半導体・半導体製造装置            |  |
| GF SECURITIES CO LTD-H       | 4,424   | 4,424   | 3,627   | 72,408     |       | 金融サービス                 |  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H   | 7,548   | 10,486  | 9,982   | 199,254    |       | 金融サービス                 |  |
| 3SBIO INC                    | 6,305   | —       | —       | —          |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L | 4,990   | —       | —       | —          |       | 資本財                    |  |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD | 6,100   | 6,100   | 3,214   | 64,165     |       | 不動産管理・開発               |  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H | 3,192   | 5,084   | 24,631  | 491,654    |       | 自動車・自動車部品              |  |
| SINOTRUK HONG KONG LTD       | —       | 7,440   | 15,028  | 299,974    |       | 資本財                    |  |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD      | 25,560  | 25,560  | 5,086   | 101,525    |       | メディア・娯楽                |  |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 16,920  | 27,420  | 40,197  | 802,346    |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP    | 2,984   | —       | —       | —          |       | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| CHINA LITERATURE LTD         | 2,206   | 2,206   | 6,816   | 136,058    |       | メディア・娯楽                |  |
| CMOC GROUP LTD-H             | 16,200  | 21,540  | 17,296  | 345,240    |       | 素材                     |  |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC | 8,475   | 8,475   | 4,991   | 99,635     |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| DALI FOODS GROUP CO LTD      | 9,275   | —       | —       | —          |       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD     | 6,040   | 9,440   | 14,405  | 287,532    |       | 自動車・自動車部品              |  |
| PING AN HEALTHCARE AND TECHN | 1,871   | —       | —       | —          |       | 生活必需品流通・小売り            |  |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP       | 4,940   | 6,280   | 7,887   | 157,438    |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 37,200  | 55,860  | 24,969  | 498,389    |       | 銀行                     |  |
| BOC AVIATION LTD             | 973     | 973     | 6,188   | 123,518    |       | 資本財                    |  |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H | 7,680   | 12,460  | 12,958  | 258,649    |       | 金融サービス                 |  |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H | 3,068   | 4,221   | 6,272   | 125,197    |       | 保険                     |  |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO L | 4,800   | —       | —       | —          |       | 不動産管理・開発               |  |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 9,520   | 12,390  | 7,434   | 148,382    |       | 不動産管理・開発               |  |
| CHINA TOWER CORP LTD-H       | 197,440 | 261,180 | 25,595  | 510,888    |       | 電気通信サービス               |  |
| MEITUAN-CLASS B              | 23,405  | 34,935  | 414,331 | 8,270,056  |       | 消費者サービス                |  |
| XIAOMI CORP-CLASS B          | 71,772  | 103,734 | 201,243 | 4,016,829  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| INNOVENT BIOLOGICS INC       | 5,065   | 7,440   | 30,801  | 614,799    |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING  | 2,920   | —       | —       | —          |       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| WUXI APPTEC CO LTD-H         | 1,231   | 1,960   | 7,469   | 149,083    |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | 5,900   | 12,970  | 25,810  | 515,173    |       | 消費者サービス                |  |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP  | 5,060   | 6,960   | 12,597  | 251,448    |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-H   | 1,044   | —       | —       | —          |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 69,973  | 111,721 | 870,865 | 17,382,469 |       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD | 9,700   | 9,700   | 5,626   | 112,294    |       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| EAST BUY HOLDING LTD         | 1,700   | 2,375   | 4,061   | 81,062     |       | 生活必需品流通・小売り            |  |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS | 1,750   | —       | —       | —          |       | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| CHINA FEIHE LTD              | 19,170  | 27,160  | 12,222  | 243,951    |       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 6,300   | 9,828   | 20,540  | 409,988    |       | 消費者サービス                |  |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H | 811     | —       | —       | —          |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| NONGFU SPRING CO LTD-H       | 8,514   | 14,136  | 65,025  | 1,297,910  |       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS  | 4,060   | —       | —       | —          |       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-H | 2,902   | 4,652   | 8,662   | 172,912    |       | 素材                     |  |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING | 7,970   | 11,280  | 7,896   | 157,604    |       | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H    | 11,056  | 14,870  | 46,245  | 923,064    |       | 耐久消費財・アパレル             |  |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC  | 5,312   | 7,025   | 20,725  | 413,675    |       | 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                 |           |  |
| (香港)                         |         | 百株      | 百株      | 千香港ドル       | 千円                     |           |  |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY | 3,436   | 4,238   | 12,459  | 248,696     | 不動産管理・開発               |           |  |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-H    | 1,460   | 1,460   | 2,569   | 51,289      | 半導体・半導体製造装置            |           |  |
| KUAISHOU TECHNOLOGY          | 8,376   | 16,258  | 92,264  | 1,841,592   | メディア・娯楽                |           |  |
| GDS HOLDINGS LTD-CL A        | 3,514   | —       | —       | —           | ソフトウェア・サービス            |           |  |
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD | 3,140   | —       | —       | —           | 消費者サービス                |           |  |
| BILIBILI INC-CLASS Z         | 935     | 2,048   | 22,183  | 442,785     | メディア・娯楽                |           |  |
| BAIDU INC-CLASS A            | 10,388  | 16,053  | 172,090 | 3,434,931   | メディア・娯楽                |           |  |
| JD.COM INC-CLASS A           | 10,205  | 15,846  | 200,614 | 4,004,266   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |           |  |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 6,897   | 10,007  | 67,002  | 1,337,364   | 消費者サービス                |           |  |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H | 1,311   | 1,851   | 4,979   | 99,395      | 素材                     |           |  |
| SANY HEAVY EQUIPMENT INTL    | 5,000   | 5,370   | 3,630   | 72,457      | 資本財                    |           |  |
| AKESO INC                    | 2,110   | 2,740   | 13,686  | 273,178     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |           |  |
| BEIGENE LTD                  | 2,928   | 5,386   | 53,808  | 1,074,016   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |           |  |
| NETEASE INC                  | 9,282   | 13,342  | 204,547 | 4,082,766   | メディア・娯楽                |           |  |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LTD  | 11,440  | —       | —       | —           | ソフトウェア・サービス            |           |  |
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C | 1,706   | 3,242   | 12,027  | 240,075     | ヘルスケア機器・サービス           |           |  |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP | 2,310   | 2,310   | 8,131   | 162,298     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |           |  |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H | 314     | 623     | 4,298   | 85,802      | 一般消費財・サービス流通・小売り       |           |  |
| SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H  | 1,530   | —       | —       | —           | 半導体・半導体製造装置            |           |  |
| C&D INTERNATIONAL INVESTMENT | 2,990   | 4,340   | 7,994   | 159,565     | 不動産管理・開発               |           |  |
| XPENG INC - CLASS A SHARES   | 3,884   | 9,861   | 31,506  | 628,872     | 自動車・自動車部品              |           |  |
| LI AUTO INC-CLASS A          | 5,304   | 7,771   | 81,988  | 1,636,494   | 自動車・自動車部品              |           |  |
| JD LOGISTICS INC             | —       | 21,202  | 19,060  | 380,449     | 運輸                     |           |  |
| TRIP.COM GROUP LTD           | —       | 3,695   | 155,497 | 3,103,736   | 消費者サービス                |           |  |
| ZAI LAB LTD                  | —       | 5,342   | 8,654   | 172,737     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |           |  |
| ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG | —       | 2,894   | 8,870   | 177,047     | 自動車・自動車部品              |           |  |
| MINISO GROUP HOLDING LTD     | —       | 1,878   | 9,156   | 182,769     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |           |  |
| GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD | —       | 2,864   | 15,050  | 300,404     | 家庭用品・パーソナル用品           |           |  |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B | 471     | 660     | 8,458   | 168,835     | 食品・飲料・タバコ              |           |  |
| 小計                           | 株数      | ・       | 金額      | 3,926,999   | 5,383,116              | 8,311,446 |  |
| 銘柄                           | 銘柄数     | <       | 比率      | 191         | 169                    | <20.3%>   |  |
| (マレーシア)                      |         |         |         | 千マレーシアリンギット |                        |           |  |
| GENTING MALAYSIA BHD         | 12,214  | 17,573  | 4,621   | 151,982     | 消費者サービス                |           |  |
| GENTING BHD                  | 9,164   | 11,544  | 5,252   | 172,727     | 消費者サービス                |           |  |
| TELEKOM MALAYSIA BHD         | 6,530   | 6,530   | 4,029   | 132,492     | 電気通信サービス               |           |  |
| TENAGA NASIONAL BHD          | 12,096  | 20,503  | 25,423  | 836,048     | 公益事業                   |           |  |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 1,890   | 3,371   | 7,638   | 251,195     | 食品・飲料・タバコ              |           |  |
| MALAYAN BANKING BHD          | 22,178  | 34,147  | 33,703  | 1,108,312   | 銀行                     |           |  |
| IOI CORP BHD                 | 10,532  | 14,406  | 5,820   | 191,389     | 食品・飲料・タバコ              |           |  |
| AMMB HOLDINGS BHD            | 9,023   | 13,763  | 5,821   | 191,445     | 銀行                     |           |  |
| YTL CORP BHD                 | —       | 29,723  | 10,105  | 332,325     | 公益事業                   |           |  |
| GAMUDA BHD                   | 10,121  | 20,808  | 11,361  | 373,607     | 資本財                    |           |  |
| MISC BHD                     | 5,223   | 7,448   | 6,062   | 199,368     | 運輸                     |           |  |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 33,514  | 41,750  | 28,264  | 929,474     | 銀行                     |           |  |
| PETRONAS GAS BHD             | 4,130   | 4,470   | 8,072   | 265,471     | 公益事業                   |           |  |
| SIME DARBY BERHAD            | 11,292  | 16,973  | 4,803   | 157,956     | 資本財                    |           |  |
| PUBLIC BANK BERHAD           | 68,286  | 110,426 | 46,158  | 1,517,889   | 銀行                     |           |  |
| PPB GROUP BERHAD             | 2,942   | 3,712   | 5,746   | 188,981     | 食品・飲料・タバコ              |           |  |
| CELCOMDIGI BHD               | 13,981  | 25,538  | 10,496  | 345,160     | 電気通信サービス               |           |  |
| MAXIS BHD                    | 11,224  | 18,034  | 6,492   | 213,494     | 電気通信サービス               |           |  |

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末     |         |           |                    | 業種等        |  |
|-------------------------------|---------|---------|---------|-----------|--------------------|------------|--|
|                               |         | 株 数     | 株 数     | 評価額       |                    |            |  |
|                               |         |         |         | 外貨建金額     | 邦貨換算金額             |            |  |
| (マレーシア)                       |         | 百株      | 百株      | 千円        | 千円                 |            |  |
| AXIATA GROUP BERHAD           | 11,950  | 23,390  | 6,549   | 215,367   | 電気通信サービス           |            |  |
| YTL POWER INTERNATIONAL BHD   | —       | 20,941  | 10,407  | 342,252   | 公益事業               |            |  |
| HONG LEONG BANK BERHAD        | 2,868   | 3,664   | 7,181   | 236,158   | 銀行                 |            |  |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD  | 12,149  | 18,155  | 12,545  | 412,540   | 素材                 |            |  |
| PETRONAS DAGANGAN BHD         | 1,493   | 1,493   | 3,203   | 105,361   | エネルギー              |            |  |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD   | 3,499   | 5,549   | 5,704   | 187,585   | 運輸                 |            |  |
| IHH HEALTHCARE BHD            | 7,053   | 12,203  | 7,712   | 253,615   | ヘルスケア機器・サービス       |            |  |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP    | 1,225   | —       | —       | —         | 銀行                 |            |  |
| HAP SENG CONSOLIDATED         | 2,214   | —       | —       | —         | 資本財                |            |  |
| TOP GLOVE CORP BHD            | 28,651  | —       | —       | —         | ヘルスケア機器・サービス       |            |  |
| DIALOG GROUP BHD              | 22,398  | —       | —       | —         | エネルギー              |            |  |
| QL RESOURCES BHD              | 5,212   | 5,212   | 3,414   | 112,274   | 食品・飲料・タバコ          |            |  |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD      | 309     | 399     | 5,147   | 169,260   | 食品・飲料・タバコ          |            |  |
| INARI AMERTRON BHD            | 16,182  | 16,182  | 4,951   | 162,834   | 半導体・半導体製造装置        |            |  |
| RHB BANK BHD                  | 6,824   | 10,980  | 6,039   | 198,598   | 銀行                 |            |  |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDING | 18,775  | 22,651  | 12,095  | 397,760   | 素材                 |            |  |
| SIME DARBY PLANTATION BHD     | 9,670   | 13,745  | 6,212   | 204,303   | 食品・飲料・タバコ          |            |  |
| MR DIY GROUP M BHD            | 9,780   | 19,490  | 3,508   | 115,365   | 一般消費財・サービス流通・小売    |            |  |
| 小計                            | 株数      | ・       | 金額      | 404,594   | 574,774            | 10,672,604 |  |
| 銘柄                            | 株数      | 比       | 率       | 34        | 32                 | <1.3%>     |  |
| (タイ)                          |         |         | 千タイプツ   |           |                    |            |  |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR      | 9,458   | 11,462  | 71,637  | 303,743   | 不動産管理・開発           |            |  |
| KASIKORN BANK PCL-NVDR        | 2,772   | 3,043   | 40,624  | 172,245   | 銀行                 |            |  |
| TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR   | —       | 120,000 | 21,120  | 89,548    | 銀行                 |            |  |
| CP ALL PCL-NVDR               | 27,355  | 46,051  | 271,700 | 1,152,011 | 生活必需品流通・小売         |            |  |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR    | 5,511   | 9,551   | 196,750 | 834,222   | 電気通信サービス           |            |  |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR          | 3,754   | 5,811   | 144,125 | 611,090   | 素材                 |            |  |
| PTT PCL-NVDR                  | 47,096  | 75,504  | 254,826 | 1,080,462 | エネルギー              |            |  |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR    | 6,522   | 8,735   | 134,082 | 568,508   | エネルギー              |            |  |
| AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR  | 19,908  | 31,077  | 206,662 | 876,247   | 運輸                 |            |  |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR      | 34,930  | —       | —       | —         | エネルギー              |            |  |
| CHAROEN POKHAND FOODS-NVDR    | 19,964  | 19,964  | 40,926  | 173,527   | 食品・飲料・タバコ          |            |  |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR    | 7,870   | 7,870   | 18,494  | 78,416    | 素材                 |            |  |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR  | 10,484  | 22,314  | 79,774  | 338,244   | 素材                 |            |  |
| THAI OIL PCL-NVDR             | 7,359   | 7,579   | 40,547  | 171,922   | エネルギー              |            |  |
| KRUNG THAI BANK - NVDR        | 17,706  | 17,706  | 29,746  | 126,123   | 銀行                 |            |  |
| INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR     | 5,131   | 5,131   | 35,403  | 150,112   | 電気通信サービス           |            |  |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR  | 49,458  | 81,147  | 235,326 | 997,783   | ヘルスケア機器・サービス       |            |  |
| CP AXTRA PCL-NVDR             | —       | 11,191  | 34,971  | 148,280   | 生活必需品流通・小売         |            |  |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR      | 37,958  | 52,451  | 37,240  | 157,898   | 不動産管理・開発           |            |  |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR     | 12,102  | —       | —       | —         | 食品・飲料・タバコ          |            |  |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR  | 27,495  | 97,577  | 98,552  | 417,863   | 一般消費財・サービス流通・小売    |            |  |
| RATCH GROUP PCL-NVDR          | 4,948   | —       | —       | —         | 公益事業               |            |  |
| ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR   | 906     | —       | —       | —         | 公益事業               |            |  |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR   | 29,999  | 44,922  | 27,402  | 116,186   | 運輸                 |            |  |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR  | 2,635   | 4,986   | 126,644 | 536,972   | ヘルスケア機器・サービス       |            |  |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR   | 14,713  | 22,235  | 159,536 | 676,433   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |            |  |
| KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR       | 4,180   | 4,930   | 21,445  | 90,928    | 金融サービス             |            |  |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR  | 14,491  | 18,069  | 59,627  | 252,821   | 消費者サービス            |            |  |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR   | 5,936   | —       | —       | —         | 生活必需品流通・小売         |            |  |

| 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                 |     |  |
| (タイ)                         |         |         |             |           |                        |     |  |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR     | 百株      | 百株      | 千タイバーツ      | 千円        |                        |     |  |
| BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR      | 7,518   | 9,436   | 27,836      | 118,025   | 公益事業                   |     |  |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR       | 35,394  | 35,394  | 29,023      | 123,057   | 運輸                     |     |  |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR   | 3,551   | —       | —           | —         | 金融サービス                 |     |  |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR       | 4,028   | 4,028   | 19,334      | 81,977    | 金融サービス                 |     |  |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 6,117   | —       | —           | —         | 公益事業                   |     |  |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR    | 13,628  | 15,562  | 64,582      | 273,828   | 公益事業                   |     |  |
| OSOTSPA PCL-NVDR             | 3,726   | 3,726   | 18,723      | 79,386    | 公益事業                   |     |  |
| JMT NETWORK SERVICES-NVDR    | 9,372   | —       | —           | —         | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 3,984   | —       | —           | —         | 金融サービス                 |     |  |
| ASSET WORLD CORP PCL-NVDR    | 9,555   | 9,555   | 29,382      | 124,580   | 一般消費財・サービス流通・小売        |     |  |
| PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 36,679  | 36,679  | 15,625      | 66,251    | 消費者サービス                |     |  |
| CARABAO GROUP PCL-NVDR       | 11,939  | 17,872  | 32,527      | 137,914   | 一般消費財・サービス流通・小売        |     |  |
| SCG PACKAGING PCL-NVDR       | 1,396   | —       | —           | —         | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| SCB X PCL-NVDR               | 5,616   | 5,616   | 17,409      | 73,816    | 素材                     |     |  |
| TRUE CORP PCL/NEW-NVDR       | 3,704   | 4,720   | 50,976      | 216,138   | 銀行                     |     |  |
|                              | 52,768  | 52,768  | 45,380      | 192,414   | 電気通信サービス               |     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 639,617 | 924,663     | 2,737,968 | 11,608,987             |     |  |
|                              | 銘柄数比率   | 43      | 35          | —         | <1.4%>                 |     |  |
| (フィリピン)                      |         |         |             |           |                        |     |  |
| PLDT INC                     | 354     | 508     | 71,451      | 194,097   | 電気通信サービス               |     |  |
| SM PRIME HOLDINGS INC        | 55,820  | 67,669  | 181,014     | 491,726   | 不動産管理・開発               |     |  |
| AYALA LAND INC               | 33,272  | 41,296  | 112,325     | 305,132   | 不動産管理・開発               |     |  |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN | 8,401   | 12,503  | 152,798     | 415,077   | 銀行                     |     |  |
| INTL CONTAINER TERM SVCS INC | 5,072   | 8,481   | 293,124     | 796,271   | 運輸                     |     |  |
| JOLLIBEE FOODS CORP          | 2,613   | 2,613   | 58,010      | 157,586   | 消費者サービス                |     |  |
| SM INVESTMENTS CORP          | 1,172   | 1,505   | 132,488     | 359,904   | 資本財                    |     |  |
| MANILA ELECTRIC COMPANY      | 1,130   | 1,692   | 63,303      | 171,963   | 公益事業                   |     |  |
| AYALA CORPORATION            | 1,037   | 1,751   | 102,786     | 279,219   | 資本財                    |     |  |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC  | 9,249   | 9,249   | 36,767      | 99,880    | 資本財                    |     |  |
| METROPOLITAN BANK & TRUST    | 8,429   | 13,494  | 92,707      | 251,840   | 銀行                     |     |  |
| BDO UNIBANK INC              | 10,624  | 15,493  | 215,045     | 584,169   | 銀行                     |     |  |
| UNIVERSAL ROBINA CORP        | 3,676   | 5,362   | 58,982      | 160,224   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC       | 16,089  | 16,718  | 52,997      | 143,968   | 資本財                    |     |  |
| ACEN CORP                    | 3,353   | —       | —           | —         | 公益事業                   |     |  |
| MONDE NISSIN CORP            | 27,422  | —       | —           | —         | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 187,719 | 198,339     | 1,623,803 | 4,411,062              |     |  |
|                              | 銘柄数比率   | 16      | 14          | —         | <0.5%>                 |     |  |
| (インドネシア)                     |         |         |             |           |                        |     |  |
| KALBE FARMA TBK PT           | 99,780  | 111,711 | 15,862,962  | 155,457   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 232,966 | 346,193 | 106,627,444 | 1,044,948 | 電気通信サービス               |     |  |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P | 21,122  | 21,122  | 13,095,640  | 128,337   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT     | 262,911 | 385,411 | 361,322,812 | 3,540,963 | 銀行                     |     |  |
| ASTRA INTERNATIONAL TBK PT   | 97,408  | 151,720 | 77,756,500  | 762,013   | 資本財                    |     |  |
| BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 322,258 | 458,582 | 214,616,376 | 2,103,240 | 銀行                     |     |  |
| VALE INDONESIA TBK           | 9,951   | —       | —           | —         | 素材                     |     |  |
| ANEKA TAMBANG TBK            | 33,024  | 33,024  | 5,069,184   | 49,678    | 素材                     |     |  |
| SEmen INDONESIA PERSERO TBK  | 18,367  | 18,367  | 8,228,416   | 80,638    | 素材                     |     |  |
| UNITED TRACTORS TBK PT       | 8,216   | 15,842  | 35,010,820  | 343,106   | エネルギー                  |     |  |
| BANK MANDIRI PERSERO TBK PT  | 176,885 | 249,966 | 156,853,665 | 1,537,165 | 銀行                     |     |  |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT    | 30,865  | 44,567  | 11,409,152  | 111,809   | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |

| 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     |                    |  |
| (インドネシア)                     |         |           |             |               |            |                    |  |
| ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 百株      | 百株        | 千インドネシアルピア  | 千円            |            |                    |  |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 69,656  | 98,458    | 28,257,446  | 276,922       |            | エネルギー              |  |
| CHAROEN POKPHAND INDONESI PT | 34,457  | 137,687   | 64,299,829  | 630,138       |            | 銀行                 |  |
| INDAH KIAT PULP & PAPER TBK  | 30,677  | 41,368    | 21,925,040  | 214,865       |            | 食品・飲料・タバコ          |  |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 12,464  | 13,293    | 12,661,582  | 124,083       |            | 素材                 |  |
| SARANA MENARA NUSANTARA PT   | 10,107  | 11,533    | 12,426,807  | 121,782       |            | 食品・飲料・タバコ          |  |
| SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | 111,862 | 111,862   | 8,893,029   | 87,151        |            | 電気通信サービス           |  |
| BARITO PACIFIC TBK PT        | 70,917  | 103,765   | 29,884,320  | 292,866       |            | 生活必需品流通・小売り        |  |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT   | 133,372 | 133,372   | 13,070,524  | 128,091       |            | 素材                 |  |
| GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT  | 64,164  | 48,273    | 13,081,983  | 128,203       |            | 素材                 |  |
| AMMAN MINERAL INTERNASIONAL  | —       | 7,892,773 | 52,881,579  | 518,239       |            | 一般消費財・サービス流通・小売り   |  |
|                              |         | 37,321    | 35,454,950  | 347,458       |            | 素材                 |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 1,851,429 | 10,466,210  | 1,298,690,062 | 12,727,162 |                    |  |
| 銘柄                           | 比<br>率  | 21        | 22          | <1.6%>        |            |                    |  |
| (韓国)                         |         |           |             |               |            |                    |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD   | 22,526  | 32,773    | 259,566,199 | 29,538,633    |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP    | 1,233   | 1,450     | 2,987,556   | 339,983       |            | 公益事業               |  |
| CJ CORP                      | 60      | —         | —           | —             |            | 資本財                |  |
| SK TELECOM                   | —       | 312       | 1,634,880   | 186,049       |            | 電気通信サービス           |  |
| HYUNDAI MOTOR CO             | 642     | 928       | 22,417,237  | 2,551,081     |            | 自動車・自動車部品          |  |
| POSCO HOLDINGS INC           | 337     | 476       | 19,110,056  | 2,174,724     |            | 素材                 |  |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | 259     | 442       | 6,789,273   | 772,619       |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| KT CORP                      | —       | 300       | 1,074,000   | 122,221       |            | 電気通信サービス           |  |
| SAMSUNG SECURITIES CO LTD    | 234     | 360       | 1,420,803   | 161,687       |            | 金融サービス             |  |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD         | 291     | 444       | 10,088,107  | 1,148,026     |            | 自動車・自動車部品          |  |
| CHEIL WORLDWIDE INC          | 300     | —         | —           | —             |            | メディア・娯楽            |  |
| KB FINANCIAL GROUP INC       | 1,838   | 2,570     | 20,387,395  | 2,320,085     |            | 銀行                 |  |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS    | 138     | 202       | 6,600,197   | 751,102       |            | 保険                 |  |
| SAMSUNG SDI CO LTD           | 259     | 393       | 16,889,730  | 1,922,051     |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD  | 2,170   | 2,962     | 14,143,741  | 1,609,557     |            | 銀行                 |  |
| LG ELECTRONICS INC           | 503     | 675       | 6,584,857   | 749,356       |            | 耐久消費財・アパレル         |  |
| KT&G CORP                    | 497     | 671       | 6,081,978   | 692,129       |            | 食品・飲料・タバコ          |  |
| HANWHA OCEAN CO LTD          | —       | 378       | 1,199,503   | 136,503       |            | 資本財                |  |
| NCSOFT CORP                  | 74      | 74        | 1,529,388   | 174,044       |            | メディア・娯楽            |  |
| LG DISPLAY CO LTD            | 1,068   | 3,459     | 3,694,991   | 420,490       |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |  |
| HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS | 200     | 285       | 3,708,385   | 422,014       |            | 資本財                |  |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES     | 3,005   | 4,998     | 4,943,348   | 562,553       |            | 資本財                |  |
| AMOREPACIFIC CORP            | 147     | 260       | 4,446,778   | 506,043       |            | 家庭用品・パーソナル用品       |  |
| HANA FINANCIAL GROUP         | 1,440   | 1,991     | 12,369,512  | 1,407,650     |            | 銀行                 |  |
| LG CHEM LTD                  | 226     | 363       | 14,421,422  | 1,641,157     |            | 素材                 |  |
| DOOSAN ENERBILITY CO LTD     | 1,879   | 2,764     | 4,791,727   | 545,298       |            | 資本財                |  |
| LG H&H                       | 41      | 52        | 2,424,132   | 275,866       |            | 家庭用品・パーソナル用品       |  |
| SK INNOVATION CO LTD         | 272     | 392       | 4,367,936   | 497,071       |            | エネルギー              |  |
| KAKAO CORP                   | 1,473   | 2,165     | 10,351,998  | 1,178,057     |            | メディア・娯楽            |  |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 201     | 201       | 1,403,119   | 159,675       |            | 金融サービス             |  |
| COWAY CO LTD                 | 300     | 300       | 1,793,507   | 204,101       |            | 耐久消費財・アパレル         |  |
| S-1 CORPORATION              | 100     | —         | —           | —             |            | 商業・専門サービス          |  |
| KIA CORP                     | 1,234   | 1,749     | 19,957,002  | 2,271,106     |            | 自動車・自動車部品          |  |
| SK HYNIX INC                 | 2,573   | 3,725     | 67,023,723  | 7,627,299     |            | 半導体・半導体製造装置        |  |
| LG CORP                      | 424     | 691       | 5,517,212   | 627,858       |            | 資本財                |  |
| HYUNDAI STEEL CO             | 405     | 478       | 1,515,862   | 172,505       |            | 素材                 |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末   |            |           |                        | 業種等 |  |
|------------------------------|---------|-------|------------|-----------|------------------------|-----|--|
|                              |         | 株数    | 株数         | 評価額       |                        |     |  |
|                              |         |       |            | 外貨建金額     | 邦貨換算金額                 |     |  |
| (韓国)                         |         | 百株    | 百株         | 千韓国ウォン    | 千円                     |     |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS-PREF     | 3,870   | 5,579 | 36,155,160 | 4,114,457 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| HANWHA AEROSPACE CO LTD      | —       | 231   | 5,056,292  | 575,406   | 資本財                    |     |  |
| INDUSTRIAL BANK OF KOREA     | 1,370   | 1,957 | 2,716,912  | 309,184   | 銀行                     |     |  |
| PAN OCEAN CO LTD             | 1,280   | —     | —          | —         | 運輸                     |     |  |
| KANGWON LAND INC             | 471     | 471   | 734,561    | 83,593    | 消費者サービス                |     |  |
| NAVER CORP                   | 617     | 877   | 16,540,597 | 1,882,319 | メディア・娯楽                |     |  |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LT | 1,196   | 1,196 | 968,938    | 110,265   | 金融サービス                 |     |  |
| CELLTRION INC                | 480     | 1,075 | 20,755,268 | 2,361,949 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| LG UPLUS CORP                | 937     | 1,075 | 1,072,999  | 122,107   | 電気通信サービス               |     |  |
| LOTTE SHOPPING CO            | 57      | —     | —          | —         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| YUHAN CORP                   | 223     | 480   | 3,438,303  | 391,278   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| DB INSURANCE CO LTD          | 201     | 260   | 2,552,900  | 290,520   | 保険                     |     |  |
| S-OIL CORP                   | 215     | 323   | 2,274,694  | 258,860   | エネルギー                  |     |  |
| POSCO INTERNATIONAL CORP     | —       | 262   | 1,231,875  | 140,187   | 資本財                    |     |  |
| SAMSUNG E&A CO LTD           | 713     | 1,482 | 3,780,120  | 430,177   | 資本財                    |     |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF | 177     | 255   | 3,931,435  | 447,397   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONST  | 463     | 434   | 1,512,651  | 172,139   | 資本財                    |     |  |
| KOREAN AIR LINES CO LTD      | 836     | 1,875 | 4,126,298  | 469,572   | 運輸                     |     |  |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT | 398     | 482   | 4,437,115  | 504,943   | 保険                     |     |  |
| LOTTE CHEMICAL CORP          | 94      | 94    | 1,028,333  | 117,024   | 素材                     |     |  |
| GS HOLDINGS                  | 285     | 276   | 1,232,653  | 140,276   | 資本財                    |     |  |
| NH INVESTMENT & SECURITIES C | 600     | 600   | 762,571    | 86,780    | 金融サービス                 |     |  |
| HANWHA SOLUTIONS CORP        | 486     | 654   | 1,884,988  | 214,511   | 素材                     |     |  |
| HD HYUNDAI MIPO              | 105     | —     | —          | —         | 資本財                    |     |  |
| CJ CHEILJEDANG CORP          | 38      | 88    | 2,971,584  | 338,166   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD        | 84      | 111   | 2,042,424  | 232,427   | 運輸                     |     |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF     | 108     | 222   | 3,406,064  | 387,610   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| KOREA ZINC CO LTD            | 41      | 53    | 2,657,764  | 302,453   | 素材                     |     |  |
| E-MART INC                   | 118     | —     | —          | —         | 生活必需品流通・小売り            |     |  |
| KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD   | 80      | 80    | 1,127,299  | 128,286   | 素材                     |     |  |
| SK INC                       | 189     | 344   | 5,635,681  | 641,340   | 資本財                    |     |  |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES   | 328     | 418   | 2,236,942  | 254,563   | 資本財                    |     |  |
| HMM CO LTD                   | 1,323   | 1,704 | 3,125,686  | 355,703   | 運輸                     |     |  |
| LG INNOTEK CO LTD            | 76      | 136   | 3,196,674  | 363,781   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| LG CHEM LTD-PREFERENCE       | 49      | 43    | 1,130,203  | 128,617   | 素材                     |     |  |
| HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO | 349     | 436   | 1,877,165  | 213,621   | 自動車・自動車部品              |     |  |
| HANON SYSTEMS                | 1,069   | 1,069 | 610,918    | 69,522    | 自動車・自動車部品              |     |  |
| HANJIN KAL CORP              | —       | 247   | 1,587,008  | 180,601   | 運輸                     |     |  |
| HOTEL SHILLA CO LTD          | 128     | —     | —          | —         | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| SAMSUNG SDS CO LTD           | 143     | 244   | 3,830,374  | 435,896   | ソフトウェア・サービス            |     |  |
| SAMSUNG C&T CORP             | 378     | 667   | 10,013,400 | 1,139,524 | 資本財                    |     |  |
| HANMI PHARM CO LTD           | 36      | 36    | 1,175,265  | 133,745   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| SKC CO LTD                   | 80      | 198   | 2,218,193  | 252,430   | 素材                     |     |  |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD     | 84      | 128   | 10,103,506 | 1,149,778 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NETMARBLE CORP               | 122     | 122   | 853,342    | 97,110    | メディア・娯楽                |     |  |
| HD HYUNDAI                   | 257     | 234   | 1,546,512  | 175,993   | エネルギー                  |     |  |
| DOOSAN BOBCAT INC            | 238     | 323   | 1,764,601  | 200,811   | 資本財                    |     |  |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | 121     | 121   | 1,119,501  | 127,399   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD  | 412     | —     | —          | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BGF RETAIL CO LTD            | 47      | —     | —          | —         | 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<br>邦貨換算金額 |                        |  |
|                              |         |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |                 |                        |  |
| (韓国)                         |         |         |            |            |                 |                        |  |
| POSCO FUTURE M CO LTD        | 百株      | 百株      | 千韓国ウォン     | 千円         |                 |                        |  |
| LOTTE ENERGY MATERIALS CORP  | 122     | 202     | 5,670,027  | 645,249    |                 | 資本財                    |  |
| L&F CO LTD                   | 109     | —       | —          | —          |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ECOPRO CO LTD                | 105     | 160     | 2,466,443  | 280,681    |                 | 資本財                    |  |
| HLB INC                      | —       | 690     | 6,785,129  | 772,147    |                 | 資本財                    |  |
| CELLTRION PHARM INC          | 492     | 813     | 8,216,350  | 935,020    |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| PEARL ABYSS CORP             | 99      | 104     | 1,026,027  | 116,761    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC    | 174     | —       | —          | —          |                 | メディア・娯楽                |  |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD | 2,556   | 4,407   | 6,403,429  | 728,710    |                 | 銀行                     |  |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD      | 173     | 173     | 1,560,364  | 177,569    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HYBE CO LTD                  | 120     | 178     | 1,043,080  | 118,702    |                 | 資本財                    |  |
| KAKAO BANK CORP              | 81      | 119     | 2,392,566  | 272,274    |                 | メディア・娯楽                |  |
| ECOPRO BM CO LTD             | 648     | 1,039   | 2,498,795  | 284,362    |                 | 銀行                     |  |
| SK BIOSCIENCE CO LTD         | 255     | 342     | 7,449,157  | 847,714    |                 | 資本財                    |  |
| KAKAO PAY CORP               | 81      | 147     | 880,530    | 100,204    |                 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| F&F CO LTD / NEW             | 112     | 112     | 403,240    | 45,888     |                 | 金融サービス                 |  |
| KRAFTON INC                  | 92      | —       | —          | —          |                 | 耐久消費財・アパレル             |  |
| SD BIOSENSOR INC             | 130     | 189     | 4,912,194  | 559,007    |                 | メディア・娯楽                |  |
| KAKAO GAMES CORP             | 100     | —       | —          | —          |                 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SK SQUARE CO LTD             | 163     | —       | —          | —          |                 | メディア・娯楽                |  |
| LG ENERGY SOLUTION           | 490     | 638     | 5,132,736  | 584,105    |                 | 資本財                    |  |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC   | 164     | 347     | 13,336,212 | 1,517,660  |                 | 資本財                    |  |
| HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES  | 473     | 674     | 5,554,427  | 632,093    |                 | 金融サービス                 |  |
| COSMOAM&T CO LTD             | 91      | 124     | 1,690,120  | 192,335    |                 | 資本財                    |  |
| HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD   | —       | 126     | 1,816,279  | 206,692    |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| KUM YANG CO LTD              | —       | 328     | 4,564,705  | 519,463    |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| POSCO DX CO LTD              | —       | 180     | 1,769,400  | 201,357    |                 | 素材                     |  |
| ECOPRO MATERIALS CO LTD      | —       | 302     | 1,241,220  | 141,250    |                 | ソフトウェア・サービス            |  |
|                              | —       | 116     | 1,171,600  | 133,328    |                 | 資本財                    |  |
| 小計                           | 株数      | ・       | 金額         | 74,202     | 107,802         | 829,644,383            |  |
|                              | 銘柄      | 数       | <比率>       | 102        | 99              | 94,413,530             |  |
|                              |         |         |            |            |                 | <11.5%>                |  |
| (台湾)                         |         |         |            |            |                 |                        |  |
| COMPAL ELECTRONICS           | 20,067  | 28,307  | 千ニュー台湾ドル   |            |                 |                        |  |
| DELTA ELECTRONICS INC        | 9,122   | 13,932  | 103,040    | 495,520    |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 15,121  | 15,121  | 444,437    | 2,137,298  |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| FORMOSA PLASTICS CORP        | 19,476  | 28,026  | 52,093     | 250,515    |                 | 資本財                    |  |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY   | 58,522  | 85,072  | 192,258    | 924,570    |                 | 素材                     |  |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 55,880  | 78,100  | 1,441,982  | 6,934,494  |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| NAN YA PLASTICS CORP         | 22,355  | 35,985  | 407,682    | 1,960,542  |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP   | 2,560   | 3,690   | 205,117    | 986,411    |                 | 素材                     |  |
| TAIWAN CEMENT                | 28,626  | 40,586  | 101,290    | 487,106    |                 | 生活必需品流通・小売り            |  |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 116,260 | 168,770 | 135,154    | 649,958    |                 | 素材                     |  |
| ASUSTEK COMPUTER INC         | 3,237   | 4,957   | 13,535,354 | 65,091,517 |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| WINBOND ELECTRONICS CORP     | 14,380  | 18,870  | 233,261    | 1,121,755  |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP   | 2,107   | 3,167   | 47,741     | 229,586    |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| YAGEO CORPORATION            | 1,607   | 2,187   | 163,735    | 787,403    |                 | 半導体・半導体製造装置            |  |
| QUANTA COMPUTER INC          | 12,211  | 18,291  | 138,898    | 667,963    |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO  | 40,143  | 63,833  | 494,785    | 2,379,421  |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ACER INC                     | 13,641  | 16,641  | 354,276    | 1,703,717  |                 | 保険                     |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS   | 53,838  | 81,034  | 79,547     | 382,542    |                 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE    | 15,614  | 22,774  | 185,973    | 894,344    |                 | 銀行                     |  |
|                              |         |         |            | 128,902    | 619,892         | 素材                     |  |

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末     |           |           |                    | 業種等 |  |
|-------------------------------|---------|---------|-----------|-----------|--------------------|-----|--|
|                               |         | 株数      | 評価額       | 外貨建金額     |                    |     |  |
|                               |         |         |           | 邦貨換算金額    |                    |     |  |
| (台湾)                          |         |         |           |           |                    |     |  |
| WAN HAI LINES LTD             | 百株      | 百株      | 千ニュー台湾ドル  | 千円        |                    |     |  |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO    | 3,228   | 3,228   | 20,597    | 99,053    | 運輸                 |     |  |
| mediatek inc                  | 34,829  | 51,585  | 370,384   | 1,781,178 | 保険                 |     |  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING     | 7,162   | 10,392  | 1,137,963 | 5,472,466 | 半導体・半導体製造装置        |     |  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | 49,349  | 88,627  | 166,619   | 801,271   | 銀行                 |     |  |
| TAIWAN MOBILE CO LTD          | 83,309  | 119,339 | 446,926   | 2,149,270 | 銀行                 |     |  |
| CHINA STEEL CORP              | 7,804   | 13,564  | 142,422   | 684,907   | 電気通信サービス           |     |  |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR  | 55,869  | 84,019  | 208,368   | 1,002,043 | 素材                 |     |  |
| ADVANTECH CO LTD              | 2,780   | 4,100   | 241,080   | 1,159,353 | 半導体・半導体製造装置        |     |  |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD     | 2,131   | 2,880   | 101,383   | 487,551   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| AUO CORP                      | 2,930   | 5,260   | 116,772   | 561,556   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| INVENTEC CORP                 | 33,778  | 41,658  | 72,901    | 350,583   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD       | 12,914  | 15,364  | 87,576    | 421,155   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| WPG HOLDINGS LTD              | 17,620  | 26,000  | 326,300   | 1,569,176 | 電気通信サービス           |     |  |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO   | 8,261   | 15,401  | 141,849   | 682,154   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| GIANT MANUFACTURING           | 3,450   | 4,320   | 71,280    | 342,785   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| GLOBAL UNICHIP CORP           | 1,520   | —       | —         | —         | 耐久消費財・アパレル         |     |  |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP   | —       | 570     | 72,390    | 348,123   | 半導体・半導体製造装置        |     |  |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO   | 6,311   | 8,741   | 75,093    | 361,123   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| INNOLUX CORP                  | 48,552  | 63,021  | 202,297   | 972,850   | 金融サービス             |     |  |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C  | 39,603  | 53,454  | 71,094    | 341,894   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING   | 44,001  | 52,281  | 137,237   | 659,976   | 銀行                 |     |  |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD   | 58,088  | 69,488  | 63,026    | 303,092   | 保険                 |     |  |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD  | 7,440   | 14,190  | 120,189   | 577,990   | 電気通信サービス           |     |  |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP    | 8,944   | 11,454  | 57,270    | 275,414   | 自動車・自動車部品          |     |  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT  | 4,591   | 5,971   | 41,979    | 201,880   | エネルギー              |     |  |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO    | 52,560  | 76,467  | 313,132   | 1,505,854 | 銀行                 |     |  |
| LARGAN PRECISION CO LTD       | 50,331  | 83,346  | 232,536   | 1,118,268 | 銀行                 |     |  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO  | 488     | 738     | 164,618   | 791,650   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK     | 22,416  | 32,686  | 252,337   | 1,213,492 | 食品・飲料・タバコ          |     |  |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL   | 21,486  | 28,583  | 53,165    | 255,675   | 銀行                 |     |  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP       | 71,862  | 129,832 | 183,713   | 883,476   | 保険                 |     |  |
| ASIA CEMENT CORP              | 10,291  | 13,201  | 138,616   | 666,608   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| POU CHEN                      | 11,132  | 13,122  | 60,364    | 290,294   | 素材                 |     |  |
| WISTRON CORP                  | 10,665  | 22,875  | 85,095    | 409,221   | 耐久消費財・アパレル         |     |  |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP     | —       | 18,140  | 206,796   | 994,481   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| E INN HOLDINGS INC            | 5,710   | 8,750   | 166,250   | 799,496   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD  | 3,830   | 6,890   | 145,034   | 697,470   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| PEGATRON CORP                 | 1,140   | 1,140   | 21,660    | 104,162   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| CHINA AIRLINES LTD            | 9,179   | 12,319  | 122,581   | 589,494   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO   | 15,820  | 15,820  | 35,832    | 172,317   | 運輸                 |     |  |
| WALSIN LIHWA CORP             | 63,582  | 99,770  | 284,346   | 1,367,421 | 銀行                 |     |  |
| EVA AIRWAYS CORP              | 13,140  | 16,290  | 58,236    | 280,060   | 資本財                |     |  |
| EVERGREEN MARINE CORP LTD     | 10,610  | 25,690  | 96,594    | 464,522   | 運輸                 |     |  |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP    | 4,603   | 7,263   | 140,549   | 675,901   | 運輸                 |     |  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL  | 630     | 930     | 108,345   | 521,031   | 資本財                |     |  |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD       | 47,553  | 80,675  | 214,597   | 1,031,998 | 銀行                 |     |  |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD    | 1,440   | 1,818   | 111,310   | 535,292   | 一般消費財・サービス流通・小売    |     |  |
| TAIWAN BUSINESS BANK          | 9,612   | 8,651   | 35,038    | 168,498   | 不動産管理・開発           |     |  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING  | 29,770  | 62,794  | 107,378   | 516,383   | 銀行                 |     |  |
|                               | 3,460   | 6,910   | 82,920    | 398,762   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |     |  |

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末    |           |           |                       | 業種等         |  |
|-------------------------------|---------|--------|-----------|-----------|-----------------------|-------------|--|
|                               |         | 株数     | 株数        | 評価額       |                       |             |  |
|                               |         |        |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額                |             |  |
| (台湾)                          |         | 百株     | 百株        | 千ニュー台湾ドル  | 千円                    |             |  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD      | 6,822   | 10,992 | 168,189   | 808,821   | 金融サービス                |             |  |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI   | 4,730   | 4,730  | 43,516    | 209,268   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| YANG MING MARINE TRANSPORT    | 7,910   | 10,650 | 64,539    | 310,368   | 運輸                    |             |  |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD     | 807     | 1,007  | 49,155    | 236,387   | 耐久消費財・アパレル            |             |  |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD       | 470     | 470    | 35,062    | 168,613   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD    | —       | 3,350  | 102,845   | 494,581   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |             |  |
| SILERGY CORP                  | 1,480   | 2,880  | 119,376   | 574,079   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD    | 2,259   | 3,440  | 55,915    | 268,899   | 耐久消費財・アパレル            |             |  |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC        | 290     | 420    | 92,820    | 446,371   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| MOMO.COM INC                  | 296     | —      | —         | —         | 一般消費財・サービス流通・小売り      |             |  |
| VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY    | 300     | 380    | 60,420    | 290,559   | 資本財                   |             |  |
| NANYA TECHNOLOGY CORP         | 5,850   | 7,060  | 45,466    | 218,647   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD   | 780     | 1,320  | 44,946    | 216,145   | 耐久消費財・アパレル            |             |  |
| WIN SEMICONDUCTORS CORP       | 1,640   | —      | —         | —         | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| GLOBALWAFERS CO LTD           | 1,010   | 1,240  | 63,860    | 307,102   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP   | 7,460   | 10,770 | 32,686    | 157,191   | 運輸                    |             |  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD | 15,662  | 21,312 | 322,891   | 1,552,783 | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA  | 18,490  | 28,480 | 133,571   | 642,343   | 銀行                    |             |  |
| ACCTON TECHNOLOGY CORP        | 2,300   | 3,190  | 147,218   | 707,973   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |             |  |
| WIWYNN CORP                   | 420     | 740    | 177,970   | 855,857   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |             |  |
| POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU  | 15,230  | 21,080 | 51,329    | 246,845   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| PHARMAESSENTIA CORP           | 1,030   | 1,360  | 42,500    | 204,382   | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| ALCHIP TECHNOLOGIES LTD       | —       | 550    | 140,250   | 674,462   | 半導体・半導体製造装置           |             |  |
| 小計                            | 株数      | 金額     | 1,615,802 | 2,404,395 | 28,354,115            | 136,354,941 |  |
|                               | 銘柄数     | <比率>   | 88        | 89        | <16.6%>               |             |  |
| (インド)                         |         |        | 千インドルピー   |           |                       |             |  |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE   | 8,151   | —      | —         | —         | 金融サービス                |             |  |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD     | 4,296   | 6,193  | 2,411,834 | 4,534,249 | ソフトウェア・サービス           |             |  |
| ITC LTD                       | 13,971  | 20,786 | 900,799   | 1,693,503 | 食品・飲料・タバコ             |             |  |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD        | 3,867   | 5,447  | 1,286,906 | 2,419,385 | 家庭用品・パーソナル用品          |             |  |
| JINDAL STEEL & POWER LTD      | 1,796   | 3,015  | 280,652   | 527,627   | 素材                    |             |  |
| BHARAT HEAVY ELECTRICALS      | —       | 8,274  | 226,971   | 426,706   | 資本財                   |             |  |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD    | 11,494  | 19,862 | 536,796   | 1,009,177 | エネルギー                 |             |  |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD       | 6,327   | 9,409  | 588,633   | 1,106,630 | 素材                    |             |  |
| COAL INDIA LTD                | 7,428   | 9,917  | 445,702   | 837,921   | エネルギー                 |             |  |
| GAIL INDIA LTD                | 10,703  | 13,696 | 263,728   | 495,809   | 公益事業                  |             |  |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD       | 2,630   | 7,322  | 1,192,051 | 2,241,057 | 銀行                    |             |  |
| AMBUJA CEMENTS LTD            | 2,871   | 3,550  | 206,581   | 388,373   | 素材                    |             |  |
| HERO MOTOCORP LTD             | 507     | 872    | 425,479   | 799,902   | 自動車・自動車部品             |             |  |
| BAJAJ AUTO LTD                | 304     | 491    | 441,239   | 829,531   | 自動車・自動車部品             |             |  |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS      | 4,487   | 6,769  | 1,019,929 | 1,917,468 | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| ADANI ENTERPRISES LTD         | 850     | 1,308  | 366,134   | 688,333   | 資本財                   |             |  |
| ASIAN PAINTS LTD              | 1,814   | 2,763  | 765,862   | 1,439,821 | 素材                    |             |  |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD  | 14,688  | 33,818 | 1,027,223 | 1,931,180 | 公益事業                  |             |  |
| SHIRIRAM FINANCE LTD          | 1,127   | 2,136  | 500,889   | 941,671   | 金融サービス                |             |  |
| VEDANTA LTD                   | 3,645   | 5,553  | 228,095   | 428,819   | 素材                    |             |  |
| TATA POWER CO LTD             | 6,543   | 12,269 | 508,983   | 956,889   | 公益事業                  |             |  |
| BHARTI AIRTEL LTD             | 10,475  | 15,530 | 2,020,797 | 3,799,099 | 電気通信サービス              |             |  |
| CIPLA LTD                     | 2,248   | 3,446  | 461,690   | 867,978   | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| NTPC LTD                      | 18,737  | 28,327 | 1,007,056 | 1,893,266 | 公益事業                  |             |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末     |           |            |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|---------|-----------|------------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数      | 株数        | 評価額        |        |                        |  |
|                              |         |         |           | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (インド)                        | 百株      | 百株      |           | 千円         |        |                        |  |
| INFOSYS LTD                  | 15,864  | 22,544  | 3,212,388 | 6,039,290  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| ULTRATECH CEMENT LTD         | 465     | 758     | 720,021   | 1,353,640  |        | 素材                     |  |
| ACC LTD                      | 290     | —       | —         | —          |        | 素材                     |  |
| HDFC BANK LIMITED            | —       | 19,204  | 2,761,427 | 5,191,484  |        | 銀行                     |  |
| DLF LTD                      | 2,818   | 4,934   | 407,537   | 766,169    |        | 不動産管理・開発               |  |
| DR. REDDY'S LABORATORIES     | 558     | 843     | 499,578   | 939,207    |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ICICI BANK LTD               | 24,373  | 35,227  | 3,935,044 | 7,397,883  |        | 銀行                     |  |
| LUPIN LTD                    | 810     | 1,755   | 282,302   | 530,728    |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |  |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | 572     | 961     | 1,218,445 | 2,290,676  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD      | 14,359  | 20,955  | 5,898,687 | 11,089,531 |        | エネルギー                  |  |
| STATE BANK OF INDIA          | 8,480   | 12,366  | 1,010,753 | 1,900,217  |        | 銀行                     |  |
| TATA STEEL LTD               | 34,736  | 50,273  | 815,684   | 1,533,486  |        | 素材                     |  |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | 4,250   | 5,567   | 344,404   | 647,480    |        | エネルギー                  |  |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 1,988   | 2,676   | 353,583   | 664,737    |        | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| REC LTD                      | —       | 9,678   | 497,322   | 934,965    |        | 金融サービス                 |  |
| POWER FINANCE CORPORATION    | —       | 10,736  | 448,394   | 842,980    |        | 金融サービス                 |  |
| BANK OF BARODA               | 4,850   | 6,836   | 174,217   | 327,528    |        | 銀行                     |  |
| DABUR INDIA LTD              | 2,874   | 3,555   | 195,843   | 368,185    |        | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| JSW STEEL LTD                | 3,575   | 4,114   | 351,229   | 660,312    |        | 素材                     |  |
| LARSEN & TOUBRO LTD          | 3,236   | 4,491   | 1,469,401 | 2,762,474  |        | 資本財                    |  |
| UNITED SPIRITS LTD           | 1,398   | 1,675   | 201,432   | 378,692    |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TITAN CO LTD                 | 1,683   | 2,333   | 767,818   | 1,443,498  |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| SIEMENS LTD                  | 360     | 692     | 427,298   | 803,321    |        | 資本財                    |  |
| WIPRO LTD                    | 6,239   | 9,604   | 433,996   | 815,912    |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| AXIS BANK LTD                | 10,763  | 15,824  | 1,772,463 | 3,332,230  |        | 銀行                     |  |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | 4,120   | 6,599   | 1,447,270 | 2,720,868  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| TATA MOTORS LTD              | 7,676   | 10,835  | 1,134,138 | 2,132,180  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| HCL TECHNOLOGIES LTD         | 4,489   | 6,560   | 863,475   | 1,623,334  |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| DIVI'S LABORATORIES LTD      | 616     | 724     | 274,968   | 516,939    |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |  |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 2,427   | 3,918   | 496,405   | 933,241    |        | 運輸                     |  |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE  | 459     | 747     | 436,799   | 821,182    |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| YES BANK LTD                 | 53,868  | 112,989 | 254,225   | 477,943    |        | 銀行                     |  |
| NESTLE INDIA LTD             | 163     | 2,275   | 576,467   | 1,083,759  |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TECH MAHINDRA LTD            | 2,731   | 3,784   | 478,464   | 899,512    |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| AUROBINDO PHARMA LTD         | 1,410   | 1,410   | 159,061   | 299,035    |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフケイエンス |  |
| SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN | 9,670   | 12,633  | 161,205   | 303,066    |        | 自動車・自動車部品              |  |
| SHREE CEMENT LTD             | 49      | 49      | 125,817   | 236,536    |        | 素材                     |  |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD  | 1,312   | 1,815   | 181,911   | 341,994    |        | 運輸                     |  |
| MARICO LTD                   | 2,503   | 3,030   | 177,960   | 334,565    |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| INDUS TOWERS LTD             | 2,708   | —       | —         | —          |        | 電気通信サービス               |  |
| EICHER MOTORS LTD            | 634     | 1,071   | 499,014   | 938,146    |        | 自動車・自動車部品              |  |
| BHARAT FORGE LTD             | 1,174   | 2,149   | 300,369   | 564,695    |        | 自動車・自動車部品              |  |
| UPL LTD                      | 2,279   | 3,311   | 166,215   | 312,484    |        | 素材                     |  |
| CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU | 2,629   | 5,246   | 304,280   | 572,047    |        | 資本財                    |  |
| GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE  | —       | 19,258  | 154,257   | 290,003    |        | 運輸                     |  |
| GODREJ PROPERTIES LTD        | 684     | 1,080   | 290,872   | 546,840    |        | 不動産管理・開発               |  |
| HAVELLS INDIA LTD            | 1,216   | 1,441   | 243,138   | 457,099    |        | 資本財                    |  |
| INDUSIND BANK LTD            | —       | 1,611   | 227,175   | 427,089    |        | 銀行                     |  |
| MRF LTD                      | 9       | 21      | 275,861   | 518,620    |        | 自動車・自動車部品              |  |
| PETRONET LNG LTD             | 3,300   | 5,488   | 164,460   | 309,185    |        | エネルギー                  |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |           |           |        | 業種等                   |  |
|------------------------------|---------|--------|-----------|-----------|--------|-----------------------|--|
|                              |         | 株数     | 株数        | 評価額       |        |                       |  |
|                              |         |        |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |                       |  |
| (インド)                        | 百株      | 百株     |           | 千円        |        |                       |  |
| ADANI POWER LTD              | 3,895   | 4,651  | 280,506   | 527,351   |        | 公益事業                  |  |
| ADANI ENERGY SOLUTIONS LTD   | 1,351   | —      | —         | —         |        | 公益事業                  |  |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD      | 703     | 1,125  | 328,748   | 618,047   |        | 素材                    |  |
| ASTRAL LTD                   | —       | 721    | 155,766   | 292,840   |        | 資本財                   |  |
| ASHOK LEYLAND LTD            | —       | 8,106  | 160,759   | 302,227   |        | 資本財                   |  |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR        | —       | 4,207  | 297,278   | 558,884   |        | 自動車・自動車部品             |  |
| INTERGLOBE AVIATION LTD      | 503     | 1,089  | 437,723   | 822,919   |        | 運輸                    |  |
| BAJAJ FINANCE LTD            | 1,290   | 1,878  | 1,255,697 | 2,360,711 |        | 金融サービス                |  |
| BAJAJ FINSERV LTD            | 1,790   | 2,881  | 453,203   | 852,022   |        | 金融サービス                |  |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP     | 2,814   | 3,580  | 179,588   | 337,625   |        | エネルギー                 |  |
| IDFC FIRST BANK LTD          | —       | 28,397 | 217,383   | 408,681   |        | 銀行                    |  |
| GRASIM INDUSTRIES LTD        | 1,255   | 1,918  | 456,125   | 857,515   |        | 素材                    |  |
| AVENUE SUPERMARTS LTD        | 744     | 1,102  | 528,986   | 994,494   |        | 生活必需品流通・小売            |  |
| INDIAN OIL CORP LTD          | 12,009  | 18,301 | 290,895   | 546,883   |        | エネルギー                 |  |
| COLGATE PALMOLIVE (INDIA)    | 640     | 936    | 262,334   | 493,189   |        | 家庭用品・パーソナル用品          |  |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD     | 492     | 758    | 384,331   | 722,544   |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| INDRAPRASTHA GAS LTD         | 1,352   | 2,137  | 95,320    | 179,202   |        | 公益事業                  |  |
| BHARAT ELECTRONICS LTD       | 16,694  | 27,680 | 628,623   | 1,181,812 |        | 資本財                   |  |
| NMDC LTD                     | —       | 8,590  | 219,400   | 412,472   |        | 素材                    |  |
| TVS MOTOR CO LTD             | 987     | 1,412  | 291,387   | 547,808   |        | 自動車・自動車部品             |  |
| BERGER PAINTS INDIA LTD      | 1,029   | 1,707  | 83,726    | 157,406   |        | 素材                    |  |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD  | 449     | 941    | 244,681   | 460,001   |        | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| PAGE INDUSTRIES LTD          | 30      | 40     | 138,305   | 260,014   |        | 耐久消費財・アパレル            |  |
| TATA COMMUNICATIONS LTD      | —       | 663    | 115,497   | 217,136   |        | 電気通信サービス              |  |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD    | 385     | 385    | 95,440    | 179,428   |        | 自動車・自動車部品             |  |
| TRENT LTD                    | 817     | 1,282  | 573,237   | 1,077,687 |        | 一般消費財・サービス流通・小売       |  |
| JUBILANT FOODWORKS LTD       | 1,844   | 2,405  | 111,283   | 209,212   |        | 消費者サービス               |  |
| MPHASIS LTD                  | 515     | 433    | 96,813    | 182,010   |        | ソフトウェア・サービス           |  |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURA | 1,117   | 1,388  | 230,690   | 433,699   |        | 保険                    |  |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD   | 4,383   | 6,190  | 339,571   | 638,394   |        | 保険                    |  |
| VARUN BEVERAGES LTD          | 1,009   | 3,433  | 502,383   | 944,480   |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| BANDHAN BANK LTD             | 2,660   | 4,045  | 75,667    | 142,254   |        | 銀行                    |  |
| HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | —       | 728    | 265,155   | 498,492   |        | 金融サービス                |  |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | 1,946   | 1,946  | 115,157   | 216,496   |        | 保険                    |  |
| INFO EDGE INDIA LTD          | 373     | 551    | 332,694   | 625,465   |        | メディア・娯楽               |  |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD    | 2,042   | 3,185  | 456,134   | 857,533   |        | 保険                    |  |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD   | 2,525   | 4,511  | 492,221   | 925,376   |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| ADANI GREEN ENERGY LTD       | 1,555   | 2,006  | 344,129   | 646,963   |        | 公益事業                  |  |
| LTMINDTREE LTD               | 425     | 575    | 264,985   | 498,173   |        | ソフトウェア・サービス           |  |
| MUTHOOT FINANCE LTD          | 484     | 701    | 116,593   | 219,196   |        | 金融サービス                |  |
| PI INDUSTRIES LTD            | 359     | 561    | 199,972   | 375,947   |        | 素材                    |  |
| MACROTECH DEVELOPERS LTD     | —       | 1,387  | 156,079   | 293,428   |        | 不動産管理・開発              |  |
| ADANI TOTAL GAS LTD          | 1,239   | —      | —         | —         |        | 公益事業                  |  |
| CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND | 1,899   | 2,495  | 317,526   | 596,949   |        | 金融サービス                |  |
| SBI CARDS & PAYMENT SERVICES | 1,127   | 1,526  | 109,933   | 206,674   |        | 金融サービス                |  |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO | 1,289   | 1,289  | 128,326   | 241,253   |        | 商業・専門サービス             |  |
| SRF LTD                      | 680     | 1,146  | 261,064   | 490,801   |        | 素材                    |  |
| ZOMATO LTD                   | 17,457  | 40,742 | 820,136   | 1,541,856 |        | 消費者サービス               |  |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD    | 808     | 808    | 51,316    | 96,474    |        | 銀行                    |  |
| TATA ELXSI LTD               | 159     | 196    | 139,697   | 262,630   |        | ソフトウェア・サービス           |  |

| 銘柄                             | 期首(前期末) | 当期末    |           |              |                        | 業種等         |  |
|--------------------------------|---------|--------|-----------|--------------|------------------------|-------------|--|
|                                |         | 株数     | 株数        | 評価額          |                        |             |  |
|                                |         |        |           | 外貨建金額        | 邦貨換算金額                 |             |  |
| (インド)                          |         |        |           |              |                        |             |  |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT  | 百株      | 百株     | 千円        |              |                        |             |  |
| INDIAN HOTELS CO LTD           | 119     | 161    | 255,206   | 金融サービス       |                        |             |  |
| ABB INDIA LTD                  | 3,723   | 5,461  | 558,045   | 消費者サービス      |                        |             |  |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD  | 249     | 320    | 431,849   | 資本財          |                        |             |  |
| HINDUSTAN AERONAUTICS LTD      | 543     | 650    | 497,347   | 自動車・自動車部品    |                        |             |  |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD   | —       | 1,281  | 933,095   | 資本財          |                        |             |  |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS    | —       | 5,833  | 889,845   | ヘルスケア機器・サービス |                        |             |  |
| CUMMINS INDIA LTD              | —       | 3,299  | 366,071   | 自動車・自動車部品    |                        |             |  |
| SUPREME INDUSTRIES LTD         | —       | 917    | 588,180   | 資本財          |                        |             |  |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD     | —       | 381    | 377,984   | 素材           |                        |             |  |
| APL APOLLO TUBES LTD           | —       | 19,006 | 1,242,927 | 金融サービス       |                        |             |  |
| ONE 97 COMMUNICATIONS LTD      | —       | 934    | 269,612   | 素材           |                        |             |  |
| PERSISTENT SYSTEMS LTD         | —       | 1,259  | 82,759    | 金融サービス       |                        |             |  |
| POLYCARB INDIA LTD             | —       | 746    | 472,285   | ソフトウェア・サービス  |                        |             |  |
| SUZLON ENERGY LTD              | —       | 247    | 285,843   | 資本財          |                        |             |  |
| UNION BANK OF INDIA            | —       | 73,274 | 549,649   | 資本財          |                        |             |  |
| PUNJAB NATIONAL BANK           | —       | 11,457 | 305,856   | 銀行           |                        |             |  |
|                                | —       | 16,703 | 389,066   | 銀行           |                        |             |  |
| 小計                             | 株数      | ・金額    | 489,432   | 1,025,118    | 73,328,572             | 137,857,715 |  |
|                                | 銘柄数     | <比率>   | 114       | 136          | —                      | <16.8%>     |  |
| (中国オフショア)                      |         |        | 千オフショア元   |              |                        |             |  |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A          | 1,592   | 9,175  | 13,406    | 288,918      | 自動車・自動車部品              |             |  |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A       | 352     | 527    | 91,736    | 1,977,048    | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A   | 2,120   | 2,120  | 5,861     | 126,329      | 保険                     |             |  |
| CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A   | 6,082   | 8,562  | 21,817    | 470,187      | 公益事業                   |             |  |
| CHINA JUSHI CO LTD-A           | 1,104   | 1,104  | 1,443     | 31,110       | 素材                     |             |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A     | 1,839   | 1,839  | 3,330     | 71,775       | ヘルスケア機器・サービス           |             |  |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A   | 606     | 1,594  | 11,807    | 254,472      | 一般消費財・サービス流通・小売り       |             |  |
| SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A   | —       | 3,582  | 4,481     | 96,573       | 半導体・半導体製造装置            |             |  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A      | 2,089   | 5,256  | 16,499    | 355,587      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| AVICOPTER PLC-A                | 374     | 374    | 1,673     | 36,069       | 資本財                    |             |  |
| MIDEA GROUP CO LTD-A           | —       | 1,958  | 14,074    | 303,316      | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A    | 90      | 90     | 219       | 4,734        | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| GOERTEK INC-A                  | 714     | 714    | 1,156     | 24,928       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| UNISPLENDOUR CORP LTD-A        | 1,106   | 1,106  | 2,257     | 48,646       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| WEICHAI POWER CO LTD-A         | 4,136   | 2,852  | 5,074     | 109,365      | 資本財                    |             |  |
| SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY-A | 915     | 498    | 3,150     | 67,899       | 資本財                    |             |  |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD-A       | 5,828   | 7,405  | 12,641    | 272,444      | 銀行                     |             |  |
| CHINA STATE CONSTRUCTION-A     | 13,054  | 24,875 | 13,631    | 293,787      | 資本財                    |             |  |
| GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A   | 1,997   | 778    | 3,364     | 72,516       | 耐久消費財・アパレル             |             |  |
| S F HOLDING CO LTD-A           | 1,422   | 3,896  | 14,703    | 316,881      | 運輸                     |             |  |
| WULIANGYE YIBIN CO LTD-A       | 1,071   | 1,479  | 22,840    | 492,238      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| PING AN BANK CO LTD-A          | 6,790   | 6,790  | 7,428     | 160,103      | 銀行                     |             |  |
| CHINA UNITED NETWORK-A         | 11,858  | 11,858 | 5,537     | 119,344      | 電気通信サービス               |             |  |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO-A      | 6,814   | 6,814  | 4,790     | 103,250      | 素材                     |             |  |
| JIANGSU HENGRIU PHARMACEUT-A   | 2,341   | 3,741  | 17,392    | 374,822      | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |             |  |
| SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A   | 1,399   | 1,399  | 808       | 17,426       | 運輸                     |             |  |
| BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A   | 17,092  | 12,389 | 5,426     | 116,946      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |             |  |
| INNER MONGOLIA YILI INDUS-A    | 1,617   | 2,930  | 8,189     | 176,491      | 食品・飲料・タバコ              |             |  |
| BANK OF BEIJING CO LTD-A       | 7,511   | 7,511  | 4,198     | 90,486       | 銀行                     |             |  |
| FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A   | 2,805   | 6,262  | 4,145     | 89,340       | メディア・娯楽                |             |  |

| 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 |                        |  |
| (中国オフショア)                     | 百株      | 百株     |        | 千円      |        |                        |  |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A  | 3,570   | 3,570  | 3,470  | 74,784  |        | 不動産管理・開発               |  |
| FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A  | 1,192   | 2,892  | 11,235 | 242,149 |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| POWER CONSTRUCTION CORP OF-A  | 5,127   | 5,127  | 2,671  | 57,567  |        | 資本財                    |  |
| CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A  | 2,400   | 2,400  | 2,198  | 47,378  |        | 公益事業                   |  |
| SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A  | 2,405   | 2,405  | 1,789  | 38,562  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A   | 875     | 2,068  | 18,657 | 402,096 |        | 素材                     |  |
| YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A  | 802     | 802    | 4,296  | 92,591  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A  | 8,843   | 8,843  | 7,021  | 151,326 |        | 銀行                     |  |
| HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A   | 682     | 682    | 1,130  | 24,354  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| NINGBO SHANSHAN CO LTD-A      | 411     | 3,381  | 3,986  | 85,908  |        | 素材                     |  |
| ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A  | 550     | 550    | 1,654  | 35,664  |        | 素材                     |  |
| CMOC GROUP LTD-A              | 5,151   | 19,536 | 17,973 | 387,346 |        | 素材                     |  |
| GOTION HIGH-TECH CO LTD-A     | 357     | 2,318  | 4,455  | 96,015  |        | 資本財                    |  |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO LT-A | 1,025   | 1,025  | 3,757  | 80,985  |        | 素材                     |  |
| TIANQI LITHIUM CORP-A         | 592     | 592    | 2,364  | 50,957  |        | 素材                     |  |
| GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A  | 842     | 842    | 1,854  | 39,959  |        | 素材                     |  |
| SHENZHEN KEDALI INDUSTRY C-A  | 87      | 87     | 871    | 18,777  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| BEIJING EASPRING MATERIAL-A   | 142     | —      | —      | —       |        | 資本財                    |  |
| CHINA NORTHERN RARE EARTH -A  | 1,231   | 1,231  | 2,519  | 54,306  |        | 素材                     |  |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A  | 7,243   | 11,263 | 7,208  | 155,352 |        | エネルギー                  |  |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A     | 8,709   | 10,456 | 7,005  | 150,978 |        | 資本財                    |  |
| CHINA RESOURCES SANJU MED-A   | 360     | 360    | 2,200  | 47,419  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A  | 4,441   | 4,441  | 2,513  | 54,171  |        | 運輸                     |  |
| CHINA VANKE CO LTD -A         | 1,949   | 4,249  | 3,212  | 69,237  |        | 不動産管理・開発               |  |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A   | 2,741   | 2,741  | 4,052  | 87,337  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| CITIC SECURITIES CO-A         | 3,974   | 3,974  | 7,575  | 163,258 |        | 金融サービス                 |  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A  | 4,691   | 4,691  | 6,262  | 134,973 |        | 運輸                     |  |
| CRRC CORP LTD-A               | 11,390  | 11,390 | 8,166  | 176,002 |        | 資本財                    |  |
| DAQIN RAILWAY CO LTD -A       | 8,740   | 3,617  | 2,557  | 55,111  |        | 運輸                     |  |
| DHC SOFTWARE CO LTD -A        | 2,815   | —      | —      | —       |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| DONG-E-JIAOCO LTD-A           | 62      | 1,095  | 7,565  | 163,043 |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| DONGXING SECURITIES CO LT-A   | 262     | 262    | 232    | 5,014   |        | 金融サービス                 |  |
| EVERBRIGHT SECURITIE CO -A    | 1,016   | 1,016  | 1,679  | 36,194  |        | 金融サービス                 |  |
| FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A  | 361     | 13,052 | 6,813  | 146,837 |        | 資本財                    |  |
| FIRST CAPITAL SECURITIES C-A  | 971     | 971    | 554    | 11,948  |        | 金融サービス                 |  |
| FOUNDER SECURITIES CO LTD-A   | —       | 2,999  | 2,735  | 58,957  |        | 金融サービス                 |  |
| SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A      | 587     | 587    | 639    | 13,789  |        | 不動産管理・開発               |  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A  | 468     | 468    | 2,377  | 51,228  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| GEMDALE CORP-A                | 429     | —      | —      | —       |        | 不動産管理・開発               |  |
| GF SECURITIES CO LTD-A        | 2,819   | 2,819  | 3,723  | 80,255  |        | 金融サービス                 |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A  | 3,489   | 3,489  | 3,063  | 66,019  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A   | 1,289   | 1,289  | 4,146  | 89,367  |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A  | 218     | 13,303 | 14,606 | 314,794 |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| GUOSEN SECURITIES CO LTD-A    | 4,191   | 2,295  | 2,054  | 44,267  |        | 金融サービス                 |  |
| AECC AVIATION POWER CO-A      | 792     | 792    | 2,973  | 64,093  |        | 資本財                    |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A  | 22,348  | 48,635 | 21,253 | 458,042 |        | 銀行                     |  |
| AIR CHINA LTD-A               | 2,878   | 2,878  | 2,109  | 45,464  |        | 運輸                     |  |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A   | 797     | 1,739  | 4,217  | 90,883  |        | 素材                     |  |
| AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A  | 4,619   | 4,619  | 1,408  | 30,361  |        | 金融サービス                 |  |
| BANK OF CHINA LTD-A           | 7,724   | 14,123 | 6,312  | 136,053 |        | 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 |                       |  |
| (中国オフショア)                    | 百株      | 百株     | 千オフショア元 | 千円      |        |                       |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A  | 7,922   | 12,098 | 8,396   | 180,950 |        | 銀行                    |  |
| BANK OF HANGZHOU CO LTD-A    | 1,510   | 1,510  | 2,020   | 43,542  |        | 銀行                    |  |
| BANK OF JIANGSU CO LTD-A     | 5,767   | 5,767  | 4,654   | 100,308 |        | 銀行                    |  |
| BANK OF NANJING CO LTD -A    | 3,215   | 3,215  | 3,006   | 64,784  |        | 銀行                    |  |
| BANK OF NINGBO CO LTD -A     | 2,361   | 2,361  | 5,761   | 124,159 |        | 銀行                    |  |
| BANK OF SHANGHAI CO LTD-A    | 5,433   | 5,433  | 4,025   | 86,764  |        | 銀行                    |  |
| BBMG CORPORATION-A           | 791     | —      | —       | —       |        | 素材                    |  |
| BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A | 403     | 403    | 193     | 4,160   |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| BEIJING SHIJI INFORMATION -A | 164     | —      | —       | —       |        | ソフトウェア・サービス           |  |
| BEIJING TONGRENTANG CO-A     | 299     | 299    | 1,329   | 28,662  |        | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BYD CO LTD -A                | 480     | 1,245  | 28,361  | 611,221 |        | 自動車・自動車部品             |  |
| CHANGJIANG SECURITIES CO L-A | 6,444   | 3,228  | 1,807   | 38,962  |        | 金融サービス                |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A    | 912     | 2,571  | 1,817   | 39,173  |        | 銀行                    |  |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-A  | 5,474   | 5,474  | 2,091   | 45,065  |        | 運輸                    |  |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A   | 9,560   | 19,130 | 6,064   | 130,692 |        | 銀行                    |  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A    | 854     | 854    | 2,701   | 58,214  |        | 保険                    |  |
| CHINA MERCHANTS BANK-A       | 5,656   | 8,948  | 31,876  | 686,978 |        | 銀行                    |  |
| CHINA MERCHANTS SECURITIES-A | 1,599   | 6,999  | 10,323  | 222,486 |        | 金融サービス                |  |
| CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A | 2,426   | 2,426  | 2,382   | 51,347  |        | 不動産管理・開発              |  |
| CHINA MINSHENG BANKING-A     | 7,460   | 14,261 | 5,576   | 120,174 |        | 銀行                    |  |
| CHINA NATIONAL CHEMICAL-A    | 980     | 980    | 746     | 16,093  |        | 資本財                   |  |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | 1,736   | 7,456  | 10,349  | 223,041 |        | 金融サービス                |  |
| GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A  | 319     | 319    | 217     | 4,695   |        | 金融サービス                |  |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 2,429   | 12,934 | 10,916  | 235,275 |        | 金融サービス                |  |
| HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A | 875     | 875    | 2,336   | 50,349  |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| HESTEEL CO LTD-A             | 1,008   | 15,961 | 3,575   | 77,051  |        | 素材                    |  |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A    | 3,676   | 3,676  | 2,532   | 54,584  |        | 公益事業                  |  |
| HUADONG MEDICINE CO LTD-A    | 571     | 571    | 1,909   | 41,142  |        | ヘルスケア機器・サービス          |  |
| HUANENG POWER INTL INC-A     | 3,243   | 3,243  | 3,003   | 64,719  |        | 公益事業                  |  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A   | 1,152   | 3,137  | 4,354   | 93,850  |        | 金融サービス                |  |
| HUAXIA BANK CO LTD-A         | 1,987   | 6,791  | 4,557   | 98,211  |        | 銀行                    |  |
| HUNDSEN TECHNOLOGIES INC-A   | 503     | 503    | 1,062   | 22,906  |        | ソフトウェア・サービス           |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-A     | 16,474  | 20,294 | 10,958  | 236,179 |        | 銀行                    |  |
| IFLYTEK CO LTD - A           | 828     | 828    | 3,626   | 78,150  |        | ソフトウェア・サービス           |  |
| INDUSTRIAL SECURITIES CO-A   | 1,807   | 1,807  | 1,011   | 21,808  |        | 金融サービス                |  |
| INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A  | 9,513   | 22,823 | 3,674   | 79,190  |        | 素材                    |  |
| JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A  | 449     | 1,051  | 10,156  | 218,881 |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A      | 991     | 991    | 2,653   | 57,195  |        | 素材                    |  |
| JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A | —       | 1,814  | 2,129   | 45,896  |        | 素材                    |  |
| JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A    | 178     | 371    | 304     | 6,553   |        | ヘルスケア機器・サービス          |  |
| LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A | 2,071   | 3,853  | 7,175   | 154,651 |        | 半導体・半導体製造装置           |  |
| LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A | 2,105   | 4,544  | 13,405  | 288,899 |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A      | 378     | 805    | 15,058  | 324,541 |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A | 355     | 19,131 | 8,857   | 190,900 |        | ヘルスケア機器・サービス          |  |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 5,275   | 5,275  | 1,751   | 37,745  |        | 資本財                   |  |
| MUYUAN FOODS CO LTD-A        | 1,909   | 1,909  | 9,031   | 194,640 |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 313     | 1,350  | 4,403   | 94,908  |        | 保険                    |  |
| NEW HOPE LIUHE CO LTD-A      | 2,097   | 2,097  | 1,971   | 42,481  |        | 食品・飲料・タバコ             |  |
| NINESTAR CORP-A              | 397     | 397    | 1,046   | 22,553  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| OFFSHORE OIL ENGINEERING-A   | 420     | 420    | 268     | 5,783   |        | エネルギー                 |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |        |         |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|--------|--------|---------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数     | 株数     | 評価額     |        |                        |  |
|                              |         |        |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (中国オフショア)                    |         | 百株     | 百株     | 千オフショア元 | 千円     |                        |  |
| ORIENT SECURITIES CO LTD-A   | 1,395   | 3,418  | 2,891  | 62,318  |        | 金融サービス                 |  |
| ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A | —       | 2,411  | 1,632  | 35,177  |        | メディア・娯楽                |  |
| PERFECT WORLD CO LTD-A       | 183     | 183    | 181    | 3,908   |        | メディア・娯楽                |  |
| PETROCHINA CO LTD-A          | 9,321   | 6,851  | 6,905  | 148,829 |        | エネルギー                  |  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 2,904   | 4,124  | 17,705 | 381,573 |        | 保険                     |  |
| QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A | 2,116   | 2,116  | 3,838  | 82,723  |        | 素材                     |  |
| RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A | 3,259   | 3,259  | 3,621  | 78,049  |        | 素材                     |  |
| SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A | 3,406   | 3,406  | 5,923  | 127,655 |        | 資本財                    |  |
| SDIC CAPITAL CO LTD-A        | —       | 3,434  | 2,211  | 47,660  |        | 金融サービス                 |  |
| SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A | —       | 3,905  | 6,099  | 131,455 |        | 公益事業                   |  |
| SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A | 2,895   | 4,096  | 10,223 | 220,333 |        | エネルギー                  |  |
| SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A | 107     | —      | —      | —       |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SHANDONG GOLD MINING CO LT-A | 904     | 904    | 2,772  | 59,749  |        | 素材                     |  |
| SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A | 845     | 845    | 202    | 4,370   |        | 資本財                    |  |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A | 4,077   | 4,077  | 1,810  | 39,012  |        | 資本財                    |  |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A | 486     | 1,124  | 2,716  | 58,548  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | 381     | 381    | 1,409  | 30,372  |        | 運輸                     |  |
| SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A | 1,009   | 1,009  | 2,307  | 49,731  |        | エネルギー                  |  |
| SHANXI SECURITIES CO LTD-A   | 269     | —      | —      | —       |        | 金融サービス                 |  |
| SHANXI TAIGANG STAINLESS-A   | 1,450   | 11,744 | 4,544  | 97,949  |        | 素材                     |  |
| SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A | 340     | 443    | 11,991 | 258,431 |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| SHANXI COKING COAL ENERGY-A  | 1,429   | 1,429  | 1,574  | 33,924  |        | エネルギー                  |  |
| SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A  | 10,481  | 6,347  | 2,976  | 64,154  |        | 金融サービス                 |  |
| SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A | 375     | 3,008  | 2,253  | 48,564  |        | 公益事業                   |  |
| SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A  | 2,681   | 2,681  | 731    | 15,773  |        | 不動産管理・開発               |  |
| SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A    | 82      | 898    | 2,802  | 60,401  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A | 1,804   | 1,804  | 2,996  | 64,577  |        | 公益事業                   |  |
| SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A | 136     | 1,068  | 3,704  | 79,845  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SINOLINK SECURITIES CO LTD-A | —       | 2,103  | 1,842  | 39,702  |        | 金融サービス                 |  |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A  | 581     | —      | —      | —       |        | 素材                     |  |
| SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A  | 285     | 2,461  | 1,663  | 35,853  |        | 金融サービス                 |  |
| SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A | 537     | 537    | 214    | 4,629   |        | 金融サービス                 |  |
| SPRING AIRLINES CO LTD-A     | —       | 542    | 3,000  | 64,665  |        | 運輸                     |  |
| TBEA CO LTD-A                | 1,670   | 2,171  | 3,169  | 68,310  |        | 資本財                    |  |
| TIANMA MICROELECTRONICS-A    | 1,111   | 1,111  | 892    | 19,226  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| TONGLING NONFERROUS METALS-A | 5,108   | 5,108  | 2,109  | 45,464  |        | 素材                     |  |
| TONGWEI CO LTD-A             | 1,577   | 1,577  | 3,562  | 76,775  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-A    | 407     | 181    | 1,570  | 33,855  |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| WESTERN SECURITIES CO LTD-A  | 2,476   | 2,476  | 1,807  | 38,953  |        | 金融サービス                 |  |
| 37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A | 753     | 753    | 1,274  | 27,474  |        | メディア・娯楽                |  |
| XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A   | 3,636   | 3,636  | 2,916  | 62,845  |        | 資本財                    |  |
| XIAMEN C & D INC-A           | 269     | 269    | 279    | 6,017   |        | 資本財                    |  |
| GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A | 1,298   | 1,298  | 1,038  | 22,378  |        | 資本財                    |  |
| YOUNGOR FASHION CO LTD-A     | 1,064   | 1,064  | 852    | 18,367  |        | 不動産管理・開発               |  |
| ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A | 193     | 193    | 4,590  | 98,931  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A  | 1,265   | 1,265  | 584    | 12,597  |        | メディア・娯楽                |  |
| ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A | —       | 3,445  | 2,997  | 64,592  |        | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A   | 360     | 360    | 760    | 16,385  |        | 資本財                    |  |
| ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A  | 757     | 757    | 1,323  | 28,517  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A | —       | 2,048  | 1,904  | 41,047  |        | 素材                     |  |

| 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  |                        |  |
| (中国オフショア)                    | 百株      | 百株    | 千円      |        |         |                        |  |
| ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A  | —       | 8,382 | 千オフショア元 | 5,272  | 113,624 | 公益事業                   |  |
| ZHONGJIN GOLD CORP-A         | —       | 3,499 |         | 5,014  | 108,060 | 素材                     |  |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A  | 8,224   | 6,736 |         | 12,286 | 264,790 | 素材                     |  |
| ZOOLION HEAVY INDUSTRY S-A   | 1,439   | 1,439 |         | 1,293  | 27,880  | 資本財                    |  |
| ZTE CORP-A                   | 816     | 1,541 |         | 4,313  | 92,956  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-A    | 1,556   | 2,367 |         | 9,698  | 209,021 | エネルギー                  |  |
| GD POWER DEVELOPMENT CO -A   | 5,704   | 5,704 |         | 3,028  | 65,275  | 公益事業                   |  |
| HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A  | 2,571   | 2,571 |         | 4,149  | 89,429  | 素材                     |  |
| NARI TECHNOLOGY CO LTD-A     | 2,270   | 2,724 |         | 6,377  | 137,435 | 資本財                    |  |
| SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A | 114     | 374   |         | 853    | 18,401  | 自動車・自動車部品              |  |
| TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A  | 3,410   | 9,183 |         | 4,316  | 93,016  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A  | 870     | 870   |         | 1,010  | 21,772  | ソフトウェア・サービス            |  |
| AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A | 2,129   | 2,767 |         | 3,551  | 76,534  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| NAVINFO CO LTD-A             | 186     | —     |         | —      | —       | ソフトウェア・サービス            |  |
| UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A | 362     | 362   |         | 2,156  | 46,483  | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ANGEL YEAST CO LTD-A         | 78      | 78    |         | 248    | 5,365   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| 360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A | 3,196   | 3,196 |         | 2,844  | 61,301  | ソフトウェア・サービス            |  |
| DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A | 1,447   | 1,447 |         | 2,615  | 56,374  | 資本財                    |  |
| OPPEIN HOME GROUP INC-A      | 129     | 129   |         | 880    | 18,974  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 3,500   | 6,503 |         | 5,137  | 110,717 | 素材                     |  |
| FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A | 2,221   | 4,739 |         | 11,335 | 244,299 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| GUANGHUI ENERGY CO LTD-A     | 2,350   | 2,350 |         | 1,849  | 39,858  | エネルギー                  |  |
| HUAXI SECURITIES CO LTD-A    | 249     | —     |         | —      | —       | 金融サービス                 |  |
| BANK OF CHENGDU CO LTD-A     | 1,377   | 1,377 |         | 2,115  | 45,583  | 銀行                     |  |
| CAITONG SECURITIES CO LTD-A  | 4,528   | 4,528 |         | 3,459  | 74,563  | 金融サービス                 |  |
| CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A | 481     | 481   |         | 1,338  | 28,855  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A | 601     | 902   |         | 3,239  | 69,822  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 1,247   | 2,081 |         | 42,363 | 912,990 | 資本財                    |  |
| EAST MONEY INFORMATION CO-A  | 5,223   | 5,223 |         | 6,847  | 147,579 | 金融サービス                 |  |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A | 70      | 70    |         | 423    | 9,119   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HENGYI PETROCHEMICAL CO -A   | 351     | 5,377 |         | 4,108  | 88,541  | 素材                     |  |
| HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A | 135     | 135   |         | 1,655  | 35,670  | 金融サービス                 |  |
| INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A | 4,829   | 4,829 |         | 2,134  | 46,001  | 素材                     |  |
| LENS TECHNOLOGY CO LTD-A     | 1,094   | 1,094 |         | 1,569  | 33,833  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A    | 951     | 951   |         | 1,509  | 32,526  | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A | 807     | 807   |         | 1,817  | 39,170  | メディア・娯楽                |  |
| SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A | 154     | 1,298 |         | 2,701  | 58,224  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | 383     | 591   |         | 18,008 | 388,118 | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A | 248     | 248   |         | 265    | 5,728   | 消費者サービス                |  |
| SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A  | 722     | 722   |         | 1,135  | 24,476  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A    | 324     | 1,805 |         | 2,721  | 58,648  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WENS FOODSTUFFS GROUP CO L-A | 2,611   | 2,611 |         | 5,436  | 117,173 | 食品・飲料・タバコ              |  |
| YANKUANG ENERGY GROUP CO-A   | 1,000   | 1,500 |         | 3,720  | 80,182  | エネルギー                  |  |
| WUXI APPTEC CO LTD-A         | 1,162   | 878   |         | 3,938  | 84,876  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| YUNDA HOLDING CO LTD-A       | 780     | 780   |         | 636    | 13,710  | 運輸                     |  |
| ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A   | 301     | 301   |         | 5,153  | 111,056 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A | 150     | 2,210 |         | 4,000  | 86,207  | 資本財                    |  |
| AECC AERO-ENGINE CONTROL-A   | 789     | 789   |         | 1,641  | 35,382  | 資本財                    |  |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A | 102     | 102   |         | 2,808  | 60,522  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A | 56      | 466   |         | 2,001  | 43,127  | 食品・飲料・タバコ              |  |

| 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                 |     |  |
| (中国オショア)                     |         | 百株     | 百株    | 千円      | 千円                     |     |  |
| ASMCHEM LABORATORIES TIAN-A  | 190     | 190    | 1,590 | 34,267  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| OVCTEK CHINA INC-A           | 172     | —      | —     | —       | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A  | —       | 2,887  | 1,758 | 37,891  | 自動車・自動車部品              |     |  |
| BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A | 279     | 279    | 250   | 5,393   | メディア・娯楽                |     |  |
| BEIJING NEW BUILDING MATER-A | 668     | 668    | 2,256 | 48,630  | 資本財                    |     |  |
| BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A | —       | 2,815  | 8,506 | 183,336 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BEIJING YANJING BREWERY CO-A | 2,340   | 2,340  | 2,377 | 51,237  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A | 38      | —      | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BGI GENOMICS CO LTD-A        | 170     | —      | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| BY-HEALTH CO LTD-A           | 150     | 1,335  | 2,119 | 45,688  | 家庭用品・パーソナル用品           |     |  |
| CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A | 87      | 87     | 1,026 | 22,122  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | 26      | 201    | 2,746 | 59,194  | 自動車・自動車部品              |     |  |
| CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A | 1,640   | 1,640  | 1,543 | 33,258  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| CHINA MERCHANTS ENERGY -A    | 1,765   | 1,765  | 1,613 | 34,766  | エネルギー                  |     |  |
| CHONGQING BREWERY CO-A       | 160     | 160    | 1,191 | 25,679  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| CHONGQING FULING ZHACAI-A    | 75      | —      | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A | 1,249   | 1,249  | 2,142 | 46,163  | エネルギー                  |     |  |
| CSC FINANCIAL CO LTD-A       | 1,927   | 1,927  | 4,383 | 94,479  | 金融サービス                 |     |  |
| LIAONING PORT CO LTD-A       | 26,970  | 26,970 | 3,937 | 84,861  | 運輸                     |     |  |
| EVE ENERGY CO LTD-A          | 672     | 672    | 2,620 | 56,483  | 資本財                    |     |  |
| FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A  | 98      | 5,675  | 9,170 | 197,643 | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A  | 7       | —      | —     | —       | メディア・娯楽                |     |  |
| GIGADEVICE SEMICONDUCTO-CL A | 135     | 355    | 2,933 | 63,210  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| GRG BANKING EQUIPMENT CO -A  | 1,665   | 1,665  | 1,896 | 40,870  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| GUANGDONG HAID GROUP CO-A    | 495     | 495    | 2,577 | 55,558  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A | 44      | 44     | 165   | 3,573   | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A | 332     | 332    | 652   | 14,066  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| HEILONGJIANG AGRICULTURE-A   | 1,186   | 1,186  | 1,617 | 34,863  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A   | 99      | 99     | 287   | 6,190   | 資本財                    |     |  |
| HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A | 541     | 541    | 1,083 | 23,345  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| HUAXIN CEMENT CO LTD-A       | 129     | —      | —     | —       | 素材                     |     |  |
| HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A  | 1,852   | 1,852  | 955   | 20,595  | 素材                     |     |  |
| IEIT SYSTEMS CO LTD-A        | 549     | 549    | 2,112 | 45,528  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A   | 76      | —      | —     | —       | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| JCET GROUP CO LTD-A          | 472     | 472    | 1,238 | 26,681  | 半導体・半導体製造装置            |     |  |
| JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A | 260     | 625    | 3,384 | 72,934  | 資本財                    |     |  |
| JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A | 325     | 325    | 1,853 | 39,950  | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A | 232     | 301    | 1,967 | 42,398  | 素材                     |     |  |
| JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A  | 643     | 643    | 2,550 | 54,959  | ヘルスケア機器・サービス           |     |  |
| JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOL-A  | 1,037   | 1,037  | 1,491 | 32,137  | 資本財                    |     |  |
| JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A | 184     | 184    | 237   | 5,119   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A | 76      | 76     | 223   | 4,810   | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| JUEWEI FOOD CO LTD-A         | 55      | —      | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |     |  |
| LINGYI ITECH GUANGDONG CO -A | 2,177   | 2,177  | 1,088 | 23,458  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |     |  |
| LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A | 58      | 58     | 235   | 5,079   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| LB GROUP CO LTD-A            | 596     | 596    | 1,292 | 27,860  | 素材                     |     |  |
| WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A  | 482     | 482    | 237   | 5,110   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |     |  |
| NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A | 125     | 2,106  | 2,927 | 63,094  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |     |  |
| NANJING SECURITIES CO LTD-A  | —       | 2,269  | 1,869 | 40,293  | 金融サービス                 |     |  |
| NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A  | 209     | 209    | 6,227 | 134,203 | 半導体・半導体製造装置            |     |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末    |       |         |       | 業種等                    |
|------------------------------|---------|--------|-------|---------|-------|------------------------|
|                              |         | 株数     | 株数    | 評価額     | 外貨建替額 |                        |
|                              |         |        |       | 邦貨換算額   |       |                        |
| (中国オフショア)                    |         | 百株     | 百株    | 千オフショア元 | 千円    |                        |
| NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A   | 123     | 123    | 214   | 4,626   |       | 自動車・自動車部品              |
| PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A | 817     | 6,977  | 2,218 | 47,815  |       | 素材                     |
| SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A   | 85      | 85     | 457   | 9,855   |       | ソフトウェア・サービス            |
| SEALAND SECURITIES CO LTD-A  | 400     | —      | —     | —       |       | 金融サービス                 |
| SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A | 308     | 308    | 184   | 3,969   |       | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| SHANDONG HUALU HENGSHENG-A   | 498     | 1,991  | 6,084 | 131,119 |       | 素材                     |
| SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A  | 3,361   | 3,361  | 1,260 | 27,162  |       | 素材                     |
| SHANDONG SUN PAPER INDSTR-A  | 246     | 2,339  | 3,765 | 81,158  |       | 素材                     |
| SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A | 352     | 422    | 1,691 | 36,444  |       | ソフトウェア・サービス            |
| SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A | 270     | 270    | 797   | 17,194  |       | 消費者サービス                |
| SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A  | 1,607   | 1,607  | 1,750 | 37,724  |       | 不動産管理・開発               |
| SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A | 88      | 743    | 2,872 | 61,905  |       | 商業・専門サービス              |
| SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A | 1,455   | 1,455  | 902   | 19,441  |       | 素材                     |
| SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD-A  | 216     | 1,402  | 2,789 | 60,127  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A    | 277     | 277    | 2,445 | 52,703  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| GEM CO LTD-A                 | 1,317   | 1,317  | 913   | 19,697  |       | 素材                     |
| SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A | 761     | 761    | 1,468 | 31,653  |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A    | 126     | 126    | 584   | 12,602  |       | 食品・飲料・タバコ              |
| SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A  | 376     | 376    | 572   | 12,341  |       | 資本財                    |
| TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A | 1,316   | 1,645  | 1,773 | 38,217  |       | 半導体・半導体製造装置            |
| TOLY BREAD CO LTD-A          | 122     | —      | —     | —       |       | 食品・飲料・タバコ              |
| TONGKUN GROUP CO LTD-A       | 609     | 609    | 934   | 20,146  |       | 素材                     |
| TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A | 70      | 70     | 453   | 9,775   |       | ヘルスケア機器・サービス           |
| WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A | 78      | 78     | 212   | 4,582   |       | 素材                     |
| WESTERN MINING CO-A          | —       | 1,632  | 3,221 | 69,429  |       | 素材                     |
| CETC CYBERSPACE SECURITY T-A | 266     | —      | —     | —       |       | ソフトウェア・サービス            |
| WILL SEMICONDUCTOR CO LTD-A  | 559     | 389    | 4,031 | 86,886  |       | 半導体・半導体製造装置            |
| WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A | 1,207   | 1,570  | 1,096 | 23,622  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A | 180     | 1,320  | 4,144 | 89,324  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A     | 134     | 134    | 270   | 5,833   |       | 素材                     |
| YANTAI JEREH OILFIELD-A      | 91      | 91     | 303   | 6,546   |       | エネルギー                  |
| YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A | 224     | 314    | 1,196 | 25,787  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A | 65      | 849    | 3,911 | 84,292  |       | 生活必需品流通・小売り            |
| YINTAI GOLD CO LTD-A         | 264     | 1,990  | 3,833 | 82,625  |       | 素材                     |
| YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A | 125     | —      | —     | —       |       | 食品・飲料・タバコ              |
| YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL-A | 346     | 346    | 1,497 | 32,268  |       | 素材                     |
| ZHEJIANG DINGLI MACHINERY-A  | 46      | 46     | 331   | 7,139   |       | 資本財                    |
| ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A | 138     | 138    | 241   | 5,212   |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZHEJIANG JUHUA CO-A          | 1,077   | 1,077  | 2,722 | 58,677  |       | 素材                     |
| ZHEJIANG NHU CO LTD-A        | 851     | 851    | 1,687 | 36,364  |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A | —       | 1,135  | 2,448 | 52,762  |       | 資本財                    |
| ZHEJIANG SUPOR CO LTD-A      | 52      | 52     | 306   | 6,611   |       | 耐久消費財・アパレル             |
| ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A | 50      | —      | —     | —       |       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A | 740     | 740    | 859   | 18,515  |       | 金融サービス                 |
| PICC HOLDING CO-A            | 12,519  | 6,470  | 3,487 | 75,156  |       | 保険                     |
| WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A | 250     | 250    | 808   | 17,418  |       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A | —       | 23,309 | 3,239 | 69,825  |       | 運輸                     |
| NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A  | 513     | 513    | 3,017 | 65,030  |       | 自動車・自動車部品              |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 702     | 2,235  | 2,778 | 59,872  |       | 金融サービス                 |
| SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A | 349     | 1,017  | 1,940 | 41,829  |       | 素材                     |

| 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   | 千円      |                        |
| (中国オフショア)                     |         | 百株    | 百株     | 千オフショア元 | 千円      |                        |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD-A  | —       | —     | 5,676  | 1,657   | 35,719  | 金融サービス                 |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A  | 90      | 90    | 90     | 216     | 4,664   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TIANSUI HUATIAN TECHNOLOG-A   | 2,013   | 2,013 | 2,013  | 1,654   | 35,660  | 半導体・半導体製造装置            |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A  | 84      | 84    | 490    | 1,615   | 34,806  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KUNLUN TECH CO LTD-A          | —       | —     | 560    | 2,186   | 47,128  | メディア・娯楽                |
| ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A  | 297     | 297   | 614    | 2,013   | 43,389  | 半導体・半導体製造装置            |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A  | 124     | 124   | 124    | 587     | 12,669  | ソフトウェア・サービス            |
| SG MICRO CORP-A               | 60      | 60    | 78     | 605     | 13,046  | 半導体・半導体製造装置            |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A  | 580     | 580   | 580    | 439     | 9,474   | 金融サービス                 |
| DAAN GENE CO LTD-A            | 193     | 193   | —      | —       | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TONGFU MICROELECTRONIC CO-A   | 291     | 291   | 291    | 582     | 12,561  | 半導体・半導体製造装置            |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A    | 150     | 150   | —      | —       | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A   | —       | —     | 15,331 | 7,895   | 170,158 | 運輸                     |
| MAXSCEND MICROELECTRONICS -A  | 107     | 107   | 107    | 970     | 20,915  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A  | 8,744   | 8,744 | 8,744  | 4,372   | 94,222  | 銀行                     |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A  | 2,412   | 2,412 | 10,935 | 3,247   | 69,992  | 銀行                     |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A  | 565     | 565   | 6,506  | 3,051   | 65,760  | 銀行                     |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A  | 164     | 164   | 197    | 435     | 9,393   | 生活必需品流通・小売り            |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A    | 737     | 737   | 737    | 664     | 14,310  | 資本財                    |
| ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A    | 59      | 59    | 59     | 564     | 12,167  | 食品・飲料・タバコ              |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A     | 1,643   | 1,643 | 925    | 2,406   | 51,861  | 自動車・自動車部品              |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A  | 78      | 78    | —      | —       | —       | 資本財                    |
| GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A  | 1,102   | 1,102 | 1,102  | 639     | 13,782  | 金融サービス                 |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A   | 516     | 516   | 516    | 539     | 11,632  | 金融サービス                 |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A  | 445     | 445   | 623    | 1,670   | 35,995  | 半導体・半導体製造装置            |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A  | 299     | 299   | 299    | 617     | 13,313  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A   | 101     | 101   | 101    | 636     | 13,721  | 半導体・半導体製造装置            |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A  | 1,444   | 1,444 | 1,444  | 2,115   | 45,585  | 半導体・半導体製造装置            |
| JASON FURNITURE HANGZHOU C-A  | 161     | 161   | 161    | 575     | 12,402  | 耐久消費財・アパレル             |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A        | 36      | 36    | 36     | 199     | 4,292   | 食品・飲料・タバコ              |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A   | 474     | 474   | 474    | 922     | 19,879  | 資本財                    |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A  | 247     | 247   | 247    | 526     | 11,356  | 食品・飲料・タバコ              |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A  | 208     | 208   | 208    | 690     | 14,890  | 素材                     |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A  | 86      | 86    | 86     | 589     | 12,694  | 半導体・半導体製造装置            |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A  | 471     | 471   | 471    | 790     | 17,043  | 素材                     |
| SKSHU PAINT CO LTD-A          | 96      | 96    | 135    | 497     | 10,722  | 素材                     |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A  | 384     | 384   | 631    | 6,732   | 145,100 | 資本財                    |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A    | 752     | 752   | 752    | 1,221   | 26,319  | 運輸                     |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A | 326     | 326   | 960    | 3,287   | 70,846  | 金融サービス                 |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A     | 114     | 114   | 114    | 654     | 14,107  | 耐久消費財・アパレル             |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A  | 237     | 237   | 237    | 756     | 16,308  | 食品・飲料・タバコ              |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A  | 723     | 723   | 2,905  | 2,902   | 62,562  | 素材                     |
| YUNNAN ALUMINUM CO LTD-A      | —       | —     | 1,220  | 1,842   | 39,715  | 素材                     |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD -A     | 1,066   | 1,066 | 1,066  | 889     | 19,166  | 素材                     |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A   | 847     | 847   | 847    | 1,686   | 36,342  | 素材                     |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A  | 120     | 120   | 120    | 1,306   | 28,163  | 自動車・自動車部品              |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A  | 367     | 367   | 367    | 998     | 21,513  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A  | 35      | 35    | 56     | 674     | 14,542  | 半導体・半導体製造装置            |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A    | 187     | 187   | 281    | 610     | 13,159  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A   | 1,326   | 1,326 | 1,856  | 1,412   | 30,446  | 資本財                    |

| 銘柄                            | 期首(前期末) | 当期末    |         |         |        | 業種等                    |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------|---------|--------|------------------------|--|
|                               |         | 株数     | 株数      | 評価額     |        |                        |  |
|                               |         |        |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (中国オフショア)                     | 百株      | 百株     | 千オフショア元 | 千円      |        |                        |  |
| CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A     | 730     | 730    | 2,773   | 59,767  |        | 資本財                    |  |
| ENN NATURAL GAS CO LTD-A      | 736     | 736    | 1,374   | 29,614  |        | 公益事業                   |  |
| NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A  | 3,198   | 3,198  | 5,462   | 117,717 |        | 素材                     |  |
| SAILUN GROUP CO LTD-A         | 1,071   | 1,071  | 1,827   | 39,377  |        | 自動車・自動車部品              |  |
| MING YANG SMART ENERGY GRO-A  | 479     | 479    | 510     | 10,994  |        | 資本財                    |  |
| ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A  | 905     | —      | —       | —       |        | 資本財                    |  |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD-A     | 1,013   | 1,013  | 2,656   | 57,242  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| JOINN LABORATORIES CHINA C-A  | 148     | —      | —       | —       |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A  | 92      | —      | —       | —       |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A  | 82      | —      | —       | —       |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A  | 257     | —      | —       | —       |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BEIJING UNITED INFORMATION-A  | 172     | —      | —       | —       |        | 資本財                    |  |
| ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A  | 120     | —      | —       | —       |        | 資本財                    |  |
| MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A   | 184     | 526    | 2,675   | 57,666  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A  | 2,969   | 2,969  | 1,722   | 37,124  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPM-E-A | 81      | 113    | 2,444   | 52,676  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| NATIONAL SILICON INDUSTRY -A  | —       | 1,895  | 2,562   | 55,215  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A  | 35      | 35     | 458     | 9,879   |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A  | 1,322   | 1,322  | 869     | 18,747  |        | 金融サービス                 |  |
| BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A  | 175     | 175    | 5,102   | 109,957 |        | ソフトウェア・サービス            |  |
| BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A  | —       | 59     | 2,733   | 58,910  |        | 耐久消費財・アパレル             |  |
| BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A   | 98      | 138    | 915     | 19,723  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CHINA BAOAN GROUP-A           | 492     | 492    | 523     | 11,274  |        | 資本財                    |  |
| ADVANCED MICRO-FABRICATION-A  | 207     | 207    | 2,753   | 59,351  |        | 半導体・半導体製造装置            |  |
| ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A  | 218     | 218    | 1,619   | 34,907  |        | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A  | 272     | 272    | 1,443   | 31,103  |        | 素材                     |  |
| HUBEI XINGFA CHEMICALS GRP-A  | 386     | —      | —       | —       |        | 素材                     |  |
| SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A  | 246     | 246    | 743     | 16,021  |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A  | 310     | 310    | 4,521   | 97,448  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A  | 166     | 232    | 1,002   | 21,596  |        | 素材                     |  |
| XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A    | 63      | 63     | 614     | 13,235  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| ZHEJIANG WEIMING ENVIRONME-A  | 581     | 581    | 1,258   | 27,113  |        | 商業・専門サービス              |  |
| CECEP SOLAR ENERGY CO LT-A    | —       | 3,238  | 1,712   | 36,915  |        | 公益事業                   |  |
| CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A   | 272     | 272    | 506     | 10,915  |        | 素材                     |  |
| CHINA RARE EARTH RESOURCES-A  | 325     | 325    | 968     | 20,879  |        | 素材                     |  |
| CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A  | 137     | 137    | 656     | 14,148  |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A  | 97      | 97     | 566     | 12,208  |        | 資本財                    |  |
| NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A  | 499     | —      | —       | —       |        | 資本財                    |  |
| SHENZHEN NEW INDUSTRIES BI-A  | 100     | 493    | 3,837   | 82,693  |        | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY-A  | 179     | —      | —       | —       |        | 素材                     |  |
| SICHUAN YAHTA INDUSTRIAL-A    | 1,114   | —      | —       | —       |        | 素材                     |  |
| SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A     | 120     | 601    | 4,315   | 92,998  |        | 資本財                    |  |
| CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A  | 205     | 205    | 441     | 9,521   |        | 素材                     |  |
| TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO-A  | 1,000   | 1,000  | 799     | 17,219  |        | 素材                     |  |
| TITAN WIND ENERGY SUZHOU-A    | 120     | —      | —       | —       |        | 資本財                    |  |
| YONGXING SPECIAL MATERIALS-A  | 145     | 145    | 683     | 14,722  |        | 素材                     |  |
| YOUNGY CO LTD-A               | 100     | —      | —       | —       |        | 素材                     |  |
| ZHEJIANG YONGTAI TECH-A       | 253     | —      | —       | —       |        | 素材                     |  |
| ZHUZHOU HONGDA ELECTRONICS-A  | 100     | —      | —       | —       |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CHINA ENERGY ENGINEERING C-A  | 12,521  | 12,521 | 2,754   | 59,365  |        | 資本財                    |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末) | 当期末     |           |           |            | 業種等                   |  |
|------------------------------|---------|---------|-----------|-----------|------------|-----------------------|--|
|                              |         | 株数      | 株数        | 評価額       |            |                       |  |
|                              |         |         |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |                       |  |
| (中国オフショア)                    |         | 百株      | 百株        | 千オフショア元   | 千円         |                       |  |
| CHINA RESOURCES MICROELECT-A | 210     | 510     | 1,981     | 42,700    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | 6,613   | 11,223  | 5,319     | 114,647   |            | 公益事業                  |  |
| CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A | 91      | 543     | 2,888     | 62,260    |            | 素材                    |  |
| NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A | 83      | —       | —         | —         |            | 資本財                   |  |
| TRINA SOLAR CO LTD-A         | 562     | 562     | 1,209     | 26,064    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| HENAN SHENHUA COAL & POWER-A | —       | 1,251   | 2,974     | 64,112    |            | 素材                    |  |
| SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A  | 119     | —       | —         | —         |            | 素材                    |  |
| YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOL-A | 97      | 97      | 581       | 12,524    |            | 家庭用品・パーソナル用品          |  |
| SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A | 1,480   | 2,220   | 2,257     | 48,657    |            | エネルギー                 |  |
| HUATBEI MINING HOLDINGS CO-A | —       | 1,312   | 2,595     | 55,928    |            | 素材                    |  |
| NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A | 240     | 240     | 1,115     | 24,041    |            | 資本財                   |  |
| NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A | 40      | 267     | 2,656     | 57,254    |            | 資本財                   |  |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-A | —       | 452     | 2,228     | 48,024    |            | 資本財                   |  |
| BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A | —       | 342     | 2,130     | 45,918    |            | 医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| YUNNAN YUNTIANHUA CO-A       | 400     | 400     | 860       | 18,534    |            | 素材                    |  |
| ZANGGE MINING CO LTD-A       | 344     | 344     | 969       | 20,899    |            | 素材                    |  |
| PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A  | 34      | —       | —         | —         |            | 資本財                   |  |
| SHANGHAI RURAL COMMERCIAL -A | 7,494   | 7,494   | 5,620     | 121,129   |            | 銀行                    |  |
| SUPCON TECHNOLOGY CO LTD-A   | 355     | 514     | 2,374     | 51,163    |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A | —       | 1,022   | 1,250     | 26,959    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| WINTIME ENERGY GROUP CO L-A  | —       | 23,078  | 3,115     | 67,144    |            | 公益事業                  |  |
| HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A | —       | 4,981   | 1,748     | 37,685    |            | 不動産管理・開発              |  |
| SHEDE SPIRITS CO LTD-A       | —       | 223     | 1,697     | 36,592    |            | 食品・飲料・タバコ             |  |
| SERES GROUP CO L-A           | —       | 553     | 4,679     | 100,849   |            | 自動車・自動車部品             |  |
| JINKO SOLAR CO LTD-A         | —       | 3,510   | 2,815     | 60,667    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| CAMBRICON TECHNOLOGIES-A     | —       | 100     | 1,703     | 36,714    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A | —       | 874     | 2,216     | 47,767    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| GALAXYCORE INC-A             | —       | 1,001   | 1,517     | 32,704    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| CNPC CAPITAL CO LTD-A        | —       | 3,611   | 2,148     | 46,304    |            | 銀行                    |  |
| ANKER INNOVATIONS TECHNOLO-A | —       | 201     | 1,859     | 40,065    |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| ANHUI JIANGHUI AUTO GROUP-A  | —       | 1,090   | 1,643     | 35,424    |            | 自動車・自動車部品             |  |
| CHINA XD ELECTRIC CO LTD-A   | —       | 3,911   | 2,941     | 63,384    |            | 資本財                   |  |
| PEOPLE.CN CO LTD-A           | —       | 554     | 1,322     | 28,511    |            | メディア・娯楽               |  |
| GONEO GROUP CO LTD-A         | —       | 344     | 4,421     | 95,280    |            | 資本財                   |  |
| EASTROC BEVERAGE GROUP CO -A | —       | 175     | 3,998     | 86,178    |            | 食品・飲料・タバコ             |  |
| PIOTECH INC-A                | —       | 79      | 1,385     | 29,861    |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| EVERDISPLAY Optronics SHAN-A | —       | 6,964   | 1,490     | 32,117    |            | テクノロジー・ハードウェアおよび機器    |  |
| CGN POWER CO LTD-A           | —       | 6,328   | 2,581     | 55,641    |            | 公益事業                  |  |
| EMPYREAN TECHNOLOGY CO LTD-A | —       | 176     | 1,432     | 30,864    |            | ソフトウェア・サービス           |  |
| HYGON INFORMATION TECHNOLO-A | —       | 712     | 5,190     | 111,862   |            | 半導体・半導体製造装置           |  |
| RANGE INTELLIGENT COMPUTI-A  | —       | 797     | 2,290     | 49,365    |            | ソフトウェア・サービス           |  |
| SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A | —       | 317     | 4,168     | 89,844    |            | ヘルスケア機器・サービス          |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 706,359 | 1,169,589 | 1,583,444 | 34,125,444 |                       |  |
| 銘柄                           | 株数<比率>  | 419     | 428       | —         | <4.2%>     |                       |  |
| (アラブ首長国連邦)                   |         |         | 千アラブディルハム |           |            |                       |  |
| EMAAR PROPERTIES PJSC        | 33,382  | 44,082  | 35,398    | 1,505,854 |            | 不動産管理・開発              |  |
| ALDAR PROPERTIES PJSC        | 20,255  | 28,746  | 16,385    | 697,046   |            | 不動産管理・開発              |  |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK    | 14,942  | 20,864  | 17,609    | 749,124   |            | 銀行                    |  |
| FIRST ABU DHABI BANK PJSC    | 22,144  | 31,646  | 39,241    | 1,669,326 |            | 銀行                    |  |
| DUBAI ISLAMIC BANK           | 16,973  | 21,178  | 11,965    | 509,017   |            | 銀行                    |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |         | 当期末         |           |                | 業種等              |  |
|------------------------------|----------|---------|-------------|-----------|----------------|------------------|--|
|                              | 株数       | 株数      | 評価額         |           | 外貨建替額<br>邦貨換算額 |                  |  |
|                              |          |         | 外貨建替額       | 邦貨換算額     |                |                  |  |
| (アラブ首長国連邦)                   | 百株       | 百株      | 千アラブディルハム   | 千円        |                |                  |  |
| EMIRATES TELECOM GROUP CO    | 16,803   | 25,204  | 42,293      | 1,799,178 |                | 電気通信サービス         |  |
| ABU DHABI ISLAMIC BANK       | 7,035    | 12,634  | 15,186      | 646,040   |                | 銀行               |  |
| ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 16,121   | 27,122  | 9,194       | 391,129   |                | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| Q HOLDING PJSC               | 8,664    | —       | —           | —         |                | 資本財              |  |
| MULTIPLY GROUP               | 17,406   | 23,823  | 5,455       | 232,078   |                | 資本財              |  |
| AMERICANA RESTAURANTS INTERN | —        | 14,818  | 4,608       | 196,044   |                | 消費者サービス          |  |
| AGILITY GLOBAL PLC           | —        | 16,945  | 2,185       | 92,992    |                | 運輸               |  |
| 小計                           | 株数・金額    | 173,729 | 267,067     | 199,525   | 8,487,832      |                  |  |
|                              | 銘柄数 <比率> | 10      | 11          |           | <1.0%>         |                  |  |
| (クウェート)                      |          |         | 千クウェートディナール |           |                |                  |  |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 11,180   | 18,750  | 900         | 457,423   |                | 電気通信サービス         |  |
| KUWAIT FINANCE HOUSE         | 38,007   | 66,868  | 4,975       | 2,528,517 |                | 銀行               |  |
| AGILITY                      | 6,826    | —       | —           | —         |                | 運輸               |  |
| MABANEE CO KPSC              | 3,108    | 3,657   | 295         | 150,404   |                | 不動産管理・開発         |  |
| NATIONAL BANK OF KUWAIT      | 35,634   | 53,394  | 4,709       | 2,393,482 |                | 銀行               |  |
| GULF BANK                    | 8,577    | 13,532  | 354         | 180,192   |                | 銀行               |  |
| BOUBYAN BANK K. S. C         | 6,093    | 8,289   | 499         | 254,051   |                | 銀行               |  |
| 小計                           | 株数・金額    | 109,427 | 164,493     | 11,734    | 5,964,071      |                  |  |
|                              | 銘柄数 <比率> | 7       | 6           | —         | <0.7%>         |                  |  |
| (サウジアラビア)                    |          |         | 千サウジアラビアリヤル |           |                |                  |  |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP  | 4,214    | 6,051   | 48,412      | 2,016,376 |                | 素材               |  |
| AL RAJHI BANK                | 9,253    | 13,272  | 104,853     | 4,367,156 |                | 銀行               |  |
| THE SAUDI NATIONAL BANK      | 13,731   | 20,772  | 74,157      | 3,088,645 |                | 銀行               |  |
| SAUDI TELECOM CO             | 7,000    | 13,296  | 50,993      | 2,123,883 |                | 電気通信サービス         |  |
| RIYAD BANK                   | 6,481    | 10,106  | 27,236      | 1,134,399 |                | 銀行               |  |
| BANQUE SAUDI FRANSI          | 2,782    | 4,765   | 17,394      | 724,460   |                | 銀行               |  |
| SAUDI ARABIAN MINING CO      | 4,065    | 8,697   | 44,442      | 1,851,018 |                | 素材               |  |
| SAUDI ELECTRICITY CO         | 3,759    | 5,405   | 10,010      | 416,945   |                | 公益事業             |  |
| ALINMA BANK                  | 4,528    | 9,665   | 30,882      | 1,286,235 |                | 銀行               |  |
| SABIC AGRI-NUTRIENTS CO      | 988      | 1,719   | 19,223      | 800,638   |                | 素材               |  |
| ALMARAI CO                   | 1,212    | 1,449   | 7,988       | 332,703   |                | 食品・飲料・タバコ        |  |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 1,281    | 1,585   | 5,944       | 247,602   |                | 素材               |  |
| SAUDI AWWAL BANK             | 4,446    | 7,027   | 28,459      | 1,185,353 |                | 銀行               |  |
| BANK ALBILAD                 | 2,261    | 4,884   | 17,072      | 711,064   |                | 銀行               |  |
| ETIHAD ETISALAT CO           | 1,719    | 2,469   | 13,087      | 545,112   |                | 電気通信サービス         |  |
| JARIR MARKETING CO           | 303      | 6,136   | 8,246       | 343,481   |                | 一般消費財・サービス流通・小売り |  |
| SAVOLA                       | 1,369    | 1,369   | 6,671       | 277,858   |                | 食品・飲料・タバコ        |  |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 3,626    | 3,626   | 3,296       | 137,308   |                | 素材               |  |
| SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 1,675    | 2,027   | 6,609       | 275,298   |                | 素材               |  |
| DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV | 2,486    | 2,746   | 3,515       | 146,404   |                | 不動産管理・開発         |  |
| BANK AL-JAZIRA               | 1,836    | 3,581   | 5,693       | 237,150   |                | 銀行               |  |
| ADVANCED PETROCHEMICALS CO   | 570      | 1,017   | 4,031       | 167,894   |                | 素材               |  |
| SAUDI IND INVESTMENT GROUP   | 1,946    | 3,709   | 8,071       | 336,176   |                | 素材               |  |
| NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 1,987    | —       | —           | —         |                | 素材               |  |
| RABIGH REFINING AND PETROCHE | 2,023    | —       | —           | —         |                | エネルギー            |  |
| CO FOR COOPERATIVE INSURANCE | —        | 401     | 5,984       | 249,270   |                | 保険               |  |
| EMAAR ECONOMIC CITY          | 1,620    | —       | —           | —         |                | 不動産管理・開発         |  |
| BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE  | 346      | 497     | 13,082      | 544,872   |                | 保険               |  |
| ARAB NATIONAL BANK           | 2,800    | 5,591   | 16,242      | 676,504   |                | 銀行               |  |
| SAUDI ARABIAN OIL CO         | 12,541   | 18,878  | 56,542      | 2,354,979 |                | エネルギー            |  |

| 銘柄                           | 期首(前期末)     |             | 当期末           |               |                | 業種等                  |  |
|------------------------------|-------------|-------------|---------------|---------------|----------------|----------------------|--|
|                              | 株数          | 株数          | 評価額           |               | 外貨建替額<br>邦貨換算額 |                      |  |
|                              |             |             | 外貨建替額         | 邦貨換算額         |                |                      |  |
| (サウジアラビア)                    |             |             |               |               | 千円             |                      |  |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 百株<br>2,287 | 百株<br>2,287 | 2,727         | 113,586       | 千円             | 電気通信サービス             |  |
| DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 422         | 560         | 17,396        | 724,582       | 千円             | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 235         | 604         | 8,084         | 336,701       | 千円             | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 155         | 238         | 5,776         | 240,583       | 千円             | メディア・娯楽              |  |
| ACWA POWER CO                | 364         | 667         | 25,819        | 1,075,381     | 千円             | 公益事業                 |  |
| ELM CO                       | 102         | 189         | 16,469        | 685,958       | 千円             | ソフトウェア・サービス          |  |
| SAUDI INVESTMENT BANK/THE    | 2,683       | 3,354       | 4,474         | 186,359       | 千円             | 銀行                   |  |
| SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING  | 224         | 293         | 7,112         | 296,240       | 千円             | 金融サービス               |  |
| ARABIAN INTERNET & COMMUNICA | 107         | 167         | 5,563         | 231,723       | 千円             | ソフトウェア・サービス          |  |
| NAHDI MEDICAL CO             | 188         | 188         | 2,511         | 104,622       | 千円             | 生活必需品流通・小売り          |  |
| DALLAH HEALTHCARE CO         | 177         | 177         | 2,960         | 123,314       | 千円             | ヘルスケア機器・サービス         |  |
| POWER & WATER UTILITY CO FOR | —           | 341         | 2,317         | 96,540        | 千円             | 公益事業                 |  |
| SAUDI ARAMCO BASE OIL CO     | —           | 268         | 3,960         | 164,942       | 千円             | 素材                   |  |
| ADES HOLDING CO              | —           | 3,029       | 5,368         | 223,582       | 千円             | エネルギー                |  |
| 小計                           | 株数<br>銘柄数   | 金額<br><比率>  | 109,810<br>40 | 173,121<br>41 | 748,689<br>—   | 31,182,916<br><3.8%> |  |
| (カタール)                       |             |             |               |               | 千カタールリアル       |                      |  |
| MASRAF AL RAYAN              | 28,631      | 35,103      | 8,375         | 358,898       | 千円             | 銀行                   |  |
| OOREDOO QPSC                 | 3,976       | 3,976       | 3,956         | 169,551       | 千円             | 電気通信サービス             |  |
| QATAR NATIONAL BANK          | 21,605      | 31,289      | 43,429        | 1,860,962     | 千円             | 銀行                   |  |
| INDUSTRIES QATAR             | 6,643       | 8,321       | 10,085        | 432,155       | 千円             | 資本財                  |  |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 2,662       | 2,662       | 3,966         | 169,979       | 千円             | 公益事業                 |  |
| QATAR ISLAMIC BANK           | 7,680       | 11,999      | 21,286        | 912,142       | 千円             | 銀行                   |  |
| BARWA REAL ESTATE CO         | 8,926       | 31,053      | 9,315         | 399,186       | 千円             | 不動産管理・開発             |  |
| COMMERCIAL BANK PSQC         | 15,416      | 23,566      | 9,714         | 416,248       | 千円             | 銀行                   |  |
| QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT) | 12,248      | 18,570      | 7,595         | 325,456       | 千円             | エネルギー                |  |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 21,425      | 50,785      | 9,049         | 387,791       | 千円             | 素材                   |  |
| QATAR FUEL QSC               | 2,889       | 4,226       | 6,161         | 264,037       | 千円             | エネルギー                |  |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC  | 4,297       | 5,557       | 5,762         | 246,940       | 千円             | 銀行                   |  |
| DUKHAN BANK                  | —           | 11,043      | 4,224         | 180,999       | 千円             | 銀行                   |  |
| 小計                           | 株数<br>銘柄数   | 金額<br><比率>  | 136,403<br>12 | 238,154<br>13 | 142,925<br>—   | 6,124,349<br><0.7%>  |  |
| (南アフリカ)                      |             |             |               |               | 千南アフリカランド      |                      |  |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD  | 223         | 493         | 36,411        | 307,678       | 千円             | 素材                   |  |
| NEDBANK GROUP LTD            | 2,213       | 3,328       | 77,531        | 655,144       | 千円             | 銀行                   |  |
| SASOL LTD                    | 2,583       | 4,643       | 63,664        | 537,961       | 千円             | 素材                   |  |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 1,974       | —           | —             | —             | 千円             | 素材                   |  |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 4,068       | 5,900       | 57,117        | 482,642       | 千円             | 素材                   |  |
| GOLD FIELDS LTD              | 4,189       | 6,436       | 203,137       | 1,716,508     | 千円             | 素材                   |  |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 4,808       | 8,105       | 49,324        | 416,792       | 千円             | 一般消費財・サービス流通・小売り     |  |
| SANLAM LTD                   | 8,469       | 12,666      | 89,579        | 756,947       | 千円             | 保険                   |  |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 2,247       | 3,400       | 87,886        | 742,644       | 千円             | 生活必需品流通・小売り          |  |
| STANDARD BANK GROUP LTD      | 6,384       | 9,029       | 167,255       | 1,413,311     | 千円             | 銀行                   |  |
| REMGRO LTD                   | 2,321       | 4,299       | 54,202        | 458,008       | 千円             | 金融サービス               |  |
| NASPERS LTD-N SHS            | 1,025       | 1,282       | 483,632       | 4,086,695     | 千円             | 一般消費財・サービス流通・小売り     |  |
| MTN GROUP LTD                | 8,083       | 12,204      | 114,718       | 969,370       | 千円             | 電気通信サービス             |  |
| KUMBA IRON ORE LTD           | 350         | 350         | 17,870        | 151,009       | 千円             | 素材                   |  |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD   | 2,526       | 3,250       | 56,045        | 473,586       | 千円             | 素材                   |  |
| FIRSTRAND LTD                | 23,754      | 33,711      | 226,205       | 1,911,438     | 千円             | 金融サービス               |  |
| THE FOSCHINI GROUP LTD       | 1,317       | —           | —             | —             | 千円             | 一般消費財・サービス流通・小売り     |  |

| 銘柄                            | 期首(前期末)  |            | 当期末        |           |             | 業種等                    |  |
|-------------------------------|----------|------------|------------|-----------|-------------|------------------------|--|
|                               | 株数       | 株数         | 評価額        |           | 邦貨換算金額      |                        |  |
|                               |          |            | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |             |                        |  |
| (南アフリカ)                       |          |            |            |           | 千円          |                        |  |
| EXXARO RESOURCES LTD          | 百株       | 百株         | 千南アフリカランド  |           | 195,928     | エネルギー                  |  |
| BIDVEST GROUP LTD             | 1,277    | 1,277      | 23,186     |           | 195,928     | 資本財                    |  |
| ABSA GROUP LTD                | 1,334    | 2,486      | 63,337     |           | 535,198     | 銀行                     |  |
| AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD  | 4,138    | 6,360      | 96,786     |           | 817,845     | 素材                     |  |
| ASPER PHARMACARE HOLDINGS LTD | 646      | —          | —          |           | —           | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| DISCOVERY LTD                 | 1,776    | 2,239      | 51,508     |           | 435,244     | 保険                     |  |
| VODACOM GROUP LTD             | 2,491    | 2,994      | 35,185     |           | 297,315     | 電気通信サービス               |  |
| OUTSURANCE GROUP LTD          | 3,096    | 4,308      | 40,572     |           | 342,840     | 保険                     |  |
| MR PRICE GROUP LTD            | 3,947    | 3,947      | 16,321     |           | 137,920     | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD     | 1,356    | —          | —          |           | —           | 銀行                     |  |
| CLICKS GROUP LTD              | 398      | 543        | 124,639    |           | 1,053,202   | 生活必需品流通・小売り            |  |
| BID CORP LTD                  | 1,144    | 1,483      | 45,147     |           | 381,499     | 生活必需品流通・小売り            |  |
| NEPI ROCKCASTLE N.V.          | 1,526    | 2,133      | 91,649     |           | 774,438     | 不動産管理・開発               |  |
| REINET INVESTMENTS SCA        | 2,074    | 4,241      | 53,353     |           | 450,834     | 金融サービス                 |  |
| OLD MUTUAL LTD                | 648      | 845        | 37,822     |           | 319,597     | 保険                     |  |
| MULTICHOICE GROUP LTD         | 23,452   | 34,294     | 37,586     |           | 317,609     | メディア・娯楽                |  |
| PEPKOR HOLDINGS LTD           | 2,090    | —          | —          |           | —           | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| SIBANYE STILLWATER LTD        | 8,813    | 10,212     | 19,352     |           | 163,529     | 素材                     |  |
| NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD | 12,932   | 18,962     | 43,423     |           | 366,931     | 素材                     |  |
| ANGLOGOLD ASHANTI PLC         | 1,663    | 3,468      | 47,111     |           | 398,094     | 素材                     |  |
|                               | —        | 2,977      | 135,831    |           | 1,147,773   | 素材                     |  |
| 小計                            | 株数・金額    | 151,351    | 211,881    | 2,747,401 | 23,215,544  |                        |  |
|                               | 銘柄数 <比率> | 36         | 32         |           | <2.8%>      |                        |  |
| 合計                            | 株数・金額    | 25,669,143 | 40,250,535 | —         | 788,658,888 |                        |  |
|                               | 銘柄数 <比率> | 1,318      | 1,305      | —         | <96.3%>     |                        |  |

(注) 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) 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各國別株式評価額の比率。

## 外国投資信託証券

| 銘柄                          | 期首(前期末)  |        | 当期末     |         |           | 比率  |  |
|-----------------------------|----------|--------|---------|---------|-----------|-----|--|
|                             | 口数       | 口数     | 評価額     |         | 邦貨換算金額    |     |  |
|                             |          |        | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |           |     |  |
| (メキシコ)                      |          |        |         |         | 千円        | %   |  |
| TRUST FIBRA UNO             | 千口       | 千口     | 千メキシコペソ |         | 411,777   | 0.1 |  |
| PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA | 1,521    | 1,759  | 44,279  |         | 433,873   | 0.1 |  |
| OPERADORA DE SITES MEX-A-1  | —        | 701    | 46,655  |         | 125,141   | 0.0 |  |
| 648                         | 648      | 13,456 |         |         |           |     |  |
| 小計                          | 口数・金額    | 2,169  | 3,108   | 104,390 | 970,791   |     |  |
|                             | 銘柄数 <比率> | 2      | 3       | —       | <0.1%>    |     |  |
| (南アフリカ)                     |          |        |         |         | 千南アフリカランド |     |  |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD  | 1,670    | —      | —       |         | —         | —   |  |
| 小計                          | 口数・金額    | 1,670  | —       | —       | —         | —   |  |
|                             | 銘柄数 <比率> | 1      | —       | —       | <-%>      |     |  |
| 合計                          | 口数・金額    | 3,840  | 3,108   | —       | 970,791   |     |  |
|                             | 銘柄数 <比率> | 3      | 3       | —       | <0.1%>    |     |  |

(注) 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) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 |        |         | 当 期 末         |          |
|-------|--------|---------|---------------|----------|
|       |        |         | 買 建 額         | 売 建 額    |
| 外 国   | 株式先物取引 | MINI MS | 百万円<br>29,736 | 百万円<br>— |

(注) 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。

## ○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 株式           | 千円<br>788,658,888 | %<br>96.3 |
| 投資証券         | 970,791           | 0.1       |
| コール・ローン等、その他 | 29,724,006        | 3.6       |
| 投資信託財産総額     | 819,353,685       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産（818,127,088千円）の投資信託財産総額（819,353,685千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                       |                         |                     |                     |
|-----------------------|-------------------------|---------------------|---------------------|
| 1 アメリカドル=155.98円      | 1 メキシコペソ=9.2996円        | 1 ブラジルレアル=30.234円   | 100 チリペソ=16.824円    |
| 100 コロンビアペソ=4.0081円   | 1 ユーロ=167.96円           | 1 イギリスポンド=195.24円   | 1 トルコリラ=4.8346円     |
| 1 チェココルナ=6.74円        | 100 ハンガリーフォリント=43.2976円 | 1 ポーランドズロチ=39.032円  | 1 香港ドル=19.96円       |
| 1 マレーシアリンギット=32.8846円 | 1 タイバーツ=4.24円           | 1 フィリピンペソ=2.7165円   | 100 インドネシアルピア=0.98円 |
| 100 韓国ウォン=11.38円      | 1 ニュー台湾ドル=4.809円        | 1 インドルピー=1.88円      | 1 オフショア元=21.5514円   |
| 1 アラブペティルハム=42.54円    | 1 クウェートディナール=508.24円    | 1 サウジアラビアリヤル=41.65円 | 1 カタールリアル=42.85円    |
| 1 南アフリカランド=8.45円      |                         |                     |                     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

| 項目              | 当期末              |
|-----------------|------------------|
| (A) 資産          | 円                |
| コール・ローン等        | 820,618,916,675  |
| 株式(評価額)         | 22,107,823,354   |
| 投資証券(評価額)       | 788,658,888,796  |
| 未収入金            | 970,791,971      |
| 未収配当金           | 1,904,661,728    |
| 未利利息            | 1,643,527,093    |
| 差入委託証拠金         | 2,107            |
| (A) 資産          | 5,333,221,626    |
| (B) 負債          | 1,586,450,593    |
| 未払金             | 1,275,369,057    |
| 未払解約金           | 311,081,536      |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 819,032,466,082  |
| 元本              | 206,526,910,578  |
| 次期繰越損益金         | 612,505,555,504  |
| (D) 受益権総口数      | 206,526,910,578口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 39,657円          |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 137,622,015,994円  
 期中追加設定元本額 86,150,764,068円  
 期中一部解約元本額 17,245,869,484円  
 また、1口当たり純資産額は、期末3,9657円です。

## ②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

|                                    |                 |
|------------------------------------|-----------------|
| e MAX I S S l i m 全世界株式（オール・カントリー） | 85,921,627,512円 |
| e MAX I S S l i m 新興国株式インデックス      | 40,381,036,847円 |
| 三菱UFJ D C 新興国株式インデックスファンド          | 16,921,699,337円 |
| e MAX I S S l i m 全世界株式（除く日本）      | 13,335,929,820円 |
| e MAX I S 新興国株式インデックス              | 10,231,986,211円 |
| e MAX I S S l i m バランス（8資産均等型）     | 8,899,492,844円  |
| つみたて新興国株式                          | 8,849,393,836円  |
| つみたて8資産均等バランス                      | 4,411,839,181円  |
| 新興国株式インデックス・オープン（ラップ向け）            | 3,335,625,185円  |
| e MAX I S バランス（8資産均等型）             | 1,696,943,441円  |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）          | 1,438,107,897円  |
| e MAX I S 全世界株式インデックス              | 1,427,931,999円  |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）          | 1,282,415,806円  |
| MAX I S 全世界株式（オール・カントリー）上場投信       | 1,277,146,996円  |
| e MAX I S S l i m 全世界株式（3地域均等型）    | 1,249,302,678円  |
| ラップ向けインデックス f 新興国株式                | 1,033,419,630円  |
| MUAM 全世界株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）    | 902,124,140円    |
| e MAX I S 最適化バランス（マイストライカー）        | 882,009,128円    |
| 三菱UFJ ブライムバランス（8資産）（確定拠出年金）        | 580,468,818円    |
| つみたて全世界株式                          | 562,336,141円    |
| 新興国株式インデックススオープン                   | 416,902,849円    |

## ○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項目                 | 当期               |
|--------------------|------------------|
| (A) 配当等収益          | 円                |
| 受取配当金              | 15,897,219,286   |
| 受取利息               | 15,095,411,830   |
| その他収益金             | 793,026,649      |
| 支払利息               | 9,293,846        |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 513,039        |
| 売買益                | 143,809,456,989  |
| 売買損                | 184,429,175,065  |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 40,619,718,076 |
| 取引益                | 1,045,981,779    |
| 取引損                | 4,886,701,381    |
| (D) 保管費用等          | △ 709,803,082    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 160,042,854,972  |
| (F) 前期繰越損益金        | 281,938,977,225  |
| (G) 追加信託差損益金       | 210,904,910,498  |
| (H) 解約差損益金         | △ 40,381,187,191 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 612,505,555,504  |
| 次期繰越損益金(I)         | 612,505,555,504  |

(注) (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算によるものを含みます。

(注) (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) (H) 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。

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| 三菱UFJ バランス・イノベーション（新興国投資型）        | 360,877,063円     |
| e MAXIS バランス（波乗り型）                | 298,650,528円     |
| e MAXIS 最適化バランス（マイフォワード）          | 229,515,300円     |
| e MAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）       | 209,229,329円     |
| MUKAM バランスファンド2019-12（適格機関投資家限定）  | 52,048,803円      |
| MUKAM バランスファンド2020-07（適格機関投資家限定）  | 51,685,373円      |
| MUKAM バランスファンド2020-10（適格機関投資家限定）  | 51,436,075円      |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（保守型）         | 47,918,887円      |
| MUKAM バランスファンド2021-06（適格機関投資家限定）  | 47,230,286円      |
| MUKAM バランスファンド2021-03（適格機関投資家限定）  | 45,518,639円      |
| e MAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）        | 34,327,114円      |
| 全世界株式インデックスファンドV（適格機関投資家限定）       | 26,644,417円      |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）        | 18,912,614円      |
| e MAXIS マイマネージャー 1990s            | 6,940,950円       |
| 全世界株式（除く日本）インデックスファンドV（適格機関投資家限定） | 6,066,087円       |
| e MAXIS マイマネージャー 1980s            | 1,376,986円       |
| e MAXIS マイマネージャー 1970s            | 566,584円         |
| グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）         | 225,247円         |
| 合計                                | 206,526,910,578円 |

## [お知らせ]

- ①資金流入が見込まれ信託金限度額に到達する可能性が高いため、信託金限度額の引き上げを行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2023年6月30日)
- ②委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。  
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。  
 (2023年10月1日)
- ③資金流入が見込まれ信託金限度額に到達する可能性が高いため、信託金限度額の引き上げを行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
 (2024年4月30日)

# 日本債券インデックスマザーファンド

**《第23期》決算日2024年5月13日**

**[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]**

「日本債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第23期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第23期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | NOMURA-BPI 総合と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をNOMURA-BPI 総合の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。 |
| 主要運用対象 | NOMURA-BPI 総合に採用されている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は行いません。   |

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額        |          | NOMURA-BPI 総合 | 債組入比率    | 債先物比率     | 純資産額     |
|-----------------|-------------|----------|---------------|----------|-----------|----------|
|                 | 期騰          | 中落率      |               | 期騰       | 中落率       |          |
| 19期(2020年5月12日) | 円<br>13,524 | %<br>0.2 | 388.75        | %<br>0.2 | %<br>99.6 | %<br>0.1 |
| 20期(2021年5月12日) | 13,462      | △0.5     | 386.93        | △0.5     | 99.5      | 0.2      |
| 21期(2022年5月12日) | 13,195      | △2.0     | 379.29        | △2.0     | 99.7      | 0.1      |
| 22期(2023年5月12日) | 13,084      | △0.8     | 375.76        | △0.9     | 99.6      | 0.1      |
| 23期(2024年5月13日) | 12,543      | △4.1     | 360.26        | △4.1     | 99.4      | 0.4      |

(注) NOMURA-BPI 総合とは、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が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日         | 基<br>準<br>価<br>額 | 騰<br>落<br>率 | N O M U R A - B P I 総合 | 債<br>券<br>組<br>入<br>比<br>率 |           | 債<br>券<br>先<br>物<br>比<br>率 |
|---------------------|------------------|-------------|------------------------|----------------------------|-----------|----------------------------|
|                     |                  |             |                        | 騰<br>落<br>率                | %         |                            |
| (期 首)<br>2023年5月12日 | 円<br>13,084      | %<br>—      | 375.76                 | %<br>—                     | %<br>99.6 | %<br>0.1                   |
| 5月末                 | 13,069           | △0.1        | 375.27                 | △0.1                       | 100.6     | 0.1                        |
| 6月末                 | 13,101           | 0.1         | 376.29                 | 0.1                        | 101.0     | 0.1                        |
| 7月末                 | 12,898           | △1.4        | 370.43                 | △1.4                       | 99.8      | 0.1                        |
| 8月末                 | 12,805           | △2.1        | 367.76                 | △2.1                       | 99.9      | 0.1                        |
| 9月末                 | 12,714           | △2.8        | 365.13                 | △2.8                       | 99.7      | 0.1                        |
| 10月末                | 12,512           | △4.4        | 359.31                 | △4.4                       | 99.2      | 0.1                        |
| 11月末                | 12,776           | △2.4        | 366.88                 | △2.4                       | 100.3     | 0.0                        |
| 12月末                | 12,829           | △1.9        | 368.38                 | △2.0                       | 99.7      | 0.1                        |
| 2024年1月末            | 12,735           | △2.7        | 365.75                 | △2.7                       | 101.0     | 0.1                        |
| 2月末                 | 12,775           | △2.4        | 366.90                 | △2.4                       | 100.5     | 0.1                        |
| 3月末                 | 12,760           | △2.5        | 366.50                 | △2.5                       | 100.6     | 0.1                        |
| 4月末                 | 12,614           | △3.6        | 362.35                 | △3.6                       | 99.5      | 0.4                        |
| (期 末)<br>2024年5月13日 | 12,543           | △4.1        | 360.26                 | △4.1                       | 99.4      | 0.4                        |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

#### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ4.1%の下落となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率（-4.1%）とほぼ同程度となりました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因  
(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

○国内債券市況

- ・国内債券市況は下落しました。
- ・国内債券市況は、期間の初めはもみ合いで推移し、その後は日銀による度重なる金融政策の柔軟化などから下落しました。期間の後半では欧米中銀の利下げ観測が高まつたことなどを背景に国内債券市況は反発する場面もありましたが、期間を通して見ると下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を債券(先物を含む)に投資し、高い公社債組入比率を維持しました。
- ・ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の構成銘柄を種別や年限等の属性でグループに区切り、ベンチマークの各グループの比率とポートフォリオの同じグループの比率を極力近づけるように、ポートフォリオを構築しました\*。

\*一般的に、このような手法を層化抽出法といいます。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは4.1%の下落になったため、カイ離は△0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・評価時価差異要因\*によるものです。  
※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価が異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2023年5月13日～2024年5月13日)

| 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) | 円<br>0<br>(0) | %<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>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| 合計                        | 0             | 0.000                 |  |
| 期中の平均基準価額は、12,813円です。     |               |                       |  |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○ 売買及び取引の状況

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 公社債

| 国内 | 債券種別  | 買付額         |     | 売付額         |              |
|----|-------|-------------|-----|-------------|--------------|
|    |       | 新規買付額       | 決済額 | 新規売付額       | 決済額          |
|    | 国債証券  | 384,256,743 |     | 177,764,642 |              |
|    | 地方債証券 | 16,956,546  |     | 7,211,864   | ( 70,000)    |
|    | 特殊債券  | 12,540,611  |     | 7,067,950   | ( 783,677)   |
|    | 社債券   | 35,789,366  |     | 21,005,130  | ( 1,300,000) |

(注) 金額は交渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注) 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。

## 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 債券先物取引 | 百万円<br>6,716 | 百万円<br>4,108 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分  | 買付額等<br>A      | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
|     |                |                    |               |                |                    |               |
| 公社債 | 百万円<br>449,543 | 百万円<br>94,047      | %<br>20.9     | 百万円<br>213,049 | 百万円<br>39,969      | %<br>18.8     |

(注) 公社債には現先などによるものを含みません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

| 種類  | 買付額          | 売付額          | 当期末保有額       |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| 公社債 | 百万円<br>1,094 | 百万円<br>2,699 | 百万円<br>2,111 |

## 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           |
|-----|---------------|
| 公社債 | 百万円<br>18,201 |

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、モルガン・スタンレーMUFG証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年5月13日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区分              | 当期末                             |                                 |                     |                |                   |                     |                  |  |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------|----------------|-------------------|---------------------|------------------|--|
|                 | 額面金額                            | 評価額                             | 組入比率                | うちBB格以下組入比率    | 残存期間別組入比率         |                     |                  |  |
|                 |                                 |                                 |                     |                | 5年以上              | 2年以上                | 2年未満             |  |
| 国債証券            | 千円<br>807,394,000<br>( 200,000) | 千円<br>772,173,696<br>( 200,278) | %<br>83.9<br>( 0.0) | %<br>—<br>( —) | %<br>55.3<br>( —) | %<br>19.6<br>( 0.0) | %<br>9.0<br>( —) |  |
| 地方債証券           | 48,280,400<br>( 48,280,400)     | 48,581,318<br>( 48,581,318)     | 5.3<br>( 5.3)       | —<br>( —)      | 2.1<br>( 2.1)     | 1.9<br>( 1.9)       | 1.3<br>( 1.3)    |  |
| 特殊債券<br>(除く金融債) | 34,900,958<br>( 34,900,958)     | 34,758,179<br>( 34,758,179)     | 3.8<br>( 3.8)       | —<br>( —)      | 1.9<br>( 1.9)     | 1.2<br>( 1.2)       | 0.7<br>( 0.7)    |  |
| 金融債券            | 2,900,000<br>( 2,900,000)       | 2,867,778<br>( 2,867,778)       | 0.3<br>( 0.3)       | —<br>( —)      | 0.0<br>( 0.0)     | 0.2<br>( 0.2)       | 0.1<br>( 0.1)    |  |
| 普通社債券           | 56,900,000<br>( 56,900,000)     | 56,319,048<br>( 56,319,048)     | 6.1<br>( 6.1)       | 0.0<br>( 0.0)  | 1.3<br>( 1.3)     | 3.9<br>( 3.9)       | 0.9<br>( 0.9)    |  |
| 合計              | 950,375,358<br>(143,181,358)    | 914,700,021<br>(142,726,602)    | 99.4<br>(15.5)      | 0.0<br>(0.0)   | 60.7<br>( 5.4)    | 26.8<br>( 7.2)      | 11.9<br>( 2.9)   |  |

(注) ( )内は非上場債で内書き。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 現先の組み入れがある場合、現先は国債証券に含めて記載。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄            | 利率    | 当期末        |            |    | 償還年月日      |
|---------------|-------|------------|------------|----|------------|
|               |       | 額面金額       | 評価額        | 千円 |            |
| 国債証券          | %     |            |            | 千円 |            |
| 第449回利付国債(2年) | 0.005 | 3,720,000  | 3,714,717  | 千円 | 2025/6/1   |
| 第450回利付国債(2年) | 0.005 | 1,300,000  | 1,297,933  |    | 2025/7/1   |
| 第451回利付国債(2年) | 0.005 | 5,800,000  | 5,788,690  |    | 2025/8/1   |
| 第452回利付国債(2年) | 0.005 | 3,100,000  | 3,092,529  |    | 2025/9/1   |
| 第453回利付国債(2年) | 0.005 | 4,600,000  | 4,586,660  |    | 2025/10/1  |
| 第454回利付国債(2年) | 0.1   | 3,550,000  | 3,542,971  |    | 2025/11/1  |
| 第455回利付国債(2年) | 0.005 | 1,550,000  | 1,544,001  |    | 2025/12/1  |
| 第456回利付国債(2年) | 0.1   | 5,100,000  | 5,085,873  |    | 2026/1/1   |
| 第457回利付国債(2年) | 0.1   | 5,710,000  | 5,691,385  |    | 2026/2/1   |
| 第458回利付国債(2年) | 0.2   | 6,400,000  | 6,388,544  |    | 2026/3/1   |
| 第144回利付国債(5年) | 0.1   | 6,380,000  | 6,376,491  |    | 2025/6/20  |
| 第145回利付国債(5年) | 0.1   | 6,410,000  | 6,401,731  |    | 2025/9/20  |
| 第146回利付国債(5年) | 0.1   | 4,450,000  | 4,438,964  |    | 2025/12/20 |
| 第147回利付国債(5年) | 0.005 | 5,830,000  | 5,798,343  |    | 2026/3/20  |
| 第148回利付国債(5年) | 0.005 | 8,200,000  | 8,143,502  |    | 2026/6/20  |
| 第149回利付国債(5年) | 0.005 | 11,570,000 | 11,479,406 |    | 2026/9/20  |
| 第150回利付国債(5年) | 0.005 | 1,630,000  | 1,615,493  |    | 2026/12/20 |
| 第151回利付国債(5年) | 0.005 | 50,000     | 49,492     |    | 2027/3/20  |
| 第152回利付国債(5年) | 0.1   | 5,480,000  | 5,439,009  |    | 2027/3/20  |
| 第153回利付国債(5年) | 0.005 | 5,620,000  | 5,555,370  |    | 2027/6/20  |
| 第154回利付国債(5年) | 0.1   | 10,230,000 | 10,130,052 |    | 2027/9/20  |
| 第155回利付国債(5年) | 0.3   | 2,850,000  | 2,838,343  |    | 2027/12/20 |
| 第156回利付国債(5年) | 0.2   | 8,050,000  | 7,988,498  |    | 2027/12/20 |
| 第157回利付国債(5年) | 0.2   | 2,020,000  | 2,002,022  |    | 2028/3/20  |
| 第158回利付国債(5年) | 0.1   | 8,740,000  | 8,629,089  |    | 2028/3/20  |
| 第159回利付国債(5年) | 0.1   | 1,980,000  | 1,951,686  |    | 2028/6/20  |
| 第160回利付国債(5年) | 0.2   | 2,850,000  | 2,820,730  |    | 2028/6/20  |
| 第161回利付国債(5年) | 0.3   | 3,820,000  | 3,796,125  |    | 2028/6/20  |
| 第162回利付国債(5年) | 0.3   | 190,000    | 188,500    |    | 2028/9/20  |
| 第163回利付国債(5年) | 0.4   | 13,900,000 | 13,849,543 |    | 2028/9/20  |
| 第164回利付国債(5年) | 0.2   | 1,900,000  | 1,873,077  |    | 2028/12/20 |
| 第165回利付国債(5年) | 0.3   | 5,600,000  | 5,545,848  |    | 2028/12/20 |
| 第166回利付国債(5年) | 0.4   | 2,100,000  | 2,089,605  |    | 2028/12/20 |
| 第167回利付国債(5年) | 0.4   | 750,000    | 745,035    |    | 2029/3/20  |
| 第1回利付国債(40年)  | 2.4   | 2,105,000  | 2,327,393  |    | 2048/3/20  |
| 第2回利付国債(40年)  | 2.2   | 1,335,000  | 1,420,586  |    | 2049/3/20  |
| 第3回利付国債(40年)  | 2.2   | 1,668,000  | 1,770,081  |    | 2050/3/20  |
| 第4回利付国債(40年)  | 2.2   | 1,838,000  | 1,942,931  |    | 2051/3/20  |
| 第5回利付国債(40年)  | 2.0   | 1,525,000  | 1,541,531  |    | 2052/3/20  |
| 第6回利付国債(40年)  | 1.9   | 1,230,000  | 1,209,705  |    | 2053/3/20  |
| 第7回利付国債(40年)  | 1.7   | 1,540,000  | 1,441,517  |    | 2054/3/20  |
| 第8回利付国債(40年)  | 1.4   | 2,110,000  | 1,821,541  |    | 2055/3/20  |
| 第9回利付国債(40年)  | 0.4   | 3,630,000  | 2,262,288  |    | 2056/3/20  |
| 第10回利付国債(40年) | 0.9   | 3,000,000  | 2,195,610  |    | 2057/3/20  |

| 銘柄             | 利   | 当期末        |   |            | 償還年月日      |
|----------------|-----|------------|---|------------|------------|
|                |     | 額          | 面 | 金額         |            |
| 国債証券           | %   | 千円         |   | 千円         |            |
| 第11回利付国債(40年)  | 0.8 | 3,080,000  |   | 2,155,568  | 2058/3/20  |
| 第12回利付国債(40年)  | 0.5 | 2,570,000  |   | 1,584,687  | 2059/3/20  |
| 第13回利付国債(40年)  | 0.5 | 3,170,000  |   | 1,924,094  | 2060/3/20  |
| 第14回利付国債(40年)  | 0.7 | 3,590,000  |   | 2,323,842  | 2061/3/20  |
| 第15回利付国債(40年)  | 1.0 | 4,200,000  |   | 2,995,188  | 2062/3/20  |
| 第16回利付国債(40年)  | 1.3 | 4,000,000  |   | 3,121,680  | 2063/3/20  |
| 第339回利付国債(10年) | 0.4 | 4,020,000  |   | 4,031,014  | 2025/6/20  |
| 第340回利付国債(10年) | 0.4 | 3,470,000  |   | 3,479,577  | 2025/9/20  |
| 第341回利付国債(10年) | 0.3 | 3,320,000  |   | 3,322,357  | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債(10年) | 0.1 | 2,570,000  |   | 2,560,542  | 2026/3/20  |
| 第343回利付国債(10年) | 0.1 | 4,870,000  |   | 4,846,088  | 2026/6/20  |
| 第344回利付国債(10年) | 0.1 | 4,620,000  |   | 4,594,081  | 2026/9/20  |
| 第345回利付国債(10年) | 0.1 | 6,340,000  |   | 6,299,107  | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債(10年) | 0.1 | 6,130,000  |   | 6,084,147  | 2027/3/20  |
| 第347回利付国債(10年) | 0.1 | 5,700,000  |   | 5,651,037  | 2027/6/20  |
| 第348回利付国債(10年) | 0.1 | 4,970,000  |   | 4,921,443  | 2027/9/20  |
| 第349回利付国債(10年) | 0.1 | 6,090,000  |   | 6,021,852  | 2027/12/20 |
| 第350回利付国債(10年) | 0.1 | 6,530,000  |   | 6,447,134  | 2028/3/20  |
| 第351回利付国債(10年) | 0.1 | 4,870,000  |   | 4,800,359  | 2028/6/20  |
| 第352回利付国債(10年) | 0.1 | 4,110,000  |   | 4,042,513  | 2028/9/20  |
| 第353回利付国債(10年) | 0.1 | 4,630,000  |   | 4,543,604  | 2028/12/20 |
| 第354回利付国債(10年) | 0.1 | 6,320,000  |   | 6,191,514  | 2029/3/20  |
| 第355回利付国債(10年) | 0.1 | 6,040,000  |   | 5,908,026  | 2029/6/20  |
| 第356回利付国債(10年) | 0.1 | 8,080,000  |   | 7,890,847  | 2029/9/20  |
| 第357回利付国債(10年) | 0.1 | 4,150,000  |   | 4,046,291  | 2029/12/20 |
| 第358回利付国債(10年) | 0.1 | 9,440,000  |   | 9,186,158  | 2030/3/20  |
| 第359回利付国債(10年) | 0.1 | 9,350,000  |   | 9,080,159  | 2030/6/20  |
| 第360回利付国債(10年) | 0.1 | 6,340,000  |   | 6,140,353  | 2030/9/20  |
| 第361回利付国債(10年) | 0.1 | 9,410,000  |   | 9,088,083  | 2030/12/20 |
| 第362回利付国債(10年) | 0.1 | 7,240,000  |   | 6,971,975  | 2031/3/20  |
| 第363回利付国債(10年) | 0.1 | 6,320,000  |   | 6,067,516  | 2031/6/20  |
| 第364回利付国債(10年) | 0.1 | 9,170,000  |   | 8,775,965  | 2031/9/20  |
| 第365回利付国債(10年) | 0.1 | 11,820,000 |   | 11,275,452 | 2031/12/20 |
| 第366回利付国債(10年) | 0.2 | 6,090,000  |   | 5,837,325  | 2032/3/20  |
| 第367回利付国債(10年) | 0.2 | 8,390,000  |   | 8,016,141  | 2032/6/20  |
| 第368回利付国債(10年) | 0.2 | 9,730,000  |   | 9,265,587  | 2032/9/20  |
| 第369回利付国債(10年) | 0.5 | 8,320,000  |   | 8,106,009  | 2032/12/20 |
| 第370回利付国債(10年) | 0.5 | 9,000,000  |   | 8,744,310  | 2033/3/20  |
| 第371回利付国債(10年) | 0.4 | 8,410,000  |   | 8,076,627  | 2033/6/20  |
| 第372回利付国債(10年) | 0.8 | 6,820,000  |   | 6,769,873  | 2033/9/20  |
| 第373回利付国債(10年) | 0.6 | 8,880,000  |   | 8,629,228  | 2033/12/20 |
| 第374回利付国債(10年) | 0.8 | 1,550,000  |   | 1,531,121  | 2034/3/20  |
| 第1回利付国債(30年)   | 2.8 | 196,000    |   | 219,275    | 2029/9/20  |
| 第2回利付国債(30年)   | 2.4 | 268,000    |   | 295,904    | 2030/2/20  |
| 第3回利付国債(30年)   | 2.3 | 307,000    |   | 338,188    | 2030/5/20  |

| 銘柄            | 利   | 当期末       |           |            |     |
|---------------|-----|-----------|-----------|------------|-----|
|               |     | 額         | 面         | 金額         | 評価額 |
|               | %   | 千円        | 千円        | 償還年月日      |     |
| 国債証券          |     |           |           |            |     |
| 第4回利付国債(30年)  | 2.9 | 252,000   | 288,550   | 2030/11/20 |     |
| 第5回利付国債(30年)  | 2.2 | 238,000   | 262,842   | 2031/5/20  |     |
| 第6回利付国債(30年)  | 2.4 | 339,000   | 380,578   | 2031/11/20 |     |
| 第7回利付国債(30年)  | 2.3 | 339,000   | 379,449   | 2032/5/20  |     |
| 第8回利付国債(30年)  | 1.8 | 302,000   | 326,754   | 2032/11/22 |     |
| 第9回利付国債(30年)  | 1.4 | 206,000   | 216,034   | 2032/12/20 |     |
| 第10回利付国債(30年) | 1.1 | 398,000   | 407,022   | 2033/3/20  |     |
| 第11回利付国債(30年) | 1.7 | 237,000   | 254,554   | 2033/6/20  |     |
| 第12回利付国債(30年) | 2.1 | 325,000   | 360,353   | 2033/9/20  |     |
| 第13回利付国債(30年) | 2.0 | 595,000   | 654,583   | 2033/12/20 |     |
| 第14回利付国債(30年) | 2.4 | 683,000   | 777,090   | 2034/3/20  |     |
| 第15回利付国債(30年) | 2.5 | 686,000   | 787,630   | 2034/6/20  |     |
| 第16回利付国債(30年) | 2.5 | 547,000   | 628,399   | 2034/9/20  |     |
| 第17回利付国債(30年) | 2.4 | 577,000   | 657,589   | 2034/12/20 |     |
| 第18回利付国債(30年) | 2.3 | 687,000   | 775,925   | 2035/3/20  |     |
| 第19回利付国債(30年) | 2.3 | 593,000   | 670,362   | 2035/6/20  |     |
| 第20回利付国債(30年) | 2.5 | 655,000   | 754,789   | 2035/9/20  |     |
| 第21回利付国債(30年) | 2.3 | 529,000   | 598,314   | 2035/12/20 |     |
| 第22回利付国債(30年) | 2.5 | 1,975,000 | 2,277,984 | 2036/3/20  |     |
| 第23回利付国債(30年) | 2.5 | 194,000   | 223,722   | 2036/6/20  |     |
| 第24回利付国債(30年) | 2.5 | 981,000   | 1,131,593 | 2036/9/20  |     |
| 第25回利付国債(30年) | 2.3 | 1,287,000 | 1,455,519 | 2036/12/20 |     |
| 第26回利付国債(30年) | 2.4 | 1,014,000 | 1,157,835 | 2037/3/20  |     |
| 第27回利付国債(30年) | 2.5 | 760,000   | 876,226   | 2037/9/20  |     |
| 第28回利付国債(30年) | 2.5 | 2,926,000 | 3,369,698 | 2038/3/20  |     |
| 第29回利付国債(30年) | 2.4 | 1,630,000 | 1,853,603 | 2038/9/20  |     |
| 第30回利付国債(30年) | 2.3 | 1,721,000 | 1,931,598 | 2039/3/20  |     |
| 第31回利付国債(30年) | 2.2 | 2,223,000 | 2,458,593 | 2039/9/20  |     |
| 第32回利付国債(30年) | 2.3 | 1,989,000 | 2,222,627 | 2040/3/20  |     |
| 第33回利付国債(30年) | 2.0 | 1,227,000 | 1,315,331 | 2040/9/20  |     |
| 第34回利付国債(30年) | 2.2 | 2,231,000 | 2,447,630 | 2041/3/20  |     |
| 第35回利付国債(30年) | 2.0 | 3,179,000 | 3,383,854 | 2041/9/20  |     |
| 第36回利付国債(30年) | 2.0 | 2,579,000 | 2,735,519 | 2042/3/20  |     |
| 第37回利付国債(30年) | 1.9 | 2,717,000 | 2,830,624 | 2042/9/20  |     |
| 第38回利付国債(30年) | 1.8 | 1,590,000 | 1,625,457 | 2043/3/20  |     |
| 第39回利付国債(30年) | 1.9 | 1,360,000 | 1,410,401 | 2043/6/20  |     |
| 第40回利付国債(30年) | 1.8 | 1,720,000 | 1,751,407 | 2043/9/20  |     |
| 第41回利付国債(30年) | 1.7 | 1,210,000 | 1,209,104 | 2043/12/20 |     |
| 第42回利付国債(30年) | 1.7 | 1,820,000 | 1,813,266 | 2044/3/20  |     |
| 第43回利付国債(30年) | 1.7 | 2,020,000 | 2,009,455 | 2044/6/20  |     |
| 第44回利付国債(30年) | 1.7 | 2,230,000 | 2,214,925 | 2044/9/20  |     |
| 第45回利付国債(30年) | 1.5 | 1,940,000 | 1,858,112 | 2044/12/20 |     |
| 第46回利付国債(30年) | 1.5 | 2,530,000 | 2,418,578 | 2045/3/20  |     |
| 第47回利付国債(30年) | 1.6 | 2,890,000 | 2,808,039 | 2045/6/20  |     |
| 第48回利付国債(30年) | 1.4 | 2,100,000 | 1,962,849 | 2045/9/20  |     |

| 銘柄            | 利   | 当期末       |    |           | 償還年月日      |
|---------------|-----|-----------|----|-----------|------------|
|               |     | 額         | 面  | 金額        |            |
| 国債証券          | %   |           | 千円 | 千円        |            |
| 第49回利付国債(30年) | 1.4 | 2,360,000 |    | 2,201,172 | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債(30年) | 0.8 | 2,710,000 |    | 2,229,083 | 2046/3/20  |
| 第51回利付国債(30年) | 0.3 | 2,560,000 |    | 1,865,804 | 2046/6/20  |
| 第52回利付国債(30年) | 0.5 | 2,490,000 |    | 1,896,906 | 2046/9/20  |
| 第53回利付国債(30年) | 0.6 | 2,490,000 |    | 1,933,808 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債(30年) | 0.8 | 2,040,000 |    | 1,653,481 | 2047/3/20  |
| 第55回利付国債(30年) | 0.8 | 2,240,000 |    | 1,809,539 | 2047/6/20  |
| 第56回利付国債(30年) | 0.8 | 2,310,000 |    | 1,859,850 | 2047/9/20  |
| 第57回利付国債(30年) | 0.8 | 2,340,000 |    | 1,876,212 | 2047/12/20 |
| 第58回利付国債(30年) | 0.8 | 2,140,000 |    | 1,708,768 | 2048/3/20  |
| 第59回利付国債(30年) | 0.7 | 2,410,000 |    | 1,871,581 | 2048/6/20  |
| 第60回利付国債(30年) | 0.9 | 2,200,000 |    | 1,787,566 | 2048/9/20  |
| 第61回利付国債(30年) | 0.7 | 1,940,000 |    | 1,494,556 | 2048/12/20 |
| 第62回利付国債(30年) | 0.5 | 1,850,000 |    | 1,346,874 | 2049/3/20  |
| 第63回利付国債(30年) | 0.4 | 2,620,000 |    | 1,846,890 | 2049/6/20  |
| 第64回利付国債(30年) | 0.4 | 2,330,000 |    | 1,634,098 | 2049/9/20  |
| 第65回利付国債(30年) | 0.4 | 1,510,000 |    | 1,054,478 | 2049/12/20 |
| 第66回利付国債(30年) | 0.4 | 1,900,000 |    | 1,320,120 | 2050/3/20  |
| 第67回利付国債(30年) | 0.6 | 2,740,000 |    | 2,004,803 | 2050/6/20  |
| 第68回利付国債(30年) | 0.6 | 2,540,000 |    | 1,851,228 | 2050/9/20  |
| 第69回利付国債(30年) | 0.7 | 2,370,000 |    | 1,768,968 | 2050/12/20 |
| 第70回利付国債(30年) | 0.7 | 2,340,000 |    | 1,740,187 | 2051/3/20  |
| 第71回利付国債(30年) | 0.7 | 2,610,000 |    | 1,933,801 | 2051/6/20  |
| 第72回利付国債(30年) | 0.7 | 2,410,000 |    | 1,778,989 | 2051/9/20  |
| 第73回利付国債(30年) | 0.7 | 2,130,000 |    | 1,566,487 | 2051/12/20 |
| 第74回利付国債(30年) | 1.0 | 3,040,000 |    | 2,422,576 | 2052/3/20  |
| 第75回利付国債(30年) | 1.3 | 2,370,000 |    | 2,034,929 | 2052/6/20  |
| 第76回利付国債(30年) | 1.4 | 2,420,000 |    | 2,124,590 | 2052/9/20  |
| 第77回利付国債(30年) | 1.6 | 2,690,000 |    | 2,473,966 | 2052/12/20 |
| 第78回利付国債(30年) | 1.4 | 3,260,000 |    | 2,850,022 | 2053/3/20  |
| 第79回利付国債(30年) | 1.2 | 2,030,000 |    | 1,684,778 | 2053/6/20  |
| 第80回利付国債(30年) | 1.8 | 2,800,000 |    | 2,688,952 | 2053/9/20  |
| 第81回利付国債(30年) | 1.6 | 2,580,000 |    | 2,359,590 | 2053/12/20 |
| 第82回利付国債(30年) | 1.8 | 1,100,000 |    | 1,053,954 | 2054/3/20  |
| 第78回利付国債(20年) | 1.9 | 310,000   |    | 315,964   | 2025/6/20  |
| 第79回利付国債(20年) | 2.0 | 150,000   |    | 153,051   | 2025/6/20  |
| 第80回利付国債(20年) | 2.1 | 585,000   |    | 597,542   | 2025/6/20  |
| 第81回利付国債(20年) | 2.0 | 250,000   |    | 256,090   | 2025/9/20  |
| 第82回利付国債(20年) | 2.1 | 1,082,000 |    | 1,109,818 | 2025/9/20  |
| 第83回利付国債(20年) | 2.1 | 395,000   |    | 406,632   | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債(20年) | 2.0 | 880,000   |    | 904,508   | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債(20年) | 2.1 | 520,000   |    | 537,258   | 2026/3/20  |
| 第86回利付国債(20年) | 2.3 | 1,047,000 |    | 1,085,602 | 2026/3/20  |
| 第87回利付国債(20年) | 2.2 | 420,000   |    | 434,712   | 2026/3/20  |
| 第88回利付国債(20年) | 2.3 | 1,264,000 |    | 1,315,963 | 2026/6/20  |

| 銘柄             | 利   | 当期末       |           |           | 償還年月日      |
|----------------|-----|-----------|-----------|-----------|------------|
|                |     | 額面金額      | 評価額       | 千円        |            |
| 国債証券           | %   |           |           | 千円        |            |
| 第89回利付国債(20年)  | 2.2 | 340,000   | 353,266   | 353,266   | 2026/6/20  |
| 第90回利付国債(20年)  | 2.2 | 1,270,000 | 1,325,295 | 1,325,295 | 2026/9/20  |
| 第91回利付国債(20年)  | 2.3 | 548,000   | 573,142   | 573,142   | 2026/9/20  |
| 第92回利付国債(20年)  | 2.1 | 1,282,000 | 1,340,036 | 1,340,036 | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債(20年)  | 2.0 | 190,000   | 198,816   | 198,816   | 2027/3/20  |
| 第94回利付国債(20年)  | 2.1 | 875,000   | 918,067   | 918,067   | 2027/3/20  |
| 第95回利付国債(20年)  | 2.3 | 1,107,000 | 1,172,501 | 1,172,501 | 2027/6/20  |
| 第96回利付国債(20年)  | 2.1 | 340,000   | 358,033   | 358,033   | 2027/6/20  |
| 第97回利付国債(20年)  | 2.2 | 573,000   | 607,425   | 607,425   | 2027/9/20  |
| 第98回利付国債(20年)  | 2.1 | 610,000   | 644,629   | 644,629   | 2027/9/20  |
| 第99回利付国債(20年)  | 2.1 | 1,480,000 | 1,569,066 | 1,569,066 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債(20年) | 2.2 | 1,030,000 | 1,099,442 | 1,099,442 | 2028/3/20  |
| 第101回利付国債(20年) | 2.4 | 723,000   | 777,225   | 777,225   | 2028/3/20  |
| 第102回利付国債(20年) | 2.4 | 520,000   | 561,059   | 561,059   | 2028/6/20  |
| 第103回利付国債(20年) | 2.3 | 760,000   | 816,946   | 816,946   | 2028/6/20  |
| 第104回利付国債(20年) | 2.1 | 610,000   | 650,790   | 650,790   | 2028/6/20  |
| 第105回利付国債(20年) | 2.1 | 920,000   | 983,967   | 983,967   | 2028/9/20  |
| 第106回利付国債(20年) | 2.2 | 571,000   | 613,139   | 613,139   | 2028/9/20  |
| 第107回利付国債(20年) | 2.1 | 607,000   | 650,691   | 650,691   | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債(20年) | 1.9 | 1,000,000 | 1,062,980 | 1,062,980 | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債(20年) | 1.9 | 560,000   | 596,411   | 596,411   | 2029/3/20  |
| 第110回利付国債(20年) | 2.1 | 876,000   | 941,244   | 941,244   | 2029/3/20  |
| 第111回利付国債(20年) | 2.2 | 861,000   | 933,108   | 933,108   | 2029/6/20  |
| 第112回利付国債(20年) | 2.1 | 1,050,000 | 1,132,719 | 1,132,719 | 2029/6/20  |
| 第113回利付国債(20年) | 2.1 | 922,000   | 997,613   | 997,613   | 2029/9/20  |
| 第114回利付国債(20年) | 2.1 | 1,600,000 | 1,736,208 | 1,736,208 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債(20年) | 2.2 | 944,000   | 1,029,498 | 1,029,498 | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債(20年) | 2.2 | 461,000   | 504,246   | 504,246   | 2030/3/20  |
| 第117回利付国債(20年) | 2.1 | 1,320,000 | 1,436,344 | 1,436,344 | 2030/3/20  |
| 第118回利付国債(20年) | 2.0 | 520,000   | 564,007   | 564,007   | 2030/6/20  |
| 第119回利付国債(20年) | 1.8 | 400,000   | 429,136   | 429,136   | 2030/6/20  |
| 第120回利付国債(20年) | 1.6 | 780,000   | 827,369   | 827,369   | 2030/6/20  |
| 第121回利付国債(20年) | 1.9 | 1,299,000 | 1,403,634 | 1,403,634 | 2030/9/20  |
| 第122回利付国債(20年) | 1.8 | 100,000   | 107,442   | 107,442   | 2030/9/20  |
| 第123回利付国債(20年) | 2.1 | 1,318,000 | 1,443,091 | 1,443,091 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債(20年) | 2.0 | 1,240,000 | 1,349,826 | 1,349,826 | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債(20年) | 2.2 | 1,844,000 | 2,034,743 | 2,034,743 | 2031/3/20  |
| 第126回利付国債(20年) | 2.0 | 200,000   | 217,990   | 217,990   | 2031/3/20  |
| 第127回利付国債(20年) | 1.9 | 440,000   | 476,687   | 476,687   | 2031/3/20  |
| 第128回利付国債(20年) | 1.9 | 1,974,000 | 2,140,763 | 2,140,763 | 2031/6/20  |
| 第129回利付国債(20年) | 1.8 | 280,000   | 301,753   | 301,753   | 2031/6/20  |
| 第130回利付国債(20年) | 1.8 | 1,862,000 | 2,008,036 | 2,008,036 | 2031/9/20  |
| 第131回利付国債(20年) | 1.7 | 420,000   | 450,000   | 450,000   | 2031/9/20  |
| 第132回利付国債(20年) | 1.7 | 187,000   | 200,497   | 200,497   | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債(20年) | 1.8 | 2,320,000 | 2,504,208 | 2,504,208 | 2031/12/20 |

| 銘柄             | 利率  | 当期末       |           |    | 償還年月日      |
|----------------|-----|-----------|-----------|----|------------|
|                |     | 額面金額      | 評価額       | 千円 |            |
| 国債証券           | %   |           |           | 千円 | 千円         |
| 第134回利付国債(20年) | 1.8 | 4,545,000 | 4,909,645 |    | 2032/3/20  |
| 第135回利付国債(20年) | 1.7 | 50,000    | 53,640    |    | 2032/3/20  |
| 第136回利付国債(20年) | 1.6 | 190,000   | 202,346   |    | 2032/3/20  |
| 第137回利付国債(20年) | 1.7 | 4,342,000 | 4,658,792 |    | 2032/6/20  |
| 第138回利付国債(20年) | 1.5 | 160,000   | 169,163   |    | 2032/6/20  |
| 第139回利付国債(20年) | 1.6 | 310,000   | 330,122   |    | 2032/6/20  |
| 第140回利付国債(20年) | 1.7 | 2,817,000 | 3,023,795 |    | 2032/9/20  |
| 第141回利付国債(20年) | 1.7 | 1,120,000 | 1,202,577 |    | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債(20年) | 1.8 | 3,090,000 | 3,342,731 |    | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債(20年) | 1.6 | 1,740,000 | 1,853,500 |    | 2033/3/20  |
| 第144回利付国債(20年) | 1.5 | 1,520,000 | 1,605,940 |    | 2033/3/20  |
| 第145回利付国債(20年) | 1.7 | 3,100,000 | 3,329,617 |    | 2033/6/20  |
| 第146回利付国債(20年) | 1.7 | 3,420,000 | 3,670,275 |    | 2033/9/20  |
| 第147回利付国債(20年) | 1.6 | 3,450,000 | 3,668,316 |    | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債(20年) | 1.5 | 3,360,000 | 3,539,188 |    | 2034/3/20  |
| 第149回利付国債(20年) | 1.5 | 4,180,000 | 4,397,945 |    | 2034/6/20  |
| 第150回利付国債(20年) | 1.4 | 4,800,000 | 4,996,512 |    | 2034/9/20  |
| 第151回利付国債(20年) | 1.2 | 4,480,000 | 4,565,881 |    | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債(20年) | 1.2 | 3,980,000 | 4,047,978 |    | 2035/3/20  |
| 第153回利付国債(20年) | 1.3 | 3,990,000 | 4,093,221 |    | 2035/6/20  |
| 第154回利付国債(20年) | 1.2 | 4,160,000 | 4,216,867 |    | 2035/9/20  |
| 第155回利付国債(20年) | 1.0 | 4,720,000 | 4,671,431 |    | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債(20年) | 0.4 | 3,100,000 | 2,854,542 |    | 2036/3/20  |
| 第157回利付国債(20年) | 0.2 | 4,980,000 | 4,453,763 |    | 2036/6/20  |
| 第158回利付国債(20年) | 0.5 | 3,760,000 | 3,474,954 |    | 2036/9/20  |
| 第159回利付国債(20年) | 0.6 | 3,400,000 | 3,169,718 |    | 2036/12/20 |
| 第160回利付国債(20年) | 0.7 | 4,430,000 | 4,164,820 |    | 2037/3/20  |
| 第161回利付国債(20年) | 0.6 | 3,720,000 | 3,438,098 |    | 2037/6/20  |
| 第162回利付国債(20年) | 0.6 | 4,580,000 | 4,212,775 |    | 2037/9/20  |
| 第163回利付国債(20年) | 0.6 | 3,550,000 | 3,251,480 |    | 2037/12/20 |
| 第164回利付国債(20年) | 0.5 | 3,890,000 | 3,498,043 |    | 2038/3/20  |
| 第165回利付国債(20年) | 0.5 | 3,810,000 | 3,408,159 |    | 2038/6/20  |
| 第166回利付国債(20年) | 0.7 | 4,060,000 | 3,720,299 |    | 2038/9/20  |
| 第167回利付国債(20年) | 0.5 | 3,710,000 | 3,287,208 |    | 2038/12/20 |
| 第168回利付国債(20年) | 0.4 | 3,800,000 | 3,300,376 |    | 2039/3/20  |
| 第169回利付国債(20年) | 0.3 | 3,140,000 | 2,669,471 |    | 2039/6/20  |
| 第170回利付国債(20年) | 0.3 | 3,120,000 | 2,636,306 |    | 2039/9/20  |
| 第171回利付国債(20年) | 0.3 | 3,070,000 | 2,579,721 |    | 2039/12/20 |
| 第172回利付国債(20年) | 0.4 | 3,790,000 | 3,221,083 |    | 2040/3/20  |
| 第173回利付国債(20年) | 0.4 | 3,550,000 | 3,000,744 |    | 2040/6/20  |
| 第174回利付国債(20年) | 0.4 | 6,120,000 | 5,144,716 |    | 2040/9/20  |
| 第175回利付国債(20年) | 0.5 | 3,620,000 | 3,079,461 |    | 2040/12/20 |
| 第176回利付国債(20年) | 0.5 | 3,590,000 | 3,037,678 |    | 2041/3/20  |
| 第177回利付国債(20年) | 0.4 | 3,790,000 | 3,133,041 |    | 2041/6/20  |
| 第178回利付国債(20年) | 0.5 | 4,070,000 | 3,408,665 |    | 2041/9/20  |

| 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          |            |
| 第179回利付国債(20年)       | 0.5   |   | 3,790,000   | 3,158,813   | 2041/12/20 |
| 第180回利付国債(20年)       | 0.8   |   | 3,680,000   | 3,222,024   | 2042/3/20  |
| 第181回利付国債(20年)       | 0.9   |   | 4,000,000   | 3,549,680   | 2042/6/20  |
| 第182回利付国債(20年)       | 1.1   |   | 3,760,000   | 3,441,979   | 2042/9/20  |
| 第183回利付国債(20年)       | 1.4   |   | 3,320,000   | 3,188,229   | 2042/12/20 |
| 第184回利付国債(20年)       | 1.1   |   | 4,050,000   | 3,684,690   | 2043/3/20  |
| 第185回利付国債(20年)       | 1.1   |   | 4,630,000   | 4,199,132   | 2043/6/20  |
| 第186回利付国債(20年)       | 1.5   |   | 3,700,000   | 3,584,375   | 2043/9/20  |
| 第187回利付国債(20年)       | 1.3   |   | 3,320,000   | 3,097,394   | 2043/12/20 |
| 第188回利付国債(20年)       | 1.6   |   | 730,000     | 714,918     | 2044/3/20  |
| 第1回大韓民国              | 0.475 |   | 100,000     | 99,995      | 2026/9/14  |
| 第2回大韓民国              | 0.75  |   | 100,000     | 100,283     | 2028/9/14  |
| 小計                   |       |   | 807,394,000 | 772,173,696 |            |
| 地方債証券                |       |   |             |             |            |
| 第7回東京都公募公債(20年)      | 2.16  |   | 100,000     | 102,535     | 2025/9/19  |
| 第7回東京都公募公債(30年)      | 2.51  |   | 80,000      | 90,874      | 2038/9/17  |
| 第10回東京都公募公債(30年)     | 2.31  |   | 100,000     | 110,449     | 2039/9/20  |
| 第12回東京都公募公債(20年)     | 2.31  |   | 100,000     | 106,013     | 2027/9/17  |
| 第20回東京都公募公債(20年)     | 2.09  |   | 80,000      | 86,053      | 2029/9/20  |
| 第21回東京都公募公債(20年)     | 2.19  |   | 80,000      | 86,740      | 2029/12/20 |
| 第28回東京都公募公債(20年)     | 1.59  |   | 100,000     | 105,496     | 2033/3/18  |
| 第33回東京都公募公債(20年)     | 0.18  |   | 100,000     | 88,139      | 2036/6/20  |
| 第747回東京都公募公債         | 0.475 |   | 500,000     | 501,310     | 2025/9/19  |
| 第750回東京都公募公債         | 0.444 |   | 200,000     | 200,314     | 2025/12/19 |
| 第751回東京都公募公債         | 0.37  |   | 500,000     | 500,195     | 2025/12/19 |
| 第757回東京都公募公債         | 0.03  |   | 150,000     | 148,734     | 2026/6/19  |
| 第758回東京都公募公債         | 0.03  |   | 150,000     | 148,734     | 2026/6/19  |
| 第782回東京都公募公債         | 0.23  |   | 100,000     | 98,734      | 2028/6/20  |
| 第783回東京都公募公債         | 0.22  |   | 400,000     | 394,776     | 2028/6/20  |
| 第807回東京都公募公債         | 0.1   |   | 200,000     | 193,144     | 2030/6/20  |
| 第809回東京都公募公債         | 0.105 |   | 100,000     | 96,326      | 2030/9/20  |
| 平成27年度第5回北海道公募公債     | 0.583 |   | 100,000     | 100,370     | 2025/6/30  |
| 平成30年度第14回北海道公募公債    | 0.195 |   | 100,000     | 98,134      | 2028/12/28 |
| 令和3年度第14回北海道公募公債(5年) | 0.001 |   | 400,000     | 395,072     | 2027/1/28  |
| 第32回1号宮城県公募公債        | 0.07  |   | 200,000     | 198,468     | 2026/6/24  |
| 第36回2号宮城県公募公債        | 0.135 |   | 342,000     | 329,657     | 2030/10/28 |
| 第2回神奈川県公募公債(30年)     | 2.87  |   | 180,000     | 212,662     | 2036/6/20  |
| 第3回神奈川県公募公債(20年)     | 2.11  |   | 500,000     | 510,320     | 2025/6/20  |
| 第4回神奈川県公募公債(30年)     | 2.62  |   | 100,000     | 115,205     | 2038/3/19  |
| 第19回神奈川県公募公債(20年)    | 1.818 |   | 100,000     | 107,335     | 2032/1/30  |
| 第20回神奈川県公募公債(20年)    | 1.706 |   | 500,000     | 532,470     | 2032/6/18  |
| 第27回神奈川県公募公債(20年)    | 1.398 |   | 100,000     | 102,952     | 2034/9/20  |
| 第226回神奈川県公募公債        | 0.195 |   | 100,000     | 99,251      | 2027/3/19  |
| 第234回神奈川県公募公債        | 0.254 |   | 100,000     | 98,830      | 2028/6/20  |
| 第243回神奈川県公募公債        | 0.075 |   | 100,000     | 96,864      | 2029/12/20 |

| 銘柄                    | 利率    | 当期末     |         |         | 償還年月日      |
|-----------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
|                       |       | 額面金額    | 評価額     | 千円      |            |
| 地方債証券                 | %     |         |         | 千円      |            |
| 第256回神奈川県公募公債         | 0.269 | 350,000 | 334,901 | 334,901 | 2032/3/19  |
| 第7回大阪府公募公債(20年)       | 1.84  | 220,000 | 236,277 | 236,277 | 2031/9/26  |
| 第11回大阪府公募公債(20年)      | 1.693 | 100,000 | 106,265 | 106,265 | 2033/9/27  |
| 第179回大阪府公募公債(5年)      | 0.001 | 100,000 | 99,371  | 99,371  | 2026/1/28  |
| 第184回大阪府公募公債(5年)      | 0.001 | 120,000 | 118,900 | 118,900 | 2026/6/29  |
| 第186回大阪府公募公債(5年)      | 0.001 | 300,000 | 297,042 | 297,042 | 2026/8/28  |
| 第191回大阪府公募公債(5年)      | 0.001 | 160,000 | 158,072 | 158,072 | 2027/1/28  |
| 第400回大阪府公募公債          | 0.531 | 136,000 | 136,450 | 136,450 | 2025/9/29  |
| 第407回大阪府公募公債          | 0.09  | 200,000 | 198,738 | 198,738 | 2026/4/27  |
| 第410回大阪府公募公債          | 0.001 | 200,000 | 198,100 | 198,100 | 2026/7/28  |
| 第415回大阪府公募公債          | 0.142 | 100,000 | 99,215  | 99,215  | 2026/12/25 |
| 第417回大阪府公募公債          | 0.248 | 300,000 | 298,278 | 298,278 | 2027/2/26  |
| 第418回大阪府公募公債          | 0.22  | 800,000 | 794,520 | 794,520 | 2027/3/30  |
| 第420回大阪府公募公債          | 0.17  | 100,000 | 99,099  | 99,099  | 2027/5/28  |
| 第426回大阪府公募公債          | 0.172 | 100,000 | 98,855  | 98,855  | 2027/11/29 |
| 第435回大阪府公募公債          | 0.2   | 130,000 | 128,012 | 128,012 | 2028/8/30  |
| 第439回大阪府公募公債          | 0.193 | 100,000 | 98,170  | 98,170  | 2028/12/27 |
| 第455回大阪府公募公債          | 0.116 | 148,000 | 143,259 | 143,259 | 2030/4/26  |
| 第460回大阪府公募公債          | 0.115 | 194,000 | 186,911 | 186,911 | 2030/9/27  |
| 第464回大阪府公募公債          | 0.072 | 800,000 | 765,568 | 765,568 | 2031/1/28  |
| 第465回大阪府公募公債          | 0.12  | 500,000 | 479,640 | 479,640 | 2031/2/25  |
| 第467回大阪府公募公債          | 0.164 | 200,000 | 192,054 | 192,054 | 2031/4/28  |
| 第471回大阪府公募公債          | 0.083 | 97,000  | 92,170  | 92,170  | 2031/8/29  |
| 第483回大阪府公募公債          | 0.799 | 200,000 | 198,016 | 198,016 | 2033/1/28  |
| 平成26年度第2回京都府公募公債(15年) | 1.071 | 200,000 | 204,340 | 204,340 | 2029/4/27  |
| 平成26年度第5回京都府公募公債(20年) | 1.455 | 100,000 | 103,593 | 103,593 | 2034/8/10  |
| 令和6年度第1回京都府公募公債(5年)   | 0.482 | 200,000 | 198,774 | 198,774 | 2029/4/16  |
| 第1回兵庫県公募公債(15年)       | 1.66  | 400,000 | 410,728 | 410,728 | 2026/7/29  |
| 第2回兵庫県公募公債(20年)       | 2.37  | 300,000 | 318,633 | 318,633 | 2027/9/17  |
| 第2回兵庫県公募公債(30年)       | 2.36  | 90,000  | 99,854  | 99,854  | 2040/3/19  |
| 第4回兵庫県公募公債(12年)       | 0.73  | 300,000 | 301,989 | 301,989 | 2026/8/6   |
| 第5回兵庫県公募公債(12年)       | 0.687 | 400,000 | 402,628 | 402,628 | 2027/7/7   |
| 第5回兵庫県公募公債(15年)       | 1.31  | 200,000 | 206,084 | 206,084 | 2028/5/26  |
| 第6回兵庫県公募公債(15年)       | 1.35  | 100,000 | 103,277 | 103,277 | 2028/7/14  |
| 第9回兵庫県公募公債(15年)       | 1.02  | 800,000 | 815,584 | 815,584 | 2029/7/13  |
| 第9回兵庫県公募公債(20年)       | 2.25  | 200,000 | 217,260 | 217,260 | 2029/11/19 |
| 第27回兵庫県公募公債(20年)      | 0.387 | 200,000 | 181,222 | 181,222 | 2036/5/12  |
| 平成28年度第29回兵庫県公募公債     | 0.238 | 100,000 | 99,403  | 99,403  | 2027/2/19  |
| 令和5年度第4回兵庫県公募公債(グリーン) | 0.661 | 100,000 | 97,501  | 97,501  | 2033/6/20  |
| 令和5年度第5回兵庫県公募公債       | 0.815 | 100,000 | 98,538  | 98,538  | 2033/9/22  |
| 令和6年度第1回兵庫県公募公債(5年)   | 0.541 | 100,000 | 99,669  | 99,669  | 2029/4/23  |
| 令和6年度第2回兵庫県公募公債       | 0.938 | 200,000 | 198,416 | 198,416 | 2034/4/21  |
| 第1回静岡県公募公債(15年)       | 1.514 | 100,000 | 102,976 | 102,976 | 2027/3/19  |
| 第6回静岡県公募公債(15年)       | 1.062 | 300,000 | 306,510 | 306,510 | 2029/6/25  |
| 第11回静岡県公募公債(20年)      | 1.841 | 550,000 | 588,885 | 588,885 | 2030/10/18 |

| 銘柄                     | 利     | 当期末     |         |            | 償還年月日 |
|------------------------|-------|---------|---------|------------|-------|
|                        |       | 額面金額    | 評価額     | 千円         |       |
| 地方債証券                  | %     |         |         | 千円         |       |
| 第14回静岡県公募公債(20年)       | 1.736 | 100,000 | 106,762 | 2032/6/18  |       |
| 平成27年度第10回静岡県公募公債      | 0.461 | 400,000 | 400,948 | 2025/9/19  |       |
| 令和2年度第15回静岡県公募公債(5年)   | 0.01  | 120,000 | 119,139 | 2026/3/19  |       |
| 令和2年度第13回静岡県公募公債(5年)   | 0.01  | 120,000 | 119,139 | 2026/3/19  |       |
| 平成20年度第8回愛知県公募公債(20年)  | 2.04  | 200,000 | 213,014 | 2028/12/20 |       |
| 平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)  | 2.28  | 700,000 | 757,918 | 2029/6/20  |       |
| 平成23年度第13回愛知県公募公債      | 1.529 | 500,000 | 513,485 | 2026/11/13 |       |
| 平成24年度第14回愛知県公募公債(15年) | 1.314 | 300,000 | 308,547 | 2027/12/13 |       |
| 平成27年度第7回愛知県公募公債       | 0.548 | 100,000 | 100,352 | 2025/7/28  |       |
| 平成27年度第16回愛知県公募公債      | 0.454 | 100,000 | 100,175 | 2025/12/25 |       |
| 平成29年度第5回愛知県公募公債       | 0.2   | 600,000 | 594,906 | 2027/6/29  |       |
| 平成30年度第5回愛知県公募公債       | 0.195 | 100,000 | 98,583  | 2028/6/29  |       |
| 平成30年度第8回愛知県公募公債       | 0.255 | 200,000 | 197,402 | 2028/8/31  |       |
| 令和3年度第18回愛知県公募公債       | 0.274 | 100,000 | 95,672  | 2032/3/30  |       |
| 令和5年度第8回愛知県公募公債        | 0.772 | 100,000 | 98,127  | 2033/9/20  |       |
| 令和6年度第1回愛知県公募公債(5年)    | 0.477 | 100,000 | 99,388  | 2029/4/12  |       |
| 平成23年度第1回広島県公募公債(20年)  | 1.83  | 100,000 | 107,319 | 2031/9/22  |       |
| 平成28年度第1回広島県公募公債       | 0.08  | 100,000 | 99,304  | 2026/5/25  |       |
| 平成28年度第4回広島県公募公債       | 0.06  | 100,000 | 99,046  | 2026/11/25 |       |
| 平成28年度第1回広島県公募公債(20年)  | 0.414 | 100,000 | 90,311  | 2036/9/26  |       |
| 平成30年度第4回広島県公募公債       | 0.259 | 200,000 | 197,082 | 2028/11/22 |       |
| 令和3年度第7回広島県公募公債        | 0.244 | 100,000 | 95,493  | 2032/3/25  |       |
| 第2回埼玉県公募公債(サステナビリティ)   | 0.782 | 100,000 | 98,320  | 2033/8/29  |       |
| 第3回埼玉県公募公債             | 0.875 | 200,000 | 198,012 | 2033/10/18 |       |
| 第4回埼玉県公募公債             | 0.995 | 200,000 | 199,528 | 2034/5/19  |       |
| 第9回埼玉県公募公債(20年)        | 2.15  | 200,000 | 217,360 | 2030/5/24  |       |
| 第10回埼玉県公募公債(20年)       | 1.94  | 100,000 | 107,723 | 2030/11/12 |       |
| 第14回埼玉県公募公債(20年)       | 1.546 | 200,000 | 209,246 | 2034/5/8   |       |
| 第16回埼玉県公募公債(20年)       | 1.216 | 100,000 | 100,405 | 2035/8/14  |       |
| 平成29年度第1回埼玉県公募公債       | 0.205 | 100,000 | 99,245  | 2027/4/19  |       |
| 平成29年度第3回埼玉県公募公債       | 0.175 | 200,000 | 198,234 | 2027/5/24  |       |
| 平成30年度第4回埼玉県公募公債       | 0.205 | 100,000 | 98,627  | 2028/6/26  |       |
| 令和2年度第1回埼玉県公募公債        | 0.131 | 100,000 | 96,897  | 2030/4/15  |       |
| 令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)    | 0.01  | 110,000 | 109,159 | 2026/4/15  |       |
| 平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)  | 2.62  | 70,000  | 80,694  | 2037/9/18  |       |
| 平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)  | 2.28  | 80,000  | 88,505  | 2038/9/17  |       |
| 平成21年度第2回福岡県公募公債(20年)  | 2.23  | 200,000 | 217,676 | 2030/2/22  |       |
| 平成22年度第2回福岡県公募公債(20年)  | 2.116 | 800,000 | 872,256 | 2031/2/21  |       |
| 平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)  | 1.491 | 800,000 | 821,032 | 2026/11/27 |       |
| 平成27年度第7回福岡県公募公債       | 0.464 | 100,000 | 100,191 | 2025/12/25 |       |
| 令和2年度第4回福岡県公募公債        | 0.14  | 200,000 | 193,078 | 2030/9/20  |       |
| 令和5年度第1回福岡県公募公債(グリーン)  | 0.681 | 100,000 | 97,754  | 2033/5/30  |       |
| 令和5年度第3回福岡県公募公債        | 0.656 | 100,000 | 97,502  | 2033/6/13  |       |
| 第9回千葉県公募公債(20年)        | 1.84  | 80,000  | 85,635  | 2030/10/11 |       |
| 第13回千葉県公募公債(20年)       | 1.701 | 300,000 | 319,485 | 2032/10/15 |       |

| 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      |            |
| 第14回千葉県公募公債(20年)          |     | 1.137 | 100,000 | 101,642 | 2033/4/15  |
| 平成27年度第3回千葉県公募公債          |     | 0.524 | 200,000 | 200,632 | 2025/6/25  |
| 平成27年度第6回千葉県公募公債          |     | 0.469 | 500,000 | 500,995 | 2025/12/25 |
| 平成27年度第9回千葉県公募公債          |     | 0.095 | 200,000 | 198,868 | 2026/3/25  |
| 平成28年度第3回千葉県公募公債          |     | 0.05  | 400,000 | 396,644 | 2026/7/24  |
| 平成30年度第6回千葉県公募公債          |     | 0.145 | 100,000 | 97,896  | 2029/1/25  |
| 令和元年度第6回千葉県公募公債           |     | 0.135 | 100,000 | 97,112  | 2030/1/25  |
| 令和5年度第7回千葉県公募公債(サステナビリティ) |     | 0.747 | 100,000 | 97,912  | 2033/9/22  |
| 令和5年度第8回千葉県公募公債           |     | 0.875 | 100,000 | 99,004  | 2033/10/25 |
| 令和6年度第1回千葉県公募公債           |     | 0.87  | 300,000 | 295,641 | 2034/4/25  |
| 平成27年度第2回新潟県公募公債          |     | 0.215 | 100,000 | 99,679  | 2026/2/26  |
| 令和4年度第1回長野県公募公債           |     | 0.299 | 300,000 | 287,364 | 2032/4/23  |
| 令和5年度第2回長野県公募公債           |     | 0.767 | 100,000 | 98,083  | 2033/9/22  |
| 第2回群馬県公募公債(20年)           |     | 2.019 | 100,000 | 108,620 | 2031/7/18  |
| 第7回群馬県公募公債(20年)           |     | 0.313 | 100,000 | 89,638  | 2036/6/13  |
| 平成27年度第1回岐阜県公募公債          |     | 0.515 | 300,000 | 300,930 | 2025/9/30  |
| 令和2年度第2回岐阜県公募公債(5年)       |     | 0.02  | 100,000 | 99,533  | 2025/11/25 |
| 平成27年度第1回大分県公募公債          |     | 0.476 | 203,400 | 203,892 | 2025/10/30 |
| 第2回共同発行市場公募地方債(グリーン)      |     | 0.893 | 200,000 | 197,536 | 2034/3/24  |
| 第148回共同発行市場公募地方債          |     | 0.553 | 500,000 | 501,780 | 2025/7/25  |
| 第150回共同発行市場公募地方債          |     | 0.51  | 200,000 | 200,614 | 2025/9/25  |
| 第151回共同発行市場公募地方債          |     | 0.466 | 200,000 | 200,464 | 2025/10/24 |
| 第152回共同発行市場公募地方債          |     | 0.496 | 700,000 | 701,827 | 2025/11/25 |
| 第153回共同発行市場公募地方債          |     | 0.469 | 200,000 | 200,398 | 2025/12/25 |
| 第157回共同発行市場公募地方債          |     | 0.08  | 500,000 | 496,810 | 2026/4/24  |
| 第158回共同発行市場公募地方債          |     | 0.08  | 200,000 | 198,608 | 2026/5/25  |
| 第159回共同発行市場公募地方債          |     | 0.07  | 500,000 | 496,165 | 2026/6/25  |
| 第172回共同発行市場公募地方債          |     | 0.225 | 100,000 | 99,197  | 2027/7/23  |
| 第173回共同発行市場公募地方債          |     | 0.215 | 400,000 | 396,504 | 2027/8/25  |
| 第185回共同発行市場公募地方債          |     | 0.245 | 300,000 | 296,058 | 2028/8/25  |
| 第193回共同発行市場公募地方債          |     | 0.1   | 100,000 | 97,478  | 2029/4/25  |
| 第198回共同発行市場公募地方債          |     | 0.05  | 100,000 | 96,906  | 2029/9/25  |
| 第205回共同発行市場公募地方債          |     | 0.135 | 100,000 | 96,907  | 2030/4/25  |
| 第206回共同発行市場公募地方債          |     | 0.131 | 100,000 | 96,818  | 2030/5/24  |
| 第207回共同発行市場公募地方債          |     | 0.15  | 100,000 | 96,859  | 2030/6/25  |
| 第232回共同発行市場公募地方債          |     | 0.364 | 450,000 | 432,081 | 2032/7/23  |
| 令和元年度第3回堺市公募公債            |     | 0.11  | 100,000 | 97,055  | 2029/12/19 |
| 平成27年度第1回長崎県公募公債          |     | 0.515 | 300,000 | 300,930 | 2025/9/30  |
| 平成27年度第1回佐賀県公募公債          |     | 0.476 | 500,000 | 501,120 | 2025/11/28 |
| 平成29年度第1回佐賀県公募公債          |     | 0.19  | 100,000 | 98,917  | 2027/11/30 |
| 平成30年度第1回福島県公募公債          |     | 0.264 | 100,000 | 98,557  | 2028/11/30 |
| 第2回滋賀県公募公債(サステナビリティ)      |     | 0.795 | 100,000 | 98,321  | 2033/9/29  |
| 令和元年度第2回栃木県公募公債           |     | 0.09  | 100,000 | 96,980  | 2029/11/29 |
| 令和2年度第2回栃木県公募公債           |     | 0.135 | 100,000 | 96,285  | 2030/11/27 |
| 令和3年度第1回熊本県公募公債(5年)       |     | 0.005 | 200,000 | 198,112 | 2026/7/30  |

| 銘柄                     | 当期末   |   |         |         |            |
|------------------------|-------|---|---------|---------|------------|
|                        | 利     | 率 | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 地方債証券                  |       | % | 千円      | 千円      |            |
| 令和5年度第2回奈良県公募公債        | 0.752 |   | 200,000 | 196,610 | 2033/6/20  |
| 令和6年度第1回奈良県公募公債(5年)    | 0.575 |   | 100,000 | 99,904  | 2029/3/19  |
| 第5回大阪市公募公債(20年)        | 2.47  |   | 100,000 | 108,152 | 2028/9/21  |
| 第15回大阪市公募公債(20年)       | 2.12  |   | 100,000 | 108,995 | 2031/1/24  |
| 令和2年度第3回大阪市公募公債(5年)    | 0.02  |   | 500,000 | 498,270 | 2025/9/11  |
| 令和6年度第1回大阪市公募公債(5年)    | 0.58  |   | 300,000 | 299,640 | 2029/5/22  |
| 令和6年度第2回大阪市公募公債        | 0.995 |   | 200,000 | 199,436 | 2034/5/22  |
| 第1回名古屋市公募公債(30年)       | 2.53  |   | 100,000 | 114,100 | 2035/3/20  |
| 第9回名古屋市公募公債(20年)       | 2.07  |   | 100,000 | 106,642 | 2028/12/20 |
| 第9回名古屋市公募公債(30年)       | 2.095 |   | 90,000  | 94,944  | 2042/9/19  |
| 第28回名古屋市公募公債(5年)       | 0.01  |   | 500,000 | 497,325 | 2025/12/19 |
| 第33回名古屋市公募公債(5年)       | 0.58  |   | 300,000 | 299,712 | 2029/5/18  |
| 第491回名古屋市公募公債          | 0.587 |   | 400,000 | 401,544 | 2025/6/19  |
| 第511回名古屋市公募公債          | 0.075 |   | 100,000 | 96,633  | 2030/3/27  |
| 第1回京都市公募公債(15年)        | 0.781 |   | 100,000 | 100,324 | 2030/12/20 |
| 第3回京都市公募公債(20年)        | 2.09  |   | 100,000 | 102,789 | 2025/12/19 |
| 第5回京都市公募公債(20年)        | 2.36  |   | 50,000  | 52,468  | 2026/12/18 |
| 令和5年度第7回京都市公募公債(5年)    | 0.482 |   | 100,000 | 99,371  | 2029/3/21  |
| 平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)  | 2.54  |   | 110,000 | 114,833 | 2026/6/19  |
| 平成20年度第24回神戸市公募公債(20年) | 2.08  |   | 200,000 | 213,372 | 2028/12/20 |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債       | 1.895 |   | 100,000 | 107,363 | 2030/9/13  |
| 平成23年度第4回神戸市公募公債(20年)  | 1.913 |   | 150,000 | 161,860 | 2031/9/12  |
| 令和6年度第1回神戸市公募公債(5年)    | 0.477 |   | 300,000 | 298,086 | 2029/4/20  |
| 第5回横浜市公募公債(20年)        | 2.17  |   | 100,000 | 102,130 | 2025/6/20  |
| 第7回横浜市公募公債(20年)        | 2.06  |   | 450,000 | 462,334 | 2025/12/19 |
| 第19回横浜市公募公債(20年)       | 2.2   |   | 200,000 | 216,182 | 2029/8/31  |
| 平成27年度第2回横浜市公募公債       | 0.568 |   | 200,000 | 200,714 | 2025/6/16  |
| 平成27年度第3回横浜市公募公債       | 0.524 |   | 400,000 | 401,304 | 2025/8/18  |
| 平成27年度第4回横浜市公募公債       | 0.486 |   | 300,000 | 300,777 | 2025/10/20 |
| 第27回横浜市公募公債(20年)       | 1.599 |   | 100,000 | 105,611 | 2033/5/20  |
| 第33回横浜市公募公債(20年)       | 0.323 |   | 100,000 | 89,971  | 2036/4/28  |
| 第35回横浜市公募公債(20年)       | 0.443 |   | 500,000 | 452,325 | 2036/10/28 |
| 第54回横浜市公募公債(5年)        | 0.02  |   | 300,000 | 298,599 | 2025/11/25 |
| 第64回横浜市公募公債(5年)        | 0.477 |   | 800,000 | 795,104 | 2029/4/12  |
| 平成22年度第8回札幌市公募公債(30年)  | 2.277 |   | 80,000  | 87,591  | 2040/9/20  |
| 平成23年度第3回札幌市公募公債       | 1.944 |   | 100,000 | 108,104 | 2031/7/29  |
| 平成23年度第9回札幌市公募公債       | 1.493 |   | 600,000 | 616,926 | 2027/2/12  |
| 令和2年度第7回札幌市公募公債        | 0.115 |   | 200,000 | 192,186 | 2030/12/20 |
| 令和3年度第2回札幌市公募公債(5年)    | 0.01  |   | 100,000 | 99,114  | 2026/6/19  |
| 令和3年度第9回札幌市公募公債(5年)    | 0.046 |   | 500,000 | 494,870 | 2026/12/18 |
| 第7回川崎市公募公債(20年)        | 2.08  |   | 100,000 | 107,349 | 2029/7/17  |
| 第12回川崎市公募公債(20年)       | 2.04  |   | 100,000 | 108,680 | 2031/5/30  |
| 第62回川崎市公募公債(5年)        | 0.005 |   | 490,000 | 485,374 | 2026/7/30  |
| 第3回北九州市公募公債(サステナビリティ)  | 0.747 |   | 100,000 | 97,912  | 2033/9/22  |
| 第17回北九州市公募公債(20年)      | 1.529 |   | 100,000 | 104,368 | 2034/6/20  |

| 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>               |     | %     | 千円         | 千円         |            |
| 令和3年度第1回北九州市公募公債(5年)       |     | 0.005 | 200,000    | 197,974    | 2026/9/28  |
| 2020年度第9回福岡市公募公債(5年)       |     | 0.01  | 200,000    | 198,920    | 2025/12/25 |
| 2023年度第8回福岡市公募公債           |     | 0.831 | 100,000    | 98,215     | 2034/3/15  |
| 2024年度第1回福岡市公募公債(5年)       |     | 0.482 | 200,000    | 198,774    | 2029/4/16  |
| 令和3年度第4回千葉市公募公債            |     | 0.135 | 100,000    | 94,990     | 2031/12/24 |
| 令和5年度第4回千葉市公募公債(サステナビリティ)  |     | 0.782 | 100,000    | 98,557     | 2033/6/20  |
| 第21回さいたま市公募公債              |     | 0.861 | 170,000    | 167,788    | 2033/12/23 |
| 令和5年度第2回鹿児島県公募公債(5年)       |     | 0.482 | 100,000    | 99,372     | 2029/3/19  |
| 令和2年度第2回徳島県公募公債            |     | 0.135 | 100,000    | 96,285     | 2030/11/27 |
| 平成28年度第1回山梨県公募公債           |     | 0.06  | 200,000    | 198,144    | 2026/10/30 |
| 平成30年度第1回山梨県公募公債           |     | 0.289 | 100,000    | 98,733     | 2028/10/30 |
| 令和2年度第1回山梨県公募公債            |     | 0.135 | 700,000    | 674,716    | 2030/10/30 |
| 第96回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券  |     | 2.34  | 100,000    | 106,989    | 2028/12/20 |
| 小計                         |     |       | 48,280,400 | 48,581,318 |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         |     |       |            |            |            |
| 第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 2.3   | 100,000    | 110,575    | 2040/2/29  |
| 第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 2.2   | 100,000    | 108,988    | 2040/5/31  |
| 第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 1.8   | 100,000    | 103,108    | 2040/8/31  |
| 第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 1.9   | 100,000    | 107,610    | 2030/9/30  |
| 第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 1.8   | 100,000    | 107,286    | 2031/10/31 |
| 第158回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 2.0   | 100,000    | 104,874    | 2042/2/28  |
| 第162回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 1.737 | 100,000    | 106,904    | 2032/4/30  |
| 第165回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 1.83  | 100,000    | 102,043    | 2042/5/30  |
| 第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 1.39  | 100,000    | 103,199    | 2034/8/31  |
| 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.484 | 101,000    | 101,306    | 2025/6/30  |
| 第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.557 | 100,000    | 100,396    | 2025/7/31  |
| 第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.386 | 100,000    | 100,154    | 2025/10/31 |
| 第263回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.379 | 200,000    | 200,206    | 2025/12/26 |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.32  | 100,000    | 99,965     | 2026/1/30  |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.145 | 200,000    | 199,250    | 2026/2/27  |
| 第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.02  | 300,000    | 297,864    | 2026/4/30  |
| 第276回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.02  | 300,000    | 297,717    | 2026/5/29  |
| 第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.145 | 100,000    | 98,551     | 2028/5/31  |
| 第437回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.251 | 1,000,000  | 990,340    | 2028/4/28  |
| 第443回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 |     | 0.15  | 300,000    | 295,560    | 2028/6/30  |
| 第73回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.484 | 302,000    | 302,893    | 2025/6/13  |
| 第76回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.425 | 400,000    | 400,928    | 2025/9/12  |
| 第77回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.386 | 100,000    | 100,164    | 2025/10/15 |
| 第78回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.381 | 150,000    | 150,205    | 2025/11/18 |
| 第81回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.145 | 100,000    | 99,640     | 2026/2/16  |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.02  | 674,000    | 669,760    | 2026/3/13  |
| 第83回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.02  | 102,000    | 101,296    | 2026/4/17  |
| 第91回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.085 | 1,300,000  | 1,289,002  | 2026/12/14 |
| 第94回政府保証地方公共団体金融機構債券       |     | 0.145 | 100,000    | 99,211     | 2027/3/15  |
| 第100回政府保証地方公共団体金融機構債券      |     | 0.09  | 325,000    | 321,031    | 2027/9/17  |

| 銘柄                            | 当期末 |       |           |           |            |
|-------------------------------|-----|-------|-----------|-----------|------------|
|                               | 利   | 率     | 額面金額      | 評価額       | 償還年月日      |
| 特殊債券(除く金融債)                   |     | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第101回政府保証地方公共団体金融機関債券         |     | 0.17  | 100,000   | 99,021    | 2027/10/15 |
| 第102回政府保証地方公共団体金融機関債券         |     | 0.16  | 131,000   | 129,619   | 2027/11/15 |
| 第108回政府保証地方公共団体金融機関債券         |     | 0.145 | 223,000   | 219,840   | 2028/5/19  |
| 第115回政府保証地方公共団体金融機関債券         |     | 0.16  | 200,000   | 196,378   | 2028/12/15 |
| 第4回政府保証新関西国際空港債券              |     | 0.484 | 904,000   | 906,730   | 2025/6/13  |
| 第19回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券     |     | 0.001 | 500,000   | 496,000   | 2026/5/29  |
| 第21回政府保証原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券     |     | 0.001 | 600,000   | 598,548   | 2025/6/30  |
| 第6回神奈川県住宅供給公社債券               |     | 0.215 | 100,000   | 97,100    | 2029/4/23  |
| 第36回日本政策投資銀行債券(財投機関債)         |     | 2.23  | 30,000    | 31,540    | 2027/5/28  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)   |     | 2.99  | 100,000   | 118,067   | 2045/9/20  |
| 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)   |     | 2.45  | 140,000   | 145,147   | 2026/3/19  |
| 第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.35  | 300,000   | 313,041   | 2026/9/18  |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.87  | 30,000    | 34,782    | 2046/12/20 |
| 第19回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.75  | 200,000   | 227,538   | 2047/3/20  |
| 第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.28  | 200,000   | 210,270   | 2027/4/20  |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.67  | 110,000   | 123,539   | 2047/3/20  |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.39  | 300,000   | 317,586   | 2027/7/20  |
| 第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 2.34  | 200,000   | 212,190   | 2027/10/20 |
| 第28回道路債券(財投機関債)               |     | 2.83  | 100,000   | 115,711   | 2033/12/20 |
| 第33回道路債券(財投機関債)               |     | 2.91  | 300,000   | 349,719   | 2034/6/20  |
| 第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 1.9   | 150,000   | 161,187   | 2032/3/19  |
| 第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債)  |     | 1.773 | 100,000   | 106,504   | 2032/9/17  |
| 第145回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |     | 1.523 | 100,000   | 93,511    | 2044/12/20 |
| 第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |     | 1.133 | 300,000   | 297,324   | 2035/3/20  |
| 第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |     | 1.974 | 100,000   | 96,117    | 2055/3/19  |
| 第160回日本高速道路保有・債務返済機構債券(財投機関債) |     | 1.284 | 100,000   | 100,388   | 2035/9/20  |
| 第1回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)   |     | 2.266 | 50,000    | 53,997    | 2029/6/28  |
| 第4回公営企業債券(30年)(財投機関債)         |     | 2.95  | 100,000   | 117,315   | 2034/3/24  |
| 第11回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 1.851 | 100,000   | 106,862   | 2030/10/28 |
| 第13回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 2.132 | 100,000   | 108,807   | 2031/1/28  |
| 第14回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 2.187 | 80,000    | 87,380    | 2031/4/28  |
| 第16回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 1.846 | 80,000    | 85,625    | 2031/8/28  |
| 第17回公営企業債券(20年)(財投機関債)        |     | 2.39  | 150,000   | 155,391   | 2026/3/24  |
| 第22回公営企業債券(20年)(財投機関債)        |     | 2.32  | 1,000,000 | 1,055,210 | 2027/6/18  |
| 第23回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 1.68  | 100,000   | 105,810   | 2032/7/28  |
| 第24回公営企業債券(20年)(財投機関債)        |     | 2.29  | 300,000   | 320,007   | 2028/4/25  |
| 第24回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 1.702 | 200,000   | 212,028   | 2032/9/28  |
| 第27回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 1.785 | 50,000    | 53,334    | 2033/1/28  |
| 第29回地方公共団体金融機関債券(5年)(財投機関債)   |     | 0.005 | 500,000   | 494,750   | 2026/7/28  |
| 第44回地方公共団体金融機関債券(20年)(財投機関債)  |     | 1.298 | 100,000   | 100,608   | 2035/6/28  |
| 第77回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)       |     | 0.491 | 300,000   | 300,570   | 2025/10/28 |
| F 90回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)      |     | 1.609 | 100,000   | 103,854   | 2028/1/28  |
| F 131回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)     |     | 1.546 | 70,000    | 73,465    | 2031/7/30  |
| F 134回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)     |     | 1.348 | 300,000   | 308,847   | 2028/3/17  |
| F 151回地方公共団体金融機関債券(財投機関債)     |     | 1.348 | 100,000   | 102,761   | 2027/11/5  |

| 銘柄                        | 当期末   |   |         |         |            |
|---------------------------|-------|---|---------|---------|------------|
|                           | 利     | 率 | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 特殊債券(除く金融債)               | %     |   | 千円      | 千円      |            |
| F 203回地方公共団体金融機関債券(財投機関債) | 1.063 |   | 200,000 | 203,746 | 2028/2/28  |
| F 234回地方公共団体金融機関債券(財投機関債) | 1.605 |   | 100,000 | 103,868 | 2035/4/27  |
| 第27回首都高速道路                | 0.06  |   | 100,000 | 99,418  | 2025/12/19 |
| 第10回日本政策金融公庫(財投機関債)       | 2.167 |   | 80,000  | 86,645  | 2030/3/19  |
| 第15回日本政策金融公庫(財投機関債)       | 1.911 |   | 80,000  | 85,681  | 2030/10/29 |
| 第48回福祉医療機関債券(財投機関債)       | 0.175 |   | 400,000 | 396,660 | 2026/12/18 |
| 第54回福祉医療機関債券(財投機関債)       | 0.225 |   | 100,000 | 98,496  | 2028/6/20  |
| 第4回中部国際空港(財投機関債)          | 0.305 |   | 200,000 | 198,570 | 2027/2/22  |
| 第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券     | 0.18  |   | 28,640  | 28,273  | 2032/5/10  |
| 第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券     | 0.16  |   | 29,986  | 29,652  | 2033/1/10  |
| 第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券     | 0.08  |   | 34,682  | 34,169  | 2033/4/10  |
| 第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券     | 0.13  |   | 49,638  | 48,691  | 2034/6/10  |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.95  |   | 17,886  | 18,579  | 2044/10/10 |
| 第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.89  |   | 17,821  | 18,472  | 2044/12/10 |
| 第33回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.88  |   | 18,136  | 18,789  | 2045/2/10  |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.87  |   | 17,608  | 18,234  | 2045/4/10  |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.81  |   | 33,562  | 34,652  | 2045/5/10  |
| 第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.71  |   | 34,846  | 35,925  | 2045/6/10  |
| 第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.61  |   | 18,987  | 19,540  | 2045/7/10  |
| 第40回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.36  |   | 36,766  | 37,517  | 2045/9/10  |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.6   |   | 21,889  | 22,607  | 2045/12/10 |
| 第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.77  |   | 82,976  | 86,126  | 2046/1/10  |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.79  |   | 51,525  | 53,230  | 2046/2/10  |
| 第47回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.92  |   | 14,851  | 15,314  | 2046/4/10  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.89  |   | 31,856  | 32,915  | 2046/5/10  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.76  |   | 32,576  | 33,570  | 2046/6/10  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.67  |   | 33,780  | 34,739  | 2046/7/10  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.64  |   | 35,550  | 36,578  | 2046/8/10  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.51  |   | 38,230  | 39,224  | 2046/9/10  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.48  |   | 40,358  | 41,397  | 2046/10/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.42  |   | 22,605  | 23,165  | 2047/1/10  |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.44  |   | 22,782  | 23,364  | 2047/2/10  |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.44  |   | 48,388  | 49,637  | 2047/4/10  |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.34  |   | 48,782  | 49,849  | 2047/5/10  |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.26  |   | 49,466  | 50,303  | 2047/6/10  |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.21  |   | 27,999  | 28,373  | 2047/7/10  |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.11  |   | 27,417  | 27,665  | 2047/8/10  |
| 第65回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.15  |   | 190,620 | 192,348 | 2047/10/10 |
| 第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.12  |   | 91,701  | 92,437  | 2047/11/10 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.25  |   | 28,709  | 29,145  | 2048/3/10  |
| 第74回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.32  |   | 32,258  | 32,807  | 2048/7/10  |
| 第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.21  |   | 27,156  | 27,532  | 2048/9/10  |
| 第77回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.751 |   | 30,000  | 30,793  | 2026/6/19  |
| 第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.08  |   | 28,392  | 28,609  | 2048/11/10 |
| 第81回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.07  |   | 32,000  | 32,158  | 2049/2/10  |

| 銘柄                         | 当期末 |       |         |         |            |
|----------------------------|-----|-------|---------|---------|------------|
|                            | 利   | 率     | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 特殊債券(除く金融債)                |     | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第83回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 1.04  | 34,607  | 34,665  | 2049/4/10  |
| 第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 1.01  | 135,172 | 135,266 | 2049/5/10  |
| 第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 1.02  | 70,408  | 70,430  | 2049/6/10  |
| 第88回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)  |     | 1.863 | 100,000 | 107,095 | 2031/11/18 |
| 第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 0.95  | 37,773  | 37,568  | 2049/10/10 |
| 第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 0.87  | 116,622 | 115,433 | 2049/11/10 |
| 第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 0.74  | 41,251  | 40,431  | 2050/1/10  |
| 第93回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債)  |     | 1.557 | 200,000 | 205,452 | 2026/12/18 |
| 第95回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 0.81  | 52,255  | 51,228  | 2050/4/10  |
| 第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 0.74  | 49,730  | 48,504  | 2050/5/10  |
| 第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       |     | 0.9   | 51,125  | 50,248  | 2050/7/10  |
| 第100回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) |     | 1.892 | 200,000 | 214,854 | 2032/4/16  |
| 第102回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) |     | 1.441 | 100,000 | 102,626 | 2027/3/19  |
| 第103回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.86  | 54,287  | 53,057  | 2050/12/10 |
| 第106回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.54  | 113,826 | 108,750 | 2051/3/10  |
| 第107回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.48  | 117,662 | 111,756 | 2051/4/10  |
| 第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.36  | 249,524 | 235,730 | 2051/6/10  |
| 第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.23  | 316,575 | 296,890 | 2051/7/10  |
| 第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.19  | 515,288 | 480,959 | 2051/8/10  |
| 第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.46  | 133,334 | 126,139 | 2052/2/10  |
| 第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.47  | 463,512 | 439,233 | 2052/3/10  |
| 第121回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) |     | 2.227 | 130,000 | 139,157 | 2042/9/19  |
| 第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.44  | 206,427 | 194,518 | 2052/7/10  |
| 第123回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) |     | 1.801 | 100,000 | 106,721 | 2032/9/17  |
| 第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.42  | 68,313  | 64,199  | 2052/10/10 |
| 第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.4   | 70,652  | 66,173  | 2052/12/10 |
| 第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.42  | 69,151  | 64,935  | 2053/1/10  |
| 第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.46  | 142,058 | 133,538 | 2053/2/10  |
| 第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.42  | 141,884 | 133,044 | 2053/3/10  |
| 第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.4   | 70,629  | 66,044  | 2053/4/10  |
| 第132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.4   | 70,105  | 65,580  | 2053/5/10  |
| 第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.42  | 214,116 | 200,491 | 2053/6/10  |
| 第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.39  | 72,003  | 67,181  | 2053/7/10  |
| 第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.44  | 73,001  | 68,328  | 2053/9/10  |
| 第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.47  | 146,690 | 137,562 | 2053/10/10 |
| 第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.5   | 145,478 | 136,788 | 2053/11/10 |
| 第143回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) |     | 1.192 | 100,000 | 102,449 | 2028/10/20 |
| 第147回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.21  | 154,452 | 141,289 | 2054/8/10  |
| 第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.15  | 234,405 | 213,165 | 2054/9/10  |
| 第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.21  | 238,764 | 218,008 | 2054/11/10 |
| 第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.26  | 161,718 | 148,091 | 2054/12/10 |
| 第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.33  | 80,234  | 73,930  | 2055/1/10  |
| 第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.34  | 161,584 | 148,835 | 2055/2/10  |
| 第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      |     | 0.37  | 83,350  | 76,817  | 2055/9/10  |
| 第161回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) |     | 0.713 | 100,000 | 100,572 | 2027/6/18  |

| 銘柄                         | 当期末   |   |         |         |            |
|----------------------------|-------|---|---------|---------|------------|
|                            | 利     | 率 | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 特殊債券(除く金融債)                | %     |   | 千円      | 千円      |            |
| 第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.35  |   | 168,884 | 155,354 | 2055/11/10 |
| 第164回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 0.514 |   | 100,000 | 100,239 | 2025/8/20  |
| 第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.36  |   | 85,251  | 78,400  | 2056/2/10  |
| 第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.4   |   | 256,449 | 236,369 | 2056/5/10  |
| 第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.39  |   | 173,996 | 160,111 | 2056/6/10  |
| 第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.36  |   | 174,098 | 160,009 | 2056/7/10  |
| 第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.31  |   | 176,090 | 161,004 | 2056/8/10  |
| 第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.31  |   | 87,636  | 80,111  | 2056/9/10  |
| 第174回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 1.129 |   | 180,000 | 177,199 | 2035/11/20 |
| 第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.36  |   | 89,716  | 82,312  | 2056/12/10 |
| 第176回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.32  |   | 178,670 | 163,145 | 2057/1/10  |
| 第177回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.4   |   | 179,176 | 164,736 | 2057/2/10  |
| 第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.48  |   | 89,509  | 82,960  | 2057/3/10  |
| 第179回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.46  |   | 180,274 | 166,529 | 2057/4/10  |
| 第180回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.5   |   | 90,265  | 83,839  | 2057/5/10  |
| 第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.5   |   | 90,762  | 84,201  | 2057/6/10  |
| 第182回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.5   |   | 183,548 | 170,112 | 2057/7/10  |
| 第183回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.53  |   | 183,272 | 170,180 | 2057/8/10  |
| 第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.5   |   | 185,086 | 171,376 | 2057/9/10  |
| 第186回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.74  |   | 93,233  | 88,397  | 2057/11/10 |
| 第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.02  |   | 186,570 | 181,138 | 2058/1/10  |
| 第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.09  |   | 94,067  | 91,859  | 2058/3/10  |
| 第191回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.95  |   | 94,834  | 92,113  | 2058/4/10  |
| 第192回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.04  |   | 378,580 | 370,520 | 2058/5/10  |
| 第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.96  |   | 95,563  | 92,807  | 2058/6/10  |
| 第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.94  |   | 95,875  | 92,948  | 2058/7/10  |
| 第194回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 0.075 |   | 100,000 | 98,999  | 2026/10/20 |
| 第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 0.93  |   | 194,318 | 188,078 | 2058/8/10  |
| 第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.02  |   | 291,615 | 284,715 | 2058/9/10  |
| 第197回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.08  |   | 195,046 | 191,299 | 2058/10/10 |
| 第198回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.18  |   | 195,288 | 193,257 | 2058/11/10 |
| 第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.11  |   | 391,924 | 385,539 | 2058/12/10 |
| 第200回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.05  |   | 296,040 | 290,048 | 2059/1/10  |
| 第201回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.0   |   | 296,358 | 288,969 | 2059/2/10  |
| 第202回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.08  |   | 99,456  | 97,990  | 2059/3/10  |
| 第203回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.14  |   | 399,120 | 394,849 | 2059/4/10  |
| 第203回一般担保住宅金融支援機構債券(財投機関債) | 0.24  |   | 100,000 | 99,224  | 2027/3/19  |
| 第204回貸付債権担保住宅金融支援機構債券      | 1.21  |   | 300,000 | 298,287 | 2059/5/10  |
| 第6回沖縄振興開発金融公庫債券(財投機関債)     | 2.04  |   | 50,000  | 50,963  | 2025/6/20  |
| 第7回国際協力機構債券(財投機関債)         | 1.991 |   | 70,000  | 75,545  | 2031/6/13  |
| 第83回東日本高速道路                | 0.05  |   | 400,000 | 396,132 | 2026/6/19  |
| 第111回東日本高速道路               | 0.607 |   | 200,000 | 199,014 | 2029/4/25  |
| 第29回西日本高速道路                | 0.31  |   | 200,000 | 199,494 | 2026/2/12  |
| 第56回西日本高速道路                | 0.06  |   | 900,000 | 896,301 | 2025/9/19  |
| 第61回西日本高速道路                | 0.04  |   | 700,000 | 693,084 | 2026/6/19  |

| 銘柄                           | 利 率   | 当 期 末      |            |            | 償還年月日      |
|------------------------------|-------|------------|------------|------------|------------|
|                              |       | 額面金額       | 評価額        | 千円         |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>           | %     |            |            | 千円         |            |
| 第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券(財投機関債) | 0.905 | 100,000    | 101,129    | 千円         | 2029/11/27 |
| 小計                           |       | 34,900,958 | 34,758,179 |            |            |
| <b>金融債券</b>                  |       |            |            |            |            |
| い第843号商工債券                   | 0.12  | 200,000    | 199,330    | 2025/8/27  |            |
| い第848号商工債券                   | 0.1   | 100,000    | 99,296     | 2026/1/27  |            |
| い第850号商工債券                   | 0.1   | 300,000    | 297,498    | 2026/3/27  |            |
| い第852号商工債券                   | 0.09  | 100,000    | 98,962     | 2026/5/27  |            |
| い第854号商工債券                   | 0.08  | 500,000    | 494,175    | 2026/7/27  |            |
| い第857号商工債券                   | 0.09  | 100,000    | 98,692     | 2026/10/27 |            |
| い第871号商工債券                   | 0.35  | 200,000    | 197,280    | 2027/12/27 |            |
| い第872号商工債券                   | 0.45  | 400,000    | 395,740    | 2028/1/27  |            |
| い第885号商工債券                   | 0.65  | 400,000    | 396,308    | 2029/2/27  |            |
| 第376回信金中金債                   | 0.05  | 100,000    | 99,183     | 2026/3/27  |            |
| 第32号商工債券(10年)                | 0.25  | 200,000    | 192,648    | 2029/12/20 |            |
| 第280号商工債券(3年)                | 0.22  | 200,000    | 198,448    | 2026/5/27  |            |
| 第2回信金中金債(10年)                | 0.52  | 100,000    | 100,218    | 2025/9/26  |            |
| 小計                           |       | 2,900,000  | 2,867,778  |            |            |
| <b>普通社債券</b>                 |       |            |            |            |            |
| 第548回東京電力                    | 2.347 | 100,000    | 102,178    | 2028/9/29  |            |
| 第567回東京電力                    | 1.958 | 100,000    | 99,961     | 2030/7/29  |            |
| 第566回中部電力                    | 1.071 | 300,000    | 295,476    | 2034/4/25  |            |
| 第508回関西電力                    | 0.455 | 200,000    | 198,494    | 2027/4/23  |            |
| 第510回関西電力                    | 0.49  | 500,000    | 496,095    | 2027/7/23  |            |
| 第511回関西電力                    | 0.41  | 100,000    | 98,888     | 2027/9/17  |            |
| 第518回関西電力                    | 0.44  | 200,000    | 197,018    | 2028/6/20  |            |
| 第524回関西電力                    | 0.514 | 200,000    | 196,946    | 2028/10/25 |            |
| 第400回中国電力                    | 0.34  | 200,000    | 197,498    | 2027/9/24  |            |
| 第409回中国電力                    | 0.4   | 200,000    | 196,328    | 2028/9/25  |            |
| 第446回中国電力                    | 0.7   | 100,000    | 97,663     | 2031/3/25  |            |
| 第448回中国電力                    | 0.92  | 200,000    | 194,386    | 2033/5/25  |            |
| 第322回北陸電力                    | 0.38  | 100,000    | 99,007     | 2027/6/25  |            |
| 第492回東北電力                    | 0.405 | 300,000    | 297,480    | 2027/4/23  |            |
| 第494回東北電力                    | 0.425 | 200,000    | 198,290    | 2027/6/25  |            |
| 第527回東北電力                    | 0.32  | 400,000    | 380,752    | 2031/2/25  |            |
| 第552回東北電力                    | 0.864 | 400,000    | 399,992    | 2028/12/25 |            |
| 第449回九州電力                    | 0.43  | 300,000    | 297,612    | 2027/4/23  |            |
| 第451回九州電力                    | 0.45  | 300,000    | 297,678    | 2027/5/25  |            |
| 第468回九州電力                    | 0.435 | 100,000    | 98,349     | 2028/8/25  |            |
| 第471回九州電力                    | 0.455 | 300,000    | 294,507    | 2028/11/24 |            |
| 第484回九州電力                    | 0.375 | 400,000    | 387,736    | 2029/11/22 |            |
| 第503回九州電力                    | 0.36  | 600,000    | 594,012    | 2027/4/23  |            |
| 第524回九州電力                    | 1.161 | 300,000    | 295,251    | 2034/4/25  |            |
| 第12回新関西国際空港                  | 1.067 | 100,000    | 101,526    | 2029/9/20  |            |
| 第27回新関西国際空港                  | 0.05  | 100,000    | 99,193     | 2026/3/19  |            |
| 第32回成田国際空港                   | 0.22  | 100,000    | 97,697     | 2029/1/29  |            |

| 銘柄                       | 利     | 当期末     |    |         | 償還年月日      |
|--------------------------|-------|---------|----|---------|------------|
|                          |       | 額       | 面  | 金額      |            |
| 普通社債券                    | %     |         | 千円 | 千円      |            |
| 第1回国際石油開発帝石              | 0.08  | 100,000 |    | 99,108  | 2026/3/16  |
| 第48回鹿島建設（サステナビリティ）       | 0.554 | 100,000 |    | 99,399  | 2028/3/16  |
| 第10回明治ホールディングス（サステナビリティ） | 0.05  | 200,000 |    | 198,078 | 2026/4/23  |
| 第16回アサヒグループホールディングス      | 0.08  | 100,000 |    | 99,193  | 2026/3/13  |
| 第19回アサヒグループホールディングス      | 0.28  | 400,000 |    | 398,280 | 2026/3/6   |
| 第21回キリンホールディングス（ソーシャル）   | 0.29  | 300,000 |    | 296,331 | 2027/6/7   |
| 第22回キリンホールディングス（ソーシャル）   | 0.673 | 100,000 |    | 99,405  | 2028/10/26 |
| 第9回サントリーホールディングス         | 0.3   | 500,000 |    | 495,295 | 2027/6/8   |
| 第22回味の素                  | 0.305 | 100,000 |    | 99,660  | 2026/3/2   |
| 第3回 キューピー                | 0.23  | 100,000 |    | 99,513  | 2026/2/13  |
| 第13回日本たばこ産業              | 0.355 | 400,000 |    | 392,564 | 2028/9/8   |
| 第16回日本たばこ産業              | 0.92  | 300,000 |    | 293,262 | 2033/4/20  |
| 第6回ヒューリック                | 0.494 | 400,000 |    | 392,372 | 2028/10/20 |
| 第13回ヒューリック               | 0.569 | 300,000 |    | 299,334 | 2027/4/16  |
| 第14回ヒューリック               | 0.806 | 300,000 |    | 299,268 | 2029/4/18  |
| 第24回森ヒルズリート投資法人（グリーン）    | 0.49  | 300,000 |    | 297,567 | 2026/11/27 |
| 第9回クレラ                   | 0.34  | 100,000 |    | 98,993  | 2027/4/30  |
| 第56回住友化学                 | 0.38  | 200,000 |    | 196,866 | 2027/9/13  |
| 第59回住友化学                 | 0.355 | 200,000 |    | 195,640 | 2028/4/17  |
| 第3回三菱ケミカルグループ            | 0.758 | 500,000 |    | 496,635 | 2028/12/5  |
| 第4回野村総合研究所               | 0.34  | 100,000 |    | 98,278  | 2028/3/23  |
| 第12回野村総合研究所              | 0.624 | 200,000 |    | 197,954 | 2028/12/7  |
| 第6回花王                    | 0.13  | 200,000 |    | 199,126 | 2025/9/19  |
| 第1回アステラス製薬               | 0.26  | 400,000 |    | 398,664 | 2025/12/5  |
| 第10回テルモ                  | 0.519 | 300,000 |    | 299,328 | 2027/4/23  |
| 第17回Zホールディングス            | 0.79  | 100,000 |    | 98,879  | 2027/6/11  |
| 第22回Zホールディングス            | 0.76  | 200,000 |    | 197,216 | 2027/9/15  |
| 第7回住友三井オートサービス（サステナビリティ） | 0.14  | 100,000 |    | 98,653  | 2026/10/22 |
| 第8回住友三井オートサービス（サステナビリティ） | 0.4   | 100,000 |    | 99,581  | 2026/2/17  |
| 第12回日本電気硝子               | 0.26  | 100,000 |    | 98,142  | 2028/2/25  |
| 第4回新日本製鐵                 | 0.375 | 200,000 |    | 197,950 | 2027/5/20  |
| 第36回ジェイ エフ イー ホールディングス   | 0.33  | 400,000 |    | 395,224 | 2027/6/9   |
| 第1回住友生命2023基金            | 0.705 | 400,000 |    | 393,824 | 2028/8/8   |
| 第14回LIXIL                | 0.475 | 200,000 |    | 197,676 | 2027/8/27  |
| 第1回日本郵政（グリーン）            | 0.255 | 100,000 |    | 98,538  | 2027/9/1   |
| 第4回日本郵政                  | 0.603 | 500,000 |    | 496,595 | 2028/10/24 |
| 第9回住友重機械工業               | 0.736 | 200,000 |    | 199,512 | 2029/4/18  |
| 第30回ダイキン工業               | 0.459 | 200,000 |    | 195,532 | 2029/7/27  |
| 第22回パナソニック               | 0.29  | 100,000 |    | 98,021  | 2027/12/24 |
| 第24回パナソニックホールディングス       | 0.709 | 300,000 |    | 297,531 | 2028/9/14  |
| 第25回パナソニックホールディングス       | 1.051 | 800,000 |    | 799,296 | 2030/9/13  |
| 第40回ソニーグループ              | 0.627 | 600,000 |    | 595,866 | 2029/3/7   |
| 第15回デンソー                 | 0.245 | 300,000 |    | 296,532 | 2027/6/18  |
| 第18回デンソー                 | 0.315 | 300,000 |    | 295,629 | 2028/3/17  |
| 第40回三菱重工業                | 0.31  | 300,000 |    | 295,812 | 2027/9/8   |

| 銘柄                        | 利     | 当期末       |           |            |       |
|---------------------------|-------|-----------|-----------|------------|-------|
|                           |       | 率         | 額面金額      | 評価額        | 償還年月日 |
| <b>普通社債券</b>              | %     | 千円        | 千円        |            |       |
| 第14回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 0.574 | 500,000   | 498,670   | 2027/4/19  |       |
| 第26回トヨタ自動車(サステナビリティ)      | 0.05  | 800,000   | 792,680   | 2026/3/18  |       |
| 第27回トヨタ自動車(サステナビリティ)      | 0.219 | 600,000   | 572,154   | 2031/3/18  |       |
| 第31回トヨタ自動車(サステナビリティ)      | 0.735 | 200,000   | 193,180   | 2033/6/1   |       |
| 第6回ヤマハ発動機                 | 0.569 | 100,000   | 99,805    | 2027/4/23  |       |
| 第1回明治安田生命2019基金           | 0.29  | 200,000   | 199,892   | 2024/8/2   |       |
| 第7回アシックス                  | 0.792 | 100,000   | 99,451    | 2028/12/14 |       |
| 第63回三井物産                  | 2.37  | 400,000   | 419,876   | 2027/4/23  |       |
| 第40回住友商事                  | 2.261 | 200,000   | 216,030   | 2030/5/27  |       |
| 第51回住友商事                  | 1.241 | 100,000   | 101,893   | 2029/4/23  |       |
| 第53回住友商事                  | 0.33  | 300,000   | 296,592   | 2027/7/26  |       |
| 第55回住友商事                  | 0.33  | 500,000   | 491,910   | 2028/4/13  |       |
| 第61回住友商事                  | 0.644 | 100,000   | 99,684    | 2028/3/1   |       |
| 第44回丸井グループ                | 0.629 | 100,000   | 98,613    | 2029/1/23  |       |
| 第101回クレディセゾン              | 0.599 | 500,000   | 498,585   | 2027/4/30  |       |
| 第3回三菱UFJフィナンシャル・グループ      | 0.724 | 300,000   | 299,583   | 2025/3/5   |       |
| 第17回三菱UFJフィナンシャル・グループ     | 0.535 | 500,000   | 486,115   | 2028/5/31  |       |
| 第23回三菱東京UFJ銀行劣後特約付        | 2.91  | 200,000   | 216,478   | 2029/10/16 |       |
| 第26回三菱東京UFJ銀行劣後特約付        | 1.95  | 200,000   | 202,884   | 2025/11/12 |       |
| 第29回三菱東京UFJ銀行劣後特約付        | 2.16  | 200,000   | 203,804   | 2026/1/20  |       |
| 第30回三菱東京UFJ銀行(劣後特約付)      | 2.46  | 100,000   | 106,163   | 2031/1/20  |       |
| 第88回三菱東京UFJ銀行             | 2.34  | 100,000   | 104,718   | 2027/4/20  |       |
| 第15回みずほフィナンシャルグループ劣後特約付   | 0.545 | 100,000   | 97,032    | 2028/6/12  |       |
| 第18回みずほ銀行(劣後特約付)          | 2.14  | 100,000   | 102,282   | 2026/9/11  |       |
| 第38回芙蓉総合リース(サステナビリティ)     | 0.808 | 400,000   | 399,168   | 2028/10/27 |       |
| 第40回芙蓉総合リース(サステナビリティ)     | 0.707 | 100,000   | 99,148    | 2029/2/28  |       |
| 第7回みずほリース                 | 0.33  | 500,000   | 491,590   | 2028/1/20  |       |
| 第9回みずほリース                 | 0.23  | 300,000   | 292,263   | 2028/9/1   |       |
| 第12回みずほリース                | 0.34  | 200,000   | 195,218   | 2028/12/15 |       |
| 第21回みずほリース                | 0.599 | 300,000   | 296,913   | 2028/9/6   |       |
| 第22回みずほリース(サステナビリティ)      | 0.639 | 300,000   | 297,789   | 2028/6/12  |       |
| 第23回みずほリース                | 0.693 | 200,000   | 198,166   | 2029/2/28  |       |
| 第16回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 0.18  | 1,200,000 | 1,193,040 | 2025/12/19 |       |
| 第17回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 0.28  | 300,000   | 295,371   | 2027/12/20 |       |
| 第18回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス       | 0.38  | 1,500,000 | 1,450,380 | 2030/9/20  |       |
| 第25回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.648 | 300,000   | 295,701   | 2030/6/20  |       |
| 第26回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.838 | 200,000   | 194,154   | 2033/6/20  |       |
| 第28回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.614 | 300,000   | 297,951   | 2028/9/20  |       |
| 第29回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 0.86  | 300,000   | 298,995   | 2030/9/20  |       |
| 第30回エヌ・ティ・ティ・ファイナンス(グリーン) | 1.213 | 200,000   | 200,158   | 2033/9/20  |       |
| 第53回日産ファイナンシャルサービス        | 0.58  | 300,000   | 295,812   | 2026/9/18  |       |
| 第56回日産ファイナンシャルサービス        | 0.52  | 500,000   | 494,500   | 2026/6/19  |       |
| 第57回日産ファイナンシャルサービス        | 0.834 | 400,000   | 392,188   | 2028/6/20  |       |
| 第58回日産ファイナンシャルサービス        | 0.7   | 100,000   | 99,510    | 2027/3/19  |       |
| 第30回東京センチュリー              | 0.29  | 100,000   | 98,200    | 2028/1/27  |       |

| 銘柄                  | 利     | 当期末     |         |         | 償還年月日      |
|---------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
|                     |       | 額面金額    | 評価額     | 千円      |            |
| 普通社債券               | %     |         |         | 千円      |            |
| 第34回東京センチュリー        | 0.22  | 300,000 | 292,461 | 292,461 | 2028/7/21  |
| 第102回トヨタファイナンス      | 0.414 | 700,000 | 697,053 | 697,053 | 2027/4/9   |
| 第103回トヨタファイナンス      | 0.617 | 300,000 | 298,035 | 298,035 | 2029/4/11  |
| 第22回ポケットカード         | 0.3   | 100,000 | 99,378  | 99,378  | 2025/10/29 |
| 第23回ポケットカード         | 0.2   | 200,000 | 196,568 | 196,568 | 2026/12/3  |
| 第24回ポケットカード         | 0.898 | 300,000 | 297,621 | 297,621 | 2028/11/22 |
| 第42回リコーリース          | 0.39  | 400,000 | 395,680 | 395,680 | 2027/6/1   |
| 第209回オリックス          | 0.39  | 500,000 | 494,230 | 494,230 | 2027/9/1   |
| 第220回オリックス          | 0.723 | 400,000 | 397,224 | 397,224 | 2028/11/29 |
| 第222回オリックス          | 0.677 | 500,000 | 495,145 | 495,145 | 2029/3/7   |
| 第34回三井住友ファイナンス＆リース  | 0.43  | 300,000 | 299,130 | 299,130 | 2026/2/2   |
| 第2回三菱HCキャピタル        | 0.19  | 500,000 | 492,170 | 492,170 | 2027/3/1   |
| 第40回大和証券グループ本社      | 0.575 | 500,000 | 497,560 | 497,560 | 2026/11/27 |
| 第3回野村ホールディングス       | 0.28  | 200,000 | 197,100 | 197,100 | 2026/9/4   |
| 第24回野村ホールディングス      | 2.329 | 100,000 | 101,798 | 101,798 | 2025/6/24  |
| 第27回野村ホールディングス      | 2.107 | 100,000 | 101,823 | 101,823 | 2025/9/24  |
| 第83回三井不動産（グリーン）     | 0.81  | 200,000 | 192,456 | 192,456 | 2033/6/6   |
| 第142回三菱地所（サステナビリティ） | 0.43  | 200,000 | 197,684 | 197,684 | 2028/5/2   |
| 第143回三菱地所           | 0.9   | 100,000 | 96,989  | 96,989  | 2033/5/2   |
| 第111回住友不動産（グリーン）    | 0.52  | 100,000 | 99,058  | 99,058  | 2028/4/28  |
| 第76回東京急行電鉄          | 1.563 | 200,000 | 205,544 | 205,544 | 2027/6/7   |
| 第36回京王電鉄            | 0.325 | 200,000 | 197,786 | 197,786 | 2027/9/17  |
| 第53回東日本旅客鉄道         | 2.35  | 300,000 | 319,356 | 319,356 | 2028/4/21  |
| 第71回東日本旅客鉄道         | 1.905 | 400,000 | 425,184 | 425,184 | 2030/9/27  |
| 第100回東日本旅客鉄道        | 1.981 | 200,000 | 201,118 | 201,118 | 2044/1/29  |
| 第163回東日本旅客鉄道        | 0.05  | 600,000 | 594,402 | 594,402 | 2026/4/15  |
| 第73回西日本旅客鉄道         | 0.05  | 400,000 | 396,228 | 396,228 | 2026/4/22  |
| 第42回東海旅客鉄道          | 2.312 | 100,000 | 107,276 | 107,276 | 2029/4/24  |
| 第53回東海旅客鉄道          | 1.797 | 100,000 | 105,609 | 105,609 | 2030/10/25 |
| 第28回東京地下鉄           | 0.25  | 300,000 | 294,591 | 294,591 | 2028/5/24  |
| 第50回阪急阪神ホールディングス    | 0.345 | 200,000 | 196,836 | 196,836 | 2028/9/13  |
| 第58回阪急阪神ホールディングス    | 0.09  | 200,000 | 198,458 | 198,458 | 2026/2/26  |
| 第68回名古屋鉄道（サステナビリティ） | 0.375 | 200,000 | 196,606 | 196,606 | 2028/7/13  |
| 第71回名古屋鉄道           | 0.35  | 400,000 | 396,928 | 396,928 | 2027/3/12  |
| 第14回日本通運            | 0.28  | 200,000 | 197,534 | 197,534 | 2027/6/16  |
| 第1回横浜高速鉄道           | 0.62  | 300,000 | 299,658 | 299,658 | 2026/2/25  |
| 第20回三菱倉庫            | 0.759 | 100,000 | 98,764  | 98,764  | 2031/3/14  |
| 第31回KDDI（サステナビリティ）  | 0.43  | 200,000 | 197,854 | 197,854 | 2027/10/27 |
| 第9回ソフトバンク           | 0.48  | 600,000 | 585,972 | 585,972 | 2027/12/3  |
| 第13回ソフトバンク          | 0.52  | 500,000 | 465,070 | 465,070 | 2031/6/3   |
| 第16回ソフトバンク          | 0.52  | 500,000 | 462,275 | 462,275 | 2031/10/10 |
| 第21回ソフトバンク          | 0.82  | 700,000 | 688,877 | 688,877 | 2028/7/12  |
| 第22回ソフトバンク          | 1.0   | 300,000 | 292,674 | 292,674 | 2030/7/12  |
| 第49回電源開発            | 0.4   | 500,000 | 495,245 | 495,245 | 2027/5/20  |
| 第50回電源開発            | 0.415 | 200,000 | 198,084 | 198,084 | 2027/7/20  |

| 銘柄                      | 利率    | 当期末         |             |            | 償還年月日 |
|-------------------------|-------|-------------|-------------|------------|-------|
|                         |       | 額面金額        | 評価額         | 千円         |       |
| 普通社債券                   | %     |             |             | 千円         |       |
| 第57回電源開発                | 0.355 | 100,000     | 98,115      | 2028/7/20  |       |
| 第59回電源開発                | 0.414 | 300,000     | 294,615     | 2028/9/20  |       |
| 第64回電源開発                | 0.405 | 600,000     | 586,020     | 2029/4/20  |       |
| 第67回電源開発                | 0.24  | 200,000     | 192,870     | 2029/9/20  |       |
| 第86回電源開発                | 0.93  | 100,000     | 97,217      | 2033/5/20  |       |
| 第87回電源開発(グリーン)          | 1.106 | 200,000     | 196,052     | 2034/2/20  |       |
| 第89回電源開発(グリーン)          | 1.121 | 200,000     | 196,516     | 2034/4/20  |       |
| 第6回東京電力パワーグリッド          | 0.85  | 100,000     | 99,879      | 2027/8/31  |       |
| 第13回東京電力パワーグリッド         | 0.77  | 300,000     | 297,444     | 2028/4/19  |       |
| 第15回東京電力パワーグリッド         | 0.89  | 100,000     | 97,867      | 2030/7/24  |       |
| 第25回東京電力パワーグリッド         | 1.02  | 100,000     | 99,659      | 2029/4/24  |       |
| 第28回東京電力パワーグリッド         | 1.01  | 400,000     | 397,404     | 2029/7/10  |       |
| 第31回東京電力パワーグリッド         | 0.98  | 300,000     | 297,192     | 2029/10/9  |       |
| 第33回東京電力パワーグリッド         | 0.68  | 700,000     | 697,200     | 2027/1/27  |       |
| 第35回東京電力パワーグリッド         | 1.2   | 100,000     | 99,887      | 2030/4/23  |       |
| 第39回東京電力パワーグリッド         | 1.08  | 400,000     | 396,080     | 2030/7/16  |       |
| 第47回東京電力パワーグリッド         | 0.68  | 200,000     | 190,242     | 2031/8/29  |       |
| 第49回東京電力パワーグリッド         | 0.6   | 400,000     | 397,044     | 2027/4/26  |       |
| 第16回JERA                | 0.64  | 200,000     | 198,280     | 2028/4/25  |       |
| 第17回JERA                | 0.9   | 400,000     | 396,076     | 2030/4/25  |       |
| 第21回JERA                | 0.689 | 200,000     | 197,888     | 2028/11/24 |       |
| 第22回JERA                | 0.5   | 1,000,000   | 993,540     | 2027/2/25  |       |
| 第23回JERA                | 1.192 | 100,000     | 97,962      | 2034/2/24  |       |
| 第25回JERA                | 1.054 | 400,000     | 398,252     | 2031/4/25  |       |
| 第3回東京電力リニューアブルパワー(グリーン) | 0.85  | 400,000     | 398,732     | 2027/9/14  |       |
| 第51回大阪ガス                | 0.785 | 100,000     | 96,841      | 2033/6/2   |       |
| 第13回広島ガス                | 0.405 | 200,000     | 195,776     | 2028/9/13  |       |
| 第7回ファーストリティリング          | 0.405 | 100,000     | 98,656      | 2028/6/6   |       |
| 第19回フランス相互信用連合銀行        | 0.999 | 100,000     | 100,461     | 2025/10/15 |       |
| 第29回フランス相互信用連合銀行        | 0.25  | 200,000     | 199,836     | 2024/10/10 |       |
| 第35回フランス相互信用連合銀行        | 0.279 | 500,000     | 493,790     | 2026/10/21 |       |
| 第38回フランス相互信用連合銀行        | 0.802 | 300,000     | 300,549     | 2025/10/10 |       |
| 第25回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー   | 0.302 | 100,000     | 98,313      | 2026/12/16 |       |
| 第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー   | 0.713 | 200,000     | 199,126     | 2026/7/13  |       |
| 第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー   | 0.914 | 200,000     | 197,818     | 2028/7/13  |       |
| 第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー   | 0.895 | 400,000     | 399,368     | 2026/12/14 |       |
| 第1回サンタンデール銀行(2019)      | 0.463 | 500,000     | 498,965     | 2024/12/5  |       |
| 小計                      |       | 56,900,000  | 56,319,048  |            |       |
| 合計                      |       | 950,375,358 | 914,700,021 |            |       |

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 |        |          | 当 期 末        |          |
|-------|--------|----------|--------------|----------|
|       |        |          | 買 建 額        | 売 建 額    |
| 国 内   | 債券先物取引 | 10年国債標準物 | 百万円<br>3,311 | 百万円<br>— |

## ○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>914,700,021 | %<br>98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 15,187,539        | 1.6       |
| 投資信託財産総額     | 929,887,560       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

| 項目              | 当期末              |
|-----------------|------------------|
| (A) 資産          | 円                |
| コール・ローン等        | 929,887,560,233  |
| 公社債(評価額)        | 13,449,202,663   |
| 未収利息            | 914,700,021,042  |
| 前払費用            | 1,536,128,641    |
| 差入委託証拠金         | 140,463,382      |
|                 | 61,744,505       |
| (B) 負債          | 9,237,435,827    |
| 未払金             | 1,894,274,505    |
| 未払解約金           | 7,343,161,322    |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 920,650,124,406  |
| 元本              | 734,007,365,151  |
| 次期繰越損益金         | 186,642,759,255  |
| (D) 受益権総口数      | 734,007,365,151口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,543円          |

## &lt;注記事項&gt;

①期首元本額 552,953,193,068円

期中追加設定元本額 254,696,851,852円

期中一部解約元本額 73,642,679,769円

また、1口当たり純資産額は、期末1,2543円です。

## ○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項目               | 当期               |
|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益        | 円                |
| 受取利息             | 5,756,517,764    |
| 支払利息             | 5,757,618,467    |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 1,100,703      |
| 売買益              | △ 40,438,972,489 |
| 売買損              | 156,011,016      |
| (C) 先物取引等取引損益    | △ 40,594,983,505 |
| 取引益              | △ 41,129,190     |
| 取引損              | 8,009,430        |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 49,138,620     |
| (E) 前期繰越損益金      | △ 34,723,583,915 |
| (F) 追加信託差損益金     | 170,524,354,914  |
| (G) 解約差損益金       | 71,360,783,663   |
| (H) 計(D+E+F+G)   | △ 20,518,795,407 |
| 次期繰越損益金(H)       | 186,642,759,255  |
|                  | 186,642,759,255  |

(注) (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算によるものを含みます。

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

(注) (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。

## ②期末における元本の内訳 (当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

MUAM 日本債券インデックスファンド (適格機関投資家限定)

175,958,816,366円

三菱UFJ プライムバランス (安定成長型) (確定拠出年金)

111,916,725,165円

三菱UFJ プライムバランス (安定型) (確定拠出年金)

59,213,449,032円

三菱UFJ 国内債券インデックスファンド (確定拠出年金)

42,318,815,867円

三菱UFJ プライムバランス (成長型) (確定拠出年金)

37,533,941,113円

eMAXIS Slim バランス (8資産均等型)

24,721,245,237円

MUAM グローバルバランス (退職給付信託向け) (適格機関投資家限定)

24,503,259,248円

MUKAM 日本債券インデックスファンド2 (適格機関投資家限定)

23,446,887,158円

三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)

18,930,825,944円

eMAXIS Slim 国内債券インデックス

18,405,294,174円

つみたて8資産均等バランス

12,368,186,970円

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)

12,165,840,984円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)

11,567,969,451円

三菱UFJ バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)

8,994,011,242円

三菱UFJ ライフセレクトファンド (安定型)

7,900,455,072円

三菱UFJ DC年金バランス (株式40)

7,530,798,013円

三菱UFJ DC年金バランス (株式15)

7,397,848,968円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)

6,668,384,159円

ラップ向けインデックスf 国内債券

6,622,297,618円

eMAXIS 国内債券インデックス

6,255,315,656円

三菱UFJ 日本債券ファンドVA (適格機関投資家限定)

5,700,588,088円

三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)

5,626,856,065円

日本債券インデックスファンドS

5,544,171,553円

国内債券セレクション (ラップ向け)

5,237,609,746円

|   |                |
|---|----------------|
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式65）                    | 4,941,517,546円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定成長型）   | 4,885,797,575円 |
| つみたて4資産均等バランス                           | 4,802,081,776円 |
| eMAXIS バランス（8資産均等型）                     | 4,651,718,360円 |
| 三菱UFJ バランスタンドVA 40型（適格機関投資家限定）          | 4,588,038,506円 |
| 三菱UFJ バランスタンド50VA（適格機関投資家限定）            | 4,406,076,955円 |
| 三菱UFJ <DC>日本債券インデックスファンド                | 4,282,223,340円 |
| 三菱UFJ ライフセレクトファンド（成長型）                  | 3,294,331,907円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（成長型）     | 3,096,184,079円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045（確定拠出年金）        | 3,062,415,892円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）   | 3,011,040,143円 |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（標準型）               | 2,842,938,302円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050（確定拠出年金）        | 2,634,143,780円 |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（保守型）               | 2,499,242,039円 |
| 三菱UFJ バランスタンド20VA（適格機関投資家限定）            | 2,485,992,478円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（安定型）     | 2,303,871,049円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）              | 2,272,430,672円 |
| 三菱UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド（積極型）     | 2,188,104,377円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイゴールキーパー）               | 2,099,476,552円 |
| eMAXIS バランス（4資産均等型）                     | 2,005,690,169円 |
| 三菱UFJ 国内債券インデックスファンド                    | 1,737,524,912円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2（適格機関投資家限定）     | 1,606,571,779円 |
| 国内債券インデックスファンド（ラップ向け）                   | 1,573,070,841円 |
| 三菱UFJ DC年金バランス（株式25）                    | 1,452,531,530円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055（確定拠出年金）        | 1,238,179,419円 |
| eMAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）               | 1,236,716,237円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060（確定拠出年金）        | 930,801,383円   |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）              | 616,797,431円   |
| 三菱UFJ バランスタンドVA 20型（適格機関投資家限定）          | 611,362,804円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定） | 490,248,647円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09（適格機関投資家限定） | 478,244,702円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定） | 477,769,455円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07（適格機関投資家限定） | 477,586,919円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11（適格機関投資家限定） | 476,937,873円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03（適格機関投資家限定） | 476,919,903円   |
| 三菱UFJ バランスタンドVA 50型（適格機関投資家限定）          | 469,836,335円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05（適格機関投資家限定） | 469,323,041円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03（適格機関投資家限定） | 462,440,331円   |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065（確定拠出年金）        | 450,459,048円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07（適格機関投資家限定） | 429,832,474円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11（適格機関投資家限定） | 424,729,389円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09（適格機関投資家限定） | 424,280,144円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01（適格機関投資家限定） | 421,626,267円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05（適格機関投資家限定） | 420,955,442円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03（適格機関投資家限定） | 419,477,595円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11（適格機関投資家限定） | 418,690,273円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01（適格機関投資家限定） | 416,840,490円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09（適格機関投資家限定） | 416,234,104円   |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07（適格機関投資家限定） | 413,671,752円   |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（2ヵ月分配型）               | 216,560,403円   |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド（成長型）                  | 196,485,913円   |
| eMAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                 | 140,181,077円   |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）                | 91,833,237円    |
| eMAXIS バランス（波乗り型）                       | 89,944,163円    |

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| e MAX I S 債券バランス（2資産均等型）          | 77,885,369円      |
| e MAX I S 最適化バランス（マイストライカー）       | 58,975,151円      |
| 三菱UF J アドバンスト・バランス（安定型）           | 56,719,654円      |
| 三菱UF J バランスVA60D（適格機関投資家限定）       | 47,853,897円      |
| 三菱UF J バランスVA60G（適格機関投資家限定）       | 30,896,965円      |
| 三菱UF J バランスタンド45VA（適格機関投資家限定）     | 28,612,137円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA      | 22,848,932円      |
| e MAX I S マイマネージャー 1970s          | 19,963,028円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA        | 19,139,611円      |
| 三菱UF J バランスVA30D（適格機関投資家限定）       | 18,511,753円      |
| e MAX I S マイマネージャー 1980s          | 14,899,556円      |
| 三菱UF J DC年金バランス（株式80）             | 11,241,175円      |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA        | 9,888,453円       |
| 三菱UF J バランスVA30G（適格機関投資家限定）       | 9,458,513円       |
| グローバルバランスオープンV（適格機関投資家限定）         | 6,066,272円       |
| 国内債券インデックスオープンV（適格機関投資家限定）        | 5,319,921円       |
| 三菱UF J ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金） | 3,537,687円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA        | 3,440,927円       |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）        | 2,156,260円       |
| 三菱UF J バランスタンド55VA（適格機関投資家限定）     | 1,607,512円       |
| e MAX I S マイマネージャー 1990s          | 459,872円         |
| 三菱UF J バランスタンドVA 30型（適格機関投資家限定）   | 308,807円         |
| 合計                                | 734,007,365,151円 |

## [ お 知 ら せ ]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10月1日)

# 外国債券インデックスマザーファンド

**《第23期》決算日2024年5月13日**

**[計算期間：2023年5月13日～2024年5月13日]**

「外国債券インデックスマザーファンド」は、5月13日に第23期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第23期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |  |
|--------|--|
| 運用方針   | F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果をF T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きにできるだけ連動させるため、公社債の実質投資比率（組入現物公社債の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は原則として高位を維持します。銘柄選択は、運用モデルを活用して行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。 |
| 主要運用対象 | F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている国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割合に制限を設けません。  |

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、円換算ベース) |            | 債組入比率 | 債先物比率  | 純資産額        |
|-----------------|----------|-------------------------------------|------------|-------|--------|-------------|
|                 |          | 期騰落                                 | 中率         |       |        |             |
| 19期(2020年5月12日) | 円 21,324 | % 4.5                               | 119,287.72 | % 4.6 | % 98.6 | 百万円 149,310 |
| 20期(2021年5月12日) | 22,636   | 6.2                                 | 126,522.01 | 6.1   | 97.7   | — 197,147   |
| 21期(2022年5月12日) | 23,133   | 2.2                                 | 129,384.40 | 2.3   | 98.8   | — 302,225   |
| 22期(2023年5月12日) | 23,421   | 1.2                                 | 130,897.72 | 1.2   | 98.5   | — 438,949   |
| 23期(2024年5月13日) | 26,985   | 15.2                                | 150,774.68 | 15.2  | 98.1   | — 633,684   |

(注) F T S E 世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）とは、F T S E 世界国債インデックス（除く日本）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指數は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日         | 基<br>準<br>価<br>額 | F T S E 世界国債インデックス<br>(除く日本、円換算ベース) |            | 債<br>組<br>入<br>比 | 券<br>率    | 債<br>先<br>物<br>比<br>率 |
|---------------------|------------------|-------------------------------------|------------|------------------|-----------|-----------------------|
|                     |                  | 騰<br>落<br>率                         | 率          |                  |           |                       |
| (期 首)<br>2023年5月12日 | 円<br>23,421      | %<br>—                              | 130,897.72 | %<br>—           | %<br>98.5 | %<br>—                |
| 5月末                 | 23,777           | 1.5                                 | 132,828.99 | 1.5              | 98.4      | —                     |
| 6月末                 | 24,729           | 5.6                                 | 138,284.08 | 5.6              | 98.5      | —                     |
| 7月末                 | 24,193           | 3.3                                 | 135,227.94 | 3.3              | 98.5      | —                     |
| 8月末                 | 24,855           | 6.1                                 | 138,880.03 | 6.1              | 98.2      | —                     |
| 9月末                 | 24,483           | 4.5                                 | 136,810.50 | 4.5              | 98.3      | —                     |
| 10月末                | 24,461           | 4.4                                 | 136,724.14 | 4.5              | 98.0      | —                     |
| 11月末                | 25,316           | 8.1                                 | 141,488.31 | 8.1              | 98.4      | —                     |
| 12月末                | 25,343           | 8.2                                 | 141,801.08 | 8.3              | 98.3      | —                     |
| 2024年1月末            | 25,795           | 10.1                                | 144,118.59 | 10.1             | 98.3      | —                     |
| 2月末                 | 26,132           | 11.6                                | 146,060.66 | 11.6             | 98.2      | —                     |
| 3月末                 | 26,465           | 13.0                                | 148,025.68 | 13.1             | 98.0      | —                     |
| 4月末                 | 26,960           | 15.1                                | 150,600.10 | 15.1             | 97.9      | —                     |
| (期 末)<br>2024年5月13日 | 26,985           | 15.2                                | 150,774.68 | 15.2             | 98.1      | —                     |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

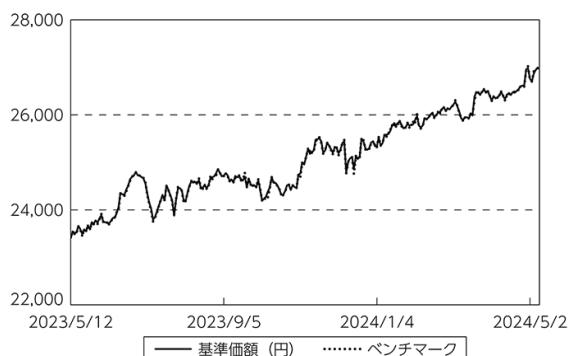
### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ15.2%の上昇となりました。

### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(15.2%)と同程度となりました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同じになるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎債券市況

先進国の債券市況は上昇しました。

- ・先進国の債券市況は、金融政策引き締め等を背景とした金利上昇により下落した後、中銀による利上げの打ち止め観測等を背景とした金利低下により反発し、期間の初めとの比較では上昇しました。

◎為替市況

- ・期間の初めに比べて米ドル、ユーロは対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・日本を除く世界各国の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは15.2%の上昇になったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・評価時価差異要因※によるものです。

※ファンドの基準価額とベンチマークで算出に用いる債券時価や為替レートが異なるため生じる要因です。

(主なマイナス要因)

- ・ありません。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項<br>目                    | 当<br>期 |            | 項<br>目<br>の<br>概<br>要           |
|---------------------------|--------|------------|---------------------------------|
|                           | 金<br>額 | 比<br>率     |                                 |
| (a) そ<br>の<br>他<br>費<br>用 | 円<br>3 | %<br>0.011 | (a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数   |
| ( 保<br>管<br>費<br>用 )      | (3)    | (0.011)    | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 |
| ( そ<br>の<br>他<br>)        | (0)    | (0.000)    | 信託事務の処理等に要するその他諸費用              |
| 合<br>計                    | 3      | 0.011      |                                 |
| 期中の平均基準価額は、25,112円です。     |        |            |                                 |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 公社債

|        |          |      | 買付額                   | 売付額                   |
|--------|----------|------|-----------------------|-----------------------|
| 外<br>国 | アメリカ     | 国債証券 | 千アメリカドル<br>814,193    | 千アメリカドル<br>458,266    |
|        | カナダ      | 国債証券 | 千カナダドル<br>42,271      | 千カナダドル<br>16,542      |
|        | メキシコ     | 国債証券 | 千メキシコペソ<br>201,901    | 千メキシコペソ<br>125,620    |
|        | ユーロ      |      | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |
|        | ドイツ      | 国債証券 | 83,615                | 48,446                |
|        | イタリア     | 国債証券 | 81,503                | 42,107                |
|        | フランス     | 国債証券 | 90,465                | 47,566                |
|        | オランダ     | 国債証券 | 13,002                | 3,824                 |
|        | スペイン     | 国債証券 | 70,161                | 34,468                |
|        | ベルギー     | 国債証券 | 19,150                | 8,292                 |
|        | オーストリア   | 国債証券 | 11,675                | 5,336                 |
|        | フィンランド   | 国債証券 | 5,786                 | 821                   |
|        | アイルランド   | 国債証券 | 3,834                 | 2,962                 |
|        | イギリス     | 国債証券 | 千イギリスポンド<br>59,078    | 千イギリスポンド<br>15,129    |
|        | スウェーデン   | 国債証券 | 千スウェーデンクローネ<br>17,392 | 千スウェーデンクローネ<br>931    |
|        | ノルウェー    | 国債証券 | 千ノルウェークローネ<br>22,343  | 千ノルウェークローネ<br>9,963   |
|        | デンマーク    | 国債証券 | 千デンマーククローネ<br>11,773  | 千デンマーククローネ<br>7,714   |
|        | ポーランド    | 国債証券 | 千ポーランドズロチ<br>29,041   | 千ポーランドズロチ<br>8,258    |
|        | オーストラリア  | 国債証券 | 千オーストラリアドル<br>18,851  | 千オーストラリアドル<br>12,388  |
|        | ニュージーランド | 国債証券 | 千ニュージーランドドル<br>6,218  | 千ニュージーランドドル<br>1,945  |
|        | シンガポール   | 国債証券 | 千シンガポールドル<br>5,272    | 千シンガポールドル<br>1,689    |
|        | マレーシア    | 国債証券 | 千マレーシアリンギット<br>26,121 | 千マレーシアリンギット<br>11,793 |
|        | 中国       | 国債証券 | 千中国元<br>1,872,942     | 千中国元<br>290,605       |
|        | イスラエル    | 国債証券 | 千イスラエルシェケル<br>26,234  | 千イスラエルシェケル<br>6,941   |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

## ○利害関係人との取引状況等

(2023年5月13日～2024年5月13日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
| 為替先物取引 | 50,160    | 28,627             | 57.1          | 49,407    | 17,079             | 34.6          |
| 為替直物取引 | 178,901   | 88,096             | 49.2          | 58,151    | 41,961             | 72.2          |

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2024年5月13日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区分       | 当期                    |                       |                   |            |             |           | 末         |          |     |
|----------|-----------------------|-----------------------|-------------------|------------|-------------|-----------|-----------|----------|-----|
|          | 額面金額                  | 評価額                   |                   | 組入比率       | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |           |          |     |
|          |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額            |            |             | 5年以上      | 2年以上      | 2年未満     |     |
| アメリカ     | 千アメリカドル<br>2,101,330  | 千アメリカドル<br>1,864,030  | 千円<br>290,751,456 | %<br>45.9  | %<br>—      | %<br>19.5 | %<br>18.1 | %<br>8.3 |     |
|          | 千カナダドル<br>120,130     | 千カナダドル<br>109,972     | 千円<br>12,539,117  | 2.0        | —           | 1.1       | 0.4       | 0.5      |     |
| メキシコ     | 千メキシコペソ<br>637,530    | 千メキシコペソ<br>573,744    | 千円<br>5,335,597   | 0.8        | —           | 0.5       | 0.2       | 0.1      |     |
|          | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  | 千円                | —          | —           | —         | —         | —        |     |
| ヨーロ      | ドイツ                   | 241,360               | 223,538           | 37,545,578 | 5.9         | —         | 3.4       | 1.7      | 0.9 |
|          | イタリア                  | 283,020               | 270,408           | 45,417,781 | 7.2         | —         | 4.2       | 2.0      | 1.0 |
|          | フランス                  | 320,960               | 292,949           | 49,203,800 | 7.8         | —         | 4.5       | 2.5      | 0.8 |
|          | オランダ                  | 61,090                | 55,256            | 9,280,940  | 1.5         | —         | 0.9       | 0.4      | 0.1 |
|          | スペイン                  | 197,020               | 184,761           | 31,032,496 | 4.9         | —         | 2.7       | 1.6      | 0.6 |
|          | ベルギー                  | 71,790                | 65,924            | 11,072,709 | 1.7         | —         | 1.2       | 0.4      | 0.2 |
|          | オーストリア                | 48,190                | 42,987            | 7,220,099  | 1.1         | —         | 0.7       | 0.4      | 0.1 |
|          | フィンランド                | 22,740                | 19,868            | 3,337,158  | 0.5         | —         | 0.3       | 0.2      | 0.1 |
|          | アイルランド                | 21,630                | 18,869            | 3,169,284  | 0.5         | —         | 0.4       | 0.1      | —   |
| イギリス     | 千イギリスポンド<br>197,680   | 千イギリスポンド<br>162,906   | 千円<br>31,805,788  | 5.0        | —           | 3.5       | 1.2       | 0.4      |     |
|          | 千スウェーデンクローネ<br>84,670 | 千スウェーデンクローネ<br>80,832 | 千円<br>1,162,376   | 0.2        | —           | 0.1       | 0.1       | 0.0      |     |
| ノルウェー    | 千ノルウェークローネ<br>70,430  | 千ノルウェークローネ<br>64,751  | 千円<br>929,829     | 0.1        | —           | 0.1       | 0.0       | 0.0      |     |
|          | 千デンマーククローネ<br>75,720  | 千デンマーククローネ<br>71,022  | 千円<br>1,599,416   | 0.3        | —           | 0.2       | 0.0       | 0.0      |     |
| ポーランド    | 千ポーランドズロチ<br>90,840   | 千ポーランドズロチ<br>83,538   | 千円<br>3,260,658   | 0.5        | —           | 0.2       | 0.3       | 0.1      |     |
|          | 千オーストラリアドル<br>87,900  | 千オーストラリアドル<br>78,051  | 千円<br>8,029,971   | 1.3        | —           | 0.8       | 0.3       | 0.1      |     |
| ニュージーランド | 千ニュージーランドドル<br>18,240 | 千ニュージーランドドル<br>15,899 | 千円<br>1,491,558   | 0.2        | —           | 0.2       | 0.1       | —        |     |
|          | 千シンガポールドル<br>22,560   | 千シンガポールドル<br>21,295   | 千円<br>2,451,736   | 0.4        | —           | 0.3       | 0.1       | 0.0      |     |
| マレーシア    | 千マレーシアリンギット<br>92,380 | 千マレーシアリンギット<br>93,847 | 千円<br>3,086,150   | 0.5        | —           | 0.3       | 0.1       | 0.0      |     |
|          | 千中国元<br>2,674,000     | 千中国元<br>2,774,135     | 千円<br>59,846,705  | 9.4        | —           | 4.3       | 3.4       | 1.8      |     |
| イスラエル    | 千イスラエルシェケル<br>53,210  | 千イスラエルシェケル<br>47,839  | 千円<br>2,009,481   | 0.3        | —           | 0.2       | 0.1       | 0.0      |     |
|          | 合計                    | —                     | —                 | 98.1       | —           | 49.5      | 33.6      | 15.0     |     |

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘<br>柄 |                     | 当<br>期<br>末 |         |             |                 | 償還年月日      |
|--------|---------------------|-------------|---------|-------------|-----------------|------------|
|        |                     | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 | 外貨建金額<br>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              |            |
| 国債証券   | 0.25 T-NOTE 250531  | 0.25        | 5,000   | 4,752       | 741,227         | 2025/5/31  |
|        | 0.25 T-NOTE 250630  | 0.25        | 6,650   | 6,300       | 982,688         | 2025/6/30  |
|        | 0.25 T-NOTE 250731  | 0.25        | 5,800   | 5,473       | 853,777         | 2025/7/31  |
|        | 0.25 T-NOTE 250831  | 0.25        | 6,700   | 6,299       | 982,586         | 2025/8/31  |
|        | 0.25 T-NOTE 250930  | 0.25        | 7,600   | 7,119       | 1,110,523       | 2025/9/30  |
|        | 0.25 T-NOTE 251031  | 0.25        | 10,300  | 9,613       | 1,499,466       | 2025/10/31 |
|        | 0.375 T-NOTE 251130 | 0.375       | 10,150  | 9,457       | 1,475,248       | 2025/11/30 |
|        | 0.375 T-NOTE 251231 | 0.375       | 8,500   | 7,893       | 1,231,286       | 2025/12/31 |
|        | 0.375 T-NOTE 260131 | 0.375       | 9,200   | 8,512       | 1,327,838       | 2026/1/31  |
|        | 0.375 T-NOTE 270731 | 0.375       | 7,150   | 6,246       | 974,325         | 2027/7/31  |
|        | 0.375 T-NOTE 270930 | 0.375       | 7,300   | 6,338       | 988,694         | 2027/9/30  |
|        | 0.5 T-NOTE 260228   | 0.5         | 9,900   | 9,153       | 1,427,753       | 2026/2/28  |
|        | 0.5 T-NOTE 270430   | 0.5         | 5,280   | 4,676       | 729,410         | 2027/4/30  |
|        | 0.5 T-NOTE 270531   | 0.5         | 5,490   | 4,846       | 755,928         | 2027/5/31  |
|        | 0.5 T-NOTE 270630   | 0.5         | 5,900   | 5,194       | 810,171         | 2027/6/30  |
|        | 0.5 T-NOTE 270831   | 0.5         | 6,650   | 5,817       | 907,365         | 2027/8/31  |
|        | 0.5 T-NOTE 271031   | 0.5         | 8,590   | 7,466       | 1,164,638       | 2027/10/31 |
|        | 0.625 T-NOTE 260731 | 0.625       | 7,930   | 7,239       | 1,129,246       | 2026/7/31  |
|        | 0.625 T-NOTE 270331 | 0.625       | 3,800   | 3,390       | 528,844         | 2027/3/31  |
|        | 0.625 T-NOTE 271130 | 0.625       | 8,780   | 7,643       | 1,192,164       | 2027/11/30 |
|        | 0.625 T-NOTE 271231 | 0.625       | 8,630   | 7,490       | 1,168,379       | 2027/12/31 |
|        | 0.625 T-NOTE 300515 | 0.625       | 14,210  | 11,332      | 1,767,639       | 2030/5/15  |
|        | 0.625 T-NOTE 300815 | 0.625       | 17,350  | 13,709      | 2,138,468       | 2030/8/15  |
|        | 0.75 T-NOTE 260331  | 0.75        | 13,590  | 12,590      | 1,963,890       | 2026/3/31  |
|        | 0.75 T-NOTE 260430  | 0.75        | 9,200   | 8,496       | 1,325,343       | 2026/4/30  |
|        | 0.75 T-NOTE 260531  | 0.75        | 8,200   | 7,550       | 1,177,712       | 2026/5/31  |
|        | 0.75 T-NOTE 260831  | 0.75        | 10,100  | 9,220       | 1,438,227       | 2026/8/31  |
|        | 0.75 T-NOTE 280131  | 0.75        | 9,950   | 8,652       | 1,349,573       | 2028/1/31  |
|        | 0.875 T-NOTE 260630 | 0.875       | 8,300   | 7,644       | 1,192,454       | 2026/6/30  |
|        | 0.875 T-NOTE 260930 | 0.875       | 10,000  | 9,133       | 1,424,718       | 2026/9/30  |
|        | 0.875 T-NOTE 301115 | 0.875       | 22,310  | 17,813      | 2,778,493       | 2030/11/15 |
|        | 1 T-NOTE 280731     | 1.0         | 9,150   | 7,910       | 1,233,957       | 2028/7/31  |
|        | 1.125 T-BOND 400515 | 1.125       | 6,890   | 4,153       | 647,843         | 2040/5/15  |
|        | 1.125 T-BOND 400815 | 1.125       | 9,380   | 5,596       | 872,911         | 2040/8/15  |
|        | 1.125 T-NOTE 261031 | 1.125       | 10,450  | 9,575       | 1,493,542       | 2026/10/31 |
|        | 1.125 T-NOTE 270228 | 1.125       | 2,950   | 2,676       | 417,550         | 2027/2/28  |
|        | 1.125 T-NOTE 280229 | 1.125       | 9,760   | 8,589       | 1,339,799       | 2028/2/29  |
|        | 1.125 T-NOTE 280831 | 1.125       | 16,430  | 14,246      | 2,222,235       | 2028/8/31  |
|        | 1.125 T-NOTE 310215 | 1.125       | 17,120  | 13,827      | 2,156,747       | 2031/2/15  |
|        | 1.25 T-BOND 500515  | 1.25        | 10,720  | 5,202       | 811,493         | 2050/5/15  |
|        | 1.25 T-NOTE 261130  | 1.25        | 11,360  | 10,416      | 1,624,779       | 2026/11/30 |
|        | 1.25 T-NOTE 261231  | 1.25        | 8,200   | 7,502       | 1,170,267       | 2026/12/31 |
|        | 1.25 T-NOTE 280331  | 1.25        | 9,950   | 8,779       | 1,369,398       | 2028/3/31  |
|        | 1.25 T-NOTE 280430  | 1.25        | 9,740   | 8,573       | 1,337,232       | 2028/4/30  |
|        | 1.25 T-NOTE 280531  | 1.25        | 9,750   | 8,562       | 1,335,545       | 2028/5/31  |
|        | 1.25 T-NOTE 280630  | 1.25        | 9,680   | 8,479       | 1,322,654       | 2028/6/30  |

| 銘<br>柄 |                     | 当<br>期<br>末 |         |             |           |
|--------|---------------------|-------------|---------|-------------|-----------|
|        |                     | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |           |
|        |                     |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |
| アメリカ   |                     | %           | 千アメリカドル | 千アメリカドル     | 千円        |
| 国債証券   | 1.25 T-NOTE 280930  | 1.25        | 10,700  | 9,306       | 1,451,659 |
|        | 1.25 T-NOTE 310815  | 1.25        | 19,990  | 16,017      | 2,498,451 |
|        | 1.375 T-BOND 401115 | 1.375       | 9,910   | 6,139       | 957,647   |
|        | 1.375 T-BOND 500815 | 1.375       | 11,180  | 5,597       | 873,086   |
|        | 1.375 T-NOTE 260831 | 1.375       | 3,800   | 3,519       | 549,033   |
|        | 1.375 T-NOTE 281031 | 1.375       | 9,050   | 7,899       | 1,232,106 |
|        | 1.375 T-NOTE 281231 | 1.375       | 8,700   | 7,558       | 1,179,048 |
|        | 1.375 T-NOTE 311115 | 1.375       | 20,320  | 16,314      | 2,544,772 |
|        | 1.5 T-NOTE 260815   | 1.5         | 9,740   | 9,058       | 1,412,957 |
|        | 1.5 T-NOTE 270131   | 1.5         | 13,540  | 12,441      | 1,940,577 |
|        | 1.5 T-NOTE 281130   | 1.5         | 9,700   | 8,497       | 1,325,446 |
|        | 1.5 T-NOTE 300215   | 1.5         | 9,680   | 8,218       | 1,281,869 |
|        | 1.625 T-BOND 501115 | 1.625       | 11,410  | 6,116       | 954,068   |
|        | 1.625 T-NOTE 260215 | 1.625       | 9,760   | 9,220       | 1,438,248 |
|        | 1.625 T-NOTE 260515 | 1.625       | 7,670   | 7,202       | 1,123,509 |
|        | 1.625 T-NOTE 260930 | 1.625       | 5,500   | 5,115       | 797,938   |
|        | 1.625 T-NOTE 261031 | 1.625       | 3,350   | 3,108       | 484,914   |
|        | 1.625 T-NOTE 261130 | 1.625       | 3,400   | 3,147       | 490,971   |
|        | 1.625 T-NOTE 290815 | 1.625       | 7,050   | 6,113       | 953,610   |
|        | 1.625 T-NOTE 310515 | 1.625       | 16,640  | 13,807      | 2,153,662 |
|        | 1.75 T-BOND 410815  | 1.75        | 14,850  | 9,657       | 1,506,411 |
|        | 1.75 T-NOTE 261231  | 1.75        | 4,700   | 4,358       | 679,812   |
|        | 1.75 T-NOTE 290131  | 1.75        | 10,040  | 8,860       | 1,382,060 |
|        | 1.75 T-NOTE 291115  | 1.75        | 5,150   | 4,479       | 698,648   |
|        | 1.875 T-BOND 410215 | 1.875       | 10,700  | 7,195       | 1,122,327 |
|        | 1.875 T-BOND 510215 | 1.875       | 12,560  | 7,188       | 1,121,207 |
|        | 1.875 T-BOND 511115 | 1.875       | 13,630  | 7,748       | 1,208,626 |
|        | 1.875 T-NOTE 260630 | 1.875       | 5,100   | 4,799       | 748,576   |
|        | 1.875 T-NOTE 260731 | 1.875       | 5,500   | 5,165       | 805,645   |
|        | 1.875 T-NOTE 270228 | 1.875       | 9,120   | 8,450       | 1,318,042 |
|        | 1.875 T-NOTE 290228 | 1.875       | 7,800   | 6,912       | 1,078,226 |
|        | 1.875 T-NOTE 320215 | 1.875       | 16,860  | 13,984      | 2,181,263 |
|        | 2 T-BOND 411115     | 2.0         | 10,220  | 6,913       | 1,078,300 |
|        | 2 T-BOND 500215     | 2.0         | 8,590   | 5,121       | 798,844   |
|        | 2 T-BOND 510815     | 2.0         | 12,060  | 7,096       | 1,106,920 |
|        | 2 T-NOTE 250815     | 2.0         | 8,600   | 8,283       | 1,292,067 |
|        | 2 T-NOTE 261115     | 2.0         | 8,680   | 8,122       | 1,266,907 |
|        | 2.125 T-NOTE 250515 | 2.125       | 6,970   | 6,766       | 1,055,381 |
|        | 2.125 T-NOTE 260531 | 2.125       | 5,000   | 4,737       | 738,985   |
|        | 2.25 T-BOND 410515  | 2.25        | 9,320   | 6,638       | 1,035,416 |
|        | 2.25 T-BOND 460815  | 2.25        | 5,730   | 3,759       | 586,463   |
|        | 2.25 T-BOND 490815  | 2.25        | 6,950   | 4,418       | 689,183   |
|        | 2.25 T-BOND 520215  | 2.25        | 10,280  | 6,421       | 1,001,576 |
|        | 2.25 T-NOTE 251115  | 2.25        | 10,290  | 9,882       | 1,541,459 |
|        | 2.25 T-NOTE 260331  | 2.25        | 4,500   | 4,289       | 669,062   |
|        | 2.25 T-NOTE 270215  | 2.25        | 6,810   | 6,382       | 995,523   |
|        | 2.25 T-NOTE 270815  | 2.25        | 12,190  | 11,317      | 1,765,327 |

| 銘<br>柄 |                     | 当<br>期<br>末 |         |             |           | 償還年月日      |  |
|--------|---------------------|-------------|---------|-------------|-----------|------------|--|
|        |                     | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|        |                     |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| アメリカ   |                     | %           | 千アメリカドル | 千アメリカドル     | 千円        |            |  |
| 国債証券   | 2.25 T-NOTE 271115  | 2.25        | 7,500   | 6,928       | 1,080,763 | 2027/11/15 |  |
|        | 2.375 T-BOND 420215 | 2.375       | 8,920   | 6,396       | 997,798   | 2042/2/15  |  |
|        | 2.375 T-BOND 491115 | 2.375       | 6,600   | 4,310       | 672,310   | 2049/11/15 |  |
|        | 2.375 T-BOND 510515 | 2.375       | 12,850  | 8,302       | 1,295,071 | 2051/5/15  |  |
|        | 2.375 T-NOTE 260430 | 2.375       | 4,000   | 3,815       | 595,063   | 2026/4/30  |  |
|        | 2.375 T-NOTE 270515 | 2.375       | 9,070   | 8,492       | 1,324,604 | 2027/5/15  |  |
|        | 2.375 T-NOTE 290331 | 2.375       | 7,500   | 6,794       | 1,059,810 | 2029/3/31  |  |
|        | 2.375 T-NOTE 290515 | 2.375       | 8,510   | 7,696       | 1,200,458 | 2029/5/15  |  |
|        | 2.5 T-BOND 450215   | 2.5         | 5,050   | 3,548       | 553,512   | 2045/2/15  |  |
|        | 2.5 T-BOND 460215   | 2.5         | 5,410   | 3,755       | 585,850   | 2046/2/15  |  |
|        | 2.5 T-BOND 460515   | 2.5         | 4,210   | 2,915       | 454,696   | 2046/5/15  |  |
|        | 2.5 T-NOTE 260228   | 2.5         | 3,450   | 3,307       | 515,859   | 2026/2/28  |  |
|        | 2.5 T-NOTE 270331   | 2.5         | 7,700   | 7,253       | 1,131,329 | 2027/3/31  |  |
|        | 2.625 T-NOTE 251231 | 2.625       | 3,200   | 3,083       | 480,974   | 2025/12/31 |  |
|        | 2.625 T-NOTE 260131 | 2.625       | 3,900   | 3,752       | 585,284   | 2026/1/31  |  |
|        | 2.625 T-NOTE 270531 | 2.625       | 7,900   | 7,444       | 1,161,267 | 2027/5/31  |  |
|        | 2.625 T-NOTE 290215 | 2.625       | 9,640   | 8,856       | 1,381,505 | 2029/2/15  |  |
|        | 2.625 T-NOTE 290731 | 2.625       | 6,790   | 6,196       | 966,453   | 2029/7/31  |  |
|        | 2.75 T-BOND 420815  | 2.75        | 2,520   | 1,906       | 297,397   | 2042/8/15  |  |
|        | 2.75 T-BOND 421115  | 2.75        | 3,700   | 2,791       | 435,414   | 2042/11/15 |  |
|        | 2.75 T-BOND 470815  | 2.75        | 5,190   | 3,725       | 581,031   | 2047/8/15  |  |
|        | 2.75 T-BOND 471115  | 2.75        | 5,710   | 4,090       | 638,064   | 2047/11/15 |  |
|        | 2.75 T-NOTE 250630  | 2.75        | 2,370   | 2,309       | 360,214   | 2025/6/30  |  |
|        | 2.75 T-NOTE 250831  | 2.75        | 4,050   | 3,932       | 613,458   | 2025/8/31  |  |
|        | 2.75 T-NOTE 270430  | 2.75        | 10,100  | 9,566       | 1,492,135 | 2027/4/30  |  |
|        | 2.75 T-NOTE 270731  | 2.75        | 7,650   | 7,219       | 1,126,080 | 2027/7/31  |  |
|        | 2.75 T-NOTE 280215  | 2.75        | 9,990   | 9,355       | 1,459,267 | 2028/2/15  |  |
|        | 2.75 T-NOTE 290531  | 2.75        | 7,160   | 6,589       | 1,027,885 | 2029/5/31  |  |
|        | 2.75 T-NOTE 320815  | 2.75        | 17,340  | 15,254      | 2,379,337 | 2032/8/15  |  |
|        | 2.875 T-BOND 430515 | 2.875       | 4,680   | 3,584       | 559,066   | 2043/5/15  |  |
|        | 2.875 T-BOND 450815 | 2.875       | 3,500   | 2,618       | 408,509   | 2045/8/15  |  |
|        | 2.875 T-BOND 461115 | 2.875       | 2,340   | 1,731       | 270,094   | 2046/11/15 |  |
|        | 2.875 T-BOND 490515 | 2.875       | 8,570   | 6,232       | 972,171   | 2049/5/15  |  |
|        | 2.875 T-BOND 520515 | 2.875       | 10,840  | 7,805       | 1,217,458 | 2052/5/15  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 250531 | 2.875       | 4,230   | 4,132       | 644,647   | 2025/5/31  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 250615 | 2.875       | 7,800   | 7,616       | 1,187,962 | 2025/6/15  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 250731 | 2.875       | 6,100   | 5,943       | 927,096   | 2025/7/31  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 251130 | 2.875       | 3,800   | 3,680       | 574,155   | 2025/11/30 |  |
|        | 2.875 T-NOTE 280515 | 2.875       | 11,990  | 11,248      | 1,754,554 | 2028/5/15  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 280815 | 2.875       | 10,310  | 9,642       | 1,504,000 | 2028/8/15  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 290430 | 2.875       | 7,000   | 6,488       | 1,012,124 | 2029/4/30  |  |
|        | 2.875 T-NOTE 320515 | 2.875       | 17,030  | 15,172      | 2,366,632 | 2032/5/15  |  |
|        | 3 T-BOND 420515     | 3.0         | 2,270   | 1,792       | 279,608   | 2042/5/15  |  |
|        | 3 T-BOND 441115     | 3.0         | 3,900   | 3,003       | 468,431   | 2044/11/15 |  |
|        | 3 T-BOND 450515     | 3.0         | 2,790   | 2,138       | 333,595   | 2045/5/15  |  |
|        | 3 T-BOND 451115     | 3.0         | 2,000   | 1,527       | 238,210   | 2045/11/15 |  |
|        | 3 T-BOND 470215     | 3.0         | 4,590   | 3,468       | 540,960   | 2047/2/15  |  |

| 銘<br>柄 |                     | 当<br>期<br>末 |         |             |           | 償還年月日      |  |
|--------|---------------------|-------------|---------|-------------|-----------|------------|--|
|        |                     | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|        |                     |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| アメリカ   |                     | %           | 千アメリカドル | 千アメリカドル     | 千円        |            |  |
| 国債証券   | 3 T-BOND 470515     | 3.0         | 3,990   | 3,009       | 469,371   | 2047/5/15  |  |
|        | 3 T-BOND 480215     | 3.0         | 5,970   | 4,477       | 698,364   | 2048/2/15  |  |
|        | 3 T-BOND 480815     | 3.0         | 7,070   | 5,286       | 824,542   | 2048/8/15  |  |
|        | 3 T-BOND 490215     | 3.0         | 7,450   | 5,558       | 867,044   | 2049/2/15  |  |
|        | 3 T-BOND 520815     | 3.0         | 9,700   | 7,167       | 1,117,910 | 2052/8/15  |  |
|        | 3 T-NOTE 250715     | 3.0         | 6,700   | 6,542       | 1,020,429 | 2025/7/15  |  |
|        | 3 T-NOTE 250930     | 3.0         | 5,400   | 5,254       | 819,606   | 2025/9/30  |  |
|        | 3 T-NOTE 251031     | 3.0         | 3,300   | 3,207       | 500,277   | 2025/10/31 |  |
|        | 3.125 T-BOND 411115 | 3.125       | 1,990   | 1,613       | 251,703   | 2041/11/15 |  |
|        | 3.125 T-BOND 420215 | 3.125       | 2,200   | 1,777       | 277,232   | 2042/2/15  |  |
|        | 3.125 T-BOND 430215 | 3.125       | 3,160   | 2,523       | 393,624   | 2043/2/15  |  |
|        | 3.125 T-BOND 440815 | 3.125       | 5,680   | 4,476       | 698,286   | 2044/8/15  |  |
|        | 3.125 T-BOND 480515 | 3.125       | 7,240   | 5,549       | 865,587   | 2048/5/15  |  |
|        | 3.125 T-NOTE 250815 | 3.125       | 5,000   | 4,883       | 761,682   | 2025/8/15  |  |
|        | 3.125 T-NOTE 270831 | 3.125       | 7,300   | 6,963       | 1,086,235 | 2027/8/31  |  |
|        | 3.125 T-NOTE 281115 | 3.125       | 9,380   | 8,838       | 1,378,564 | 2028/11/15 |  |
|        | 3.125 T-NOTE 290831 | 3.125       | 5,900   | 5,514       | 860,086   | 2029/8/31  |  |
|        | 3.25 T-BOND 420515  | 3.25        | 9,570   | 7,848       | 1,224,183 | 2042/5/15  |  |
|        | 3.25 T-NOTE 270630  | 3.25        | 8,090   | 7,762       | 1,210,811 | 2027/6/30  |  |
|        | 3.25 T-NOTE 290630  | 3.25        | 6,170   | 5,810       | 906,269   | 2029/6/30  |  |
|        | 3.375 T-BOND 420815 | 3.375       | 6,370   | 5,307       | 827,922   | 2042/8/15  |  |
|        | 3.375 T-BOND 440515 | 3.375       | 3,380   | 2,777       | 433,282   | 2044/5/15  |  |
|        | 3.375 T-BOND 481115 | 3.375       | 8,120   | 6,500       | 1,013,988 | 2048/11/15 |  |
|        | 3.375 T-NOTE 330515 | 3.375       | 16,100  | 14,757      | 2,301,841 | 2033/5/15  |  |
|        | 3.5 T-BOND 390215   | 3.5         | 1,490   | 1,323       | 206,450   | 2039/2/15  |  |
|        | 3.5 T-NOTE 250915   | 3.5         | 7,900   | 7,742       | 1,207,645 | 2025/9/15  |  |
|        | 3.5 T-NOTE 280131   | 3.5         | 9,030   | 8,692       | 1,355,790 | 2028/1/31  |  |
|        | 3.5 T-NOTE 280430   | 3.5         | 6,900   | 6,631       | 1,034,346 | 2028/4/30  |  |
|        | 3.5 T-NOTE 300131   | 3.5         | 5,800   | 5,502       | 858,354   | 2030/1/31  |  |
|        | 3.5 T-NOTE 300430   | 3.5         | 5,600   | 5,304       | 827,442   | 2030/4/30  |  |
|        | 3.5 T-NOTE 330215   | 3.5         | 17,690  | 16,405      | 2,558,968 | 2033/2/15  |  |
|        | 3.625 T-BOND 430815 | 3.625       | 3,400   | 2,915       | 454,821   | 2043/8/15  |  |
|        | 3.625 T-BOND 440215 | 3.625       | 3,870   | 3,308       | 516,020   | 2044/2/15  |  |
|        | 3.625 T-BOND 530215 | 3.625       | 9,740   | 8,141       | 1,269,875 | 2053/2/15  |  |
|        | 3.625 T-BOND 530515 | 3.625       | 10,160  | 8,494       | 1,325,036 | 2053/5/15  |  |
|        | 3.625 T-NOTE 260515 | 3.625       | 7,000   | 6,836       | 1,066,376 | 2026/5/15  |  |
|        | 3.625 T-NOTE 280331 | 3.625       | 6,000   | 5,796       | 904,074   | 2028/3/31  |  |
|        | 3.625 T-NOTE 280531 | 3.625       | 6,600   | 6,370       | 993,617   | 2028/5/31  |  |
|        | 3.625 T-NOTE 300331 | 3.625       | 5,500   | 5,248       | 818,648   | 2030/3/31  |  |
|        | 3.75 T-BOND 410815  | 3.75        | 2,060   | 1,831       | 285,672   | 2041/8/15  |  |
|        | 3.75 T-BOND 431115  | 3.75        | 4,830   | 4,212       | 657,062   | 2043/11/15 |  |
|        | 3.75 T-NOTE 260415  | 3.75        | 7,000   | 6,856       | 1,069,447 | 2026/4/15  |  |
|        | 3.75 T-NOTE 281231  | 3.75        | 10,260  | 9,924       | 1,547,999 | 2028/12/31 |  |
|        | 3.75 T-NOTE 300531  | 3.75        | 5,600   | 5,374       | 838,343   | 2030/5/31  |  |
|        | 3.75 T-NOTE 300630  | 3.75        | 6,250   | 5,995       | 935,137   | 2030/6/30  |  |
|        | 3.75 T-NOTE 301231  | 3.75        | 6,660   | 6,372       | 994,027   | 2030/12/31 |  |
|        | 3.875 T-BOND 400815 | 3.875       | 2,560   | 2,336       | 364,392   | 2040/8/15  |  |

| 銘<br>柄 |                     | 当<br>期<br>末 |         |             |           | 償還年月日      |  |
|--------|---------------------|-------------|---------|-------------|-----------|------------|--|
|        |                     | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|        |                     |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| アメリカ   |                     | %           | 千アメリカドル | 千アメリカドル     | 千円        |            |  |
| 国債証券   | 3.875 T-BOND 430215 | 3.875       | 6,740   | 6,013       | 937,981   | 2043/2/15  |  |
|        | 3.875 T-BOND 430515 | 3.875       | 6,920   | 6,165       | 961,640   | 2043/5/15  |  |
|        | 3.875 T-NOTE 260115 | 3.875       | 6,700   | 6,585       | 1,027,165 | 2026/1/15  |  |
|        | 3.875 T-NOTE 271130 | 3.875       | 6,900   | 6,732       | 1,050,196 | 2027/11/30 |  |
|        | 3.875 T-NOTE 271231 | 3.875       | 7,000   | 6,829       | 1,065,203 | 2027/12/31 |  |
|        | 3.875 T-NOTE 290930 | 3.875       | 6,030   | 5,843       | 911,497   | 2029/9/30  |  |
|        | 3.875 T-NOTE 291130 | 3.875       | 6,190   | 5,993       | 934,853   | 2029/11/30 |  |
|        | 3.875 T-NOTE 291231 | 3.875       | 5,700   | 5,516       | 860,537   | 2029/12/31 |  |
|        | 3.875 T-NOTE 330815 | 3.875       | 18,320  | 17,442      | 2,720,647 | 2033/8/15  |  |
|        | 4 T-BOND 421115     | 4.0         | 6,840   | 6,220       | 970,340   | 2042/11/15 |  |
|        | 4 T-BOND 521115     | 4.0         | 9,790   | 8,772       | 1,368,285 | 2052/11/15 |  |
|        | 4 T-NOTE 251215     | 4.0         | 7,750   | 7,632       | 1,190,547 | 2025/12/15 |  |
|        | 4 T-NOTE 260215     | 4.0         | 8,000   | 7,875       | 1,228,391 | 2026/2/15  |  |
|        | 4 T-NOTE 270115     | 4.0         | 12,300  | 12,079      | 1,884,154 | 2027/1/15  |  |
|        | 4 T-NOTE 280229     | 4.0         | 7,640   | 7,481       | 1,167,015 | 2028/2/29  |  |
|        | 4 T-NOTE 280630     | 4.0         | 8,990   | 8,797       | 1,372,270 | 2028/6/30  |  |
|        | 4 T-NOTE 290131     | 4.0         | 10,050  | 9,824       | 1,532,358 | 2029/1/31  |  |
|        | 4 T-NOTE 291031     | 4.0         | 6,600   | 6,432       | 1,003,288 | 2029/10/31 |  |
|        | 4 T-NOTE 300228     | 4.0         | 7,330   | 7,136       | 1,113,097 | 2030/2/28  |  |
|        | 4 T-NOTE 300731     | 4.0         | 5,400   | 5,250       | 818,931   | 2030/7/31  |  |
|        | 4 T-NOTE 310131     | 4.0         | 6,950   | 6,747       | 1,052,428 | 2031/1/31  |  |
|        | 4 T-NOTE 340215     | 4.0         | 20,450  | 19,633      | 3,062,448 | 2034/2/15  |  |
|        | 4.125 T-BOND 530815 | 4.125       | 10,700  | 9,795       | 1,527,969 | 2053/8/15  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 260615 | 4.125       | 7,000   | 6,901       | 1,076,420 | 2026/6/15  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 270215 | 4.125       | 9,500   | 9,358       | 1,459,814 | 2027/2/15  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 270930 | 4.125       | 7,440   | 7,323       | 1,142,358 | 2027/9/30  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 271031 | 4.125       | 6,500   | 6,395       | 997,592   | 2027/10/31 |  |
|        | 4.125 T-NOTE 280731 | 4.125       | 7,700   | 7,570       | 1,180,848 | 2028/7/31  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 290331 | 4.125       | 7,500   | 7,369       | 1,149,469 | 2029/3/31  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 300831 | 4.125       | 7,100   | 6,948       | 1,083,859 | 2030/8/31  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 310331 | 4.125       | 5,400   | 5,279       | 823,472   | 2031/3/31  |  |
|        | 4.125 T-NOTE 321115 | 4.125       | 16,070  | 15,636      | 2,439,037 | 2032/11/15 |  |
|        | 4.25 T-BOND 390515  | 4.25        | 1,770   | 1,706       | 266,227   | 2039/5/15  |  |
|        | 4.25 T-BOND 401115  | 4.25        | 1,980   | 1,888       | 294,556   | 2040/11/15 |  |
|        | 4.25 T-BOND 540215  | 4.25        | 10,660  | 9,979       | 1,556,616 | 2054/2/15  |  |
|        | 4.25 T-NOTE 251015  | 4.25        | 6,000   | 5,935       | 925,844   | 2025/10/15 |  |
|        | 4.25 T-NOTE 251231  | 4.25        | 13,580  | 13,426      | 2,094,213 | 2025/12/31 |  |
|        | 4.25 T-NOTE 260131  | 4.25        | 9,390   | 9,282       | 1,447,946 | 2026/1/31  |  |
|        | 4.25 T-NOTE 270315  | 4.25        | 14,000  | 13,839      | 2,158,641 | 2027/3/15  |  |
|        | 4.25 T-NOTE 290228  | 4.25        | 11,330  | 11,197      | 1,746,612 | 2029/2/28  |  |
|        | 4.25 T-NOTE 310228  | 4.25        | 8,180   | 8,059       | 1,257,176 | 2031/2/28  |  |
|        | 4.375 T-BOND 380215 | 4.375       | 1,280   | 1,263       | 197,092   | 2038/2/15  |  |
|        | 4.375 T-BOND 391115 | 4.375       | 2,270   | 2,212       | 345,132   | 2039/11/15 |  |
|        | 4.375 T-BOND 400515 | 4.375       | 2,080   | 2,021       | 315,326   | 2040/5/15  |  |
|        | 4.375 T-BOND 410515 | 4.375       | 1,960   | 1,892       | 295,199   | 2041/5/15  |  |
|        | 4.375 T-BOND 430815 | 4.375       | 7,570   | 7,218       | 1,125,881 | 2043/8/15  |  |
|        | 4.375 T-NOTE 260815 | 4.375       | 7,600   | 7,529       | 1,174,519 | 2026/8/15  |  |

| 銘<br>柄 |                      | 当<br>期<br>末 |         |             |             | 償還年月日      |  |
|--------|----------------------|-------------|---------|-------------|-------------|------------|--|
|        |                      | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |             |            |  |
|        |                      |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額      |            |  |
| アメリカ   |                      | %           | 千アメリカドル | 千アメリカドル     | 千円          |            |  |
| 国債証券   | 4.375 T-NOTE 261215  | 4.375       | 9,640   | 9,556       | 1,490,695   | 2026/12/15 |  |
|        | 4.375 T-NOTE 280831  | 4.375       | 7,000   | 6,949       | 1,083,905   | 2028/8/31  |  |
|        | 4.375 T-NOTE 281130  | 4.375       | 9,310   | 9,247       | 1,442,360   | 2028/11/30 |  |
|        | 4.375 T-NOTE 301130  | 4.375       | 6,250   | 6,201       | 967,239     | 2030/11/30 |  |
|        | 4.5 T-BOND 360215    | 4.5         | 1,160   | 1,173       | 182,965     | 2036/2/15  |  |
|        | 4.5 T-BOND 380515    | 4.5         | 1,330   | 1,327       | 207,052     | 2038/5/15  |  |
|        | 4.5 T-BOND 390815    | 4.5         | 1,880   | 1,861       | 290,367     | 2039/8/15  |  |
|        | 4.5 T-BOND 440215    | 4.5         | 5,350   | 5,184       | 808,675     | 2044/2/15  |  |
|        | 4.5 T-NOTE 251115    | 4.5         | 4,700   | 4,665       | 727,707     | 2025/11/15 |  |
|        | 4.5 T-NOTE 260331    | 4.5         | 2,280   | 2,263       | 353,092     | 2026/3/31  |  |
|        | 4.5 T-NOTE 260715    | 4.5         | 6,500   | 6,456       | 1,007,077   | 2026/7/15  |  |
|        | 4.5 T-NOTE 270415    | 4.5         | 13,000  | 12,937      | 2,017,918   | 2027/4/15  |  |
|        | 4.5 T-NOTE 331115    | 4.5         | 19,430  | 19,410      | 3,027,613   | 2033/11/15 |  |
|        | 4.625 T-BOND 400215  | 4.625       | 2,100   | 2,103       | 328,057     | 2040/2/15  |  |
|        | 4.625 T-NOTE 260228  | 4.625       | 19,800  | 19,699      | 3,072,781   | 2026/2/28  |  |
|        | 4.625 T-NOTE 260315  | 4.625       | 6,000   | 5,971       | 931,438     | 2026/3/15  |  |
|        | 4.625 T-NOTE 260915  | 4.625       | 7,500   | 7,473       | 1,165,645   | 2026/9/15  |  |
|        | 4.625 T-NOTE 261015  | 4.625       | 6,800   | 6,777       | 1,057,225   | 2026/10/15 |  |
|        | 4.625 T-NOTE 261115  | 4.625       | 8,720   | 8,694       | 1,356,160   | 2026/11/15 |  |
|        | 4.625 T-NOTE 280930  | 4.625       | 8,030   | 8,049       | 1,255,601   | 2028/9/30  |  |
|        | 4.625 T-NOTE 300930  | 4.625       | 5,700   | 5,734       | 894,538     | 2030/9/30  |  |
|        | 4.75 T-BOND 410215   | 4.75        | 2,010   | 2,032       | 317,010     | 2041/2/15  |  |
|        | 4.75 T-BOND 431115   | 4.75        | 6,220   | 6,226       | 971,180     | 2043/11/15 |  |
|        | 4.75 T-BOND 531115   | 4.75        | 10,670  | 10,849      | 1,692,261   | 2053/11/15 |  |
|        | 4.75 T-NOTE 250731   | 4.75        | 7,500   | 7,470       | 1,165,303   | 2025/7/31  |  |
|        | 4.875 T-NOTE 251130  | 4.875       | 8,400   | 8,384       | 1,307,749   | 2025/11/30 |  |
|        | 4.875 T-NOTE 281031  | 4.875       | 8,500   | 8,609       | 1,342,843   | 2028/10/31 |  |
|        | 4.875 T-NOTE 301031  | 4.875       | 6,100   | 6,222       | 970,507     | 2030/10/31 |  |
|        | 5 T-BOND 370515      | 5.0         | 1,020   | 1,075       | 167,682     | 2037/5/15  |  |
|        | 5 T-NOTE 250831      | 5.0         | 8,500   | 8,493       | 1,324,794   | 2025/8/31  |  |
|        | 5 T-NOTE 250930      | 5.0         | 7,600   | 7,595       | 1,184,707   | 2025/9/30  |  |
|        | 5 T-NOTE 251031      | 5.0         | 9,500   | 9,496       | 1,481,317   | 2025/10/31 |  |
|        | 5.25 T-BOND 281115   | 5.25        | 2,690   | 2,768       | 431,764     | 2028/11/15 |  |
|        | 5.375 T-BOND 310215  | 5.375       | 1,300   | 1,373       | 214,180     | 2031/2/15  |  |
|        | 6 T-BOND 260215      | 6.0         | 1,200   | 1,225       | 191,131     | 2026/2/15  |  |
|        | 6.125 T-BOND 271115  | 6.125       | 1,160   | 1,216       | 189,771     | 2027/11/15 |  |
|        | 6.25 T-BOND 300515   | 6.25        | 1,150   | 1,253       | 195,534     | 2030/5/15  |  |
| 小<br>計 |                      |             |         |             | 290,751,456 |            |  |
| カナダ    |                      |             | 千カナダドル  | 千カナダドル      |             |            |  |
| 国債証券   | 0.25 CAN GOVT 260301 | 0.25        | 2,200   | 2,047       | 233,505     | 2026/3/1   |  |
|        | 0.5 CAN GOVT 250901  | 0.5         | 2,900   | 2,755       | 314,166     | 2025/9/1   |  |
|        | 0.5 CAN GOVT 301201  | 0.5         | 4,500   | 3,673       | 418,811     | 2030/12/1  |  |
|        | 1 CAN GOVT 260901    | 1.0         | 2,500   | 2,328       | 265,505     | 2026/9/1   |  |
|        | 1 CAN GOVT 270601    | 1.0         | 1,930   | 1,769       | 201,766     | 2027/6/1   |  |
|        | 1.25 CAN GOVT 270301 | 1.25        | 2,500   | 2,317       | 264,215     | 2027/3/1   |  |
|        | 1.25 CAN GOVT 300601 | 1.25        | 4,410   | 3,829       | 436,656     | 2030/6/1   |  |
|        | 1.5 CAN GOVT 260601  | 1.5         | 4,070   | 3,854       | 439,538     | 2026/6/1   |  |

| 銘<br>柄 |                          | 当<br>期<br>末              |         |             |            | 償還年月日     |  |
|--------|--------------------------|--------------------------|---------|-------------|------------|-----------|--|
|        |                          | 利<br>率                   | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |            |           |  |
|        |                          |                          |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |           |  |
| カナダ    |                          | %                        | 千カナダドル  | 千カナダドル      | 千円         |           |  |
| 国債証券   | 1.5 CAN GOVT 310601      | 1.5                      | 5,900   | 5,102       | 581,775    | 2031/6/1  |  |
|        | 1.5 CAN GOVT 311201      | 1.5                      | 4,930   | 4,220       | 481,168    | 2031/12/1 |  |
|        | 1.75 CAN GOVT 531201     | 1.75                     | 5,550   | 3,733       | 425,720    | 2053/12/1 |  |
|        | 2 CAN GOVT 280601        | 2.0                      | 2,670   | 2,495       | 284,529    | 2028/6/1  |  |
|        | 2 CAN GOVT 320601        | 2.0                      | 5,350   | 4,720       | 538,259    | 2032/6/1  |  |
|        | 2 CAN GOVT 511201        | 2.0                      | 7,140   | 5,183       | 590,982    | 2051/12/1 |  |
|        | 2.25 CAN GOVT 250601     | 2.25                     | 4,360   | 4,257       | 485,447    | 2025/6/1  |  |
|        | 2.25 CAN GOVT 290601     | 2.25                     | 2,210   | 2,068       | 235,876    | 2029/6/1  |  |
|        | 2.25 CAN GOVT 291201     | 2.25                     | 1,000   | 931         | 106,211    | 2029/12/1 |  |
|        | 2.5 CAN GOVT 321201      | 2.5                      | 3,500   | 3,194       | 364,224    | 2032/12/1 |  |
|        | 2.75 CAN GOVT 270901     | 2.75                     | 2,000   | 1,927       | 219,828    | 2027/9/1  |  |
|        | 2.75 CAN GOVT 330601     | 2.75                     | 3,000   | 2,783       | 317,416    | 2033/6/1  |  |
|        | 2.75 CAN GOVT 481201     | 2.75                     | 1,680   | 1,453       | 165,767    | 2048/12/1 |  |
|        | 2.75 CAN GOVT 551201     | 2.75                     | 2,590   | 2,210       | 252,015    | 2055/12/1 |  |
|        | 2.75 CANADA GOVER 641201 | 2.75                     | 1,250   | 1,053       | 120,151    | 2064/12/1 |  |
|        | 3 CAN GOVT 251001        | 3.0                      | 3,000   | 2,939       | 335,108    | 2025/10/1 |  |
|        | 3 CAN GOVT 340601        | 3.0                      | 3,140   | 2,959       | 337,400    | 2034/6/1  |  |
|        | 3.25 CAN GOVT 280901     | 3.25                     | 2,600   | 2,543       | 290,031    | 2028/9/1  |  |
|        | 3.25 CAN GOVT 331201     | 3.25                     | 3,170   | 3,057       | 348,596    | 2033/12/1 |  |
|        | 3.5 CAN GOVT 280301      | 3.5                      | 2,000   | 1,975       | 225,202    | 2028/3/1  |  |
|        | 3.5 CAN GOVT 340301      | 3.5                      | 2,020   | 1,990       | 226,962    | 2034/3/1  |  |
|        | 3.5 CAN GOVT 451201      | 3.5                      | 1,650   | 1,622       | 185,019    | 2045/12/1 |  |
|        | 3.75 CAN GOVT 250501     | 3.75                     | 3,500   | 3,469       | 395,548    | 2025/5/1  |  |
|        | 4 CAN GOVT 260501        | 4.0                      | 3,200   | 3,182       | 362,916    | 2026/5/1  |  |
|        | 4 CAN GOVT 290301        | 4.0                      | 5,060   | 5,111       | 582,819    | 2029/3/1  |  |
|        | 4 CAN GOVT 410601        | 4.0                      | 1,200   | 1,254       | 142,981    | 2041/6/1  |  |
|        | 4.5 CAN GOVT 251101      | 4.5                      | 2,540   | 2,539       | 289,573    | 2025/11/1 |  |
|        | 4.5 CAN GOVT 260201      | 4.5                      | 5,200   | 5,208       | 593,881    | 2026/2/1  |  |
|        | 5 CAN GOVT 370601        | 5.0                      | 1,330   | 1,511       | 172,389    | 2037/6/1  |  |
|        | 5.75 CAN GOVT 290601     | 5.75                     | 950     | 1,040       | 118,618    | 2029/6/1  |  |
|        | 5.75 CAN GOVT 330601     | 5.75                     | 1,430   | 1,653       | 188,527    | 2033/6/1  |  |
| 小<br>計 |                          |                          |         |             | 12,539,117 |           |  |
| メキシコ   | 国債証券                     |                          | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ     |            |           |  |
|        |                          | 10 MEXICAN BONOS 361120  | 10.0    | 12,350      | 12,696     | 118,076   |  |
|        |                          | 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 5.5     | 52,000      | 46,427     | 431,758   |  |
|        |                          | 5.75 MEXICAN BONO 260305 | 5.75    | 65,500      | 60,502     | 562,650   |  |
|        |                          | 7 MEXICAN BONOS 260903   | 7.0     | 42,000      | 39,220     | 364,738   |  |
|        |                          | 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 7.5     | 63,950      | 59,918     | 557,218   |  |
|        |                          | 7.5 MEXICAN BONOS 330526 | 7.5     | 60,200      | 52,476     | 488,014   |  |
|        |                          | 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 7.75    | 68,050      | 61,482     | 571,762   |  |
|        |                          | 7.75 MEXICAN BONO 341123 | 7.75    | 13,400      | 11,746     | 109,234   |  |
|        |                          | 7.75 MEXICAN BONO 421113 | 7.75    | 57,940      | 48,169     | 447,957   |  |
|        |                          | 8 MEXICAN BONOS 350524   | 8.0     | 5,000       | 4,398      | 40,907    |  |
|        |                          | 8 MEXICAN BONOS 471107   | 8.0     | 39,100      | 33,029     | 307,163   |  |
|        |                          | 8 MEXICAN BONOS 530731   | 8.0     | 46,270      | 38,869     | 361,471   |  |
|        |                          | 8.5 MEXICAN BONOS 290301 | 8.5     | 23,420      | 22,378     | 208,113   |  |
|        |                          | 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 8.5     | 48,650      | 46,309     | 430,659   |  |

| 銘 柏  |                          |                  | 当 期 末 |         |           |            |
|------|--------------------------|------------------|-------|---------|-----------|------------|
|      |                          |                  | 利 率   | 額面金額    | 評 価 額     | 償還年月日      |
| メキシコ |                          |                  | %     | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ   | 千円         |
| 国債証券 | 8.5 MEXICAN BONOS 381118 |                  | 8.5   | 39,700  | 36,116    | 335,870    |
| 小 計  |                          |                  |       |         | 5,335,597 | 2038/11/18 |
| ユーロ  |                          |                  |       | 千ユーロ    | 千ユーロ      |            |
| ドイツ  | 国債証券                     | 0 BUND 260815    | —     | 5,930   | 5,564     | 934,683    |
|      |                          | 0 BUND 271115    | —     | 3,100   | 2,829     | 475,179    |
|      |                          | 0 BUND 281115    | —     | 5,500   | 4,912     | 825,137    |
|      |                          | 0 BUND 290815    | —     | 4,550   | 3,998     | 671,585    |
|      |                          | 0 BUND 300215    | —     | 4,820   | 4,188     | 703,431    |
|      |                          | 0 BUND 300815    | —     | 6,660   | 5,724     | 961,425    |
|      |                          | 0 BUND 300815    | —     | 1,550   | 1,333     | 223,936    |
|      |                          | 0 BUND 310215    | —     | 5,140   | 4,364     | 733,106    |
|      |                          | 0 BUND 310815    | —     | 5,400   | 4,533     | 761,432    |
|      |                          | 0 BUND 310815    | —     | 1,900   | 1,595     | 268,026    |
|      |                          | 0 BUND 320215    | —     | 4,690   | 3,886     | 652,745    |
|      |                          | 0 BUND 350515    | —     | 3,630   | 2,750     | 461,926    |
|      |                          | 0 BUND 360515    | —     | 4,270   | 3,142     | 527,754    |
|      |                          | 0 BUND 500815    | —     | 7,470   | 3,779     | 634,858    |
|      |                          | 0 BUND 500815    | —     | 1,560   | 792       | 133,117    |
|      |                          | 0 BUND 520815    | —     | 5,150   | 2,483     | 417,209    |
|      |                          | 0 OBL 251010     | —     | 4,000   | 3,830     | 643,340    |
|      |                          | 0 OBL 251010     | —     | 1,000   | 957       | 160,896    |
|      |                          | 0 OBL 260410     | —     | 6,910   | 6,536     | 1,097,942  |
|      |                          | 0 OBL 261009     | —     | 2,900   | 2,711     | 455,378    |
|      |                          | 0 OBL 270416     | —     | 3,830   | 3,539     | 594,516    |
|      |                          | 0.25 BUND 280815 | 0.25  | 4,640   | 4,214     | 707,869    |
|      |                          | 0.25 BUND 290215 | 0.25  | 4,850   | 4,362     | 732,784    |
|      |                          | 0.5 BUND 260215  | 0.5   | 6,660   | 6,378     | 1,071,396  |
|      |                          | 0.5 BUND 270815  | 0.5   | 5,120   | 4,779     | 802,682    |
|      |                          | 0.5 BUND 280215  | 0.5   | 4,280   | 3,962     | 665,566    |
|      |                          | 1 BUND 250815    | 1.0   | 5,580   | 5,427     | 911,646    |
|      |                          | 1 BUND 380515    | 1.0   | 3,610   | 2,919     | 490,367    |
|      |                          | 1.25 BUND 480815 | 1.25  | 6,260   | 4,691     | 788,006    |
|      |                          | 1.3 OBL 271015   | 1.3   | 5,750   | 5,497     | 923,417    |
|      |                          | 1.3 OBL 271015   | 1.3   | 800     | 765       | 128,563    |
|      |                          | 1.7 BUND 320815  | 1.7   | 6,430   | 6,066     | 1,018,959  |
|      |                          | 1.8 BUND 530815  | 1.8   | 4,780   | 3,961     | 665,295    |
|      |                          | 1.8 BUND 530815  | 1.8   | 1,000   | 830       | 139,489    |
|      |                          | 2.1 BUND 291115  | 2.1   | 4,460   | 4,363     | 732,956    |
|      |                          | 2.1 OBL 290412   | 2.1   | 2,510   | 2,457     | 412,774    |
|      |                          | 2.2 BUND 340215  | 2.2   | 3,850   | 3,744     | 628,960    |
|      |                          | 2.2 OBL 280413   | 2.2   | 4,250   | 4,184     | 702,749    |
|      |                          | 2.3 BUND 330215  | 2.3   | 6,190   | 6,102     | 1,025,019  |
|      |                          | 2.3 BUND 330215  | 2.3   | 950     | 937       | 157,401    |
|      |                          | 2.4 BUND 301115  | 2.4   | 2,580   | 2,564     | 430,734    |
|      |                          | 2.4 OBL 281019   | 2.4   | 4,820   | 4,780     | 803,013    |
|      |                          | 2.5 BUND 440704  | 2.5   | 5,360   | 5,195     | 872,581    |
|      |                          | 2.5 BUND 460815  | 2.5   | 5,660   | 5,481     | 920,746    |

| 銘 柏  |      |  | 当 期 末  |  |  |  |   |
|------|------|--|--|--|--|--|---|
|      |      |  | 利 率  | 額面金額   | 評 値 額  | 償還年月日  |   |
| ユーロ  |      |  | %  | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円   |   |
| ドイツ  | 国債証券 | 2.5 BUND 540815<br>2.5 SCHATS 260319<br>2.6 BUND 330815<br>2.8 SCHATS 250612<br>3.1 SCHATS 251212<br>3.25 BUND 420704<br>4 BUND 370104<br>4.25 BUND 390704<br>4.75 BUND 280704<br>4.75 BUND 340704<br>4.75 BUND 400704<br>5.5 BUND 310104<br>5.625 BUND 280104<br>6.25 BUND 300104<br>6.5 BUND 270704  | 2.5<br>2.5<br>2.6<br>2.8<br>3.1<br>3.25<br>4.0<br>4.25<br>4.75<br>4.75<br>4.75<br>5.5<br>5.625<br>6.25<br>6.5  | 1,970<br>2,500<br>4,910<br>3,470<br>4,000<br>3,190<br>4,830<br>3,810<br>2,340<br>4,890<br>3,610<br>3,650<br>3,460<br>1,700<br>2,680  | 1,909<br>2,475<br>4,950<br>3,450<br>3,997<br>3,439<br>5,540<br>4,551<br>2,535<br>5,850<br>4,580<br>4,308<br>3,813<br>2,028<br>2,979  | 320,706<br>415,846<br>831,446<br>579,620<br>671,455<br>577,758<br>930,552<br>764,529<br>425,862<br>982,650<br>769,352<br>723,671<br>640,456<br>340,650<br>500,404  | 2054/8/15<br>2026/3/19<br>2033/8/15<br>2025/6/12<br>2025/12/12<br>2042/7/4<br>2037/1/4<br>2039/7/4<br>2028/7/4<br>2034/7/4<br>2040/7/4<br>2031/1/4<br>2028/1/4<br>2030/1/4<br>2027/7/4  |
| イタリア | 国債証券 | 0 ITALY GOVT 260401<br>0 ITALY GOVT 260801<br>0.25 ITALY GOVT 280315<br>0.45 ITALY GOVT 290215<br>0.5 ITALY GOVT 260201<br>0.5 ITALY GOVT 280715<br>0.6 ITALY GOVT 310801<br>0.85 ITALY GOVT 270115<br>0.9 ITALY GOVT 310401<br>0.95 ITALY GOVT 270915<br>0.95 ITALY GOVT 300801<br>0.95 ITALY GOVT 311201<br>0.95 ITALY GOVT 320601<br>0.95 ITALY GOVT 370301<br>1.1 ITALY GOVT 270401<br>1.2 ITALY GOVT 250815<br>1.25 ITALY GOVT 261201<br>1.35 ITALY GOVT 300401<br>1.45 ITALY GOVT 250515<br>1.45 ITALY GOVT 360301<br>1.5 ITALY GOVT 250601<br>1.5 ITALY GOVT 450430<br>1.6 ITALY GOVT 260601<br>1.65 ITALY GOVT 301201<br>1.65 ITALY GOVT 320301<br>1.7 ITALY GOVT 510901<br>1.8 ITALY GOVT 410301<br>1.85 ITALY GOVT 250701<br>2 ITALY GOVT 251201<br>2 ITALY GOVT 280201<br>2.05 ITALY GOVT 270801<br>2.1 ITALY GOVT 260715 | —<br>—<br>0.25<br>0.45<br>0.5<br>0.5<br>0.6<br>0.85<br>0.9<br>0.95<br>0.95<br>0.95<br>0.95<br>0.95<br>0.95<br>1.1<br>1.2<br>1.25<br>1.35<br>1.45<br>1.45<br>1.5<br>1.5<br>1.6<br>1.65<br>1.65<br>1.7<br>1.8<br>1.85<br>2.0<br>2.0<br>2.05<br>2.1 | 3,300<br>5,000<br>4,760<br>2,300<br>2,450<br>2,400<br>3,100<br>3,060<br>4,230<br>4,000<br>2,940<br>4,330<br>3,600<br>2,560<br>3,300<br>2,100<br>4,080<br>3,610<br>2,300<br>2,140<br>3,300<br>2,880<br>4,120<br>3,870<br>4,450<br>2,650<br>2,950<br>4,650<br>3,530<br>3,880<br>2,650<br>2,350 | 3,099<br>4,646<br>4,241<br>2,010<br>2,332<br>2,140<br>2,527<br>2,869<br>3,561<br>3,707<br>2,530<br>3,590<br>2,942<br>1,793<br>3,101<br>2,041<br>3,878<br>3,214<br>2,254<br>1,646<br>3,232<br>1,822<br>3,978<br>3,454<br>3,874<br>1,613<br>2,120<br>4,566<br>3,456<br>3,705<br>2,551<br>2,289 | 520,521<br>780,342<br>712,425<br>337,704<br>391,767<br>359,509<br>424,436<br>481,955<br>598,150<br>622,705<br>424,987<br>603,123<br>494,270<br>301,218<br>520,896<br>342,926<br>651,372<br>539,838<br>378,613<br>276,530<br>542,936<br>306,105<br>668,280<br>580,259<br>650,805<br>271,015<br>356,212<br>766,944<br>580,599<br>622,446<br>428,491<br>384,551 | 2026/4/1<br>2026/8/1<br>2028/3/15<br>2029/2/15<br>2026/2/1<br>2028/7/15<br>2031/8/1<br>2027/1/15<br>2031/4/1<br>2027/9/15<br>2030/8/1<br>2031/12/1<br>2032/6/1<br>2037/3/1<br>2027/4/1<br>2025/8/15<br>2026/12/1<br>2030/4/1<br>2025/5/15<br>2036/3/1<br>2025/6/1<br>2045/4/30<br>2026/6/1<br>2030/12/1<br>2032/3/1<br>2051/9/1<br>2041/3/1<br>2025/7/1<br>2025/12/1<br>2028/2/1<br>2027/8/1<br>2026/7/15 |

| 銘 柏  |      |                        | 当 期 末 |       |       |         |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|---------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額  | 評 値 額 | 償還年月日   |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |
| イタリア | 国債証券 | 2.15 ITALY GOVT 520901 | 2.15  | 1,550 | 1,027 | 172,604 |
|      |      | 2.15 ITALY GOVT 720301 | 2.15  | 1,410 | 859   | 144,426 |
|      |      | 2.2 ITALY GOVT 270601  | 2.2   | 3,380 | 3,274 | 549,987 |
|      |      | 2.25 ITALY GOVT 360901 | 2.25  | 2,720 | 2,277 | 382,499 |
|      |      | 2.45 ITALY GOVT 330901 | 2.45  | 3,420 | 3,088 | 518,808 |
|      |      | 2.45 ITALY GOVT 500901 | 2.45  | 2,750 | 1,990 | 334,246 |
|      |      | 2.5 ITALY GOVT 251115  | 2.5   | 2,330 | 2,300 | 386,317 |
|      |      | 2.5 ITALY GOVT 321201  | 2.5   | 3,950 | 3,624 | 608,718 |
|      |      | 2.65 ITALY GOVT 271201 | 2.65  | 2,800 | 2,739 | 460,206 |
|      |      | 2.7 ITALY GOVT 470301  | 2.7   | 3,300 | 2,583 | 433,934 |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 281201  | 2.8   | 3,680 | 3,602 | 604,992 |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 290615  | 2.8   | 3,200 | 3,114 | 523,176 |
|      |      | 2.8 ITALY GOVT 670301  | 2.8   | 1,510 | 1,105 | 185,611 |
|      |      | 2.95 ITALY GOVT 270215 | 2.95  | 830   | 821   | 137,985 |
|      |      | 2.95 ITALY GOVT 380901 | 2.95  | 2,380 | 2,097 | 352,277 |
|      |      | 3 ITALY GOVT 290801    | 3.0   | 5,420 | 5,325 | 894,457 |
|      |      | 3.1 ITALY GOVT 400301  | 3.1   | 2,310 | 2,037 | 342,182 |
|      |      | 3.2 ITALY GOVT 260128  | 3.2   | 4,450 | 4,431 | 744,350 |
|      |      | 3.25 ITALY GOVT 380301 | 3.25  | 2,220 | 2,032 | 341,408 |
|      |      | 3.25 ITALY GOVT 460901 | 3.25  | 2,740 | 2,364 | 397,064 |
|      |      | 3.35 ITALY GOVT 350301 | 3.35  | 3,110 | 2,972 | 499,258 |
|      |      | 3.4 ITALY GOVT 280401  | 3.4   | 3,000 | 3,009 | 505,472 |
|      |      | 3.45 ITALY GOVT 480301 | 3.45  | 3,470 | 3,072 | 516,114 |
|      |      | 3.5 ITALY GOVT 260115  | 3.5   | 2,500 | 2,502 | 420,371 |
|      |      | 3.5 ITALY GOVT 300301  | 3.5   | 4,470 | 4,493 | 754,719 |
|      |      | 3.5 ITALY GOVT 310215  | 3.5   | 2,040 | 2,036 | 341,979 |
|      |      | 3.6 ITALY GOVT 250929  | 3.6   | 2,000 | 2,002 | 336,373 |
|      |      | 3.7 ITALY GOVT 300615  | 3.7   | 2,350 | 2,378 | 399,483 |
|      |      | 3.8 ITALY GOVT 260415  | 3.8   | 2,700 | 2,720 | 456,884 |
|      |      | 3.8 ITALY GOVT 280801  | 3.8   | 3,090 | 3,145 | 528,393 |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 260915 | 3.85  | 2,800 | 2,830 | 475,390 |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 291215 | 3.85  | 3,890 | 3,973 | 667,342 |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 340701 | 3.85  | 1,620 | 1,624 | 272,895 |
|      |      | 3.85 ITALY GOVT 490901 | 3.85  | 2,450 | 2,300 | 386,435 |
|      |      | 4 ITALY GOVT 301115    | 4.0   | 3,840 | 3,949 | 663,367 |
|      |      | 4 ITALY GOVT 311030    | 4.0   | 1,650 | 1,699 | 285,503 |
|      |      | 4 ITALY GOVT 350430    | 4.0   | 2,150 | 2,182 | 366,566 |
|      |      | 4 ITALY GOVT 370201    | 4.0   | 5,850 | 5,898 | 990,634 |
|      |      | 4.1 ITALY GOVT 290201  | 4.1   | 3,530 | 3,643 | 611,994 |
|      |      | 4.15 ITALY GOVT 391001 | 4.15  | 1,830 | 1,830 | 307,446 |
|      |      | 4.2 ITALY GOVT 340301  | 4.2   | 3,430 | 3,547 | 595,776 |
|      |      | 4.35 ITALY GOVT 331101 | 4.35  | 3,710 | 3,887 | 652,946 |
|      |      | 4.4 ITALY GOVT 330501  | 4.4   | 3,800 | 4,005 | 672,738 |
|      |      | 4.45 ITALY GOVT 430901 | 4.45  | 1,940 | 1,991 | 334,445 |
|      |      | 4.5 ITALY GOVT 260301  | 4.5   | 3,740 | 3,810 | 640,015 |
|      |      | 4.5 ITALY GOVT 531001  | 4.5   | 2,470 | 2,539 | 426,454 |
|      |      | 4.75 ITALY GOVT 280901 | 4.75  | 3,930 | 4,151 | 697,270 |

| 銘 柏  |      |                        | 当 期 末 |        |        |           |
|------|------|------------------------|-------|--------|--------|-----------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額   | 評 値 額  | 償還年月日     |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ   | 千ユーロ   | 千円        |
| イタリア | 国債証券 | 4.75 ITALY GOVT 440901 | 4.75  | 3,200  | 3,422  | 574,765   |
|      |      | 5 ITALY GOVT 340801    | 5.0   | 4,650  | 5,119  | 859,863   |
|      |      | 5 ITALY GOVT 390801    | 5.0   | 5,170  | 5,675  | 953,307   |
|      |      | 5 ITALY GOVT 400901    | 5.0   | 3,600  | 3,950  | 663,476   |
|      |      | 5.25 ITALY GOVT 291101 | 5.25  | 4,660  | 5,097  | 856,188   |
|      |      | 5.75 ITALY GOVT 330201 | 5.75  | 4,320  | 4,979  | 836,413   |
|      |      | 6 ITALY GOVT 310501    | 6.0   | 5,600  | 6,468  | 1,086,431 |
|      |      | 6.5 ITALY GOVT 271101  | 6.5   | 4,970  | 5,489  | 921,981   |
|      |      | 7.25 ITALY GOVT 261101 | 7.25  | 2,300  | 2,511  | 421,876   |
| フランス | 国債証券 | 0 O.A.T 260225         | —     | 7,790  | 7,372  | 1,238,286 |
|      |      | 0 O.A.T 270225         | —     | 6,740  | 6,212  | 1,043,382 |
|      |      | 0 O.A.T 291125         | —     | 7,180  | 6,151  | 1,033,181 |
|      |      | 0 O.A.T 301125         | —     | 8,840  | 7,356  | 1,235,661 |
|      |      | 0 O.A.T 311125         | —     | 11,400 | 9,206  | 1,546,259 |
|      |      | 0 O.A.T 320525         | —     | 6,030  | 4,794  | 805,223   |
|      |      | 0.25 O.A.T 261125      | 0.25  | 7,360  | 6,873  | 1,154,455 |
|      |      | 0.5 O.A.T 250525       | 0.5   | 2,490  | 2,417  | 405,983   |
|      |      | 0.5 O.A.T 260525       | 0.5   | 10,240 | 9,728  | 1,633,983 |
|      |      | 0.5 O.A.T 290525       | 0.5   | 10,330 | 9,206  | 1,546,384 |
|      |      | 0.5 O.A.T 400525       | 0.5   | 4,680  | 3,079  | 517,206   |
|      |      | 0.5 O.A.T 440625       | 0.5   | 3,890  | 2,296  | 385,710   |
|      |      | 0.5 O.A.T 720525       | 0.5   | 2,310  | 872    | 146,552   |
|      |      | 0.75 O.A.T 280225      | 0.75  | 11,000 | 10,167 | 1,707,749 |
|      |      | 0.75 O.A.T 280525      | 0.75  | 9,750  | 8,972  | 1,507,059 |
|      |      | 0.75 O.A.T 281125      | 0.75  | 10,340 | 9,426  | 1,583,207 |
|      |      | 0.75 O.A.T 520525      | 0.75  | 5,560  | 2,938  | 493,591   |
|      |      | 0.75 O.A.T 530525      | 0.75  | 5,390  | 2,782  | 467,420   |
|      |      | 1 O.A.T 251125         | 1.0   | 6,580  | 6,364  | 1,069,039 |
|      |      | 1 O.A.T 270525         | 1.0   | 7,540  | 7,122  | 1,196,256 |
|      |      | 1.25 O.A.T 340525      | 1.25  | 8,410  | 7,136  | 1,198,700 |
|      |      | 1.25 O.A.T 360525      | 1.25  | 7,890  | 6,420  | 1,078,305 |
|      |      | 1.25 O.A.T 380525      | 1.25  | 4,320  | 3,364  | 565,172   |
|      |      | 1.5 O.A.T 310525       | 1.5   | 10,790 | 9,872  | 1,658,144 |
|      |      | 1.5 O.A.T 500525       | 1.5   | 6,180  | 4,179  | 701,954   |
|      |      | 1.75 O.A.T 390625      | 1.75  | 5,550  | 4,586  | 770,318   |
|      |      | 1.75 O.A.T 660525      | 1.75  | 2,970  | 1,950  | 327,643   |
|      |      | 2 O.A.T 321125         | 2.0   | 7,450  | 6,932  | 1,164,405 |
|      |      | 2 O.A.T 480525         | 2.0   | 4,970  | 3,851  | 646,831   |
|      |      | 2.5 O.A.T 260924       | 2.5   | 8,300  | 8,196  | 1,376,736 |
|      |      | 2.5 O.A.T 270924       | 2.5   | 1,200  | 1,183  | 198,769   |
|      |      | 2.5 O.A.T 300525       | 2.5   | 11,270 | 11,060 | 1,857,647 |
|      |      | 2.5 O.A.T 430525       | 2.5   | 2,530  | 2,226  | 373,898   |
|      |      | 2.75 O.A.T 271025      | 2.75  | 10,320 | 10,264 | 1,723,952 |
|      |      | 2.75 O.A.T 290225      | 2.75  | 7,900  | 7,857  | 1,319,709 |
|      |      | 2.75 O.A.T 300225      | 2.75  | 750    | 744    | 125,112   |
|      |      | 3 O.A.T 330525         | 3.0   | 6,130  | 6,147  | 1,032,584 |
|      |      | 3 O.A.T 490625         | 3.0   | 1,080  | 1,011  | 169,935   |

| 銘 柏  |      |                       | 当 期 末 |       |       |            |
|------|------|-----------------------|-------|-------|-------|------------|
|      |      |                       | 利 率   | 額面金額  | 評 値 額 | 償還年月日      |
| ユーロ  |      |                       | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円         |
| フランス | 国債証券 | 3 O.A.T 540525        | 3.0   | 4,370 | 4,001 | 672,022    |
|      |      | 3.25 O.A.T 450525     | 3.25  | 5,600 | 5,510 | 925,581    |
|      |      | 3.25 O.A.T 550525     | 3.25  | 1,730 | 1,654 | 277,855    |
|      |      | 3.5 O.A.T 260425      | 3.5   | 6,690 | 6,740 | 1,132,187  |
|      |      | 3.5 O.A.T 331125      | 3.5   | 7,180 | 7,472 | 1,255,044  |
|      |      | 4 O.A.T 381025        | 4.0   | 4,510 | 4,914 | 825,510    |
|      |      | 4 O.A.T 550425        | 4.0   | 3,330 | 3,673 | 617,030    |
|      |      | 4 O.A.T 600425        | 4.0   | 3,520 | 3,922 | 658,890    |
|      |      | 4.5 O.A.T 410425      | 4.5   | 7,070 | 8,180 | 1,373,946  |
|      |      | 4.75 O.A.T 350425     | 4.75  | 4,750 | 5,482 | 920,869    |
|      |      | 5.5 O.A.T 290425      | 5.5   | 6,800 | 7,611 | 1,278,398  |
|      |      | 5.75 O.A.T 321025     | 5.75  | 6,200 | 7,477 | 1,255,947  |
|      |      | 6 O.A.T 251025        | 6.0   | 5,760 | 5,978 | 1,004,096  |
|      |      |                       |       |       |       | 2025/10/25 |
| オランダ | 国債証券 | 0 NETH GOVT 260115    | —     | 2,200 | 2,091 | 351,335    |
|      |      | 0 NETH GOVT 270115    | —     | 1,950 | 1,808 | 303,817    |
|      |      | 0 NETH GOVT 290115    | —     | 2,380 | 2,097 | 352,318    |
|      |      | 0 NETH GOVT 300715    | —     | 2,650 | 2,248 | 377,712    |
|      |      | 0 NETH GOVT 310715    | —     | 2,540 | 2,099 | 352,650    |
|      |      | 0 NETH GOVT 380115    | —     | 2,280 | 1,540 | 258,698    |
|      |      | 0 NETH GOVT 520115    | —     | 3,690 | 1,739 | 292,246    |
|      |      | 0.25 NETH GOVT 250715 | 0.25  | 3,290 | 3,177 | 533,678    |
|      |      | 0.25 NETH GOVT 290715 | 0.25  | 2,950 | 2,604 | 437,460    |
|      |      | 0.5 NETH GOVT 260715  | 0.5   | 3,970 | 3,767 | 632,868    |
|      |      | 0.5 NETH GOVT 320715  | 0.5   | 2,300 | 1,928 | 323,981    |
|      |      | 0.5 NETH GOVT 400115  | 0.5   | 2,630 | 1,848 | 310,464    |
|      |      | 0.75 NETH GOVT 270715 | 0.75  | 2,670 | 2,506 | 421,012    |
|      |      | 0.75 NETH GOVT 280715 | 0.75  | 3,020 | 2,786 | 468,095    |
|      |      | 2 NETH GOVT 540115    | 2.0   | 2,030 | 1,691 | 284,089    |
|      |      | 2.5 NETH GOVT 300115  | 2.5   | 1,900 | 1,877 | 315,315    |
|      |      | 2.5 NETH GOVT 330115  | 2.5   | 2,750 | 2,699 | 453,446    |
|      |      | 2.5 NETH GOVT 330715  | 2.5   | 1,910 | 1,868 | 313,761    |
|      |      | 2.5 NETH GOVT 340715  | 2.5   | 1,050 | 1,021 | 171,501    |
|      |      | 2.75 NETH GOVT 470115 | 2.75  | 3,320 | 3,262 | 547,980    |
|      |      | 3.25 NETH GOVT 440115 | 3.25  | 1,330 | 1,397 | 234,805    |
|      |      | 3.75 NETH GOVT 420115 | 3.75  | 2,940 | 3,278 | 550,585    |
|      |      | 4 NETH GOVT 370115    | 4.0   | 3,160 | 3,528 | 592,726    |
|      |      | 5.5 NETH GOVT 280115  | 5.5   | 2,180 | 2,383 | 400,386    |
| スペイン | 国債証券 | 0 SPAIN GOVT 250531   | —     | 2,500 | 2,412 | 405,157    |
|      |      | 0 SPAIN GOVT 260131   | —     | 3,000 | 2,842 | 477,491    |
|      |      | 0 SPAIN GOVT 270131   | —     | 9,400 | 8,652 | 1,453,331  |
|      |      | 0 SPAIN GOVT 280131   | —     | 5,320 | 4,764 | 800,171    |
|      |      | 0.1 SPAIN GOVT 310430 | 0.1   | 4,360 | 3,560 | 598,014    |
|      |      | 0.5 SPAIN GOVT 300430 | 0.5   | 4,580 | 3,960 | 665,133    |
|      |      | 0.5 SPAIN GOVT 311031 | 0.5   | 4,340 | 3,599 | 604,506    |
|      |      | 0.6 SPAIN GOVT 291031 | 0.6   | 3,680 | 3,239 | 544,116    |
|      |      | 0.7 SPAIN GOVT 320430 | 0.7   | 3,800 | 3,157 | 530,408    |
|      |      | 0.8 SPAIN GOVT 270730 | 0.8   | 3,350 | 3,123 | 524,629    |

| 銘 柏  |      |                        | 当 期 末 |       |       |           |
|------|------|------------------------|-------|-------|-------|-----------|
|      |      |                        | 利 率   | 額面金額  | 評 値 額 | 償還年月日     |
| ユーロ  |      |                        | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円        |
| スペイン | 国債証券 | 0.8 SPAIN GOVT 290730  | 0.8   | 5,430 | 4,857 | 815,849   |
|      |      | 0.85 SPAIN GOVT 370730 | 0.85  | 2,470 | 1,779 | 298,953   |
|      |      | 1 SPAIN GOVT 420730    | 1.0   | 2,070 | 1,339 | 225,034   |
|      |      | 1 SPAIN GOVT 501031    | 1.0   | 3,650 | 1,971 | 331,206   |
|      |      | 1.2 SPAIN GOVT 401031  | 1.2   | 3,400 | 2,371 | 398,311   |
|      |      | 1.25 SPAIN GOVT 301031 | 1.25  | 4,030 | 3,609 | 606,260   |
|      |      | 1.3 SPAIN GOVT 261031  | 1.3   | 4,750 | 4,550 | 764,333   |
|      |      | 1.4 SPAIN GOVT 280430  | 1.4   | 4,660 | 4,385 | 736,556   |
|      |      | 1.4 SPAIN GOVT 280730  | 1.4   | 4,240 | 3,976 | 667,929   |
|      |      | 1.45 SPAIN GOVT 271031 | 1.45  | 4,330 | 4,109 | 690,203   |
|      |      | 1.45 SPAIN GOVT 290430 | 1.45  | 4,280 | 3,981 | 668,656   |
|      |      | 1.45 SPAIN GOVT 711031 | 1.45  | 1,300 | 632   | 106,281   |
|      |      | 1.5 SPAIN GOVT 270430  | 1.5   | 4,290 | 4,103 | 689,215   |
|      |      | 1.6 SPAIN GOVT 250430  | 1.6   | 3,510 | 3,448 | 579,193   |
|      |      | 1.85 SPAIN GOVT 350730 | 1.85  | 4,400 | 3,781 | 635,158   |
|      |      | 1.9 SPAIN GOVT 521031  | 1.9   | 3,170 | 2,113 | 354,919   |
|      |      | 1.95 SPAIN GOVT 260430 | 1.95  | 3,520 | 3,438 | 577,612   |
|      |      | 1.95 SPAIN GOVT 300730 | 1.95  | 3,790 | 3,562 | 598,437   |
|      |      | 2.15 SPAIN GOVT 251031 | 2.15  | 8,000 | 7,878 | 1,323,210 |
|      |      | 2.35 SPAIN GOVT 330730 | 2.35  | 4,090 | 3,807 | 639,487   |
|      |      | 2.5 SPAIN GOVT 270531  | 2.5   | 1,400 | 1,376 | 231,232   |
|      |      | 2.55 SPAIN GOVT 321031 | 2.55  | 3,560 | 3,396 | 570,555   |
|      |      | 2.7 SPAIN GOVT 481031  | 2.7   | 3,670 | 3,035 | 509,777   |
|      |      | 2.8 SPAIN GOVT 260531  | 2.8   | 3,500 | 3,473 | 583,330   |
|      |      | 2.9 SPAIN GOVT 461031  | 2.9   | 3,540 | 3,080 | 517,390   |
|      |      | 3.15 SPAIN GOVT 330430 | 3.15  | 4,400 | 4,375 | 734,900   |
|      |      | 3.25 SPAIN GOVT 340430 | 3.25  | 3,260 | 3,243 | 544,794   |
|      |      | 3.45 SPAIN GOVT 430730 | 3.45  | 2,460 | 2,353 | 395,356   |
|      |      | 3.45 SPAIN GOVT 660730 | 3.45  | 2,800 | 2,534 | 425,637   |
|      |      | 3.5 SPAIN GOVT 290531  | 3.5   | 3,380 | 3,456 | 580,496   |
|      |      | 3.55 SPAIN GOVT 331031 | 3.55  | 4,120 | 4,212 | 707,554   |
|      |      | 3.9 SPAIN GOVT 390730  | 3.9   | 2,390 | 2,461 | 413,476   |
|      |      | 4 SPAIN GOVT 541031    | 4.0   | 1,000 | 1,011 | 169,948   |
|      |      | 4.2 SPAIN GOVT 370131  | 4.2   | 4,260 | 4,580 | 769,323   |
|      |      | 4.65 SPAIN GOVT 250730 | 4.65  | 2,890 | 2,933 | 492,767   |
|      |      | 4.7 SPAIN GOVT 410730  | 4.7   | 3,150 | 3,559 | 597,908   |
|      |      | 4.9 SPAIN GOVT 400730  | 4.9   | 3,770 | 4,332 | 727,766   |
|      |      | 5.15 SPAIN GOVT 281031 | 5.15  | 3,250 | 3,540 | 594,590   |
|      |      | 5.15 SPAIN GOVT 441031 | 5.15  | 2,640 | 3,161 | 530,993   |
|      |      | 5.75 SPAIN GOVT 320730 | 5.75  | 4,990 | 5,924 | 995,108   |
|      |      | 5.9 SPAIN GOVT 260730  | 5.9   | 4,650 | 4,916 | 825,799   |
|      |      | 6 SPAIN GOVT 290131    | 6.0   | 4,230 | 4,786 | 804,014   |
| ベルギー | 国債証券 | 0 BEL GOVT 271022      | —     | 1,800 | 1,632 | 274,213   |
|      |      | 0 BEL GOVT 311022      | —     | 2,300 | 1,860 | 312,546   |
|      |      | 0.1 BEL GOVT 300622    | 0.1   | 2,320 | 1,968 | 330,550   |
|      |      | 0.35 BEL GOVT 320622   | 0.35  | 2,940 | 2,398 | 402,846   |
|      |      | 0.4 BEL GOVT 400622    | 0.4   | 1,660 | 1,062 | 178,452   |
|      |      |                        |       |       |       | 2040/6/22 |

| 銘 柏    |      |                          | 当 期 末 |       |       |         |
|--------|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|
|        |      |                          | 利 率   | 額面金額  | 評 値 額 | 償還年月日   |
| ユーロ    |      |                          | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |
| ベルギー   | 国債証券 | 0.65 BEL GOVT 710622     | 0.65  | 1,090 | 452   | 75,922  |
|        |      | 0.8 BEL GOVT 250622      | 0.8   | 4,170 | 4,054 | 680,934 |
|        |      | 0.8 BEL GOVT 270622      | 0.8   | 2,880 | 2,701 | 453,770 |
|        |      | 0.8 BEL GOVT 280622      | 0.8   | 2,740 | 2,527 | 424,521 |
|        |      | 0.9 BEL GOVT 290622      | 0.9   | 3,090 | 2,812 | 472,325 |
|        |      | 1 BEL GOVT 260622        | 1.0   | 2,760 | 2,645 | 444,418 |
|        |      | 1 BEL GOVT 310622        | 1.0   | 4,430 | 3,901 | 655,354 |
|        |      | 1.25 BEL GOVT 330422     | 1.25  | 1,770 | 1,540 | 258,753 |
|        |      | 1.4 BEL GOVT 530622      | 1.4   | 2,040 | 1,276 | 214,418 |
|        |      | 1.45 BEL GOVT 370622     | 1.45  | 1,220 | 997   | 167,551 |
|        |      | 1.6 BEL GOVT 470622      | 1.6   | 1,800 | 1,283 | 215,513 |
|        |      | 1.7 BEL GOVT 500622      | 1.7   | 1,840 | 1,292 | 217,111 |
|        |      | 1.9 BEL GOVT 380622      | 1.9   | 1,360 | 1,155 | 194,083 |
|        |      | 2.15 BEL GOVT 660622     | 2.15  | 1,530 | 1,132 | 190,175 |
|        |      | 2.25 BEL GOVT 570622     | 2.25  | 1,300 | 994   | 167,043 |
|        |      | 2.75 BEL GOVT 390422     | 2.75  | 950   | 893   | 150,000 |
|        |      | 2.85 BEL GOVT 341022     | 2.85  | 1,850 | 1,815 | 305,002 |
|        |      | 3 BEL GOVT 330622        | 3.0   | 2,750 | 2,755 | 462,841 |
|        |      | 3 BEL GOVT 340622        | 3.0   | 2,050 | 2,047 | 343,840 |
|        |      | 3.3 BEL GOVT 540622      | 3.3   | 1,690 | 1,627 | 273,281 |
|        |      | 3.45 BEL GOVT 430622     | 3.45  | 300   | 302   | 50,761  |
|        |      | 3.5 BEL GOVT 550622      | 3.5   | 1,180 | 1,174 | 197,275 |
|        |      | 3.75 BEL GOVT 450622     | 3.75  | 1,620 | 1,703 | 286,193 |
|        |      | 4 BEL GOVT 320328        | 4.0   | 1,620 | 1,742 | 292,677 |
|        |      | 4.25 BEL GOVT 410328     | 4.25  | 2,940 | 3,286 | 551,952 |
|        |      | 4.5 BEL GOVT 260328      | 4.5   | 1,610 | 1,650 | 277,253 |
|        |      | 5 BEL GOVT 350328        | 5.0   | 3,280 | 3,855 | 647,497 |
|        |      | 5.5 BEL GOVT 280328      | 5.5   | 4,910 | 5,379 | 903,621 |
| オーストリア | 国債証券 | 0 AUSTRIA GOVT 281020    | —     | 1,790 | 1,580 | 265,392 |
|        |      | 0 AUSTRIA GOVT 300220    | —     | 2,150 | 1,827 | 306,944 |
|        |      | 0 AUSTRIA GOVT 310220    | —     | 2,720 | 2,244 | 376,936 |
|        |      | 0 AUSTRIA GOVT 401020    | —     | 1,170 | 701   | 117,870 |
|        |      | 0.25 AUSTRIA GOVT 361020 | 0.25  | 1,490 | 1,057 | 177,569 |
|        |      | 0.5 AUSTRIA GOVT 270420  | 0.5   | 2,100 | 1,958 | 329,020 |
|        |      | 0.5 AUSTRIA GOVT 290220  | 0.5   | 2,050 | 1,837 | 308,581 |
|        |      | 0.7 AUSTRIA GOVT 710420  | 0.7   | 680   | 301   | 50,698  |
|        |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 261020 | 0.75  | 2,480 | 2,353 | 395,264 |
|        |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 280220 | 0.75  | 2,940 | 2,721 | 457,102 |
|        |      | 0.75 AUSTRIA GOVT 510320 | 0.75  | 1,570 | 899   | 151,082 |
|        |      | 0.85 AUSTRIA GOVT 200630 | 0.85  | 830   | 370   | 62,203  |
|        |      | 0.9 AUSTRIA GOVT 320220  | 0.9   | 2,120 | 1,825 | 306,620 |
|        |      | 1.2 AUSTRIA GOVT 251020  | 1.2   | 2,710 | 2,634 | 442,426 |
|        |      | 1.5 AUSTRIA GOVT 470220  | 1.5   | 1,810 | 1,322 | 222,094 |
|        |      | 1.5 AUSTRIA GOVT 861102  | 1.5   | 460   | 273   | 45,967  |
|        |      | 1.85 AUSTRIA GOVT 490523 | 1.85  | 1,130 | 872   | 146,607 |
|        |      | 2 AUSTRIA GOVT 260715    | 2.0   | 1,000 | 979   | 164,448 |
|        |      | 2.1 AUSTRIA GOVT 170920  | 2.1   | 950   | 707   | 118,793 |

| 銘 柏    |      |                          | 当 期 末 |       |       |         |
|--------|------|--------------------------|-------|-------|-------|---------|
|        |      |                          | 利 率   | 額面金額  | 評 値 額 | 償還年月日   |
| ユーロ    |      |                          | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |
| オーストリア | 国債証券 | 2.4 AUSTRIA GOVT 340523  | 2.4   | 1,690 | 1,603 | 269,375 |
|        |      | 2.9 AUSTRIA GOVT 290523  | 2.9   | 700   | 702   | 118,046 |
|        |      | 2.9 AUSTRIA GOVT 330220  | 2.9   | 2,710 | 2,697 | 453,079 |
|        |      | 2.9 AUSTRIA GOVT 340220  | 2.9   | 1,470 | 1,458 | 244,948 |
|        |      | 3.15 AUSTRIA GOVT 440620 | 3.15  | 1,250 | 1,243 | 208,922 |
|        |      | 3.15 AUSTRIA GOVT 531020 | 3.15  | 1,070 | 1,058 | 177,711 |
|        |      | 3.45 AUSTRIA GOVT 301020 | 3.45  | 910   | 940   | 157,963 |
|        |      | 3.8 AUSTRIA GOVT 620126  | 3.8   | 700   | 791   | 132,949 |
|        |      | 4.15 AUSTRIA GOVT 370315 | 4.15  | 2,540 | 2,818 | 473,405 |
|        |      | 4.85 AUSTRIA GOVT 260315 | 4.85  | 1,370 | 1,412 | 237,270 |
|        |      | 6.25 AUSTRIA GOVT 270715 | 6.25  | 1,630 | 1,790 | 300,802 |
| フィンランド | 国債証券 | 0 FINNISH GOVT 260915    | —     | 1,800 | 1,679 | 282,028 |
|        |      | 0 FINNISH GOVT 300915    | —     | 750   | 626   | 105,263 |
|        |      | 0.125 FINNISH GOV 310915 | 0.125 | 1,070 | 876   | 147,278 |
|        |      | 0.125 FINNISH GOV 360415 | 0.125 | 1,120 | 793   | 133,205 |
|        |      | 0.125 FINNISH GOV 520415 | 0.125 | 750   | 343   | 57,678  |
|        |      | 0.25 FINNISH GOVT 400915 | 0.25  | 540   | 341   | 57,421  |
|        |      | 0.5 FINNISH GOVT 260415  | 0.5   | 1,670 | 1,590 | 267,219 |
|        |      | 0.5 FINNISH GOVT 270915  | 0.5   | 700   | 647   | 108,774 |
|        |      | 0.5 FINNISH GOVT 280915  | 0.5   | 1,480 | 1,339 | 224,910 |
|        |      | 0.5 FINNISH GOVT 290915  | 0.5   | 1,350 | 1,194 | 200,654 |
|        |      | 0.5 FINNISH GOVT 430415  | 0.5   | 780   | 487   | 81,900  |
|        |      | 0.75 FINNISH GOVT 310415 | 0.75  | 1,050 | 912   | 153,207 |
|        |      | 0.875 FINNISH GOV 250915 | 0.875 | 630   | 611   | 102,676 |
|        |      | 1.125 FINNISH GOV 340415 | 1.125 | 730   | 614   | 103,257 |
|        |      | 1.375 FINNISH GOV 270415 | 1.375 | 800   | 765   | 128,576 |
|        |      | 1.375 FINNISH GOV 470415 | 1.375 | 990   | 709   | 119,126 |
|        |      | 1.5 FINNISH GOVT 320915  | 1.5   | 750   | 671   | 112,816 |
|        |      | 2.625 FINNISH GOV 420704 | 2.625 | 940   | 871   | 146,355 |
|        |      | 2.75 FINNISH GOVT 280704 | 2.75  | 1,110 | 1,105 | 185,686 |
|        |      | 2.75 FINNISH GOVT 380415 | 2.75  | 680   | 649   | 109,070 |
|        |      | 2.875 FINNISH GOV 290415 | 2.875 | 600   | 600   | 100,820 |
|        |      | 2.95 FINNISH GOVT 550415 | 2.95  | 490   | 470   | 79,028  |
|        |      | 3 FINNISH GOVT 330915    | 3.0   | 1,720 | 1,724 | 289,573 |
|        |      | 4 FINNISH GOVT 250704    | 4.0   | 240   | 241   | 40,628  |
| アイルランド | 国債証券 | 0 IRISH GOVT 311018      | —     | 1,900 | 1,551 | 260,585 |
|        |      | 0.2 IRISH GOVT 270515    | 0.2   | 500   | 462   | 77,690  |
|        |      | 0.2 IRISH GOVT 301018    | 0.2   | 2,130 | 1,815 | 305,002 |
|        |      | 0.35 IRISH GOVT 321018   | 0.35  | 800   | 655   | 110,043 |
|        |      | 0.4 IRISH GOVT 350515    | 0.4   | 1,020 | 780   | 131,167 |
|        |      | 0.55 IRISH GOVT 410422   | 0.55  | 600   | 401   | 67,417  |
|        |      | 0.9 IRISH GOVT 280515    | 0.9   | 1,640 | 1,526 | 256,373 |
|        |      | 1 IRISH GOVT 260515      | 1.0   | 1,850 | 1,779 | 298,868 |
|        |      | 1.1 IRISH GOVT 290515    | 1.1   | 1,610 | 1,487 | 249,784 |
|        |      | 1.3 IRISH GOVT 330515    | 1.3   | 860   | 757   | 127,192 |
|        |      | 1.35 IRISH GOVT 310318   | 1.35  | 1,070 | 978   | 164,372 |
|        |      | 1.5 IRISH GOVT 500515    | 1.5   | 1,460 | 1,039 | 174,532 |

| 銘 柏    |   |   | 当 期 末  |  |   |   |   |
|--------|---|---|--|--|---|---|---|
|        |   |   | 利 率  | 額面金額   | 評 値 額   | 償還年月日   |   |
|        |   |   | %  | 千ユーロ   | 千ユーロ  | 千円  |   |
| ユーロ    |   |   |  |  |   |   |   |
| アイルランド | 国債証券  | 1.7 IRISH GOVT 370515<br>2 IRISH GOVT 450218<br>2.4 IRISH GOVT 300515<br>2.6 IRISH GOVT 341018<br>3 IRISH GOVT 431018   | 1.7<br>2.0<br>2.4<br>2.6<br>3.0  | 1,190<br>1,970<br>1,490<br>850<br>690  | 1,023<br>1,641<br>1,460<br>826<br>681   | 171,911<br>275,685<br>245,323<br>138,879<br>114,453   | 2037/5/15<br>2045/2/18<br>2030/5/15<br>2034/10/18<br>2043/10/18 |
| 小 計    |   |   |  |  |   | 197,279,850   |   |
| イギリス   |   |   |  | 千イギリスポンド   | 千イギリスポンド  |   |   |
| 国債証券   | 0.125 GILT 260130<br>0.125 GILT 280131<br>0.25 GILT 310731<br>0.375 GILT 261022<br>0.375 GILT 301022<br>0.5 GILT 290131<br>0.5 GILT 611022<br>0.625 GILT 250607<br>0.625 GILT 350731<br>0.625 GILT 501022<br>0.875 GILT 291022<br>0.875 GILT 330731<br>0.875 GILT 460131<br>1 GILT 320131<br>1.125 GILT 390131<br>1.125 GILT 731022<br>1.25 GILT 270722<br>1.25 GILT 411022<br>1.25 GILT 510731<br>1.5 GILT 260722<br>1.5 GILT 470722<br>1.5 GILT 530731<br>1.625 GILT 281022<br>1.625 GILT 541022<br>1.625 GILT 711022<br>1.75 GILT 370907<br>1.75 GILT 490122<br>1.75 GILT 570722<br>2 GILT 250907<br>2.5 GILT 650722<br>3.25 GILT 330131<br>3.25 GILT 440122<br>3.5 GILT 251022<br>3.5 GILT 450122<br>3.5 GILT 680722<br>3.75 GILT 270307<br>3.75 GILT 380129<br>3.75 GILT 520722<br>3.75 GILT 531022<br>4 GILT 311022 | 0.125<br>0.125<br>0.25<br>0.375<br>0.375<br>0.5<br>0.5<br>0.625<br>0.625<br>0.625<br>0.875<br>0.875<br>0.875<br>1.0<br>1.125<br>1.125<br>1.25<br>1.25<br>1.25<br>1.5<br>1.5<br>1.5<br>1.625<br>1.625<br>1.625<br>1.75<br>1.75<br>1.75<br>2.0<br>2.5<br>3.25<br>3.25<br>3.5<br>3.5<br>3.5<br>3.75<br>3.75<br>3.75<br>4.0 | 2,600<br>2,300<br>5,110<br>4,870<br>3,100<br>4,900<br>3,700<br>1,480<br>4,030<br>2,890<br>2,900<br>5,140<br>2,930<br>5,880<br>4,450<br>1,750<br>2,530<br>4,250<br>4,930<br>3,630<br>3,160<br>3,370<br>3,470<br>2,470<br>2,530<br>1,151<br>3,340<br>1,780<br>3,230<br>2,100<br>2,480<br>5,100<br>3,620<br>6,150<br>3,740<br>2,960<br>2,000<br>4,650<br>2,110<br>4,540 | 2,422<br>1,988<br>3,916<br>4,433<br>2,470<br>4,161<br>1,098<br>1,419<br>2,745<br>1,152<br>2,463<br>3,871<br>1,444<br>4,700<br>2,868<br>631<br>2,314<br>2,589<br>2,383<br>3,421<br>1,768<br>1,700<br>3,137<br>1,277<br>1,151<br>2,471<br>1,034<br>1,695<br>2,030<br>1,557<br>4,784<br>2,992<br>6,048<br>3,188<br>2,400<br>1,969<br>4,350<br>1,821<br>3,899<br>696 | 473,016<br>388,174<br>764,661<br>865,539<br>482,308<br>812,409<br>214,549<br>277,123<br>535,978<br>225,076<br>480,978<br>755,801<br>281,965<br>917,685<br>559,985<br>123,200<br>451,797<br>505,612<br>465,288<br>668,037<br>345,311<br>331,992<br>612,618<br>249,441<br>224,740<br>203,996<br>331,095<br>396,371<br>304,057<br>934,058<br>584,241<br>1,180,979<br>622,478<br>468,685<br>384,429<br>849,399<br>355,646<br>761,243<br>136,028 | 2026/1/30<br>2028/1/31<br>2031/7/31<br>2026/10/22<br>2030/10/22<br>2029/1/31<br>2061/10/22<br>2025/6/7<br>2035/7/31<br>2050/10/22<br>2029/10/22<br>2033/7/31<br>2046/1/31<br>2032/1/31<br>2039/1/31<br>2073/10/22<br>2027/7/22<br>2041/10/22<br>2051/7/31<br>2026/7/22<br>2047/7/22<br>2053/7/31<br>2028/10/22<br>2054/10/22<br>2071/10/22<br>2037/9/7<br>2049/1/22<br>2057/7/22<br>2025/9/7<br>2065/7/22<br>2033/1/31<br>2044/1/22<br>2025/10/22<br>2045/1/22<br>2068/7/22<br>2027/3/7<br>2038/1/29<br>2052/7/22<br>2053/10/22<br>2031/10/22 |   |

| 銘 柄    |                         | 当 期 末 |             |             |              | 償還年月日      |
|--------|-------------------------|-------|-------------|-------------|--------------|------------|
|        |                         | 利 率   | 額面金額        | 評 値 額       | 外貨建金額 邦貨換算金額 |            |
| イギリス   |                         | %     | 千イギリスポンド    | 千イギリスポンド    | 千円           |            |
| 国債証券   | 4 GILT 600122           | 4.0   | 2,640       | 2,376       | 464,026      | 2060/1/22  |
|        | 4 GILT 631022           | 4.0   | 2,230       | 1,999       | 390,453      | 2063/10/22 |
|        | 4.125 GILT 270129       | 4.125 | 4,900       | 4,873       | 951,509      | 2027/1/29  |
|        | 4.25 GILT 271207        | 4.25  | 2,450       | 2,460       | 480,466      | 2027/12/7  |
|        | 4.25 GILT 320607        | 4.25  | 4,290       | 4,354       | 850,230      | 2032/6/7   |
|        | 4.25 GILT 360307        | 4.25  | 2,910       | 2,906       | 567,386      | 2036/3/7   |
|        | 4.25 GILT 390907        | 4.25  | 2,430       | 2,375       | 463,796      | 2039/9/7   |
|        | 4.25 GILT 401207        | 4.25  | 2,420       | 2,349       | 458,772      | 2040/12/7  |
|        | 4.25 GILT 461207        | 4.25  | 2,930       | 2,778       | 542,478      | 2046/12/7  |
|        | 4.25 GILT 491207        | 4.25  | 2,470       | 2,329       | 454,728      | 2049/12/7  |
|        | 4.25 GILT 551207        | 4.25  | 2,770       | 2,601       | 507,879      | 2055/12/7  |
|        | 4.375 GILT 540731       | 4.375 | 1,530       | 1,463       | 285,812      | 2054/7/31  |
|        | 4.5 GILT 280607         | 4.5   | 6,460       | 6,540       | 1,276,878    | 2028/6/7   |
|        | 4.5 GILT 340907         | 4.5   | 2,300       | 2,359       | 460,597      | 2034/9/7   |
|        | 4.5 GILT 421207         | 4.5   | 3,190       | 3,169       | 618,767      | 2042/12/7  |
|        | 4.625 GILT 340131       | 4.625 | 4,220       | 4,372       | 853,779      | 2034/1/31  |
|        | 4.75 GILT 301207        | 4.75  | 3,650       | 3,807       | 743,281      | 2030/12/7  |
|        | 4.75 GILT 381207        | 4.75  | 2,310       | 2,395       | 467,703      | 2038/12/7  |
|        | 4.75 GILT 431022        | 4.75  | 2,820       | 2,876       | 561,656      | 2043/10/22 |
|        | 6 GILT 281207           | 6.0   | 1,890       | 2,044       | 399,114      | 2028/12/7  |
| 小 計    |                         |       |             |             | 31,805,788   |            |
| スウェーデン |                         |       | 千スウェーデンクローネ | 千スウェーデンクローネ |              |            |
| 国債証券   | 0.125 SWD GOVT 310512   | 0.125 | 9,450       | 8,107       | 116,590      | 2031/5/12  |
|        | 0.75 SWD GOVT 280512    | 0.75  | 17,500      | 16,360      | 235,262      | 2028/5/12  |
|        | 0.75 SWD GOVT 291112    | 0.75  | 12,200      | 11,209      | 161,187      | 2029/11/12 |
|        | 1 SWD GOVT 261112       | 1.0   | 11,960      | 11,465      | 164,880      | 2026/11/12 |
|        | 1.75 SWD GOVT 331111    | 1.75  | 11,500      | 10,919      | 157,015      | 2033/11/11 |
|        | 2.25 SWD GOVT 320601    | 2.25  | 6,750       | 6,700       | 96,350       | 2032/6/1   |
|        | 2.5 SWD GOVT 250512     | 2.5   | 8,840       | 8,776       | 126,209      | 2025/5/12  |
|        | 3.5 SWD GOVT 390330     | 3.5   | 6,470       | 7,293       | 104,879      | 2039/3/30  |
| 小 計    |                         |       |             |             | 1,162,376    |            |
| ノルウェー  |                         |       | 千ノルウェークローネ  | 千ノルウェーカローネ  |              |            |
| 国債証券   | 1.25 NORWE GOVT 310917  | 1.25  | 4,700       | 3,981       | 57,169       | 2031/9/17  |
|        | 1.375 NORWE GOVT 300819 | 1.375 | 15,770      | 13,793      | 198,067      | 2030/8/19  |
|        | 1.5 NORWE GOVT 260219   | 1.5   | 6,040       | 5,796       | 83,238       | 2026/2/19  |
|        | 1.75 NORWE GOVT 270217  | 1.75  | 5,120       | 4,856       | 69,735       | 2027/2/17  |
|        | 1.75 NORWE GOVT 290906  | 1.75  | 4,600       | 4,184       | 60,087       | 2029/9/6   |
|        | 2 NORWE GOVT 280426     | 2.0   | 6,900       | 6,485       | 93,130       | 2028/4/26  |
|        | 2.125 NORWE GOVT 320518 | 2.125 | 10,500      | 9,371       | 134,574      | 2032/5/18  |
|        | 3 NORWE GOVT 330815     | 3.0   | 8,700       | 8,227       | 118,151      | 2033/8/15  |
|        | 3.5 NORWE GOVT 421006   | 3.5   | 4,000       | 3,994       | 57,361       | 2042/10/6  |
|        | 3.625 NORWE GOVT 340413 | 3.625 | 4,100       | 4,060       | 58,312       | 2034/4/13  |
| 小 計    |                         |       |             |             | 929,829      |            |
| デンマーク  |                         |       | 千デンマーククローネ  | 千デンマーククローネ  |              |            |
| 国債証券   | 0 DMK GOVT 311115       | —     | 14,550      | 12,151      | 273,642      | 2031/11/15 |
|        | 0.25 DMK GOVT 521115    | 0.25  | 9,730       | 5,138       | 115,722      | 2052/11/15 |
|        | 0.5 DMK GOVT 271115     | 0.5   | 8,100       | 7,538       | 169,756      | 2027/11/15 |

| 銘 柄     |      | 当 期 末                 |           |           |           |         |            |
|---------|------|-----------------------|-----------|-----------|-----------|---------|------------|
|         |      | 利 率                   | 額面金額      | 評 値 額     | 償還年月日     |         |            |
|         |      | %                     | 千デンマークローネ | 千デンマークローネ | 千円        |         |            |
| デンマーク   |      |                       |           |           |           |         |            |
|         | 国債証券 | 0.5 DMK GOVT 291115   | 0.5       | 10,550    | 9,497     | 213,891 | 2029/11/15 |
|         |      | 1.75 DMK GOVT 251115  | 1.75      | 7,490     | 7,355     | 165,645 | 2025/11/15 |
|         |      | 2.25 DMK GOVT 331115  | 2.25      | 6,800     | 6,634     | 149,414 | 2033/11/15 |
|         |      | 4.5 DMK GOVT 391115   | 4.5       | 18,500    | 22,706    | 511,341 | 2039/11/15 |
| 小 計     |      |                       |           |           | 1,599,416 |         |            |
| ポーランド   |      |                       |           |           |           |         |            |
|         | 国債証券 | 0.25 POLAND 261025    | 0.25      | 8,000     | 7,094     | 276,916 | 2026/10/25 |
|         |      | 1.25 POLAND 301025    | 1.25      | 9,190     | 7,125     | 278,136 | 2030/10/25 |
|         |      | 1.75 POLAND 320425    | 1.75      | 9,900     | 7,519     | 293,490 | 2032/ 4/25 |
|         |      | 2.5 POLAND 260725     | 2.5       | 7,840     | 7,395     | 288,648 | 2026/ 7/25 |
|         |      | 2.5 POLAND 270725     | 2.5       | 6,110     | 5,610     | 218,978 | 2027/ 7/25 |
|         |      | 2.75 POLAND 280425    | 2.75      | 5,760     | 5,230     | 204,155 | 2028/ 4/25 |
|         |      | 2.75 POLAND 291025    | 2.75      | 7,900     | 6,922     | 270,217 | 2029/10/25 |
|         |      | 3.25 POLAND 250725    | 3.25      | 8,700     | 8,503     | 331,927 | 2025/ 7/25 |
|         |      | 3.75 POLAND 270525    | 3.75      | 4,000     | 3,824     | 149,265 | 2027/ 5/25 |
|         |      | 5.75 POLAND 290425    | 5.75      | 10,600    | 10,727    | 418,714 | 2029/ 4/25 |
|         |      | 6 POLAND 331025       | 6.0       | 4,720     | 4,858     | 189,621 | 2033/10/25 |
|         |      | 7.5 POLAND 280725     | 7.5       | 8,120     | 8,725     | 340,585 | 2028/ 7/25 |
| 小 計     |      |                       |           |           | 3,260,658 |         |            |
| オーストラリア |      |                       |           |           |           |         |            |
|         | 国債証券 | 0.25 AUST GOVT 251121 | 0.25      | 3,650     | 3,443     | 354,242 | 2025/11/21 |
|         |      | 0.5 AUST GOVT 260921  | 0.5       | 4,100     | 3,780     | 388,976 | 2026/ 9/21 |
|         |      | 1 AUST GOVT 301221    | 1.0       | 4,260     | 3,494     | 359,515 | 2030/12/21 |
|         |      | 1 AUST GOVT 311121    | 1.0       | 5,310     | 4,220     | 434,256 | 2031/11/21 |
|         |      | 1.25 AUST GOVT 320521 | 1.25      | 5,070     | 4,046     | 416,336 | 2032/ 5/21 |
|         |      | 1.5 AUST GOVT 310621  | 1.5       | 3,740     | 3,129     | 321,953 | 2031/ 6/21 |
|         |      | 1.75 AUST GOVT 321121 | 1.75      | 5,090     | 4,180     | 430,052 | 2032/11/21 |
|         |      | 1.75 AUST GOVT 510621 | 1.75      | 3,040     | 1,672     | 172,030 | 2051/ 6/21 |
|         |      | 2.25 AUST GOVT 280521 | 2.25      | 2,900     | 2,716     | 279,479 | 2028/ 5/21 |
|         |      | 2.5 AUST GOVT 300521  | 2.5       | 3,940     | 3,608     | 371,290 | 2030/ 5/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 271121 | 2.75      | 4,390     | 4,216     | 433,819 | 2027/11/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 281121 | 2.75      | 3,040     | 2,886     | 296,959 | 2028/11/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 291121 | 2.75      | 2,980     | 2,790     | 287,076 | 2029/11/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 350621 | 2.75      | 1,520     | 1,306     | 134,383 | 2035/ 6/21 |
|         |      | 2.75 AUST GOVT 410521 | 2.75      | 2,170     | 1,699     | 174,823 | 2041/ 5/21 |
|         |      | 3 AUST GOVT 331121    | 3.0       | 4,100     | 3,685     | 379,123 | 2033/11/21 |
|         |      | 3 AUST GOVT 470321    | 3.0       | 2,420     | 1,849     | 190,261 | 2047/ 3/21 |
|         |      | 3.25 AUST GOVT 290421 | 3.25      | 3,400     | 3,284     | 337,914 | 2029/ 4/21 |
|         |      | 3.25 AUST GOVT 390621 | 3.25      | 2,130     | 1,835     | 188,840 | 2039/ 6/21 |
|         |      | 3.5 AUST GOVT 341221  | 3.5       | 3,090     | 2,871     | 295,378 | 2034/12/21 |
|         |      | 3.75 AUST GOVT 340521 | 3.75      | 3,700     | 3,529     | 363,163 | 2034/ 5/21 |
|         |      | 3.75 AUST GOVT 370421 | 3.75      | 3,150     | 2,941     | 302,604 | 2037/ 4/21 |
|         |      | 4.25 AUST GOVT 260421 | 4.25      | 2,490     | 2,500     | 257,251 | 2026/ 4/21 |
|         |      | 4.5 AUST GOVT 330421  | 4.5       | 3,900     | 3,961     | 407,544 | 2033/ 4/21 |
|         |      | 4.75 AUST GOVT 270421 | 4.75      | 3,050     | 3,115     | 320,544 | 2027/ 4/21 |
|         |      | 4.75 AUST GOVT 540621 | 4.75      | 1,270     | 1,284     | 132,150 | 2054/ 6/21 |
| 小 計     |      |                       |           |           | 8,029,971 |         |            |

| 銘<br>柄   |                          | 当<br>期<br>末 |             |             |           | 償還年月日      |  |
|----------|--------------------------|-------------|-------------|-------------|-----------|------------|--|
|          |                          | 利<br>率      | 額面金額        | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|          |                          |             |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| ニュージーランド |                          | %           | 千ニュージーランドドル | 千ニュージーランドドル | 千円        |            |  |
| 国債証券     | 0.25 NZ GOVT 280515      | 0.25        | 2,000       | 1,684       | 157,977   | 2028/5/15  |  |
|          | 1.5 NZ GOVT 310515       | 1.5         | 1,870       | 1,522       | 142,844   | 2031/5/15  |  |
|          | 1.75 NZ GOVT 410515      | 1.75        | 600         | 376         | 35,347    | 2041/5/15  |  |
|          | 2 NZ GOVT 320515         | 2.0         | 2,300       | 1,893       | 177,616   | 2032/5/15  |  |
|          | 2.75 NZ GOVT 370415      | 2.75        | 1,450       | 1,153       | 108,253   | 2037/4/15  |  |
|          | 2.75 NZ GOVT 510515      | 2.75        | 1,180       | 784         | 73,560    | 2051/5/15  |  |
|          | 3 NZ GOVT 290420         | 3.0         | 1,700       | 1,582       | 148,413   | 2029/4/20  |  |
|          | 3.5 NZ GOVT 330414       | 3.5         | 1,900       | 1,735       | 162,841   | 2033/4/14  |  |
|          | 4.25 NZ GOVT 340515      | 4.25        | 620         | 596         | 55,928    | 2034/5/15  |  |
|          | 4.5 NZ GOVT 270415       | 4.5         | 1,800       | 1,791       | 168,084   | 2027/4/15  |  |
|          | 4.5 NZ GOVT 300515       | 4.5         | 1,000       | 994         | 93,325    | 2030/5/15  |  |
|          | 4.5 NZ GOVT 350515       | 4.5         | 1,200       | 1,170       | 109,820   | 2035/5/15  |  |
|          | 5 NZ GOVT 540515         | 5.0         | 620         | 613         | 57,543    | 2054/5/15  |  |
| 小<br>計   |                          |             |             |             | 1,491,558 |            |  |
| シンガポール   |                          |             | 千シンガポールドル   | 千シンガポールドル   |           |            |  |
| 国債証券     | 1.25 SINGAPORGVT 261101  | 1.25        | 700         | 664         | 76,480    | 2026/11/1  |  |
|          | 1.625 SINGAPORGV 310701  | 1.625       | 1,050       | 942         | 108,495   | 2031/7/1   |  |
|          | 1.875 SINGAPORGV 500301  | 1.875       | 1,090       | 827         | 95,248    | 2050/3/1   |  |
|          | 1.875 SINGAPORGV 511001  | 1.875       | 950         | 712         | 82,071    | 2051/10/1  |  |
|          | 2.125 SINGAPORGV 260601  | 2.125       | 1,530       | 1,491       | 171,724   | 2026/6/1   |  |
|          | 2.25 SINGAPORGVT 360801  | 2.25        | 1,300       | 1,170       | 134,702   | 2036/8/1   |  |
|          | 2.375 SINGAPORGV 250601  | 2.375       | 1,560       | 1,540       | 177,393   | 2025/6/1   |  |
|          | 2.375 SINGAPORGV 390701  | 2.375       | 780         | 696         | 80,140    | 2039/7/1   |  |
|          | 2.625 SINGAPORGV 280501  | 2.625       | 800         | 780         | 89,893    | 2028/5/1   |  |
|          | 2.625 SINGAPORGV 320801  | 2.625       | 700         | 668         | 76,964    | 2032/8/1   |  |
|          | 2.75 SINGAPORGVT 420401  | 2.75        | 980         | 911         | 104,985   | 2042/4/1   |  |
|          | 2.75 SINGAPORGVT 460301  | 2.75        | 1,480       | 1,359       | 156,463   | 2046/3/1   |  |
|          | 2.875 SINGAPORGV 270901  | 2.875       | 1,000       | 986         | 113,610   | 2027/9/1   |  |
|          | 2.875 SINGAPORGV 280801  | 2.875       | 1,000       | 985         | 113,460   | 2028/8/1   |  |
|          | 2.875 SINGAPORGV 290701  | 2.875       | 1,760       | 1,729       | 199,082   | 2029/7/1   |  |
|          | 2.875 SINGAPORGVT 300901 | 2.875       | 1,340       | 1,311       | 150,957   | 2030/9/1   |  |
|          | 3 SINGAPORGVT 720801     | 3.0         | 910         | 859         | 98,953    | 2072/8/1   |  |
|          | 3.375 SINGAPORGV 330901  | 3.375       | 2,630       | 2,653       | 305,517   | 2033/9/1   |  |
|          | 3.5 SINGAPORGVT 270301   | 3.5         | 1,000       | 1,004       | 115,590   | 2027/3/1   |  |
| 小<br>計   |                          |             |             |             | 2,451,736 |            |  |
| 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 |           |            |  |
| 国債証券     | 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 2.632       | 6,280       | 5,818       | 191,352   | 2031/4/15  |  |
|          | 3.502 MALAYSIAGOV 270531 | 3.502       | 3,000       | 2,989       | 98,305    | 2027/5/31  |  |
|          | 3.519 MALAYSIAGOV 280420 | 3.519       | 3,500       | 3,478       | 114,374   | 2028/4/20  |  |
|          | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 3.582       | 2,370       | 2,317       | 76,197    | 2032/7/15  |  |
|          | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 3.733       | 2,800       | 2,802       | 92,166    | 2028/6/15  |  |
|          | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 3.757       | 3,980       | 3,825       | 125,811   | 2040/5/22  |  |
|          | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 3.828       | 3,410       | 3,386       | 111,377   | 2034/7/5   |  |
|          | 3.844 MALAYSIAGOV 330415 | 3.844       | 2,400       | 2,386       | 78,473    | 2033/4/15  |  |
|          | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 3.885       | 3,600       | 3,621       | 119,107   | 2029/8/15  |  |
|          | 3.892 MALAYSIAGOV 270315 | 3.892       | 4,400       | 4,437       | 145,912   | 2027/3/15  |  |
|          | 3.899 MALAYSIAGOV 271116 | 3.899       | 5,640       | 5,689       | 187,106   | 2027/11/16 |  |

| 銘<br>柄 |                          | 当<br>期<br>末 |             |             |           | 償還年月日      |  |
|--------|--------------------------|-------------|-------------|-------------|-----------|------------|--|
|        |                          | 利<br>率      | 額面金額        | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|        |                          |             |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| 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        |            |  |
| 国債証券   | 3.9 MALAYSIAGOV 261130   | 3.9         | 2,900       | 2,924       | 96,181    | 2026/11/30 |  |
|        | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 3.906       | 2,960       | 2,983       | 98,125    | 2026/7/15  |  |
|        | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955       | 1,740       | 1,752       | 57,625    | 2025/9/15  |  |
|        | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 4.065       | 5,250       | 5,097       | 167,619   | 2050/6/15  |  |
|        | 4.232MALAYSIAGOV 310630  | 4.232       | 2,550       | 2,607       | 85,741    | 2031/6/30  |  |
|        | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254       | 2,600       | 2,660       | 87,485    | 2035/5/31  |  |
|        | 4.392 MALAYSIAGOV 260415 | 4.392       | 1,940       | 1,972       | 64,867    | 2026/4/15  |  |
|        | 4.457 MALAYSIAGOV 530331 | 4.457       | 2,400       | 2,473       | 81,355    | 2053/3/31  |  |
|        | 4.498 MALAYSIAGOV 300415 | 4.498       | 4,240       | 4,394       | 144,523   | 2030/4/15  |  |
|        | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 4.504       | 1,500       | 1,552       | 51,053    | 2029/4/30  |  |
|        | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 4.642       | 3,200       | 3,377       | 111,071   | 2033/11/7  |  |
|        | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 4.696       | 6,000       | 6,414       | 210,948   | 2042/10/15 |  |
|        | 4.736 MALAYSIAGOV 460315 | 4.736       | 1,650       | 1,771       | 58,242    | 2046/3/15  |  |
|        | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4.762       | 4,440       | 4,747       | 156,109   | 2037/4/7   |  |
|        | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 4.893       | 3,360       | 3,661       | 120,396   | 2038/6/8   |  |
|        | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 4.921       | 2,720       | 2,997       | 98,566    | 2048/7/6   |  |
|        | 4.935 MALAYSIAGOV 430930 | 4.935       | 1,550       | 1,704       | 56,052    | 2043/9/30  |  |
| 小<br>計 |                          |             |             |             | 3,086,150 |            |  |
| 中国     |                          |             | 千中国元        | 千中国元        |           |            |  |
| 国債証券   | 1.99 CHINA GOVT 260315   | 1.99        | 35,000      | 35,083      | 756,855   | 2026/3/15  |  |
|        | 2 CHINA GOVT 250615      | 2.0         | 42,000      | 42,076      | 907,713   | 2025/6/15  |  |
|        | 2.04 CHINA GOVT 270225   | 2.04        | 37,000      | 37,081      | 799,952   | 2027/2/25  |  |
|        | 2.18 CHINA GOVT 250825   | 2.18        | 34,000      | 34,139      | 736,490   | 2025/8/25  |  |
|        | 2.18 CHINA GOVT 260815   | 2.18        | 39,000      | 39,188      | 845,407   | 2026/8/15  |  |
|        | 2.22 CHINA GOVT 250925   | 2.22        | 50,000      | 50,238      | 1,083,793 | 2025/9/25  |  |
|        | 2.24 CHINA GOVT 250525   | 2.24        | 30,000      | 30,136      | 650,128   | 2025/5/25  |  |
|        | 2.28 CHINA GOVT 251125   | 2.28        | 34,000      | 34,211      | 738,054   | 2025/11/25 |  |
|        | 2.28 CHINA GOVT 310325   | 2.28        | 17,000      | 17,031      | 367,428   | 2031/3/25  |  |
|        | 2.3 CHINA GOVT 260515    | 2.3         | 30,000      | 30,216      | 651,862   | 2026/5/15  |  |
|        | 2.33 CHINA GOVT 251215   | 2.33        | 45,000      | 45,323      | 977,764   | 2025/12/15 |  |
|        | 2.35 CHINA GOVT 340225   | 2.35        | 21,000      | 21,109      | 455,404   | 2034/2/25  |  |
|        | 2.37 CHINA GOVT 270120   | 2.37        | 28,000      | 28,282      | 610,134   | 2027/1/20  |  |
|        | 2.37 CHINA GOVT 290115   | 2.37        | 58,000      | 58,692      | 1,266,182 | 2029/1/15  |  |
|        | 2.39 CHINA GOVT 261115   | 2.39        | 66,000      | 66,694      | 1,438,817 | 2026/11/15 |  |
|        | 2.4 CHINA GOVT 280715    | 2.4         | 58,000      | 58,630      | 1,264,849 | 2028/7/15  |  |
|        | 2.44 CHINA GOVT 271015   | 2.44        | 35,000      | 35,396      | 763,609   | 2027/10/15 |  |
|        | 2.46 CHINA GOVT 260215   | 2.46        | 86,000      | 86,796      | 1,872,479 | 2026/2/15  |  |
|        | 2.48 CHINA GOVT 270415   | 2.48        | 28,000      | 28,392      | 612,523   | 2027/4/15  |  |
|        | 2.48 CHINA GOVT 280925   | 2.48        | 18,000      | 18,262      | 393,970   | 2028/9/25  |  |
|        | 2.5 CHINA GOVT 270725    | 2.5         | 61,000      | 61,850      | 1,334,309 | 2027/7/25  |  |
|        | 2.52 CHINA GOVT 330825   | 2.52        | 52,000      | 52,831      | 1,139,735 | 2033/8/25  |  |
|        | 2.54 CHINA GOVT 301225   | 2.54        | 65,000      | 66,122      | 1,426,470 | 2030/12/25 |  |
|        | 2.55 CHINA GOVT 281015   | 2.55        | 50,000      | 50,919      | 1,098,492 | 2028/10/15 |  |
|        | 2.6 CHINA GOVT 300915    | 2.6         | 52,000      | 53,038      | 1,144,206 | 2030/9/15  |  |
|        | 2.6 CHINA GOVT 320901    | 2.6         | 37,000      | 37,769      | 814,808   | 2032/9/1   |  |
|        | 2.62 CHINA GOVT 280415   | 2.62        | 56,000      | 57,055      | 1,230,862 | 2028/4/15  |  |
|        | 2.62 CHINA GOVT 290925   | 2.62        | 29,000      | 29,639      | 639,416   | 2029/9/25  |  |

| 銘<br>柄 |                        | 当<br>期<br>末 |        |             |           |
|--------|------------------------|-------------|--------|-------------|-----------|
|        |                        | 利<br>率      | 額面金額   | 評<br>価<br>額 | 償還年月日     |
|        |                        |             |        | 外貨建金額       |           |
| 中国     |                        | %           | 千中国元   | 千中国元        | 千円        |
| 国債証券   | 2.62 CHINA GOVT 300625 | 2.62        | 60,000 | 61,269      | 1,321,772 |
|        | 2.64 CHINA GOVT 280115 | 2.64        | 41,000 | 41,775      | 901,225   |
|        | 2.67 CHINA GOVT 330525 | 2.67        | 52,000 | 53,332      | 1,150,542 |
|        | 2.67 CHINA GOVT 331125 | 2.67        | 46,000 | 47,357      | 1,021,640 |
|        | 2.68 CHINA GOVT 300521 | 2.68        | 55,000 | 56,363      | 1,215,925 |
|        | 2.69 CHINA GOVT 260812 | 2.69        | 34,000 | 34,561      | 745,598   |
|        | 2.69 CHINA GOVT 320815 | 2.69        | 48,000 | 49,302      | 1,063,615 |
|        | 2.74 CHINA GOVT 260804 | 2.74        | 24,000 | 24,420      | 526,829   |
|        | 2.75 CHINA GOVT 290615 | 2.75        | 30,000 | 30,851      | 665,571   |
|        | 2.75 CHINA GOVT 320217 | 2.75        | 30,000 | 30,984      | 668,439   |
|        | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 2.76        | 37,000 | 38,202      | 824,151   |
|        | 2.79 CHINA GOVT 291215 | 2.79        | 31,000 | 31,952      | 689,314   |
|        | 2.8 CHINA GOVT 290324  | 2.8         | 42,000 | 43,226      | 932,539   |
|        | 2.8 CHINA GOVT 300325  | 2.8         | 45,000 | 46,428      | 1,001,614 |
|        | 2.8 CHINA GOVT 321115  | 2.8         | 29,000 | 30,058      | 648,449   |
|        | 2.85 CHINA GOVT 270604 | 2.85        | 32,000 | 32,814      | 707,916   |
|        | 2.88 CHINA GOVT 330225 | 2.88        | 36,000 | 37,597      | 811,104   |
|        | 2.89 CHINA GOVT 311118 | 2.89        | 23,000 | 24,001      | 517,780   |
|        | 2.9 CHINA GOVT 260505  | 2.9         | 24,000 | 24,490      | 528,338   |
|        | 2.91 CHINA GOVT 281014 | 2.91        | 32,000 | 33,082      | 713,693   |
|        | 2.99 CHINA GOVT 251015 | 2.99        | 39,000 | 39,671      | 855,844   |
|        | 3 CHINA GOVT 531015    | 3.0         | 23,000 | 25,219      | 544,062   |
|        | 3.01 CHINA GOVT 280513 | 3.01        | 39,000 | 40,431      | 872,226   |
|        | 3.02 CHINA GOVT 251022 | 3.02        | 36,000 | 36,641      | 790,470   |
|        | 3.02 CHINA GOVT 310527 | 3.02        | 39,000 | 40,982      | 884,111   |
|        | 3.03 CHINA GOVT 260311 | 3.03        | 28,000 | 28,616      | 617,340   |
|        | 3.12 CHINA GOVT 261205 | 3.12        | 37,000 | 38,217      | 824,460   |
|        | 3.12 CHINA GOVT 521025 | 3.12        | 21,000 | 23,121      | 498,807   |
|        | 3.13 CHINA GOVT 291121 | 3.13        | 24,000 | 25,272      | 545,212   |
|        | 3.19 CHINA GOVT 530415 | 3.19        | 19,000 | 21,231      | 458,034   |
|        | 3.22 CHINA GOVT 251206 | 3.22        | 18,000 | 18,410      | 397,160   |
|        | 3.25 CHINA GOVT 260606 | 3.25        | 28,000 | 28,831      | 621,993   |
|        | 3.25 CHINA GOVT 281122 | 3.25        | 25,000 | 26,314      | 567,685   |
|        | 3.27 CHINA GOVT 301119 | 3.27        | 35,000 | 37,402      | 806,878   |
|        | 3.28 CHINA GOVT 271203 | 3.28        | 24,000 | 25,114      | 541,801   |
|        | 3.29 CHINA GOVT 290523 | 3.29        | 29,000 | 30,736      | 663,086   |
|        | 3.32 CHINA GOVT 520415 | 3.32        | 21,000 | 23,922      | 516,090   |
|        | 3.39 CHINA GOVT 500316 | 3.39        | 43,000 | 49,062      | 1,058,432 |
|        | 3.52 CHINA GOVT 270504 | 3.52        | 7,000  | 7,360       | 158,795   |
|        | 3.53 CHINA GOVT 511018 | 3.53        | 20,000 | 23,505      | 507,093   |
|        | 3.54 CHINA GOVT 280816 | 3.54        | 13,000 | 13,845      | 298,682   |
|        | 3.59 CHINA GOVT 270803 | 3.59        | 7,000  | 7,402       | 159,684   |
|        | 3.6 CHINA GOVT 250906  | 3.6         | 8,000  | 8,216       | 177,249   |
|        | 3.61 CHINA GOVT 250607 | 3.61        | 10,000 | 10,221      | 220,510   |
|        | 3.69 CHINA GOVT 280517 | 3.69        | 15,000 | 16,059      | 346,448   |
|        | 3.72 CHINA GOVT 510412 | 3.72        | 22,000 | 26,593      | 573,707   |
|        | 3.81 CHINA GOVT 500914 | 3.81        | 38,000 | 46,441      | 1,001,895 |

| 銘<br>柄 |      | 当<br>期<br>末   |  |  |  | 償還年月日  |  |
|--------|------|---|--|--|--|--|--|
|        |      | 利<br>率  | 額面金額   | 評<br>価<br>額  |  |  |  |
|        |      |   |  | 外貨建金額  | 邦貨換算金額   |  |  |
| 中国     |      | %   | 千中国元   | 千中国元   | 千円   |  |  |
|        | 国債証券 | 3.86 CHINA GOVT 490722<br>4.08 CHINA GOVT 481022  | 3.86<br>4.08   | 33,000<br>29,000   | 40,427<br>36,572   | 872,156<br>788,991<br>2049/7/22<br>2048/10/22  |  |
| 小      | 計    |   |  |  | 59,846,705   |  |  |
| イスラエル  |      |   | 千イスラエルシェケル   | 千イスラエルシェケル   |  |  |  |
|        | 国債証券 | 0.5 ISRAEL FIXED 260227<br>1 ISRAEL FIXED BO 300331<br>1.3 ISRAEL FIXED 320430<br>1.5 ISRAEL FIXED 370531<br>2 ISRAEL FIXED BO 270331<br>2.25 ISRAEL FIXED 280928<br>2.8 ISRAEL FIXED 521129<br>3.75 ISRAEL FIXED 290228<br>3.75 ISRAEL FIXED 470331<br>4 ISRAEL FIXED BO 350330<br>5.5 ISRAEL FIXED 420131<br>6.25 ISRAEL FIXED 261030 | 0.5<br>1.0<br>1.3<br>1.5<br>2.0<br>2.25<br>2.8<br>3.75<br>3.75<br>4.0<br>5.5<br>6.25 | 5,800<br>6,620<br>4,800<br>4,900<br>7,000<br>3,080<br>1,900<br>4,600<br>4,680<br>1,700<br>3,130<br>5,000 | 5,463<br>5,483<br>3,788<br>3,440<br>6,592<br>2,886<br>1,282<br>4,538<br>3,925<br>1,627<br>3,418<br>5,393 | 229,470<br>230,338<br>159,129<br>144,496<br>276,902<br>121,235<br>53,874<br>190,649<br>164,881<br>68,365<br>143,608<br>226,529 | 2026/2/27<br>2030/3/31<br>2032/4/30<br>2037/5/31<br>2027/3/31<br>2028/9/28<br>2052/11/29<br>2029/2/28<br>2047/3/31<br>2035/3/30<br>2042/1/31<br>2026/10/30 |
| 小      | 計    |   |  |  | 2,009,481  |  |  |
| 合      | 計    |   |  |  | 621,579,696  |  |  |

(注) 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。

## ○投資信託財産の構成 (2024年5月13日現在)

| 項<br>目       | 当<br>期<br>末 |             | 比<br>率<br>% |
|--------------|-------------|-------------|-------------|
|              | 評<br>価<br>額 | 千円          |             |
| 公社債          |             | 621,579,696 | 97.0        |
| コール・ローン等、その他 |             | 19,241,364  | 3.0         |
| 投資信託財産総額     |             | 640,821,060 | 100.0       |

(注) 期末における外貨建純資産（631,377,693千円）の投資信託財産総額（640,821,060千円）に対する比率は98.5%です。

(注) 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、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                       |                     |                      |                    |
|-----------------------|---------------------|----------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=155.98円      | 1 カナダドル=114.02円     | 1 メキシコペソ=9.2996円     | 1 ヨーロ=167.96円      |
| 1 イギリスポンド=195.24円     | 1 スウェーデンクローネ=14.38円 | 1 ノルウェークローネ=14.36円   | 1 デンマーククローネ=22.52円 |
| 1 ポーランドズロチ=39.032円    | 1 オーストラリアドル=102.88円 | 1 ニュージーランドドル=93.81円  | 1 シンガポールドル=115.13円 |
| 1 マレーシアリンギット=32.8846円 | 1 中国元=21.5731円      | 1 イスラエルシェケル=42.0043円 |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月13日現在)

| 項目              | 当期末              |
|-----------------|------------------|
| (A) 資産          | 円                |
| コール・ローン等        | 645,932,200,221  |
| 公社債(評価額)        | 8,213,049,473    |
| 未収入金            | 621,579,696,652  |
| 未収利息            | 10,096,429,878   |
| 前払費用            | 5,141,603,144    |
|                 | 901,421,074      |
| (B) 負債          | 12,247,373,336   |
| 前受収益            | 111,335          |
| 未払金             | 5,703,945,940    |
| 未払解約金           | 6,543,316,061    |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 633,684,826,885  |
| 元本              | 234,826,201,838  |
| 次期繰越損益金         | 398,858,625,047  |
| (D) 受益権総口数      | 234,826,201,838口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 26,985円          |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 187,414,503,873円  
 期中追加設定元本額 74,193,096,689円  
 期中一部解約元本額 26,781,398,724円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,6985円です。

## ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

|                                     |                 |
|-------------------------------------|-----------------|
| MUAM 外国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定)      | 49,105,890,786円 |
| eMAXIS Slim 先進国債券インデックス             | 48,049,779,033円 |
| 三菱UFJ 外国債券オープン(毎月分配型)               | 16,257,821,018円 |
| 三菱UFJ DC 海外債券インデックスファンド             | 15,416,262,306円 |
| eMAXIS Slim バランスマックス(8資産均等型)        | 12,675,874,758円 |
| MUAM グローバルバランス(退職給付信託向け)(適格機関投資家限定) | 12,357,414,449円 |
| eMAXIS 先進国債券インデックス                  | 6,351,103,113円  |
| つみたて8資産均等バランス                       | 6,329,158,717円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定成長型)(確定拠出年金)       | 6,235,501,124円  |
| 海外債券インデックスファンドS                     | 5,540,516,389円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(成長型)(確定拠出年金)         | 5,166,547,355円  |
| MUKAM 外国債券インデックスファンド2(適格機関投資家限定)    | 4,342,814,719円  |
| 海外債券セレクション(ラップ向け)                   | 3,525,643,331円  |
| 三菱UFJ 外国債券オープン(確定拠出年金)              | 3,138,734,731円  |
| ラップ向けインデックスf 先進国債券                  | 2,942,049,447円  |
| eMAXIS バランスマックス(8資産均等型)             | 2,418,064,982円  |
| 三菱UFJ DC年金インデックス(先進国債券)             | 2,405,637,592円  |
| つみたて4資産均等バランス                       | 2,346,077,233円  |
| 三菱UFJ 世界国債インデックスファンド(年1回決算型)        | 2,276,030,188円  |
| 三菱UFJ プライムバランス(安定型)(確定拠出年金)         | 2,068,100,881円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式65)                | 2,040,597,578円  |
| 三菱UFJ <DC>外国債券インデックスファンド            | 1,758,798,143円  |
| MUAM 世界債券オープン(適格機関投資家限定)            | 1,535,029,601円  |
| 三菱UFJ バランスマネジメント40VA(適格機関投資家限定)     | 1,428,002,895円  |
| 三菱UFJ DC年金バランス(株式40)                | 1,258,746,734円  |

## ○損益の状況 (2023年5月13日～2024年5月13日)

| 項目               | 当期               |
|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益        | 円                |
| 受取利息             | 13,690,786,610   |
| その他収益金           | 13,691,347,015   |
| 支払利息             | 170,720          |
| △                | △ 731,125        |
| (B) 有価証券売買損益     | 59,007,213,606   |
| 売買益              | 75,722,382,339   |
| 売買損              | △ 16,715,168,733 |
| (C) 保管費用等        | △ 54,555,199     |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 72,643,445,017   |
| (E) 前期繰越損益金      | 251,534,600,483  |
| (F) 追加信託差損益金     | 115,683,853,191  |
| (G) 解約差損益金       | △ 41,003,273,644 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 398,858,625,047  |
| 次期繰越損益金(H)       | 398,858,625,047  |

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換算によるものを含みます。

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

(注) (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。

|  |                |
|--|----------------|
| 三義UFJ バランスファンド20VA (適格機関投資家限定)         | 1,191,054,652円 |
| 三義UFJ バランスファンドVA40型 (適格機関投資家限定)        | 1,090,364,496円 |
| 三義UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)          | 1,054,740,906円 |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション (適格機関投資家転売制限付) | 1,022,914,625円 |
| 三義UFJ 外国債券ファンドVA (適格機関投資家限定)           | 985,960,602円   |
| eMAXIS バランス (4資産均等型)                   | 980,146,585円   |
| ワールド・インカムオープン                          | 967,154,593円   |
| 三義UFJ 外国債券オープン                         | 810,529,949円   |
| 三義UFJ DC年金バランス (株式15)                  | 775,136,896円   |
| 三義UFJ ライフセレクトファンド (安定成長型)              | 677,826,341円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)            | 559,426,267円   |
| 三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定成長型) | 549,008,624円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)             | 543,583,387円   |
| 三義UFJ 6資産バランスファンド (2ヶ月分配型)             | 530,155,597円   |
| MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2 (適格機関投資家限定)   | 522,918,975円   |
| 三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (成長型)   | 457,887,268円   |
| 三義UFJ ライフセレクトファンド (成長型)                | 453,465,274円   |
| 三義UFJ バランスファンドVA50型 (適格機関投資家限定)        | 446,352,042円   |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2030 (確定拠出年金)      | 420,043,104円   |
| 三義UFJ 世界国債インデックスファンド (毎月分配型)           | 398,157,123円   |
| ファンド・マネジャー (海外債券)                      | 304,210,242円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)             | 298,249,453円   |
| 三義UFJ ライフセレクトファンド (安定型)                | 275,933,073円   |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2040 (確定拠出年金)      | 248,488,172円   |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2035 (確定拠出年金)      | 238,650,170円   |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード)               | 230,674,940円   |
| eMAXIS バランス (波乗り型)                     | 210,474,759円   |
| 三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (積極型)   | 191,864,608円   |
| 三義UFJ <DC>インデックス・ライフ・バランス ファンド (安定型)   | 190,005,125円   |
| 三義UFJ DC年金バランス (株式25)                  | 178,894,500円   |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2050 (確定拠出年金)      | 171,209,004円   |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2045 (確定拠出年金)      | 166,682,843円   |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2055 (確定拠出年金)      | 96,444,871円    |
| 三義UFJ 6資産バランスファンド (成長型)                | 95,854,101円    |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2060 (確定拠出年金)      | 84,269,100円    |
| eMAXIS 最適化バランス (マイストライカー)              | 83,142,554円    |
| アドバンスト・バランスII (FOFs用) (適格機関投資家限定)      | 55,568,872円    |
| アクティビアロケーションファンド (ラップ向け)               | 43,862,810円    |
| 三義UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2065 (確定拠出年金)      | 40,452,442円    |
| 三義UFJ DC年金バランス (株式80)                  | 39,457,201円    |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)            | 34,365,210円    |
| アドバンスト・バランスI (FOFs用) (適格機関投資家限定)       | 31,727,206円    |
| ラップ向けアクティビアロケーションファンド                  | 24,018,105円    |
| 外国債券インデックスファンドV (適格機関投資家限定)            | 17,114,425円    |
| 三義UFJ バランスファンド45VA (適格機関投資家限定)         | 11,201,400円    |
| 三義UFJ 外国債券ファンドVA2 (適格機関投資家限定)          | 10,306,798円    |
| 三義UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定)            | 8,805,293円     |
| 三義UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定)            | 7,583,073円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                  | 4,833,103円     |
| 三義UFJ 外国債券インデックスファンドVA                 | 4,344,917円     |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                  | 3,666,273円     |
| 三義UFJ バランスVA30D (適格機関投資家限定)            | 3,507,655円     |
| 三義UFJ バランスVA30G (適格機関投資家限定)            | 3,368,341円     |
| グローバルバランスオープンV (適格機関投資家限定)             | 2,970,438円     |

|                                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）VA     | 2,567,288円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）VA       | 1,590,011円       |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）VA       | 865,947円         |
| e MAX I S マイマネージャー 1990s         | 650,062円         |
| インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）VA       | 507,380円         |
| 三菱UFJ バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）    | 377,170円         |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤー・ファンド2070（確定拠出年金） | 316,798円         |
| 三菱UFJ バランスファンドVA 30型（適格機関投資家限定）  | 101,696円         |
| 合計                               | 234,826,201,838円 |

## [ お 知 ら せ ]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10月1日)

# 新興国債券インデックスマザーファンド

**《第15期》決算日2025年1月27日**

**[計算期間：2024年1月27日～2025年1月27日]**

「新興国債券インデックスマザーファンド」は、1月27日に第15期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第15期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 主として対象インデックス（JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））に採用されている新興国の現地通貨建ての公社債に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用して公社債の投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外国為替予約取引を行うことがあります。 |
| 主要運用対象 | 新興国の現地通貨建て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割合に制限を設けません。   |

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | J P モルガン G B I - E M<br>グローバル・ダイバーシファイド<br>(円換算ベース) |           | 債組入比率   | 債券先物比率 | 純資産額       |
|-----------------|----------|---|-----------|---------|--------|------------|
|                 |          | 期騰落   | 中率        |         |        |            |
| 11期(2021年1月26日) | 円 13,819 | % △ 4.2   | 32,923.96 | % △ 3.7 | 97.6   | 百万円 37,779 |
| 12期(2022年1月26日) | 14,025   | 1.5   | 33,419.11 | 1.5     | 97.5   | 51,888     |
| 13期(2023年1月26日) | 14,770   | 5.3   | 35,262.54 | 5.5     | 97.1   | 64,755     |
| 14期(2024年1月26日) | 17,722   | 20.0  | 42,305.98 | 20.0    | 96.1   | 87,744     |
| 15期(2025年1月27日) | 18,960   | 7.0   | 45,725.85 | 8.1     | 97.1   | 111,509    |

(注) JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権は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。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（ドルベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「債券先物比率」は買建比率-売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日         | 基<br>準<br>価<br>額 |        | J P モルガン G B I – E M<br>グローバル・ダイバーシファイド<br>(円換算ベース) | 債<br>組<br>入<br>比<br>率 | 債<br>券<br>先<br>物<br>比<br>率 |
|---------------------|------------------|--------|---|-----------------------|----------------------------|
|                     | 騰                | 落      |   |                       |                            |
| (期 首)<br>2024年1月26日 | 円<br>17,722      | %<br>— | 42,305.98   | %<br>—                | %<br>96.1                  |
| 1月末                 | 17,738           | 0.1    | 42,292.83   | △0.0                  | 95.8                       |
| 2月末                 | 18,034           | 1.8    | 43,086.63   | 1.8                   | 95.9                       |
| 3月末                 | 18,078           | 2.0    | 43,399.92   | 2.6                   | 95.9                       |
| 4月末                 | 18,442           | 4.1    | 44,191.92   | 4.5                   | 96.8                       |
| 5月末                 | 18,648           | 5.2    | 44,741.32   | 5.8                   | 96.9                       |
| 6月末                 | 18,859           | 6.4    | 45,275.28   | 7.0                   | 95.8                       |
| 7月末                 | 18,229           | 2.9    | 43,687.81   | 3.3                   | 96.1                       |
| 8月末                 | 17,942           | 1.2    | 43,033.27   | 1.7                   | 96.3                       |
| 9月末                 | 18,309           | 3.3    | 43,946.12   | 3.9                   | 96.9                       |
| 10月末                | 18,751           | 5.8    | 45,029.50   | 6.4                   | 96.9                       |
| 11月末                | 18,219           | 2.8    | 43,779.16   | 3.5                   | 96.8                       |
| 12月末                | 18,896           | 6.6    | 45,405.44   | 7.3                   | 96.0                       |
| (期 末)<br>2025年1月27日 | 18,960           | 7.0    | 45,725.85   | 8.1                   | 97.1                       |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

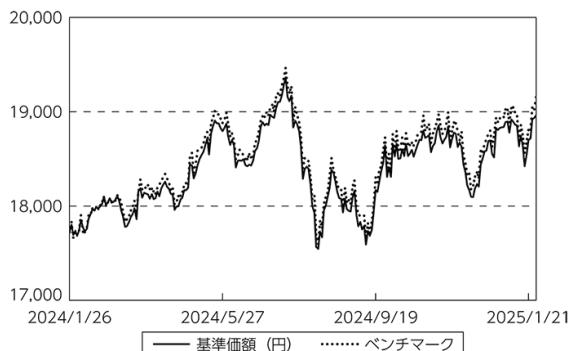
### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ7.0%の上昇となりました。

### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(8.1%)を1.1%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎債券市況

新興国の現地通貨建て債券市況は上昇しました。

新興国の現地通貨建て債券市況は、利金が相応に積みあがったことなどから上昇しました。

◎為替市況

期間の初めに比べてブラジルレアルやメキシコペソなどが対円で下落した一方、マレーシアリンギットやタイバーツなどが対円で上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・新興国の現地通貨建ての公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるJ P モルガン G B I – E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ベンチマークの動きに連動するべく、組入比率は高位に保ち、地域別配分や年限構成比がほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは8.1%の上昇になったため、カイ離は△1.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ポートフォリオ要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目                             | 当期                     |                                  | 項目の概要  |
|--------------------------------|------------------------|----------------------------------|--|
|                                | 金額                     | 比率                               |  |
| (a) その他の費用<br>（保管費用）<br>（その他の） | 円<br>15<br>(14)<br>(1) | %<br>0.080<br>(0.077)<br>(0.003) | (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>有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計                             | 15                     | 0.080                            |  |
| 期中の平均基準価額は、18,390円です。          |                        |                                  |  |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 公社債

|        |                | 買付額                       | 売付額                       |
|--------|----------------|---------------------------|---------------------------|
| 外<br>国 | メキシコ<br>国債証券   | 千メキシコペソ<br>761,739        | 千メキシコペソ<br>270,949        |
|        | ブラジル<br>国債証券   | 千ブラジルレアル<br>100,514       | 千ブラジルレアル<br>114,535       |
|        | チリ<br>国債証券     | 千チリペソ<br>5,387,923        | 千チリペソ<br>2,999,633        |
|        | コロンビア<br>国債証券  | 千コロンビアペソ<br>31,491,461    | 千コロンビアペソ<br>5,421,971     |
|        | ペルー<br>国債証券    | 千ペルーヌエボソル<br>14,169       | 千ペルーヌエボソル<br>9,369        |
|        | ウルグアイ<br>国債証券  | 千ウルグアイペソ<br>6,270         | 千ウルグアイペソ<br>—             |
|        | ドミニカ<br>国債証券   | 千ドミニカペソ<br>49,232         | 千ドミニカペソ<br>—              |
|        | セルビア<br>国債証券   | 千セルビアディナール<br>63,565      | 千セルビアディナール<br>—           |
|        | トルコ<br>国債証券    | 千トルコリラ<br>213,070         | 千トルコリラ<br>12,911          |
|        | チェコ<br>国債証券    | 千チェココルナ<br>411,030        | 千チェココルナ<br>322,952        |
|        | ハンガリー<br>国債証券  | 千ハンガリーフォリント<br>1,879,745  | 千ハンガリーフォリント<br>1,678,595  |
|        | ポーランド<br>国債証券  | 千ポーランドズロチ<br>74,953       | 千ポーランドズロチ<br>51,628       |
|        | ルーマニア<br>国債証券  | 千ルーマニアレイ<br>35,650        | 千ルーマニアレイ<br>19,502        |
|        | マレーシア<br>国債証券  | 千マレーシアリンギット<br>81,283     | 千マレーシアリンギット<br>47,616     |
|        | タイ<br>国債証券     | 千タイバーツ<br>714,428         | 千タイバーツ<br>494,018         |
|        | フィリピン<br>国債証券  | 千フィリピンペソ<br>—             | 千フィリピンペソ<br>18,700        |
|        | インドネシア<br>国債証券 | 千インドネシアルピア<br>328,478,348 | 千インドネシアルピア<br>101,126,230 |
|        | インド<br>国債証券    | 千インドルピー<br>4,058,061      | 千インドルピー<br>—              |
|        | 中国<br>国債証券     | 千中国元<br>157,178           | 千中国元<br>97,411            |
|        | 南アフリカ<br>国債証券  | 千南アフリカランド<br>410,523      | 千南アフリカランド<br>295,019      |

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

## ○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
| 為替先物取引 | 515       | 205                | 39.8          | 521       | 173                | 33.2          |
| 為替直物取引 | 41,552    | 5,392              | 13.0          | 24,555    | 2,546              | 10.4          |

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2025年1月27日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区分     | 当期末                                |                                    |                  |           |             |           |          |          |
|--------|------------------------------------|------------------------------------|------------------|-----------|-------------|-----------|----------|----------|
|        | 額面金額                               | 評価額                                |                  | 組入比率      | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |          |          |
|        |                                    | 外貨建金額                              | 邦貨換算金額           |           |             | 5年以上      | 2年以上     | 2年未満     |
| メキシコ   | 千メキシコペソ<br>1,620,700               | 千メキシコペソ<br>1,457,791               | 千円<br>11,111,580 | %<br>10.0 | %<br>—      | %<br>4.9  | %<br>3.6 | %<br>1.5 |
| ブラジル   | 千ブラジルレアル<br>324,570                | 千ブラジルレアル<br>262,306                | 千円<br>6,898,633  | 6.2       | 6.2         | 1.0       | 2.0      | 3.2      |
| チリ     | 千チリペソ<br>12,555,000                | 千チリペソ<br>12,157,920                | 千円<br>1,925,401  | 1.7       | —           | 1.1       | 0.5      | 0.2      |
| コロンビア  | 千コロンビアペソ<br>144,010,000            | 千コロンビアペソ<br>121,223,736            | 千円<br>4,512,674  | 4.0       | —           | 2.9       | 0.7      | 0.5      |
| ペルー    | 千ペルーヌエボソル<br>54,950                | 千ペルーヌエボソル<br>55,010                | 千円<br>2,299,638  | 2.1       | —           | 1.7       | 0.3      | 0.1      |
| ウルグアイ  | 千ウルグアイペソ<br>47,000                 | 千ウルグアイペソ<br>45,768                 | 千円<br>163,787    | 0.1       | —           | 0.1       | 0.0      | —        |
| ドミニカ   | 千ドミニカペソ<br>95,000                  | 千ドミニカペソ<br>103,487                 | 千円<br>261,296    | 0.2       | 0.2         | 0.2       | —        | —        |
| セルビア   | 千セルビアディナール<br>245,000              | 千セルビアディナール<br>253,203              | 千円<br>352,841    | 0.3       | —           | 0.2       | 0.1      | 0.1      |
| トルコ    | 千トルコリラ<br>404,500                  | 千トルコリラ<br>358,669                  | 千円<br>1,566,020  | 1.4       | 1.4         | 0.5       | 0.7      | 0.2      |
| チェコ    | 千チェココルナ<br>934,300                 | 千チェココルナ<br>907,301                 | 千円<br>5,892,743  | 5.3       | —           | 3.1       | 1.7      | 0.6      |
| ハンガリー  | 千ハンガリーフォント<br>7,531,000            | 千ハンガリーフォント<br>6,631,200            | 千円<br>2,648,580  | 2.4       | —           | 1.0       | 0.7      | 0.6      |
| ポーランド  | 千ポーランドズロチ<br>216,550               | 千ポーランドズロチ<br>200,423               | 千円<br>7,752,232  | 7.0       | —           | 2.1       | 3.7      | 1.1      |
| ルーマニア  | 千ルーマニアレイ<br>118,260                | 千ルーマニアレイ<br>110,899                | 千円<br>3,632,766  | 3.3       | —           | 1.6       | 1.1      | 0.5      |
| マレーシア  | 千マレーシアリンギット<br>302,380             | 千マレーシアリンギット<br>307,165             | 千円<br>10,889,062 | 9.8       | —           | 5.5       | 2.7      | 1.6      |
| タイ     | 千タイバーツ<br>2,214,600                | 千タイバーツ<br>2,281,527                | 千円<br>10,540,657 | 9.5       | —           | 4.9       | 3.6      | 0.9      |
| インドネシア | 千インドネシアルピア<br>1,086,480,000        | 千インドネシアルピア<br>1,101,921,182        | 千円<br>10,688,635 | 9.6       | —           | 6.5       | 2.2      | 0.8      |
| インド    | 千インドルピー <sup>1)</sup><br>4,000,000 | 千インドルピー <sup>1)</sup><br>4,080,068 | 千円<br>7,384,923  | 6.6       | —           | 5.4       | 1.2      | —        |
| 中国     | 千中国元<br>472,200                    | 千中国元<br>503,897                    | 千円<br>10,819,183 | 9.7       | —           | 4.8       | 3.2      | 1.7      |

| 区分    | 当期末                    |                        |                 |          |             |           |        |          |
|-------|------------------------|------------------------|-----------------|----------|-------------|-----------|--------|----------|
|       | 額面金額                   | 評価額                    |                 | 組入比率     | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 |        |          |
|       |                        | 外貨建金額                  | 邦貨換算金額          |          |             | 5年以上      | 2年以上   | 2年未満     |
| 南アフリカ | 千南アフリカランド<br>1,208,540 | 千南アフリカランド<br>1,065,815 | 千円<br>8,952,847 | %<br>8.0 | %<br>8.0    | %<br>7.3  | %<br>— | %<br>0.8 |
| 合計    | —                      | —                      | 108,293,509     | 97.1     | 15.9        | 54.8      | 28.1   | 14.3     |

(注) 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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄  |      | 当 期 末                     |         |           |                 | 償還年月日     |  |
|------|------|---------------------------|---------|-----------|-----------------|-----------|--|
|      |      | 利 率                       | 額面金額    | 評 価 額     | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |           |  |
|      |      | %                         | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ   | 千円              |           |  |
| メキシコ | 国債証券 | 10 MEXICAN BONOS 361120   | 10.0    | 33,300    | 33,527          | 255,551   |  |
|      |      | 5.5 MEXICAN BONOS 270304  | 5.5     | 138,200   | 127,898         | 974,864   |  |
|      |      | 5.75 MEXICAN BONO 260305  | 5.75    | 104,200   | 100,221         | 763,911   |  |
|      |      | 7 MEXICAN BONOS 260903    | 7.0     | 125,000   | 120,655         | 919,656   |  |
|      |      | 7.5 MEXICAN BONOS 270603  | 7.5     | 143,200   | 137,352         | 1,046,928 |  |
|      |      | 7.5 MEXICAN BONOS 330526  | 7.5     | 115,800   | 100,484         | 765,911   |  |
|      |      | 7.75 MEXICAN BONO 310529  | 7.75    | 135,900   | 123,728         | 943,081   |  |
|      |      | 7.75 MEXICAN BONO 341123  | 7.75    | 116,700   | 100,811         | 768,407   |  |
|      |      | 7.75 MEXICAN BONO 421113  | 7.75    | 137,900   | 108,867         | 829,808   |  |
|      |      | 8 MEXICAN BONOS 350524    | 8.0     | 10,000    | 8,650           | 65,933    |  |
|      |      | 8 MEXICAN BONOS 471107    | 8.0     | 90,900    | 72,161          | 550,027   |  |
|      |      | 8 MEXICAN BONOS 530731    | 8.0     | 123,000   | 96,398          | 734,766   |  |
|      |      | 8.5 MEXICAN BONOS 280302  | 8.5     | 25,000    | 24,224          | 184,644   |  |
|      |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290301  | 8.5     | 127,000   | 121,992         | 929,850   |  |
|      |      | 8.5 MEXICAN BONOS 290531  | 8.5     | 119,100   | 114,489         | 872,660   |  |
|      |      | 8.5 MEXICAN BONOS 381118  | 8.5     | 75,500    | 66,329          | 505,576   |  |
| 小 計  |      |                           |         |           | 11,111,580      |           |  |
| 小 計  |      |                           | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ   |                 |           |  |
| ブラジル | 国債証券 | 10 (IN) BRAZIL NT 270101  | 10.0    | 44,870    | 41,561          | 1,093,057 |  |
|      |      | 10 (IN) BRAZIL NTN 310101 | 10.0    | 24,100    | 19,721          | 518,674   |  |
|      |      | 10 (IN) BRAZIL NTN 330101 | 10.0    | 20,700    | 16,302          | 428,743   |  |
|      |      | 10 (IN) BRAZIL NTN 350101 | 10.0    | 8,400     | 6,387           | 168,003   |  |
|      |      | 10 (IN) BRAZIL NTN 290101 | 10.0    | 49,900    | 43,199          | 1,136,150 |  |
|      |      | BRAZIL-LTN 260101         | —       | 37,900    | 33,243          | 874,299   |  |
|      |      | BRAZIL-LTN 260701         | —       | 72,400    | 59,082          | 1,553,866 |  |
|      |      | BRAZIL-LTN 270701         | —       | 34,300    | 24,321          | 639,642   |  |
|      |      | BRAZIL-LTN 280101         | —       | 13,300    | 8,787           | 231,098   |  |
|      |      | BRAZIL-LTN 280701         | —       | 3,000     | 1,851           | 48,685    |  |
|      |      | BRAZIL-LTN 300101         | —       | 15,700    | 7,848           | 206,410   |  |
| 小 計  |      |                           |         |           | 6,898,633       |           |  |
| 小 計  |      |                           | 千チリペソ   | 千チリペソ     |                 |           |  |
| チリ   | 国債証券 | 0 BONOS TESORERIA 270506  | —       | 800,000   | 706,377         | 111,866   |  |
|      |      | 0 BONOS TESORERIA 290401  | —       | 1,650,000 | 1,312,478       | 207,852   |  |
|      |      | 4.5 BONOS TESORER 260301  | 4.5     | 1,120,000 | 1,134,952       | 179,737   |  |
|      |      | 4.7 BONOS TESORER 300901  | 4.7     | 1,570,000 | 1,511,203       | 239,323   |  |
|      |      | 5 BONOS TESORERIA 281001  | 5.0     | 640,000   | 634,467         | 100,478   |  |
|      |      | 5 BONOS TESORERIA 350301  | 5.0     | 1,740,000 | 1,654,949       | 262,087   |  |
|      |      | 5.8 BONOS TESORER 291001  | 5.8     | 600,000   | 608,714         | 96,399    |  |
|      |      | 6 BONOS TESORERIA 330401  | 6.0     | 1,890,000 | 1,922,368       | 304,437   |  |
|      |      | 6 BONOS TESORERIA 430101  | 6.0     | 1,315,000 | 1,353,858       | 214,405   |  |
|      |      | 6.2 BONOS TESORER 401001  | 6.2     | 880,000   | 935,984         | 148,228   |  |
|      |      | 7 BONOS TESORERIA 340501  | 7.0     | 350,000   | 382,567         | 60,585    |  |
| 小 計  |      |                           |         |           | 1,925,401       |           |  |

| 銘<br>柄 |                          | 当<br>期<br>末 |            |             |           | 償還年月日      |  |
|--------|--------------------------|-------------|------------|-------------|-----------|------------|--|
|        |                          | 利<br>率      | 額面金額       | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|        |                          |             |            | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| コロンビア  |                          | %           | 千コロンビアペソ   | 千コロンビアペソ    | 千円        |            |  |
| 国債証券   | 11.5 TITULOS DE T 460725 | 11.5        | 7,700,000  | 7,187,873   | 267,575   | 2046/7/25  |  |
|        | 13.25 TITULOS DE 330209  | 13.25       | 10,100,000 | 11,182,536  | 416,281   | 2033/2/9   |  |
|        | 5.75 TITULOS DE T 271103 | 5.75        | 8,900,000  | 8,111,799   | 301,969   | 2027/11/3  |  |
|        | 6 TITULOS DE TESO 280428 | 6.0         | 14,280,000 | 12,782,290  | 475,833   | 2028/4/28  |  |
|        | 6.25 TITULOS DE T 251126 | 6.25        | 1,990,000  | 1,953,139   | 72,707    | 2025/11/26 |  |
|        | 6.25 TITULOS DE T 360709 | 6.25        | 8,900,000  | 5,978,675   | 222,562   | 2036/7/9   |  |
|        | 7 TITULOS DE TESO 310326 | 7.0         | 12,080,000 | 10,120,412  | 376,742   | 2031/3/26  |  |
|        | 7 TITULOS DE TESO 320630 | 7.0         | 11,700,000 | 9,419,143   | 350,637   | 2032/6/30  |  |
|        | 7.25 TITULOS DE T 341018 | 7.25        | 11,000,000 | 8,458,053   | 314,859   | 2034/10/18 |  |
|        | 7.25 TITULOS DE T 501026 | 7.25        | 16,300,000 | 10,095,585  | 375,818   | 2050/10/26 |  |
|        | 7.5 TITULOS DE TE 260826 | 7.5         | 12,520,000 | 12,268,579  | 456,710   | 2026/8/26  |  |
|        | 7.75 TITULOS DE T 300918 | 7.75        | 8,440,000  | 7,484,470   | 278,616   | 2030/9/18  |  |
|        | 9.25 TITULOS DE T 420528 | 9.25        | 20,100,000 | 16,181,178  | 602,360   | 2042/5/28  |  |
| 小      | 計                        |             |            |             | 4,512,674 |            |  |
| ペルー    |                          |             | 千ペルーヌエボソル  | 千ペルーヌエボソル   |           |            |  |
| 国債証券   | 5.35 PERU 400812         | 5.35        | 4,350      | 3,578       | 149,573   | 2040/8/12  |  |
|        | 5.4 PERU 340812          | 5.4         | 6,300      | 5,712       | 238,815   | 2034/8/12  |  |
|        | 5.94 PERU 290212         | 5.94        | 6,600      | 6,907       | 288,762   | 2029/2/12  |  |
|        | 6.15 PERU 320812         | 6.15        | 7,400      | 7,413       | 309,889   | 2032/8/12  |  |
|        | 6.35 PERU 280812         | 6.35        | 900        | 954         | 39,907    | 2028/8/12  |  |
|        | 6.9 PERU 370812          | 6.9         | 7,600      | 7,496       | 313,379   | 2037/8/12  |  |
|        | 6.95 PERU 310812         | 6.95        | 8,200      | 8,761       | 366,280   | 2031/8/12  |  |
|        | 7.3 PERU 330812          | 7.3         | 6,400      | 6,726       | 281,210   | 2033/8/12  |  |
|        | 7.6 PERU 390812          | 7.6         | 5,800      | 5,974       | 249,771   | 2039/8/12  |  |
|        | 8.2 PERU 260812          | 8.2         | 1,400      | 1,484       | 62,048    | 2026/8/12  |  |
| 小      | 計                        |             |            |             | 2,299,638 |            |  |
| ウルグアイ  |                          |             | 千ウルグアイペソ   | 千ウルグアイペソ    |           |            |  |
| 国債証券   | 8.25 URUGUAY 310521      | 8.25        | 17,000     | 15,861      | 56,760    | 2031/5/21  |  |
|        | 8.5 URUGUAY(GL) 280315   | 8.5         | 7,000      | 6,861       | 24,554    | 2028/3/15  |  |
|        | 9.75 URUGUAY 330720      | 9.75        | 23,000     | 23,046      | 82,472    | 2033/7/20  |  |
| 小      | 計                        |             |            |             | 163,787   |            |  |
| ドミニカ   |                          |             | 千ドミニカペソ    | 千ドミニカペソ     |           |            |  |
| 国債証券   | 10.75 DOMINICAN 360601   | 10.75       | 47,000     | 49,585      | 125,197   | 2036/6/1   |  |
|        | 11.25 DOMINICAN 350915   | 11.25       | 32,000     | 34,638      | 87,459    | 2035/9/15  |  |
|        | 13.625 DOMINICAN 330203  | 13.625      | 16,000     | 19,264      | 48,640    | 2033/2/3   |  |
| 小      | 計                        |             |            |             | 261,296   |            |  |
| セルビア   |                          |             | 千セルビアディナール | 千セルビアディナール  |           |            |  |
| 国債証券   | 4.5 SERBIA TREASU 260111 | 4.5         | 61,000     | 61,091      | 85,131    | 2026/1/11  |  |
|        | 4.5 SERBIA TREASU 320820 | 4.5         | 74,000     | 72,224      | 100,645   | 2032/8/20  |  |
|        | 5.875 SERBIA TREA 280208 | 5.875       | 50,000     | 51,937      | 72,375    | 2028/2/8   |  |
|        | 7 SERBIA TREASURY 311026 | 7.0         | 60,000     | 67,950      | 94,689    | 2031/10/26 |  |
| 小      | 計                        |             |            |             | 352,841   |            |  |
| トルコ    |                          |             | 千トルコリラ     | 千トルコリラ      |           |            |  |
| 国債証券   | 10.5 TURKEY GOVT 270811  | 10.5        | 23,900     | 15,884      | 69,353    | 2027/8/11  |  |
|        | 10.6 TURKEY GOVT 260211  | 10.6        | 9,600      | 7,674       | 33,508    | 2026/2/11  |  |

| 銘<br>柄 |                          | 当<br>期<br>末 |            |             |           | 償還年月日      |  |
|--------|--------------------------|-------------|------------|-------------|-----------|------------|--|
|        |                          | 利<br>率      | 額面金額       | 評<br>価<br>額 |           |            |  |
|        |                          |             |            | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |            |  |
| トルコ    |                          | %           | 千トルコリラ     | 千トルコリラ      | 千円        |            |  |
| 国債証券   | 11 TURKEY GOVT 270224    | 11.0        | 4,500      | 3,164       | 13,815    | 2027/2/24  |  |
|        | 11.7 TURKEY GOVT 301113  | 11.7        | 14,100     | 8,566       | 37,402    | 2030/11/13 |  |
|        | 12.4 TURKEY GOVT 280308  | 12.4        | 29,100     | 19,936      | 87,045    | 2028/3/8   |  |
|        | 12.6 TURKEY GOVT 251001  | 12.6        | 33,600     | 29,187      | 127,439   | 2025/10/1  |  |
|        | 16.9 TURKEY GOVT 260902  | 16.9        | 23,200     | 18,592      | 81,177    | 2026/9/2   |  |
|        | 17.3 TURKEY GOVT 280719  | 17.3        | 58,000     | 45,055      | 196,721   | 2028/7/19  |  |
|        | 17.8 TURKEY GOVT 330713  | 17.8        | 28,000     | 21,217      | 92,637    | 2033/7/13  |  |
|        | 26.2 TURKEY GOVT 331005  | 26.2        | 103,500    | 107,269     | 468,359   | 2033/10/5  |  |
|        | 31.08 TURKEY GOVT 281108 | 31.08       | 77,000     | 82,122      | 358,561   | 2028/11/8  |  |
| 小<br>計 |                          |             |            |             | 1,566,020 |            |  |
| チェコ    |                          |             | 千チェコクロナ    | 千チェコクロナ     |           |            |  |
| 国債証券   | 0.05 CZECH REPUBL 291129 | 0.05        | 102,000    | 85,775      | 557,096   | 2029/11/29 |  |
|        | 0.25 CZECH REPUBL 270210 | 0.25        | 67,500     | 63,206      | 410,514   | 2027/2/10  |  |
|        | 1.5 CZECH REPUBLI 400424 | 1.5         | 33,100     | 22,827      | 148,259   | 2040/4/24  |  |
|        | 1.75 CZECH REPUBL 320623 | 1.75        | 63,200     | 54,562      | 354,371   | 2032/6/23  |  |
|        | 1.95 CZECH REPUBL 370730 | 1.95        | 37,300     | 28,969      | 188,153   | 2037/7/30  |  |
|        | 3 CZECH REPUBLIC 330303  | 3.0         | 67,000     | 62,369      | 405,075   | 2033/3/3   |  |
|        | 3.5 CZECH REPUBLI 350530 | 3.5         | 66,500     | 63,130      | 410,017   | 2035/5/30  |  |
|        | 3.6 CZECH REPUBLI 360603 | 3.6         | 13,000     | 12,346      | 80,188    | 2036/6/3   |  |
|        | 4.5 CZECH REPUBLI 321111 | 4.5         | 42,000     | 43,409      | 281,936   | 2032/11/11 |  |
|        | 4.9 CZECH REPUBLI 340414 | 4.9         | 56,000     | 59,362      | 385,544   | 2034/4/14  |  |
|        | 5 CZECH REPUBLIC 300930  | 5.0         | 140,700    | 149,484     | 970,871   | 2030/9/30  |  |
|        | 5.5 CZECH REPUBLI 281212 | 5.5         | 52,000     | 55,658      | 361,490   | 2028/12/12 |  |
|        | 5.75 CZECH REPUBL 290329 | 5.75        | 76,000     | 82,158      | 533,603   | 2029/3/29  |  |
|        | 6 CZECH REPUBLIC 260226  | 6.0         | 92,500     | 95,128      | 617,838   | 2026/2/26  |  |
|        | 6.2 CZECH REPUBLI 310616 | 6.2         | 25,500     | 28,912      | 187,782   | 2031/6/16  |  |
| 小<br>計 |                          |             |            |             | 5,892,743 |            |  |
| ハンガリー  |                          |             | 千ハンガリーフォント | 千ハンガリーフォント  |           |            |  |
| 国債証券   | 1 HUNGARY 251126         | 1.0         | 267,000    | 256,852     | 102,589   | 2025/11/26 |  |
|        | 1.5 HUNGARY 260422       | 1.5         | 460,000    | 436,769     | 174,450   | 2026/4/22  |  |
|        | 1.5 HUNGARY 260826       | 1.5         | 270,000    | 252,737     | 100,946   | 2026/8/26  |  |
|        | 2 HUNGARY 290523         | 2.0         | 630,000    | 532,661     | 212,751   | 2029/5/23  |  |
|        | 2.25 HUNGARY 330420      | 2.25        | 595,000    | 433,850     | 173,285   | 2033/4/20  |  |
|        | 2.25 HUNGARY 340622      | 2.25        | 200,000    | 140,481     | 56,109    | 2034/6/22  |  |
|        | 2.75 HUNGARY 261222      | 2.75        | 373,000    | 351,405     | 140,355   | 2026/12/22 |  |
|        | 3 HUNGARY 271027         | 3.0         | 541,000    | 499,025     | 199,316   | 2027/10/27 |  |
|        | 3 HUNGARY 300821         | 3.0         | 518,000    | 439,663     | 175,606   | 2030/8/21  |  |
|        | 3 HUNGARY 381027         | 3.0         | 447,000    | 298,359     | 119,168   | 2038/10/27 |  |
|        | 3 HUNGARY 410425         | 3.0         | 235,000    | 147,356     | 58,856    | 2041/4/25  |  |
|        | 3.25 HUNGARY 311022      | 3.25        | 708,000    | 589,785     | 235,567   | 2031/10/22 |  |
|        | 4.5 HUNGARY 280323       | 4.5         | 260,000    | 246,887     | 98,609    | 2028/3/23  |  |
|        | 4.75 HUNGARY 321124      | 4.75        | 540,000    | 480,443     | 191,895   | 2032/11/24 |  |
|        | 6.75 HUNGARY 281022      | 6.75        | 782,000    | 791,101     | 315,975   | 2028/10/22 |  |
|        | 7 HUNGARY 351024         | 7.0         | 265,000    | 270,064     | 107,866   | 2035/10/24 |  |

| 銘<br>柄 |      | 当<br>期<br>末  |   |  |  | 償還年月日  |  |
|--------|------|--|---|--|--|--|--|
|        |      | 利<br>率   | 額面金額  | 評<br>価<br>額  |  |  |  |
|        |      |  |   | 外貨建金額  | 邦貨換算金額   |  |  |
| ハンガリー  |      | %  | 千ハンガリーフォント  | 千ハンガリーフォント   | 千円   |  |  |
|        | 国債証券 | 9.5 HUNGARY 261021   | 9.5   | 440,000  | 463,754  | 185,228  |  |
| 小      | 計    |  |   |  | 2,648,580  | 2026/10/21   |  |
| ポーランド  |      |  | 千ポーランドズロチ   | 千ポーランドズロチ  |  |  |  |
|        | 国債証券 | 0 POLAND 251025<br>0.25 POLAND 261025<br>1.25 POLAND 301025<br>1.75 POLAND 320425<br>2.5 POLAND 260725<br>2.5 POLAND 270725<br>2.75 POLAND 280425<br>2.75 POLAND 291025<br>3.75 POLAND 270525<br>4.75 POLAND 290725<br>5 POLAND 300125<br>5 POLAND 341025<br>6 POLAND 331025<br>7.5 POLAND 280725  | —<br>0.25<br>1.25<br>1.75<br>2.5<br>2.5<br>2.75<br>2.75<br>3.75<br>4.75<br>5.0<br>5.0<br>6.0<br>7.5   | 2,700<br>13,100<br>19,700<br>20,400<br>18,000<br>16,600<br>15,950<br>20,800<br>13,900<br>18,800<br>8,000<br>10,400<br>19,700<br>18,500   | 2,602<br>12,046<br>15,530<br>15,601<br>17,323<br>15,554<br>14,754<br>18,425<br>13,464<br>18,178<br>7,771<br>9,676<br>19,804<br>19,690  | 100,678<br>465,938<br>600,709<br>603,468<br>670,052<br>601,631<br>570,684<br>712,685<br>520,783<br>703,127<br>300,587<br>374,279<br>766,005<br>761,599   | 2025/10/25<br>2026/10/25<br>2030/10/25<br>2032/4/25<br>2026/7/25<br>2027/7/25<br>2028/4/25<br>2029/10/25<br>2027/5/25<br>2029/7/25<br>2030/1/25<br>2034/10/25<br>2033/10/25<br>2028/7/25   |
| 小      | 計    |  |   |  | 7,752,232  |  |  |
| ルーマニア  |      |  | 千ルーマニアレイ  | 千ルーマニアレイ   |  |  |  |
|        | 国債証券 | 2.5 ROMANIA GOVER 271025<br>3.25 ROMANIA GOVE 260624<br>3.65 ROMANIA GOVE 310924<br>4.15 ROMANIA GOVE 280126<br>4.15 ROMANIA GOVE 301024<br>4.25 ROMANIA GOVE 360428<br>4.75 ROMANIA GOVE 341011<br>4.85 ROMANIA GOVE 260422<br>4.85 ROMANIA GOVE 290725<br>5 ROMANIA GOVERN 290212<br>5.8 ROMANIA GOV 270726<br>6.3 ROMANIA GOVER 290425<br>6.7 ROMANIA GOVER 320225<br>7.1 ROMANIA GOVER 340731<br>7.2 ROMANIA GOVER 261028<br>7.2 ROMANIA GOVER 270531<br>7.2 ROMANIA GOVER 331030<br>7.35 ROMANIA GOVE 310428<br>7.9 ROMANIA GOVER 380224<br>8 ROMANIA GOVERN 300429<br>8.25 ROMANIA GOVE 320929<br>8.75 ROMANIA GOVE 281030 | 2.5<br>3.25<br>3.65<br>4.15<br>4.15<br>4.25<br>4.75<br>4.85<br>4.85<br>5.0<br>5.8<br>6.3<br>6.7<br>7.1<br>7.2<br>7.2<br>7.2<br>7.35<br>7.9<br>8.0<br>8.25<br>8.75 | 4,000<br>6,200<br>5,000<br>5,200<br>5,000<br>4,200<br>5,200<br>4,900<br>6,300<br>5,560<br>5,800<br>3,400<br>5,900<br>3,900<br>6,400<br>5,500<br>6,100<br>5,900<br>6,300<br>5,900<br>6,100<br>5,500 | 3,523<br>5,885<br>3,982<br>4,773<br>4,188<br>3,106<br>4,119<br>4,771<br>5,635<br>5,084<br>5,615<br>3,237<br>5,550<br>3,695<br>6,390<br>5,472<br>5,837<br>5,783<br>6,369<br>5,960<br>6,232<br>5,682 | 115,435<br>192,797<br>130,439<br>156,370<br>137,191<br>101,749<br>134,935<br>156,312<br>184,599<br>166,540<br>183,941<br>106,035<br>181,826<br>121,043<br>209,339<br>179,276<br>191,235<br>189,455<br>208,661<br>195,264<br>204,166<br>186,147 | 2027/10/25<br>2026/6/24<br>2031/9/24<br>2028/1/26<br>2030/10/24<br>2036/4/28<br>2034/10/11<br>2026/4/22<br>2029/7/25<br>2029/2/12<br>2027/7/26<br>2029/4/25<br>2032/2/25<br>2034/7/31<br>2026/10/28<br>2027/5/31<br>2033/10/30<br>2031/4/28<br>2038/2/24<br>2030/4/29<br>2032/9/29<br>2028/10/30 |
| 小      | 計    |  |   |  | 3,632,766  |  |  |
| 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  |  |  |  |
|        | 国債証券 | 2.632 MALAYSIAGOV 310415<br>3.502MALAYSIAGOVT 270531   | 2.632<br>3.502  | 28,200<br>13,000   | 26,468<br>13,022   | 938,298<br>461,654   | 2031/4/15<br>2027/5/31   |

| 銘<br>柄 |                          | 当<br>期<br>末            |             |             |            |
|--------|--------------------------|------------------------|-------------|-------------|------------|
|        |                          | 利<br>率                 | 額面金額        | 評<br>価<br>額 |            |
|        |                          |                        |             | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |
| 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         |
| 国債証券   | 3.519 MALAYSIAGOV 280420 | 3.519                  | 6,500       | 6,500       | 230,457    |
|        | 3.582 MALAYSIAGOV 320715 | 3.582                  | 15,300      | 15,106      | 535,537    |
|        | 3.733 MALAYSIAGO 280615  | 3.733                  | 8,450       | 8,504       | 301,486    |
|        | 3.757 MALAYSIAGOV 400522 | 3.757                  | 20,800      | 20,245      | 717,722    |
|        | 3.828 MALAYSIAGOV 340705 | 3.828                  | 10,270      | 10,282      | 364,510    |
|        | 3.885 MALAYSIAGOV 290815 | 3.885                  | 20,200      | 20,432      | 724,352    |
|        | 3.899 MALAYSIAGO 271116  | 3.899                  | 13,200      | 13,353      | 473,369    |
|        | 3.9 MALAYSIAGOVT 261130  | 3.9                    | 12,620      | 12,749      | 451,976    |
|        | 3.906 MALAYSIAGOV 260715 | 3.906                  | 23,000      | 23,193      | 822,225    |
|        | 3.955 MALAYSIAGOV 250915 | 3.955                  | 13,300      | 13,362      | 473,700    |
|        | 4.054 MALAYSIAGO 390418  | 4.054                  | 5,500       | 5,548       | 196,679    |
|        | 4.065 MALAYSIAGOV 500615 | 4.065                  | 9,250       | 9,136       | 323,900    |
|        | 4.18 MALAYSIAGOVT 440516 | 4.18                   | 2,500       | 2,542       | 90,124     |
|        | 4.254 MALAYSIAGOV 350531 | 4.254                  | 12,150      | 12,559      | 445,228    |
|        | 4.369 MALAYSIA IN 281031 | 4.369                  | 14,500      | 14,902      | 528,296    |
|        | 4.457 MALAYSIAGOV 530331 | 4.457                  | 6,600       | 6,909       | 244,928    |
|        | 4.504 MALAYSIAGOV 290430 | 4.504                  | 7,100       | 7,355       | 260,766    |
|        | 4.642 MALAYSIAGOV 331107 | 4.642                  | 9,800       | 10,392      | 368,424    |
|        | 4.696 MALAYSIAGOV 421015 | 4.696                  | 18,840      | 20,400      | 723,205    |
|        | 4.762 MALAYSIAGOV 370407 | 4.762                  | 14,400      | 15,540      | 550,897    |
|        | 4.893 MALAYSIAGOV 380608 | 4.893                  | 11,300      | 12,386      | 439,088    |
|        | 4.921 MALAYSIAGOV 480706 | 4.921                  | 5,600       | 6,268       | 222,232    |
| 小<br>計 |                          |                        |             |             | 10,889,062 |
| タイ     | 国債証券                     |                        | 千タイバーツ      | 千タイバーツ      |            |
|        |                          | 1 THAILAND 270617      | 1.0         | 129,200     | 582,265    |
|        |                          | 1. 585 THAILAND 351217 | 1.585       | 82,900      | 355,361    |
|        |                          | 1. 6 THAILAND 291217   | 1.6         | 80,700      | 363,635    |
|        |                          | 1. 6 THAILAND 350617   | 1.6         | 44,200      | 188,802    |
|        |                          | 2 THAILAND 311217      | 2.0         | 126,000     | 574,822    |
|        |                          | 2 THAILAND 420617      | 2.0         | 59,500      | 250,105    |
|        |                          | 2. 125 THAILAND 261217 | 2.125       | 82,800      | 382,965    |
|        |                          | 2. 25 THAILAND 270317  | 2.25        | 99,900      | 463,354    |
|        |                          | 2. 35 THAILAND 260617  | 2.35        | 95,700      | 443,883    |
|        |                          | 2. 4 THAILAND 271117   | 2.4         | 110,200     | 513,920    |
|        |                          | 2. 4 THAILAND 290317   | 2.4         | 95,000      | 444,257    |
|        |                          | 2. 5 THAILAND 291117   | 2.5         | 57,000      | 268,109    |
|        |                          | 2. 65 THAILAND 280617  | 2.65        | 105,600     | 497,261    |
|        |                          | 2. 8 THAILAND 340617   | 2.8         | 92,500      | 445,302    |
|        |                          | 2. 875 THAILAND 281217 | 2.875       | 84,900      | 404,002    |
|        |                          | 2. 875 THAILAND 460617 | 2.875       | 69,400      | 324,495    |
|        |                          | 3. 3 THAILAND 380617   | 3.3         | 102,400     | 515,550    |
|        |                          | 3. 35 THAILAND 330617  | 3.35        | 99,800      | 497,812    |
|        |                          | 3. 39 THAILAND 370617  | 3.39        | 103,900     | 529,743    |
|        |                          | 3. 4 THAILAND 360617   | 3.4         | 67,400      | 342,029    |
|        |                          | 3. 45 THAILAND 430617  | 3.45        | 115,300     | 590,702    |

| 銘<br>柄 |      | 当<br>期<br>末            |            |             |            | 償還年月日   |  |
|--------|------|------------------------|------------|-------------|------------|---------|--|
|        |      | 利<br>率                 | 額面金額       | 評<br>価<br>額 |            |         |  |
|        |      |                        |            | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |         |  |
| タイ     |      | %                      | 千タイバーツ     | 千タイバーツ      | 千円         |         |  |
|        | 国債証券 | 3.65 THAILAND 310620   | 3.65       | 78,100      | 84,863     | 392,071 |  |
|        |      | 3.775 THAILAND 320625  | 3.775      | 97,200      | 107,100    | 494,802 |  |
|        |      | 3.85 THAILAND 251212   | 3.85       | 43,700      | 44,459     | 205,404 |  |
|        |      | 4.875 THAILAND 290622  | 4.875      | 91,300      | 101,730    | 469,994 |  |
| 小      | 計    |                        |            |             | 10,540,657 |         |  |
| インドネシア |      |                        | 千インドネシアルピア | 千インドネシアルピア  |            |         |  |
|        | 国債証券 | 10.5 INDONESIA 300815  | 10.5       | 9,050,000   | 10,523,973 | 102,082 |  |
|        |      | 11 INDONESIA 250915    | 11.0       | 6,250,000   | 6,418,375  | 62,258  |  |
|        |      | 5.125 INDONESIA 270415 | 5.125      | 35,300,000  | 34,093,093 | 330,703 |  |
|        |      | 5.5 INDONESIA 260415   | 5.5        | 44,200,000  | 43,525,950 | 422,201 |  |
|        |      | 6.125 INDONESIA 280515 | 6.125      | 31,000,000  | 30,361,090 | 294,502 |  |
|        |      | 6.25 INDONESIA 360615  | 6.25       | 15,000,000  | 14,065,800 | 136,438 |  |
|        |      | 6.375 INDONESIA 280815 | 6.375      | 33,000,000  | 32,526,120 | 315,503 |  |
|        |      | 6.375 INDONESIA 320415 | 6.375      | 56,700,000  | 54,676,377 | 530,360 |  |
|        |      | 6.375 INDONESIA 370715 | 6.375      | 8,000,000   | 7,585,560  | 73,579  |  |
|        |      | 6.5 INDONESIA 300715   | 6.5        | 12,000,000  | 11,834,460 | 114,794 |  |
|        |      | 6.5 INDONESIA 310215   | 6.5        | 51,100,000  | 50,001,350 | 485,013 |  |
|        |      | 6.625 INDONESIA 330515 | 6.625      | 28,400,000  | 27,624,396 | 267,956 |  |
|        |      | 6.625 INDONESIA 340215 | 6.625      | 45,700,000  | 44,341,339 | 430,110 |  |
|        |      | 6.75 INDONESIA 350715  | 6.75       | 20,200,000  | 19,849,934 | 192,544 |  |
|        |      | 6.875 INDONESIA 290415 | 6.875      | 49,100,000  | 49,277,496 | 477,991 |  |
|        |      | 7 INDONESIA 270515     | 7.0        | 33,950,000  | 34,085,800 | 330,632 |  |
|        |      | 7 INDONESIA 300915     | 7.0        | 54,200,000  | 54,381,028 | 527,495 |  |
|        |      | 7 INDONESIA 330215     | 7.0        | 44,100,000  | 44,026,353 | 427,055 |  |
|        |      | 7.125 INDONESIA 380615 | 7.125      | 33,900,000  | 33,792,876 | 327,790 |  |
|        |      | 7.125 INDONESIA 420615 | 7.125      | 32,600,000  | 32,567,400 | 315,903 |  |
|        |      | 7.125 INDONESIA 430615 | 7.125      | 31,800,000  | 31,576,446 | 306,291 |  |
|        |      | 7.5 INDONESIA 320815   | 7.5        | 15,400,000  | 15,820,112 | 153,455 |  |
|        |      | 7.5 INDONESIA 350615   | 7.5        | 42,800,000  | 43,971,864 | 426,527 |  |
|        |      | 7.5 INDONESIA 380515   | 7.5        | 23,200,000  | 23,864,680 | 231,487 |  |
|        |      | 7.5 INDONESIA 400415   | 7.5        | 38,400,000  | 39,308,928 | 381,296 |  |
|        |      | 8.25 INDONESIA 290515  | 8.25       | 47,700,000  | 50,053,041 | 485,514 |  |
|        |      | 8.25 INDONESIA 320615  | 8.25       | 18,000,000  | 19,258,920 | 186,811 |  |
|        |      | 8.25 INDONESIA 360515  | 8.25       | 30,100,000  | 32,605,524 | 316,273 |  |
|        |      | 8.375 INDONESIA 260915 | 8.375      | 45,930,000  | 47,047,936 | 456,364 |  |
|        |      | 8.375 INDONESIA 340315 | 8.375      | 61,200,000  | 66,261,852 | 642,739 |  |
|        |      | 8.375 INDONESIA 390415 | 8.375      | 20,200,000  | 22,176,166 | 215,108 |  |
|        |      | 8.75 INDONESIA 310515  | 8.75       | 27,400,000  | 29,864,082 | 289,681 |  |
|        |      | 9 INDONESIA 290315     | 9.0        | 24,600,000  | 26,472,060 | 256,778 |  |
|        |      | 9.5 INDONESIA 310715   | 9.5        | 16,000,000  | 18,080,800 | 175,383 |  |
| 小      | 計    |                        |            |             | 10,688,635 |         |  |
| インド    |      |                        | 千インドルピー    | 千インドルピー     |            |         |  |
|        | 国債証券 | 5.77 INDIA GOVT 300803 | 5.77       | 150,000     | 143,971    | 260,589 |  |
|        |      | 5.79 INDIA GOVT 300511 | 5.79       | 100,000     | 96,227     | 174,171 |  |
|        |      | 5.85 INDIA GOVT 301201 | 5.85       | 150,000     | 144,190    | 260,984 |  |

| 銘<br>柄 |                        | 当<br>期<br>末 |         |             |           |
|--------|------------------------|-------------|---------|-------------|-----------|
|        |                        | 利<br>率      | 額面金額    | 評<br>価<br>額 |           |
|        |                        |             |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |
| インド    |                        | %           | 千インドルピー | 千インドルピー     | 千円        |
| 国債証券   | 6.1 INDIA GOVT 310712  | 6.1         | 50,000  | 48,489      | 87,766    |
|        | 6.45 INDIA GOVT 291007 | 6.45        | 100,000 | 99,350      | 179,823   |
|        | 6.54 INDIA GOVT 320117 | 6.54        | 150,000 | 148,687     | 269,124   |
|        | 6.67 INDIA GOVT 501217 | 6.67        | 100,000 | 96,575      | 174,800   |
|        | 6.79 INDIA GOVT 341007 | 6.79        | 100,000 | 100,858     | 182,553   |
|        | 6.99 INDIA GOVT 511215 | 6.99        | 100,000 | 100,479     | 181,867   |
|        | 7.02 INDIA GOVT 310618 | 7.02        | 50,000  | 50,790      | 91,930    |
|        | 7.04 INDIA GOVT 290603 | 7.04        | 150,000 | 152,069     | 275,246   |
|        | 7.1 INDIA GOVT 290418  | 7.1         | 250,000 | 253,904     | 459,566   |
|        | 7.1 INDIA GOVT 340408  | 7.1         | 200,000 | 204,520     | 370,181   |
|        | 7.16 INDIA GOVT 500920 | 7.16        | 100,000 | 102,330     | 185,217   |
|        | 7.17 INDIA GOVT 300417 | 7.17        | 150,000 | 153,106     | 277,123   |
|        | 7.18 INDIA GOVT 330814 | 7.18        | 200,000 | 205,187     | 371,389   |
|        | 7.18 INDIA GOVT 370724 | 7.18        | 200,000 | 206,524     | 373,809   |
|        | 7.26 INDIA GOVT 290114 | 7.26        | 100,000 | 102,238     | 185,052   |
|        | 7.26 INDIA GOVT 320822 | 7.26        | 150,000 | 154,822     | 280,228   |
|        | 7.26 INDIA GOVT 330206 | 7.26        | 200,000 | 206,550     | 373,855   |
|        | 7.3 INDIA GOVT 530619  | 7.3         | 250,000 | 260,217     | 470,993   |
|        | 7.32 INDIA GOVT 301113 | 7.32        | 150,000 | 154,838     | 280,256   |
|        | 7.36 INDIA GOVT 520912 | 7.36        | 200,000 | 208,883     | 378,078   |
|        | 7.37 INDIA GOVT 281023 | 7.37        | 150,000 | 153,580     | 277,980   |
|        | 7.41 INDIA GOVT 361219 | 7.41        | 200,000 | 209,313     | 378,857   |
|        | 7.54 INDIA GOVT 360523 | 7.54        | 150,000 | 158,143     | 286,239   |
|        | 7.72 INDIA GOVT 490615 | 7.72        | 150,000 | 164,219     | 297,236   |
| 小<br>計 |                        |             |         |             | 7,384,923 |
| 中国     |                        |             | 千中国元    | 千中国元        |           |
| 国債証券   | 1.62 CHINA GOVT 270815 | 1.62        | 3,000   | 3,022       | 64,895    |
|        | 1.74 CHINA GOVT 291015 | 1.74        | 2,000   | 2,026       | 43,504    |
|        | 1.85 CHINA GOVT 270515 | 1.85        | 4,000   | 4,050       | 86,957    |
|        | 1.87 CHINA GOVT 310915 | 1.87        | 5,000   | 5,096       | 109,434   |
|        | 1.91 CHINA GOVT 290715 | 1.91        | 7,000   | 7,145       | 153,427   |
|        | 2.04 CHINA GOVT 270225 | 2.04        | 6,000   | 6,091       | 130,792   |
|        | 2.05 CHINA GOVT 290415 | 2.05        | 6,000   | 6,153       | 132,112   |
|        | 2.11 CHINA GOVT 340825 | 2.11        | 5,000   | 5,201       | 111,691   |
|        | 2.12 CHINA GOVT 310625 | 2.12        | 8,000   | 8,269       | 177,547   |
|        | 2.17 CHINA GOVT 340829 | 2.17        | 7,000   | 7,276       | 156,234   |
|        | 2.18 CHINA GOVT 260815 | 2.18        | 8,000   | 8,111       | 174,158   |
|        | 2.19 CHINA GOVT 540925 | 2.19        | 2,000   | 2,146       | 46,088    |
|        | 2.25 CHINA GOVT 390829 | 2.25        | 3,000   | 3,133       | 67,272    |
|        | 2.27 CHINA GOVT 340525 | 2.27        | 10,000  | 10,539      | 226,300   |
|        | 2.28 CHINA GOVT 251125 | 2.28        | 6,000   | 6,051       | 129,940   |
|        | 2.28 CHINA GOVT 310325 | 2.28        | 9,000   | 9,376       | 201,320   |
|        | 2.3 CHINA GOVT 260515  | 2.3         | 5,000   | 5,065       | 108,768   |
|        | 2.33 CHINA GOVT 440815 | 2.33        | 2,000   | 2,119       | 45,510    |
|        | 2.35 CHINA GOVT 340225 | 2.35        | 11,000  | 11,609      | 249,265   |

| 銘<br>柄 |                        | 当<br>期<br>末 |        |             |         |
|--------|------------------------|-------------|--------|-------------|---------|
|        |                        | 利<br>率      | 額面金額   | 評<br>価<br>額 |         |
|        |                        |             |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額  |
| 中国     |                        | %           | 千中国元   | 千中国元        | 千円      |
| 国債証券   | 2.37 CHINA GOVT 270120 | 2.37        | 9,000  | 9,188       | 197,283 |
|        | 2.37 CHINA GOVT 290115 | 2.37        | 3,000  | 3,108       | 66,742  |
|        | 2.39 CHINA GOVT 261115 | 2.39        | 8,000  | 8,157       | 175,144 |
|        | 2.4 CHINA GOVT 280715  | 2.4         | 5,000  | 5,164       | 110,881 |
|        | 2.44 CHINA GOVT 271015 | 2.44        | 5,000  | 5,142       | 110,409 |
|        | 2.46 CHINA GOVT 260215 | 2.46        | 8,000  | 8,094       | 173,805 |
|        | 2.47 CHINA GOVT 540725 | 2.47        | 5,000  | 5,577       | 119,761 |
|        | 2.48 CHINA GOVT 270415 | 2.48        | 5,000  | 5,127       | 110,097 |
|        | 2.48 CHINA GOVT 280925 | 2.48        | 3,000  | 3,110       | 66,793  |
|        | 2.49 CHINA GOVT 440525 | 2.49        | 5,000  | 5,425       | 116,484 |
|        | 2.5 CHINA GOVT 270725  | 2.5         | 7,000  | 7,186       | 154,309 |
|        | 2.52 CHINA GOVT 330825 | 2.52        | 10,000 | 10,671      | 229,124 |
|        | 2.54 CHINA GOVT 301225 | 2.54        | 7,000  | 7,383       | 158,524 |
|        | 2.55 CHINA GOVT 281015 | 2.55        | 9,000  | 9,357       | 200,921 |
|        | 2.57 CHINA GOVT 540520 | 2.57        | 6,000  | 6,830       | 146,663 |
|        | 2.6 CHINA GOVT 300915  | 2.6         | 7,000  | 7,391       | 158,708 |
|        | 2.6 CHINA GOVT 320901  | 2.6         | 5,000  | 5,341       | 114,680 |
|        | 2.62 CHINA GOVT 280415 | 2.62        | 7,000  | 7,266       | 156,027 |
|        | 2.62 CHINA GOVT 290925 | 2.62        | 6,000  | 6,312       | 135,539 |
|        | 2.62 CHINA GOVT 300625 | 2.62        | 5,000  | 5,279       | 113,346 |
|        | 2.64 CHINA GOVT 280115 | 2.64        | 7,000  | 7,263       | 155,944 |
|        | 2.67 CHINA GOVT 330525 | 2.67        | 7,000  | 7,537       | 161,827 |
|        | 2.67 CHINA GOVT 331125 | 2.67        | 10,000 | 10,802      | 231,935 |
|        | 2.68 CHINA GOVT 300521 | 2.68        | 13,000 | 13,793      | 296,150 |
|        | 2.69 CHINA GOVT 260812 | 2.69        | 10,000 | 10,226      | 219,568 |
|        | 2.69 CHINA GOVT 320815 | 2.69        | 6,000  | 6,455       | 138,610 |
|        | 2.75 CHINA GOVT 290615 | 2.75        | 6,000  | 6,328       | 135,869 |
|        | 2.75 CHINA GOVT 320217 | 2.75        | 5,000  | 5,387       | 115,682 |
|        | 2.76 CHINA GOVT 320515 | 2.76        | 5,000  | 5,397       | 115,882 |
|        | 2.79 CHINA GOVT 291215 | 2.79        | 4,000  | 4,246       | 91,187  |
|        | 2.8 CHINA GOVT 290324  | 2.8         | 8,000  | 8,437       | 181,152 |
|        | 2.8 CHINA GOVT 300325  | 2.8         | 4,000  | 4,257       | 91,413  |
|        | 2.8 CHINA GOVT 321115  | 2.8         | 5,000  | 5,424       | 116,465 |
|        | 2.85 CHINA GOVT 270604 | 2.85        | 12,000 | 12,444      | 267,193 |
|        | 2.88 CHINA GOVT 330225 | 2.88        | 5,000  | 5,469       | 117,431 |
|        | 2.89 CHINA GOVT 311118 | 2.89        | 5,000  | 5,426       | 116,504 |
|        | 2.91 CHINA GOVT 281014 | 2.91        | 6,000  | 6,326       | 135,842 |
|        | 3 CHINA GOVT 531015    | 3.0         | 5,000  | 6,170       | 132,494 |
|        | 3.01 CHINA GOVT 280513 | 3.01        | 9,000  | 9,484       | 203,637 |
|        | 3.02 CHINA GOVT 310527 | 3.02        | 7,000  | 7,623       | 163,676 |
|        | 3.03 CHINA GOVT 260311 | 3.03        | 9,000  | 9,192       | 197,376 |
|        | 3.12 CHINA GOVT 261205 | 3.12        | 7,000  | 7,252       | 155,724 |
|        | 3.12 CHINA GOVT 521025 | 3.12        | 3,000  | 3,742       | 80,364  |
|        | 3.13 CHINA GOVT 291121 | 3.13        | 8,000  | 8,651       | 185,757 |
|        | 3.19 CHINA GOVT 530415 | 3.19        | 4,000  | 5,065       | 108,756 |

| 銘<br>柄 |                          | 当<br>期<br>末 |           |             |             | 償還年月日      |  |
|--------|--------------------------|-------------|-----------|-------------|-------------|------------|--|
|        |                          | 利<br>率      | 額面金額      | 評<br>価<br>額 |             |            |  |
|        |                          |             |           | 外貨建金額       | 邦貨換算金額      |            |  |
| 中国     |                          | %           | 千中国元      | 千中国元        | 千円          |            |  |
| 国債証券   | 3.22 CHINA GOVT 251206   | 3.22        | 5,000     | 5,092       | 109,345     | 2025/12/ 6 |  |
|        | 3.25 CHINA GOVT 260606   | 3.25        | 12,200    | 12,554      | 269,567     | 2026/ 6/ 6 |  |
|        | 3.25 CHINA GOVT 281122   | 3.25        | 6,000     | 6,445       | 138,388     | 2028/11/22 |  |
|        | 3.27 CHINA GOVT 301119   | 3.27        | 10,000    | 11,026      | 236,751     | 2030/11/19 |  |
|        | 3.28 CHINA GOVT 271203   | 3.28        | 5,000     | 5,288       | 113,548     | 2027/12/ 3 |  |
|        | 3.29 CHINA GOVT 290523   | 3.29        | 11,000    | 11,912      | 255,782     | 2029/ 5/23 |  |
|        | 3.32 CHINA GOVT 520415   | 3.32        | 4,000     | 5,148       | 110,549     | 2052/ 4/15 |  |
|        | 3.53 CHINA GOVT 511018   | 3.53        | 4,000     | 5,299       | 113,784     | 2051/10/18 |  |
|        | 3.72 CHINA GOVT 510412   | 3.72        | 4,000     | 5,446       | 116,932     | 2051/ 4/12 |  |
|        | 3.81 CHINA GOVT 500914   | 3.81        | 7,000     | 9,669       | 207,605     | 2050/ 9/14 |  |
| 小<br>計 |                          |             |           |             | 10,819,183  |            |  |
| 南アフリカ  |                          |             | 千南アフリカランド | 千南アフリカランド   |             |            |  |
| 国債証券   | 10 SOUTH AFRICA 330331   | 10.0        | 12,500    | 12,516      | 105,136     | 2033/ 3/31 |  |
|        | 10.5 SOUTH AFRICA 261221 | 10.5        | 97,600    | 101,379     | 851,586     | 2026/12/21 |  |
|        | 10.875 SOUTH AFRI 380331 | 10.875      | 8,000     | 7,967       | 66,926      | 2038/ 3/31 |  |
|        | 11.625 SOUTH AFRI 530331 | 11.625      | 24,600    | 25,719      | 216,044     | 2053/ 3/31 |  |
|        | 6.25 SOUTH AFRICA 360331 | 6.25        | 41,800    | 30,124      | 253,048     | 2036/ 3/31 |  |
|        | 6.5 SOUTH AFRICA 410228  | 6.5         | 36,300    | 24,147      | 202,837     | 2041/ 2/28 |  |
|        | 7 SOUTH AFRICA 310228    | 7.0         | 92,200    | 82,222      | 690,668     | 2031/ 2/28 |  |
|        | 8 SOUTH AFRICA 300131    | 8.0         | 133,200   | 127,985     | 1,075,076   | 2030/ 1/31 |  |
|        | 8.25 SOUTH AFRICA 320331 | 8.25        | 129,200   | 119,770     | 1,006,069   | 2032/ 3/31 |  |
|        | 8.5 SOUTH AFRICA 370131  | 8.5         | 123,940   | 105,286     | 884,405     | 2037/ 1/31 |  |
|        | 8.75 SOUTH AFRICA 440131 | 8.75        | 103,300   | 83,560      | 701,909     | 2044/ 1/31 |  |
|        | 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 8.75        | 165,500   | 132,813     | 1,115,636   | 2048/ 2/28 |  |
|        | 8.875 SOUTH AFRIC 350228 | 8.875       | 132,500   | 120,601     | 1,013,052   | 2035/ 2/28 |  |
|        | 9 SOUTH AFRICA 400131    | 9.0         | 107,900   | 91,720      | 770,448     | 2040/ 1/31 |  |
| 小<br>計 |                          |             |           |             | 8,952,847   |            |  |
| 合<br>計 |                          |             |           |             | 108,293,509 |            |  |

(注) 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。

## ○投資信託財産の構成

(2025年1月27日現在)

| 項<br>目       | 当<br>期<br>末       |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評<br>価<br>額       | 比<br>率    |
| 公社債          | 千円<br>108,293,509 | %<br>97.0 |
| コール・ローン等、その他 | 3,321,163         | 3.0       |
| 投資信託財産総額     | 111,614,672       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産 (111,519,105千円) の投資信託財産総額 (111,614,672千円) に対する比率は99.9%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                       |                        |                       |                    |
|-----------------------|------------------------|-----------------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=155.60円      | 1 アルゼンチンペソ=0.1487円     | 1 メキシコペソ=7.6222円      | 1 ブラジルレアル=26.2999円 |
| 100チリペソ=15.8366円      | 100コロンビアペソ=3.7226円     | 1 ペルーヌエボソル=41.8035円   | 1 ウルグアイペソ=3.5786円  |
| 1 ドミニカペソ=2.5249円      | 1 ユーロ=163.01円          | 1 セルビアディナール=1.393514円 | 1 トルコリラ=4.3662円    |
| 1 チェコクローナ=6.4948円     | 100ハンガリーフォリント=39.9412円 | 1 ポーランドズロチ=38.6793円   | 1 ルーマニアレイ=32.7573円 |
| 1 マレーシアリンギット=35.4502円 | 1 タイバーツ=4.62円          | 100インドネシアルピア=0.97円    | 1 インドルピー=1.81円     |
| 1 中国元=21.471円         | 1 南アフリカランド=8.40円       |                       |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月27日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 円               |
| コレ・ローン等         | 111,644,419,845 |
| 公社債(評価額)        | 1,369,106,423   |
| 未収入金            | 108,293,509,380 |
| 未収利息            | 29,757,320      |
| 前払費用            | 1,782,156,291   |
| (B) 負債          | 169,890,431     |
| 前受収益            | 135,405,064     |
| 未払金             | 35,240          |
| 未払解約金           | 72,828,962      |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 62,540,862      |
| 元本              | 111,509,014,781 |
| 次期繰越損益金         | 58,813,117,519  |
| (D) 受益権総口数      | 18,960円         |
| 1万口当たり基準価額(C/D) |                 |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 49,510,869,131円  
 期中追加設定元本額 11,651,430,501円  
 期中一部解約元本額 2,349,182,113円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1,8960円です。

## ②期末における元本の内訳 (当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

|                                    |                 |
|------------------------------------|-----------------|
| e MAX I S S l i m バランス (8資産均等型)    | 21,431,952,601円 |
| 三菱UFJ D C 新興国債券インデックスファンド          | 12,731,562,668円 |
| つみたて8資産均等バランス                      | 11,061,952,195円 |
| e MAX I S バランス (8資産均等型)            | 3,607,393,920円  |
| ラップ向けインデックス f 新興国債券                | 3,322,441,261円  |
| e MAX I S 新興国債券インデックス              | 3,153,699,757円  |
| 三菱UFJ プライムバランス (8資産) (確定拠出年金)      | 1,354,014,891円  |
| 海外債券セレクション (ラップ向け)                 | 828,571,670円    |
| e MAX I S 最適化バランス (マイミッドフィルダー)     | 346,979,159円    |
| e MAX I S 最適化バランス (マイフォワード)        | 337,133,573円    |
| e MAX I S バランス (波乗り型)              | 292,628,195円    |
| e MAX I S 最適化バランス (マイストライカー)       | 197,569,922円    |
| e MAX I S 最適化バランス (マイディフェンダー)      | 81,314,408円     |
| 世界8資産バランスファンドV L (適格機関投資家限定)       | 48,780,857円     |
| e MAX I S / P a y P a y 証券 全世界バランス | 11,889,280円     |
| e MAX I S マイマネージャー 1980s           | 2,248,635円      |
| e MAX I S マイマネージャー 1990s           | 1,586,813円      |
| e MAX I S マイマネージャー 1970s           | 1,397,714円      |
| 合計                                 | 58,813,117,519円 |

## ○損益の状況 (2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目               | 当期              |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 円               |
| 受取利息             | 5,841,485,992   |
| その他収益金           | 5,841,190,378   |
| 支払利息             | 306,424         |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 10,810        |
| 売買益              | 891,158,424     |
| 売買損              | 6,217,998,861   |
| (C) 保管費用等        | △ 5,326,840,437 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 80,463,890    |
| (E) 前期繰越損益金      | 6,652,180,526   |
| (F) 追加信託差損益金     | 38,233,324,382  |
| (G) 解約差損益金       | 9,729,997,358   |
| (H) 計(D+E+F+G)   | △ 1,919,605,004 |
| 次期繰越損益金(H)       | 52,695,897,262  |
| 次期繰越損益金(H)       | 52,695,897,262  |

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換算によるものを含みます。

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

(注) (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。

# 東証REIT指数マザーファンド

**《第16期》決算日2025年1月27日**

**[計算期間：2024年1月27日～2025年1月27日]**

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月27日に第16期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当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。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | わが国の金融商品取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。 |
| 主要運用対象 | 東証REIT指数（配当込み）に採用されている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>投資信託証券への投資割合に制限を設けません。<br>外貨建資産への投資は行いません。   |

## ○最近5期の運用実績

| 決算期             | 基準価額     | 東証REIT指数 |          | 投資信託組入比率 | 不動産投信比率 | 純資産額                |
|-----------------|----------|----------|----------|----------|---------|---------------------|
|                 |          | （配当込み）   | 期騰落率     |          |         |                     |
| 12期(2021年1月26日) | 円 31,049 | % △14.8  | 3,872.69 | % △14.6  | % 98.0  | % 2.0<br>百万円 42,741 |
| 13期(2022年1月26日) | 34,244   | 10.3     | 4,269.20 | 10.2     | 98.9    | 1.2<br>62,254       |
| 14期(2023年1月26日) | 34,199   | △ 0.1    | 4,262.37 | △ 0.2    | 98.1    | 1.9<br>77,896       |
| 15期(2024年1月26日) | 35,281   | 3.2      | 4,390.19 | 3.0      | 98.4    | 1.8<br>102,201      |
| 16期(2025年1月27日) | 34,579   | △ 2.0    | 4,301.68 | △ 2.0    | 98.5    | 1.5<br>130,653      |

(注) 東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の指数值及び東証REIT指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社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、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日        | 基<br>準<br>価<br>額 | 東証REIT指数    |          | 投<br>資<br>信<br>託<br>組<br>入<br>比 | 不<br>動<br>産<br>指<br>数<br>率 |
|--------------------|------------------|-------------|----------|---------------------------------|----------------------------|
|                    |                  | 騰<br>落<br>率 | (配当込み)   |                                 |                            |
| (期首)<br>2024年1月26日 | 円<br>35,281      | %<br>—      | 4,390.19 | %<br>—                          | %<br>98.4                  |
| 1月末                | 35,186           | △0.3        | 4,378.56 | △0.3                            | 98.2                       |
| 2月末                | 33,482           | △5.1        | 4,166.74 | △5.1                            | 97.7                       |
| 3月末                | 35,435           | 0.4         | 4,410.17 | 0.5                             | 97.4                       |
| 4月末                | 35,801           | 1.5         | 4,455.74 | 1.5                             | 97.4                       |
| 5月末                | 34,568           | △2.0        | 4,302.09 | △2.0                            | 97.7                       |
| 6月末                | 34,371           | △2.6        | 4,277.59 | △2.6                            | 98.5                       |
| 7月末                | 34,481           | △2.3        | 4,290.75 | △2.3                            | 98.6                       |
| 8月末                | 35,453           | 0.5         | 4,411.38 | 0.5                             | 98.0                       |
| 9月末                | 34,874           | △1.2        | 4,339.32 | △1.2                            | 98.3                       |
| 10月末               | 34,090           | △3.4        | 4,241.80 | △3.4                            | 97.9                       |
| 11月末               | 33,793           | △4.2        | 4,204.17 | △4.2                            | 98.5                       |
| 12月末               | 33,805           | △4.2        | 4,205.64 | △4.2                            | 98.5                       |
| (期末)<br>2025年1月27日 | 34,579           | △2.0        | 4,301.68 | △2.0                            | 98.5                       |
|                    |                  |             |          |                                 | 1.5                        |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

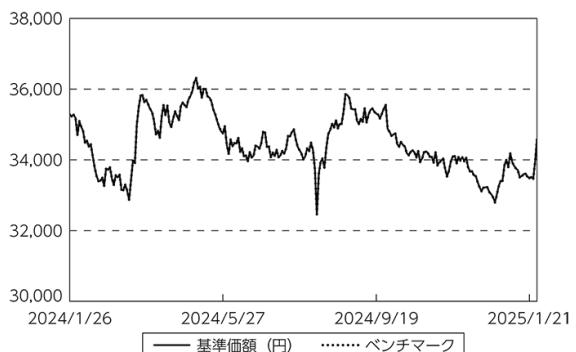
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ2.0%の下落となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(-2.0%)と同程度となりました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因  
(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎国内REIT市況

- ・国内REIT市況は下落しました。
- ・国内長期金利上昇等の影響により国内REIT市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を不動産投資信託証券(REIT)(先物を含む)に投資しました。
- ・ポートフォリオはベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは2.0%の下落となったため、カイ離は0.0%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：銘柄選択要因によるものです。

主なマイナス要因：組入要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目                                    | 当期                   |                                  | 項目の概要  |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------------------|--|
|                                       | 金額                   | 比率                               |  |
| (a) 売買委託手数料<br>(投資信託証券)<br>(先物・オプション) | 円<br>0<br>(0)<br>(0) | %<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>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| 合計                                    | 0                    | 0.001                            |  |
| 期中の平均基準価額は、34,442円です。                 |                      |                                  |  |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 投資信託証券

| 銘柄                    | 買付                |                         | 売付          |              |
|-----------------------|-------------------|-------------------------|-------------|--------------|
|                       | 口数                | 金額                      | 口数          | 金額           |
| エスコンジャパンリート投資法人       | 千口<br>1           | 千円<br>130,300           | 千口<br>0.182 | 千円<br>21,561 |
| サンケイリアルエステート投資法人      | 1                 | 114,439                 | 0.286       | 23,996       |
| S O S i L A 物流リート投資法人 | 2                 | 242,459                 | 0.444       | 51,482       |
| 東海道リート投資法人            | 0.863<br>( 0.075) | 102,755<br>( 9,387)     | 0.154       | 18,079       |
| 日本アコモデーションファンド投資法人    | 1                 | 904,960                 | 0.306       | 197,256      |
| 森ビルズリート投資法人           | 5                 | 650,986                 | 1           | 135,540      |
| 産業ファンド投資法人            | 10                | 1,316,878               | 1           | 187,889      |
| アドバンス・レジデンス投資法人       | 4                 | 1,320,349               | 0.853       | 278,870      |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人    | 2                 | 778,035                 | 0.895       | 316,570      |
| G L P 投資法人            | 14                | 1,899,894               | 3           | 474,621      |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人    | 2<br>( 0.032)     | 687,764<br>( 9,526)     | 0.433       | 137,410      |
| 日本プロロジスリート投資法人        | 7                 | 1,849,580               | 1           | 401,311      |
| 星野リゾート・リート投資法人        | 1<br>( 2)         | 583,457<br>( —)         | 0.184       | 85,790       |
| O n e リート投資法人         | 0.744             | 186,277                 | 0.154       | 39,152       |
| イオンリート投資法人            | 5                 | 688,153                 | 1           | 144,160      |
| ヒューリックリート投資法人         | 3                 | 557,120                 | 1           | 203,217      |
| 日本リート投資法人             | 1<br>( 12)        | 454,562<br>( —)         | 0.336       | 95,108       |
| 積水ハウス・リート投資法人         | 12                | 987,066                 | 2           | 213,311      |
| トーセイ・リート投資法人          | 0.978             | 132,167                 | 0.176       | 24,040       |
| ヘルスケア&メディカル投資法人       | 1                 | 127,573                 | 0.214       | 26,206       |
| サムティ・レジデンシャル投資法人      | 1                 | 117,616                 | 0.244       | 24,986       |
| 野村不動産マスターファンド投資法人     | 13                | 1,992,822               | 3           | 481,960      |
| いちごホテルリート投資法人         | 0.709             | 86,347                  | 0.151       | 17,932       |
| ラサールロジポート投資法人         | 5                 | 795,878                 | 1           | 162,887      |
| スター・アジア不動産投資法人        | 10                | 586,603                 | 1           | 79,398       |
| マリモ地方創生リート投資法人        | 1                 | 131,062                 | 0.204       | 24,757       |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人   | 3<br>( 21)        | 809,483<br>( 673,596)   | 0.479       | 158,697      |
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人     | 1                 | 98,665                  | 0.135       | 9,816        |
| 投資法人みらい               | 5                 | 254,118                 | 1           | 51,180       |
| 三差地所物流リート投資法人         | 1                 | 539,798                 | 0.307       | 115,976      |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 1                 | 264,910                 | 0.383       | 56,337       |
| ザイマックス・リート投資法人        | 0.807             | 93,938                  | 0.141       | 16,443       |
| タカラレーベン不動産投資法人        | 4<br>( 0.423)     | 370,150<br>( 39,315)    | 0.478       | 45,071       |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人     | 1<br>( △ 5)       | 169,106<br>( △ 673,596) | 0.357       | 44,087       |
| 日本ビルファンド投資法人          | 12<br>( 54)       | 3,009,944<br>( —)       | 1           | 640,904      |
| ジャパンリアルエステイト投資法人      | 5<br>( 53)        | 2,368,273<br>( —)       | 1           | 499,550      |
| 日本都市ファンド投資法人          | 26                | 2,413,098               | 4           | 447,324      |
| オリックス不動産投資法人          | 8                 | 1,360,808               | 1           | 278,954      |

| 銘柄 | 買付                    |                   | 売付                  |             |               |
|----|-----------------------|-------------------|---------------------|-------------|---------------|
|    | 口数                    | 金額                | 口数                  | 金額          |               |
| 国内 | 日本プライムリアルティ投資法人       | 千口<br>2           | 千円<br>967,178       | 千口<br>0.611 | 千円<br>203,913 |
|    | NTT都市開発リート投資法人        | 4                 | 506,226             | 0.872       | 101,905       |
|    | 東急リアル・エステート投資法人       | 2                 | 452,834             | 0.599       | 91,848        |
|    | グローバル・ワン不動産投資法人       | 3                 | 321,037             | 0.826       | 83,866        |
|    | ユナイテッド・アーバン投資法人       | 9                 | 1,352,940           | 2           | 311,924       |
|    | 森トラストリート投資法人          | 8                 | 553,847             | 1           | 116,379       |
|    | インヴィンシブル投資法人          | 29                | 1,923,228           | 4           | 284,274       |
|    | フロンティア不動産投資法人         | 1<br>(19)         | 672,797<br>(—)      | 0.399       | 141,662       |
|    | 平和不動産リート投資法人          | 3<br>(0.114)      | 439,248<br>(14,622) | 1           | 152,880       |
|    | 日本ロジスティクスファンド投資法人     | 3                 | 839,531             | 0.578       | 154,123       |
|    | 福岡リート投資法人             | 2                 | 433,714             | 0.468       | 72,298        |
|    | KDX不動産投資法人            | 12                | 1,866,370           | 3           | 570,038       |
|    | いちごオフィスリート投資法人        | 3                 | 270,045             | 1           | 143,324       |
|    | 大和証券オフィス投資法人          | 1<br>(2)          | 518,664<br>(—)      | 0.372       | 124,209       |
|    | 阪急阪神リート投資法人           | 2                 | 265,390             | 0.425       | 55,597        |
|    | スターツプロシード投資法人         | 0.742             | 141,671             | 0.156       | 30,501        |
|    | 大和ハウスクリート投資法人         | 6                 | 1,551,392           | 1           | 369,615       |
|    | ジャパン・ホテル・リート投資法人      | 18                | 1,410,249           | 3           | 237,579       |
|    | 大和証券リビング投資法人          | 6                 | 623,537             | 1           | 128,559       |
|    | ジャパンエクセレント投資法人        | 3                 | 443,766             | 0.887       | 108,152       |
|    | 東海道リート投資法人（新）         | 0.142<br>(△0.075) | 14,214<br>(△9,387)  | —           | —             |
|    | コンフォリア・レジデンシャル投資法人（新） | 0.032<br>(△0.032) | 9,526<br>(△9,526)   | —           | —             |
|    | タカラレーベン不動産投資法人（新）     | 0.423<br>(△0.423) | 39,315<br>(△39,315) | —           | —             |
|    | 平和不動産リート投資法人（新）       | 0.114<br>(△0.114) | 14,622<br>(△14,622) | —           | —             |
| 合計 |                       | 314<br>(160)      | 44,808,761<br>(—)   | 63          | 9,714,504     |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### 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>12,100 | 百万円<br>11,855 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

## ○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2025年1月27日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
| 投資信託証券 | 44,808    | 5,862              | 13.1          | 9,714     | 627                | 6.5           |

## 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   |
|--------|-------|
| 投資信託証券 | 1,681 |

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、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2025年1月27日現在)

## 国内投資信託証券

| 銘柄                  | 期首(前期末) |    | 当期末       |     | 比率 |
|---------------------|---------|----|-----------|-----|----|
|                     | 口数      | 千口 | 口数        | 千円  |    |
| エスコンジャパンリート投資法人     | 1       | 2  | 335,352   | 0.3 |    |
| サンケイリアルエステート投資法人    | 3       | 4  | 341,608   | 0.3 |    |
| SOSiLA物流リート投資法人     | 4       | 6  | 723,340   | 0.6 |    |
| 東海道リート投資法人          | 1       | 2  | 239,386   | 0.2 |    |
| 日本アコモデーションファンド投資法人  | 3       | 4  | 2,634,835 | 2.0 |    |
| 森ヒルズリート投資法人         | 11      | 15 | 1,938,096 | 1.5 |    |
| 産業ファンド投資法人          | 14      | 24 | 2,842,119 | 2.2 |    |
| アドバンス・レジデンス投資法人     | 9       | 12 | 3,729,834 | 2.9 |    |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人  | 5       | 6  | 2,131,922 | 1.6 |    |
| G L P投資法人           | 32      | 44 | 5,553,574 | 4.3 |    |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人  | 4       | 6  | 1,823,155 | 1.4 |    |
| 日本プロロジスリート投資法人      | 16      | 22 | 5,339,491 | 4.1 |    |
| 星野リゾート・リート投資法人      | 1       | 5  | 1,161,341 | 0.9 |    |
| O n eリート投資法人        | 1       | 2  | 559,004   | 0.4 |    |
| イオンリート投資法人          | 11      | 16 | 2,031,344 | 1.6 |    |
| ヒューリックリート投資法人       | 9       | 11 | 1,619,918 | 1.2 |    |
| 日本リート投資法人           | 3       | 17 | 1,376,903 | 1.1 |    |
| 積水ハウス・リート投資法人       | 29      | 39 | 3,117,498 | 2.4 |    |
| トーセイ・リート投資法人        | 2       | 2  | 365,440   | 0.3 |    |
| ヘルスケア&メディカル投資法人     | 2       | 3  | 350,351   | 0.3 |    |
| サムティ・レジデンシャル投資法人    | 2       | 3  | 342,414   | 0.3 |    |
| 野村不動産マスタークアンド投資法人   | 31      | 42 | 6,133,198 | 4.7 |    |
| いちごホテルリート投資法人       | 1       | 2  | 307,262   | 0.2 |    |
| ラサールロジポート投資法人       | 12      | 16 | 2,421,072 | 1.9 |    |
| スターアジア不動産投資法人       | 15      | 24 | 1,292,280 | 1.0 |    |
| マリモ地方創生リート投資法人      | 1       | 2  | 257,472   | 0.2 |    |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 4       | 28 | 2,891,226 | 2.2 |    |
| 日本ホテル&レジデンシャル投資法人   | 1       | 2  | 186,907   | 0.1 |    |
| 投資法人みらい             | 13      | 18 | 743,211   | 0.6 |    |
| 三菱地所物流リート投資法人       | 3       | 4  | 1,598,587 | 1.2 |    |
| CREロジスティクスファンド投資法人  | 4       | 5  | 834,948   | 0.6 |    |
| ザイマックス・リート投資法人      | 1       | 2  | 260,318   | 0.2 |    |
| タカラレーベン不動産投資法人      | 4       | 8  | 756,403   | 0.6 |    |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人   | 4       | —  | —         | —   |    |
| 日本ビルファンド投資法人        | 11      | 76 | 9,444,780 | 7.2 |    |
| ジャパンリアルエステート投資法人    | 10      | 67 | 7,331,488 | 5.6 |    |
| 日本都市ファンド投資法人        | 46      | 68 | 6,162,688 | 4.7 |    |
| オリックス不動産投資法人        | 19      | 26 | 4,432,520 | 3.4 |    |
| 日本プライムリアルティ投資法人     | 6       | 8  | 3,062,521 | 2.3 |    |
| N T T都市開発リート投資法人    | 9       | 13 | 1,645,808 | 1.3 |    |
| 東急リアル・エステート投資法人     | 6       | 8  | 1,414,083 | 1.1 |    |
| グローバル・ワン不動産投資法人     | 7       | 9  | 992,844   | 0.8 |    |
| ユナイテッド・アーバン投資法人     | 21      | 29 | 4,345,436 | 3.3 |    |
| 森トラストリート投資法人        | 18      | 25 | 1,592,187 | 1.2 |    |
| インヴィンシブル投資法人        | 47      | 72 | 4,941,778 | 3.8 |    |
| フロンティア不動産投資法人       | 3       | 24 | 1,961,221 | 1.5 |    |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当期末   |           |       |             |
|-------------------|---------|-------|-----------|-------|-------------|
|                   |         | 口数    | 口数        | 評価額   | 比率          |
| 平和不動産リート投資法人      | 千口      | 千口    | 千円        | %     |             |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 7       | 9     | 1,232,512 | 0.9   |             |
| 福岡リート投資法人         | 6       | 8     | 2,383,974 | 1.8   |             |
| KDX不動産投資法人        | 5       | 7     | 1,087,047 | 0.8   |             |
| いちごオフィスリート投資法人    | 28      | 36    | 5,595,502 | 4.3   |             |
| 大和証券オフィス投資法人      | 7       | 9     | 804,888   | 0.6   |             |
| 阪急阪神リート投資法人       | 2       | 5     | 1,536,055 | 1.2   |             |
| スターツプロシード投資法人     | 4       | 6     | 794,520   | 0.6   |             |
| 大和ハウスリート投資法人      | 1       | 2     | 406,038   | 0.3   |             |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人  | 14      | 19    | 4,651,200 | 3.6   |             |
| 大和証券リビング投資法人      | 32      | 48    | 3,502,587 | 2.7   |             |
| ジャパンエクセレント投資法人    | 14      | 19    | 1,724,304 | 1.3   |             |
| 東海道リート投資法人（新）     | 8       | 11    | 1,407,369 | 1.1   |             |
|                   | 0.075   | 0.142 | 14,763    | 0.0   |             |
| 合計                | 口数      | 金額    | 616       | 1,027 | 128,707,939 |
|                   | 銘柄数     | 比率    | 59        | 58    | <98.5%>     |

(注) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、SOSiLA物流リート投資法人、東海道リート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、森ビルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、野村不動産マスタートファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、スターアジア不動産投資法人、マリモ地方創生リート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、投資法人みらい、三菱地所物流リート投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、タカラレーベン不動産投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本都市ファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、NTT都市開発リート投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、森トラストリート投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、KDX不動産投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクセレント投資法人、東海道リート投資法人（新）につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFG証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっております。(各ファンドで開示されている2024年7月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容

当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 |             |          | 当 期 末        |          |
|-------|-------------|----------|--------------|----------|
|       |             |          | 買 建 額        | 売 建 額    |
| 国内    | 不動産投信指数先物取引 | 東証REIT指数 | 百万円<br>1,965 | 百万円<br>— |

## ○投資信託財産の構成

(2025年1月27日現在)

| 項 目          | 当 期 末             |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評 価 額             | 比 率       |
| 投資証券         | 千円<br>128,707,939 | %<br>98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 2,223,059         | 1.7       |
| 投資信託財産総額     | 130,930,998       | 100.0     |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月27日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 円               |
| コール・ローン等        | 130,894,606,308 |
| 投資証券(評価額)       | 807,344,462     |
| 未収入金            | 128,707,939,640 |
| 未収配当金           | 163,627,005     |
| 未利息             | 1,146,844,162   |
| 差入委託証拠金         | 10,224          |
| (合計)            | 68,840,815      |
| (B) 負債          | 240,790,059     |
| 未払金             | 21,493,325      |
| 未払解約金           | 219,296,734     |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 130,653,816,249 |
| 元本              | 37,783,667,134  |
| 次期継越損益金         | 92,870,149,115  |
| (D) 受益権総口数      | 37,783,667,134口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 34,579円         |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 28,967,583,332円  
 期中追加設定元本額 12,570,263,401円  
 期中一部解約元本額 3,754,179,599円  
 また、1口当たり純資産額は、期末3,4579円です。

## ○損益の状況 (2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目               | 当期              |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 円               |
| 受取配当金            | 5,493,724,824   |
| 受取利息             | 5,483,280,500   |
| その他収益金           | 2,446,754       |
| 支払利息             | 8,856,157       |
| △                | △ 858,587       |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 6,933,195,184 |
| 売買益              | 1,043,963,330   |
| 売買損              | △ 7,977,158,514 |
| (C) 先物取引等取引損益    | △ 71,587,800    |
| 取引益              | 157,847,790     |
| 取引損              | △ 229,435,590   |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 1,511,058,160 |
| (E) 前期継越損益金      | 73,233,661,545  |
| (F) 追加信託差損益金     | 30,412,977,656  |
| (G) 解約差損益金       | △ 9,265,431,926 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 92,870,149,115  |
| 次期継越損益金(H)       | 92,870,149,115  |

(注) (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算によるものを含みます。

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

(注) (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。

## ②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

|   |                 |
|---|-----------------|
| e MAXIS S1im バランス（8資産均等型）               | 11,914,675,082円 |
| e MAXIS S1im 国内リートインデックス                | 6,599,345,514円  |
| つみたて8資産均等バランス                           | 6,148,737,736円  |
| e MAXIS 国内リートインデックス                     | 3,883,003,353円  |
| e MAXIS バランス（8資産均等型）                    | 1,997,211,752円  |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（標準型）               | 1,192,077,891円  |
| オルタナティブ資産セレクション（ラップ向け）                  | 1,030,831,614円  |
| 三菱UFJ <DC> J-REITインデックスファンド             | 799,927,025円    |
| ラップ向けインデックスファンド 国内リート                   | 733,047,377円    |
| 日本リートインデックスファンドS                        | 716,373,626円    |
| 三菱UFJ ブライムバランス（8資産）（確定拠出年金）             | 566,683,775円    |
| MUKAM 3資産インカムバランスマネジメント（適格機関投資家転売制限付）   | 389,137,339円    |
| e MAXIS 最適化バランス（マイミッドフィルダー）             | 290,138,964円    |
| e MAXIS 最適化バランス（マイフォワード）                | 250,376,385円    |
| e MAXIS バランス（波乗り型）                      | 162,733,648円    |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（保守型）               | 121,749,263円    |
| e MAXIS 最適化バランス（マイストライカー）               | 110,358,339円    |
| 三菱UFJ 国内リートインデックスファンド                   | 87,138,577円     |
| e MAXIS 最適化バランス（マイディフェンダー）              | 60,408,556円     |
| アクティブラロケーションファンド（ラップ向け）                 | 53,072,915円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05（適格機関投資家限定） | 41,650,050円     |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01（適格機関投資家限定） | 41,643,078円     |

|  |                   |
|--|-------------------|
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)         | 41,642, 416円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03 (適格機関投資家限定)         | 41,636, 571円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)         | 41,579, 926円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)         | 41,261, 256円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)         | 40,203, 912円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)         | 38,938, 060円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)         | 37,092, 372円      |
| e MAX IS 最適化バランス (マイゴールキーパー)                     | 37,026, 126円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)         | 36,726, 590円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)         | 36,352, 007円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)         | 36,241, 552円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)         | 36,230, 204円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)         | 36,223, 712円      |
| MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)         | 36,160, 507円      |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)                      | 20,415, 767円      |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) スタンダードコース  | 19,539, 198円      |
| ラップ向けアクティイブアロケーションファンド                           | 5,503, 746円       |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス (為替リスク軽減型) コンサバティブコース | 5,434, 291円       |
| e MAX IS マイマネージャー 1980s                          | 1,883, 204円       |
| e MAX IS／PayPay証券 全世界バランス                        | 1,093, 133円       |
| e MAX IS マイマネージャー 1970s                          | 1,038, 129円       |
| e MAX IS マイマネージャー 1990s                          | 888, 245円         |
| マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)                      | 234, 351円         |
| 合計   | 37,783, 667, 134円 |

## MUAM G-REITマザーファンド

## 《第19期》決算日2025年1月6日

[計算期間：2024年1月6日～2025年1月6日]

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月6日に第19期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 主としてS&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。銘柄選定にあたっては、時価総額および流動性等を勘案します。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 |
| 主要運用対象 | S&P先進国REITインデックス（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている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 | 株式への直接投資は行いません。投資信託証券への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資割合に制限を設けません。  |

## ○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 |                                 | 投資信託券組入比率  | 不動産投信物比率  | 純資産額   |
|----------------|-------------|------------------|---------------------------------|------------|-----------|--------|
|                |             | 期騰落率             | 中率                              |            |           |        |
| 15期(2021年1月5日) | 円<br>15,806 | %<br>△14.0       | (除く日本、配当込み、円換算ベース)<br>40,236.52 | %<br>△14.7 | %<br>99.0 | %<br>— |
| 16期(2022年1月5日) | 24,645      | 55.9             | 62,554.10                       | 55.5       | 99.3      | —      |
| 17期(2023年1月5日) | 21,519      | △12.7            | 54,258.04                       | △13.3      | 95.3      | 5.3    |
| 18期(2024年1月5日) | 25,604      | 19.0             | 64,147.13                       | 18.2       | 98.2      | 2.0    |
| 19期(2025年1月6日) | 29,854      | 16.6             | 74,380.28                       | 16.0       | 96.0      | 3.8    |

(注) S&P先進国REITインデックスとは、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指標です。なお、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REITインデックス(除く日本、配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S&P先進国REITインデックスはS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサプライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいすれも、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インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

(注) 外国の指標は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年<br>月<br>日        | 基<br>準<br>価<br>額 |                        | S & P<br>先進国<br>REITインデックス | 投<br>資<br>信<br>託<br>組<br>入<br>比 | 不<br>投<br>信<br>物<br>先<br>動<br>指<br>産<br>数<br>率 |
|--------------------|------------------|------------------------|----------------------------|---------------------------------|--|
|                    | 騰<br>落<br>率      | (除く日本、配当込<br>み、円換算ベース) | 騰<br>落<br>率                |                                 |  |
| (期 首)<br>2024年1月5日 | 円<br>25,604      | %<br>—                 | 64,147.13                  | %<br>—                          | %<br>98.2                                      |
| 1月末                | 25,554           | △ 0.2                  | 64,012.38                  | △ 0.2                           | 2.2  |
| 2月末                | 26,014           | 1.6                    | 65,140.19                  | 1.5                             | 3.4  |
| 3月末                | 27,025           | 5.5                    | 67,617.65                  | 5.4                             | 4.0  |
| 4月末                | 26,533           | 3.6                    | 66,381.10                  | 3.5                             | 2.7  |
| 5月末                | 26,971           | 5.3                    | 67,473.50                  | 5.2                             | 2.2  |
| 6月末                | 28,277           | 10.4                   | 70,697.64                  | 10.2                            | 2.1  |
| 7月末                | 28,722           | 12.2                   | 71,710.17                  | 11.8                            | 2.8  |
| 8月末                | 28,594           | 11.7                   | 71,361.02                  | 11.2                            | 3.1  |
| 9月末                | 29,320           | 14.5                   | 73,153.95                  | 14.0                            | 3.0  |
| 10月末               | 30,914           | 20.7                   | 77,115.04                  | 20.2                            | 3.6  |
| 11月末               | 30,857           | 20.5                   | 76,883.56                  | 19.9                            | 4.4  |
| 12月末               | 29,733           | 16.1                   | 74,116.55                  | 15.5                            | 3.7  |
| (期 末)<br>2025年1月6日 | 29,854           | 16.6                   | 74,380.28                  | 16.0                            | 3.8  |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

### ●当期中の基準価額等の推移について

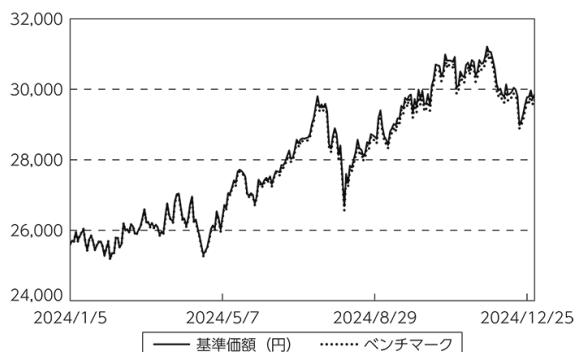
#### ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ16.6%の上昇となりました。

#### ◎ベンチマークとの差異

ファンドの謄落率は、ベンチマークの謄落率(16.0%)を0.6%上回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎外国REIT市況

- ・外国REIT市況は上昇しました。
- ・主要国での政策金利の引き下げやインフレ率の鈍化などを受けて外国REIT市況は上昇しました。

◎為替市況

- ・米ドル、ユーロは円に対して上昇しました。
- ・為替市況は、期間の初めに比べて円安・米ドル高、円安・ユーロ高となりました。

●当該投資信託の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、配当込み、円換算ベース)に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とし、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、国別比率や用途別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにポートフォリオを構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは16.0%の上昇になったため、カイ離は0.6%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因※によるものです。  
※その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・組入要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動す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

(2024年1月6日～2025年1月6日)

| 項目                                    | 当期                   |                                  | 項目の概要   |
|---------------------------------------|----------------------|----------------------------------|---|
|                                       | 金額                   | 比率                               |   |
| (a) 売買委託手数料<br>（投資信託証券）<br>（先物・オプション） | 円<br>1<br>(0)<br>(1) | %<br>0.005<br>(0.001)<br>(0.004) | (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>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (b) 有価証券取引税<br>（投資信託証券）               | 1<br>(1)             | 0.005<br>(0.005)                 | (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>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (c) その他の費用<br>（保管費用）<br>（その他）         | 12<br>(4)<br>(8)     | 0.043<br>(0.015)<br>(0.028)      | (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>有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計                                    | 14                   | 0.053                            |   |
| 期中の平均基準価額は、28,036円です。                 |                      |                                  |   |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

## ○売買及び取引の状況

(2024年1月6日～2025年1月6日)

## 投資信託証券

| 銘柄                           | 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 |
| SITE CENTERS CORP            | 7<br>(△ 85) | 103<br>(—)        | —     | —       |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 44<br>( 94) | 840<br>( 1,824)   | 9     | 176     |
| MACERICH CO/THE              | 34          | 661               | —     | —       |
| ACADIA REALTY TRUST          | 21          | 443               | —     | —       |
| AGREE REALTY CORP            | 8           | 527               | 1     | 87      |
| ALEXANDER'S INC              | 0.443       | 89                | —     | —       |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 11          | 1,314             | 2     | 270     |
| PROLOGIS INC                 | 59          | 6,759             | 5     | 594     |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | —           | —                 | 15    | 14      |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 18          | 78                | —     | —       |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 7           | 766               | 1     | 112     |
| NNN REIT INC                 | 14          | 584               | —     | —       |
| COPT DEFENSE PROPERTIES      | 4           | 106               | —     | —       |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 15          | 441               | —     | —       |
| DIAMONDRock HOSPITALITY CO   | 10          | 92                | —     | —       |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 34          | 5,200             | 11    | 1,849   |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 4           | 742               | —     | —       |
| EPR PROPERTIES               | 2           | 103               | —     | —       |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 15          | 979               | 1     | 99      |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 4           | 1,070             | 0.477 | 132     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 13          | 1,962             | 0.942 | 149     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 6           | 674               | —     | —       |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 7           | 397               | 1     | 65      |
| GETTY REALTY CORP            | 3           | 91                | —     | —       |
| WELLTOWER INC                | 68          | 7,140             | 12    | 1,595   |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 4           | 107               | —     | —       |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 5           | 104               | —     | —       |
| KILROY REALTY CORP           | 5           | 187               | —     | —       |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 13          | 284               | —     | —       |
| LXP INDUSTRIAL TRUST         | 10          | 91                | —     | —       |
| LTC PROPERTIES INC           | 4           | 153               | —     | —       |
| VERIS RESIDENTIAL INC        | 5           | 88                | —     | —       |
| BXP INC                      | 10          | 692               | 1     | 64      |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 22          | 112               | —     | —       |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 7           | 1,057             | 0.803 | 113     |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 5           | 397               | 1     | 136     |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 32          | 1,140             | 2     | 67      |
| REALTY INCOME CORP           | 75<br>( 61) | 4,022<br>( 3,566) | —     | —       |

| 銘柄                             | 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 |
| REGENCY CENTERS CORP           | 10      | 637       | 1     | 81      |
| SL GREEN REALTY CORP           | 8       | 555       | —     | —       |
| SUN COMMUNITIES INC            | 9       | 1,215     | 5     | 782     |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC   | 14      | 156       | —     | —       |
| TANGER INC                     | 7       | 233       | —     | —       |
| CUBESMART                      | 15      | 688       | 1     | 66      |
| UDR INC                        | 21      | 813       | 4     | 188     |
| VENTAS INC                     | 35      | 1,837     | 1     | 96      |
| ELME COMMUNITIES               | 4       | 65        | —     | —       |
| UMH PROPERTIES INC             | 10      | 195       | —     | —       |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP      | 5       | 90        | —     | —       |
| CENTERSPACE                    | 1       | 101       | —     | —       |
| DOUGLAS EMMETT INC             | 12      | 182       | —     | —       |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A   | 10      | 87        | —     | —       |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC    | 13      | 93        | —     | —       |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT  | 15      | 234       | 6     | 109     |
| STAG INDUSTRIAL INC            | 13      | 493       | 1     | 73      |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC     | 18      | 280       | —     | —       |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC    | 10      | 143       | 11    | 200     |
| WP CAREY INC                   | 14      | 829       | 1     | 106     |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES   | 3       | 390       | 0.685 | 68      |
| TERRENO REALTY CORP            | 13      | 852       | —     | —       |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC      | —       | —         | —     | —       |
|                                | (△ 81)  | (△ 3,566) |       |         |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN   | 17      | 173       | —     | —       |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN   | 19      | 876       | —     | —       |
| PHYSICIANS REALTY TRUST        | —       | —         | —     | —       |
|                                | (△ 140) | (△ 1,824) |       |         |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A        | 23      | 854       | 5     | 209     |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A    | 8       | 86        | —     | —       |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC     | 16      | 388       | —     | —       |
| CARETRUST REIT INC             | 47      | 1,323     | —     | —       |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES  | 19      | 916       | —     | —       |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN   | 11      | 179       | —     | —       |
| IRON MOUNTAIN INC              | 18      | 1,603     | 1     | 94      |
| LAMAR ADVERTISING CO-A         | 56      | 7,481     | —     | —       |
| URBAN EDGE PROPERTIES          | 9       | 188       | —     | —       |
| EQUINIX INC                    | 7       | 5,973     | 0.094 | 81      |
| PARAMOUNT GROUP INC            | 16      | 80        | —     | —       |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES | 8       | 103       | —     | —       |
| UNITI GROUP INC                | 16      | 91        | —     | —       |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES    | 4       | 184       | 3     | 160     |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC     | 15      | 236       | —     | —       |
| GLOBAL NET LEASE INC           | 12      | 80        | —     | —       |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST    | 8       | 222       | —     | —       |
| PARK HOTELS & RESORTS INC      | 7       | 118       | —     | —       |

| 銘柄                           | 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   |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 22       | 1,473      | 5     | 392       |
| INVITATION HOMES INC         | 38       | 1,301      | 8     | 295       |
| JBG SMITH PROPERTIES         | 5        | 88         | —     | —         |
| ALEXANDER & BALDWIN INC      | 5        | 100        | —     | —         |
| CLIPPER REALTY INC           | —        | —          | 11    | 62        |
| VICI PROPERTIES INC          | 71       | 2,070      | —     | —         |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC   | 18       | 440        | 4     | 141       |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 0.5      | 56         | —     | —         |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY  | 19       | 519        | —     | —         |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 4        | 104        | —     | —         |
| PRIME US REIT                | —        | —          | —     | —         |
|                              | (34)     | (△ 0.1742) |       |           |
| NETSTREIT CORP               | 16       | 253        | —     | —         |
| BROADSTONE NET LEASE INC     | 6        | 93         | —     | —         |
| APARTMENT INCOME REIT CO     | 8        | 288        | —     | —         |
|                              |          |            | (91)  | ( 3, 163) |
| CTO REALTY GROWTH INC        | 4        | 89         | —     | —         |
| OUTFRONT MEDIA INC           | 86       | 1,582      | —     | —         |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 147      | 87         | —     | —         |
|                              | (—)      | (△ 9)      |       |           |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 8        | 288        | —     | —         |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | —        | —          | 6     | 165       |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP   | 10       | 291        | —     | —         |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 13       | 94         | —     | —         |
|                              | (1)      | ( 7)       |       |           |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY    | —        | —          | —     | —         |
|                              | ( 0.088) | ( 2)       |       |           |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 97       | 2,077      | —     | —         |
| LINEAGE INC                  | 38       | 3,271      | —     | —         |
| MODIV INDUSTRIAL INC         | 5        | 93         | —     | —         |
| CURBLINE PROPERTIES CORP     | 4        | 91         | —     | —         |
|                              | (57)     | (—)        |       |           |
| SILA REALTY TRUST INC        | 35       | 861        | —     | —         |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 44       | 865        | 6     | 122       |
| PUBLIC STORAGE               | 10       | 2,884      | 1     | 499       |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 20       | 3,139      | 14    | 2,376     |
| VORNADO REALTY TRUST         | 12       | 389        | —     | —         |
| KIMCO REALTY CORP            | 50       | 999        | 3     | 75        |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 9        | 1,759      | 0.892 | 181       |
| 小計                           | 2,059    | 96,620     | 180   | 12,164    |
|                              | (△ 57)   | (△0.75286) | (91)  | ( 3, 163) |
| カナダ                          |          | 千カナダドル     |       | 千カナダドル    |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 2        | 191        | 1     | 105       |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 5        | 132        | —     | —         |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 3        | 127        | —     | —         |

| 銘柄                           | 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 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | —      | —         | —    | —      |
|                              | (△ 6)  | (—)       |      |        |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 13     | 130       | —    | —      |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 16     | 304       | —    | —      |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 7      | 131       | —    | —      |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 1      | 103       | —    | —      |
|                              | (△ 19) | (△ 1,490) |      |        |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 8      | 112       | —    | —      |
| CHOICE PROPERTIES REIT       | 10     | 139       | —    | —      |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 5      | 94        | —    | —      |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | —      | —         | 5    | 69     |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | —      | —         | 52   | 186    |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT        | 12     | 90        | —    | —      |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | —      | —         | 13   | 76     |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | —      | —         | 13   | 253    |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | —      | —         | —    | —      |
|                              | (— 19) | (— 1,490) |      |        |
| 小計                           | 88     | 1,558     | 85   | 690    |
|                              | (△ 6)  | (—)       |      |        |
| ヨーロッパ                        | 千ユーロ   |           | 千ユーロ |        |
|                              | ドイツ    |           |      |        |
| HAMBORNER REIT AG            | —      | —         | —    | —      |
|                              | (—)    | (△ 11)    |      |        |
| 小計                           | —      | —         | —    | —      |
|                              | (—)    | (△ 11)    |      |        |
| フランス                         |        |           |      |        |
| GECINA SA                    | 2      | 239       | —    | —      |
| KLEPIERRE                    | 24     | 683       | —    | —      |
|                              | (—)    | (△ 12)    |      |        |
| COVIVIO                      | 6      | 311       | —    | —      |
| MERCIALYS                    | 4      | 54        | —    | —      |
| ALTAREA                      | 0.972  | 92        | —    | —      |
|                              | (—)    | (△ 21)    |      |        |
| CARMILA                      | 3      | 52        | —    | —      |
|                              | (—)    | (△ 29)    |      |        |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 6      | 476       | 1    | 84     |
|                              | (—)    | (△ 157)   |      |        |
| 小計                           | 48     | 1,910     | 1    | 84     |
|                              | (—)    | (△ 220)   |      |        |
| オランダ                         |        |           |      |        |
| VASTNED RETAIL NV            | 4      | 101       | 10   | 258    |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 2      | 54        | —    | —      |
| 小計                           | 7      | 156       | 10   | 258    |
| スペイン                         |        |           |      |        |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | —      | —         | 32   | 269    |
|                              | (—)    | (△ 1)     |      |        |

| 銘柄                              | 買付           |                  | 売付           |            |
|---------------------------------|--------------|------------------|--------------|------------|
|                                 | 口数           | 金額               | 口数           | 金額         |
| 千口                              | 千ユーロ         | 千口               | 千ユーロ         |            |
| 外<br>ユーロ<br>スペイン                |              |                  |              |            |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA     | 61<br>(—)    | 631<br>(△ 47)    | —            | —          |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI    | 40           | 257              | —            | —          |
| 小計                              | 101<br>(—)   | 888<br>(△ 49)    | 32           | 269        |
|                                 |              |                  |              |            |
| ベルギー                            |              |                  |              |            |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUS    | —            | —                | 17           | 371        |
| RETAIL ESTATES                  | 0.8          | 56               | —            | —          |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA          | 14           | 338              | —            | —          |
| AEDIFICA                        | 1            | 96               | —            | —          |
| MONTEA NV                       | 3            | 286              | —            | —          |
| MONTEA NV-RTS                   | —<br>(11)    | —<br>(—)         | 11           | 10         |
| CARE PROPERTY INVEST            | 9            | 124              | —            | —          |
| XIOR STUDENT HOUSING NV         | 4            | 142              | —            | —          |
| COFINIMMO                       | 3            | 187              | —            | —          |
| 小計                              | 37<br>(11)   | 1,231<br>(—)     | 29           | 382        |
| アイルランド                          |              |                  |              |            |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES    | 103          | 93               | —            | —          |
| 小計                              | 103          | 93               | —            | —          |
| シンガポール                          |              |                  |              |            |
| STONEWEG EUROPEAN REAL ESTAT    | —<br>(—)     | —<br>(△ 14)      | —<br>(—)     | —<br>(2)   |
| 小計                              | —<br>(—)     | —<br>(△ 14)      | —<br>(—)     | —<br>(2)   |
| ユーロ計                            | 298<br>(11)  | 4,280<br>(△ 295) | 74<br>(—)    | 994<br>(2) |
| 国<br>イギリス                       |              | 千イギリスポンド         |              | 千イギリスポンド   |
| BRITISH LAND CO PLC             | 121          | 481              | 12           | 51         |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC      | 100          | 355              | —            | —          |
| GREAT PORTLAND ESTATES -NIL-RTS | —<br>(93)    | —<br>(—)         | 93           | 104        |
| HAMMERSMITH & FISHER PLC        | 496          | 153              | —<br>(2,546) | —<br>(—)   |
| LAND SECURITIES GROUP PLC       | 48           | 307              | 9            | 58         |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES       | 109          | 99               | —            | —          |
| SEGRO PLC                       | 164          | 1,397            | 10           | 96         |
| WORKSPACE GROUP PLC             | 14           | 70               | —            | —          |
| BIG YELLOW GROUP PLC            | 10           | 118              | —            | —          |
| DERWENT LONDON PLC              | 6            | 137              | —            | —          |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC       | 167<br>(544) | 329<br>(1,024)   | 28           | 58         |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC          | 16           | 122              | —            | —          |

| 銘柄                           | 買付               |                 | 売付             |               |
|------------------------------|------------------|-----------------|----------------|---------------|
|                              | 口数               | 金額              | 口数             | 金額            |
| イギリス                         | 千口               | 千イギリスポンド        | 千口             | 千イギリスポンド      |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC      | 303<br>( 206)    | 467<br>( 294)   | —              | —             |
| ASSURA PLC                   | 120              | 50              | —              | —             |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 89               | 74              | —              | —             |
| REGIONAL REIT LTD            | 92<br>(△ 113)    | 126<br>(—)      | —              | —             |
| NEWRIVER REIT PLC            | 94               | 68              | —              | —             |
| UNITE GROUP PLC/THE          | 65               | 610             | 31             | 299           |
| LXI REIT PLC                 | —<br>(△ 989)     | —<br>(△ 1,024)  | —              | —             |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT  | —<br>(△ 464)     | —<br>(△ 294)    | —              | —             |
| SOCIAL HOUSING REIT PLC      | 97               | 60              | —              | —             |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC      | 213              | 282             | 50             | 69            |
| BALANCED COMM PROPERTY TRUST | —                | —               | —<br>( 417)    | —<br>( 300)   |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST  | —<br>(—)         | —<br>(△ 98)     | —              | —             |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC     | 58               | 63              | —              | —             |
| 小計                           | 2,391<br>(△ 722) | 5,378<br>(△ 98) | 236<br>(2,964) | 737<br>( 300) |
| オーストラリア                      | 千オーストラリアドル       |                 | 千オーストラリアドル     |               |
| VICINITY CENTRES             | 327              | 658             | 71             | 133           |
| CHARTER HALL GROUP           | 34               | 442             | —              | —             |
| REGION RE LTD                | 69               | 148             | —              | —             |
| NATIONAL STORAGE REIT        | 165              | 392             | —              | —             |
| GDI PROPERTY GROUP           | 277              | 172             | 426            | 266           |
| DEXUS INDUSTRIAL REIT        | 20               | 59              | —              | —             |
| SCENTRE GROUP                | 393              | 1,285           | 58             | 187           |
| ARENA REIT                   | 77               | 287             | —              | —             |
| WAYPOINT REIT                | 59               | 137             | —              | —             |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 20               | 72              | —              | —             |
| HOMECA DAILY NEEDS REIT      | 136              | 171             | —              | —             |
| DEXUS/AU                     | 54               | 405             | —              | —             |
| HMC CAPITAL LTD              | —                | —               | 151            | 1,188         |
| GPT GROUP                    | 115              | 506             | —              | —             |
| MIRVAC GROUP                 | 183              | 369             | —              | —             |
| STOCKLAND                    | 158              | 738             | —              | —             |
| BWP TRUST                    | 92               | 318             | —              | —             |
| GOODMAN GROUP                | 227              | 7,956           | 12             | 442           |
| 小計                           | 2,413            | 14,121          | 720            | 2,219         |
| ニュージーランド                     | 千ニュージーランドドル      |                 | 千ニュージーランドドル    |               |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD      | 171              | 143             | 1,048          | 964           |
| GOODMAN PROPERTY TRUST       | 67               | 152             | —              | —             |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP    | 179              | 217             | 1,010          | 1,257         |

| 銘柄                               | 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 |
| ARGOSY PROPERTY LTD              | 80         | 89             | 531   | 555         |
| 小計                               | 498        | 603            | 2,590 | 2,777       |
| 香港                               |            | 千香港ドル          |       | 千香港ドル       |
| LINK REIT                        | 190        | 6,463          | 30    | 954         |
| PROSPERITY REIT                  | —          | —              | 760   | 973         |
| FORTUNE REIT                     | 129        | 546            | —     | —           |
| 小計                               | 319        | 7,009          | 790   | 1,927       |
| シンガポール                           |            | 千シンガポールドル      |       | 千シンガポールドル   |
| SUNTEC REIT                      | 120<br>(—) | 136<br>(△ 2)   | —     | —           |
| KEPPEL REIT                      | 285        | 246            | —     | —           |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST          | 182<br>(—) | 165<br>(△ 29)  | —     | —           |
| ESR-REIT                         | 499<br>(—) | 125<br>(△ 11)  | —     | —           |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS           | —<br>(—)   | —<br>(△ 5)     | —     | —           |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST        | 126        | 269            | —     | —           |
| STARHILL GLOBAL REIT             | 190        | 90             | —     | —           |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST        | 311<br>(—) | 421<br>(△ 70)  | —     | —           |
| CAPITALAND CHINA TRUST           | —<br>(—)   | —<br>(△ 8)     | —     | —           |
| AIMS APAC REIT                   | —<br>(—)   | —<br>(△ 8)     | —     | —           |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE          | 34<br>(—)  | 125<br>(△ 10)  | —     | —           |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST       | 173<br>(—) | 386<br>(△ 6)   | 49    | 105         |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST     | 99<br>(—)  | 120<br>(△ 23)  | —     | —           |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST       | —<br>(—)   | —<br>(△ 3)     | —     | —           |
| OUE REAL ESTATE INVESTMENT T     | 1,449      | 493            | —     | —           |
| PARAGON REIT                     | 66<br>(—)  | 56<br>(△ 14)   | 786   | 676         |
| KEPPEL DC REIT                   | 356<br>(—) | 753<br>(△ 13)  | (—)   | (— 6)       |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL   | 138<br>(—) | 137<br>(△ 37)  | —     | —           |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT   | —<br>(—)   | —<br>(△ 3)     | —     | —           |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 625<br>(—) | 1,249<br>(△ 9) | —     | —           |

| 銘柄     | 買付                           |              | 売付                  |            |                     |
|--------|------------------------------|--------------|---------------------|------------|---------------------|
|        | 口数                           | 金額           | 口数                  | 金額         |                     |
| 外<br>国 | 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 ASCENDAS REIT     | 265<br>(—)   | 703<br>(△ 42)       | 49         | 125                 |
|        | 小計                           | 4,924<br>(—) | 5,483<br>(△ 303)    | 885<br>(—) | 906<br>(— 6)        |
|        | 韓国                           |              | 千韓国ウォン              |            | 千韓国ウォン              |
|        | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD    | 21           | 133,293             | —<br>(—)   | —<br>( 2,342)       |
|        | SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS | —<br>( 15)   | —<br>( 2,342)       | 15         | 2,275               |
|        | LOTTE REIT CO LTD-RIGHTS     | —<br>( 15)   | —<br>(—)            | 15         | 1,608               |
|        | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD  | 29           | 161,907             | —          | —                   |
|        | JR GLOBAL REIT               | 28           | 102,496             | —          | —                   |
|        | KORAMCO LIFE INFRA REIT      | 12           | 60,584              | —          | —                   |
|        | KORAMCO LIFE INFRA RE-RIGHTS | —<br>( 3)    | —<br>(—)            | 3          | 989                 |
|        | D&D PLATFORM REIT CO LTD     | —            | —                   | 42         | 150,686             |
|        | SK REITS CO LTD              | 26           | 141,579             | —          | —                   |
|        | NH ALL-ONE REIT CO LTD       | —            | —                   | 32         | 115,697             |
|        | 小計                           | 117<br>( 34) | 599,860<br>( 2,342) | 108<br>(—) | 271,255<br>( 2,342) |
|        | イスラエル                        |              | 千イスラエルシェケル          |            | 千イスラエルシェケル          |
|        | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 15           | 117                 | —          | —                   |
|        | 小計                           | 15           | 117                 | —          | —                   |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は分割・合併および償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

### 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<br>不動産投信指数先物取引 | 百万円<br>42,229 | 百万円<br>38,977 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2024年1月6日～2025年1月6日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A     | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C    | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|---------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
|        |               |                    |               |              |                    |               |
| 為替直物取引 | 百万円<br>21,914 | 百万円<br>82          | %<br>0.4      | 百万円<br>7,997 | 百万円<br>82          | %<br>1.0      |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2025年1月6日現在)

## 外国投資信託証券

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末)<br>口<br>数 | 当<br>期<br>末 |             |           |                 | 比<br>率 |  |
|------------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------|-----------------|--------|--|
|                              |                   | 口<br>数      | 評<br>価<br>額 |           | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |        |  |
|                              |                   |             | 千円          | 千アメリカドル   |                 |        |  |
| (アメリカ)                       |                   |             |             |           |                 |        |  |
| SITE CENTERS CORP            | 107               | 28          | 433         | 68,386    | 0.0             |        |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 316               | 446         | 9,121       | 1,438,687 | 1.0             |        |  |
| MACERICH CO/THE              | 121               | 156         | 3,221       | 508,165   | 0.3             |        |  |
| ACADIA REALTY TRUST          | 54                | 76          | 1,826       | 288,094   | 0.2             |        |  |
| AGREE REALTY CORP            | 58                | 65          | 4,624       | 729,363   | 0.5             |        |  |
| ALEXANDER'S INC              | 1                 | 1           | 313         | 49,519    | 0.0             |        |  |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 90                | 99          | 9,856       | 1,554,728 | 1.0             |        |  |
| PROLOGIS INC                 | 537               | 591         | 62,458      | 9,851,527 | 6.5             |        |  |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST    | 15                | —           | —           | —         | —               |        |  |
| BRANDYWINE REALTY TRUST      | 96                | 115         | 652         | 102,924   | 0.1             |        |  |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 61                | 68          | 7,968       | 1,256,906 | 0.8             |        |  |
| NNN REIT INC                 | 105               | 119         | 4,829       | 761,761   | 0.5             |        |  |
| COPT DEFENSE PROPERTIES      | 67                | 71          | 2,225       | 351,034   | 0.2             |        |  |
| COUSINS PROPERTIES INC       | 90                | 106         | 3,260       | 514,260   | 0.3             |        |  |
| DIAMONDRock HOSPITALITY CO   | 126               | 137         | 1,230       | 194,043   | 0.1             |        |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 176               | 199         | 36,172      | 5,705,450 | 3.8             |        |  |
| EASTGROUP PROPERTIES INC     | 27                | 31          | 5,075       | 800,491   | 0.5             |        |  |
| EPR PROPERTIES               | 45                | 47          | 2,126       | 335,439   | 0.2             |        |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 108               | 121         | 8,262       | 1,303,236 | 0.9             |        |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 37                | 41          | 11,657      | 1,838,807 | 1.2             |        |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 122               | 135         | 20,440      | 3,224,134 | 2.1             |        |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST    | 42                | 48          | 5,342       | 842,618   | 0.6             |        |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR   | 77                | 84          | 4,240       | 668,818   | 0.4             |        |  |
| GETTY REALTY CORP            | 27                | 30          | 926         | 146,164   | 0.1             |        |  |
| WELLTOWER INC                | 322               | 377         | 47,502      | 7,492,523 | 5.0             |        |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC     | 63                | 67          | 2,082       | 328,435   | 0.2             |        |  |
| SERVICE PROPERTIES TRUST     | 100               | 100         | 253         | 39,982    | 0.0             |        |  |
| EQUITY COMMONWEALTH          | 63                | 68          | 125         | 19,817    | 0.0             |        |  |
| KILROY REALTY CORP           | 62                | 68          | 2,766       | 436,327   | 0.3             |        |  |
| KITE REALTY GROUP TRUST      | 125               | 139         | 3,482       | 549,298   | 0.4             |        |  |
| LXP INDUSTRIAL TRUST         | 174               | 184         | 1,489       | 234,962   | 0.2             |        |  |
| LTC PROPERTIES INC           | 24                | 28          | 986         | 155,551   | 0.1             |        |  |
| VERIS RESIDENTIAL INC        | 47                | 53          | 881         | 139,095   | 0.1             |        |  |
| BXP INC                      | 83                | 92          | 6,960       | 1,097,948 | 0.7             |        |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 365               | 387         | 1,608       | 253,684   | 0.2             |        |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 67                | 74          | 11,564      | 1,823,999 | 1.2             |        |  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC    | 24                | 28          | 2,000       | 315,462   | 0.2             |        |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 141               | 172         | 6,596       | 1,040,504 | 0.7             |        |  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC   | 9                 | 9           | 251         | 39,726    | 0.0             |        |  |
| REALTY INCOME CORP           | 421               | 558         | 29,766      | 4,695,132 | 3.1             |        |  |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) |        | 当<br>期<br>末 |           |        |
|-------------------------------|---------|--------|-------------|-----------|--------|
|                               | 口<br>数  | 口<br>数 | 評<br>価<br>額 |           | 比<br>率 |
|                               |         |        | 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        | %      |
| REGENCY CENTERS CORP          | 95      | 104    | 7,605       | 1,199,544 | 0.8    |
| SAUL CENTERS INC              | 8       | 8      | 314         | 49,543    | 0.0    |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST  | 131     | 131    | 302         | 47,689    | 0.0    |
| SL GREEN REALTY CORP          | 36      | 45     | 3,074       | 484,875   | 0.3    |
| SUN COMMUNITIES INC           | 72      | 76     | 9,537       | 1,504,344 | 1.0    |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC  | 113     | 128    | 1,516       | 239,121   | 0.2    |
| TANGER INC                    | 62      | 70     | 2,424       | 382,399   | 0.3    |
| CUBESMART                     | 130     | 144    | 6,108       | 963,462   | 0.6    |
| UDR INC                       | 174     | 191    | 8,253       | 1,301,767 | 0.9    |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME  | 7       | 7      | 271         | 42,786    | 0.0    |
| VENTAS INC                    | 233     | 267    | 15,611      | 2,462,376 | 1.6    |
| ELME COMMUNITIES              | 51      | 55     | 840         | 132,569   | 0.1    |
| UMH PROPERTIES INC            | 35      | 46     | 883         | 139,399   | 0.1    |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP     | 24      | 30     | 487         | 76,840    | 0.1    |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C  | 64      | 64     | 118         | 18,761    | 0.0    |
| CENTERSPACE                   | 8       | 10     | 689         | 108,733   | 0.1    |
| DOUGLAS EMMETT INC            | 95      | 107    | 2,035       | 321,062   | 0.2    |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST       | 74      | 74     | 998         | 157,514   | 0.1    |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A  | 73      | 83     | 755         | 119,208   | 0.1    |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN  | 78      | 78     | 226         | 35,747    | 0.0    |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC     | 29      | 29     | 785         | 123,966   | 0.1    |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC   | 61      | 74     | 508         | 80,178    | 0.1    |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU  | 30      | 30     | 29          | 4,668     | 0.0    |
| RLJ LODGING TRUST             | 95      | 95     | 951         | 150,056   | 0.1    |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT | 72      | 81     | 1,415       | 223,247   | 0.1    |
| STAG INDUSTRIAL INC           | 104     | 116    | 3,879       | 611,943   | 0.4    |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC    | 131     | 150    | 2,601       | 410,334   | 0.3    |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC   | 227     | 226    | 3,759       | 592,962   | 0.4    |
| WP CAREY INC                  | 126     | 139    | 7,665       | 1,209,063 | 0.8    |
| WHITESTONE REIT               | 27      | 27     | 397         | 62,691    | 0.0    |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES  | 35      | 38     | 3,989       | 629,205   | 0.4    |
| CHATHAM LODGING TRUST         | 29      | 29     | 264         | 41,640    | 0.0    |
| TERRENO REALTY CORP           | 49      | 63     | 3,735       | 589,124   | 0.4    |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC     | 81      | —      | —           | —         | —      |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN  | 38      | 55     | 561         | 88,628    | 0.1    |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN  | 122     | 141    | 5,540       | 873,907   | 0.6    |
| PHYSICIANS REALTY TRUST       | 140     | —      | —           | —         | —      |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A      | 184     | 202    | 7,552       | 1,191,322 | 0.8    |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC  | 34      | 34     | 105         | 16,603    | 0.0    |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A   | 78      | 87     | 897         | 141,603   | 0.1    |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC    | 176     | 193    | 5,337       | 841,928   | 0.6    |
| CARETRUST REIT INC            | 71      | 119    | 3,190       | 503,218   | 0.3    |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE  | 155     | 174    | 8,374       | 1,320,833 | 0.9    |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN  | 130     | 141    | 2,815       | 444,059   | 0.3    |
| IRON MOUNTAIN INC             | 169     | 187    | 19,798      | 3,122,793 | 2.1    |

| 銘<br>柄                       | 期首(前期末) |        | 当<br>期<br>末 |           |        |
|------------------------------|---------|--------|-------------|-----------|--------|
|                              | 口<br>数  | 口<br>数 | 評<br>価<br>額 |           | 比<br>率 |
|                              |         |        | 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        | %      |
| LAMAR ADVERTISING CO-A       | —       | 56     | 6,826       | 1,076,719 | 0.7    |
| URBAN EDGE PROPERTIES        | 69      | 79     | 1,695       | 267,504   | 0.2    |
| EQUINIX INC                  | 54      | 61     | 59,124      | 9,325,715 | 6.2    |
| PARAMOUNT GROUP INC          | 102     | 118    | 595         | 93,890    | 0.1    |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 57      | 65     | 755         | 119,111   | 0.1    |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC   | 64      | 64     | 950         | 149,892   | 0.1    |
| UNITI GROUP INC              | 146     | 162    | 891         | 140,678   | 0.1    |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES  | 44      | 45     | 1,756       | 277,019   | 0.2    |
| NEXPPOINT RESIDENTIAL        | 13      | 13     | 548         | 86,460    | 0.1    |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC   | 127     | 143    | 2,171       | 342,444   | 0.2    |
| GLOBAL NET LEASE INC         | 115     | 127    | 959         | 151,379   | 0.1    |
| CITY OFFICE REIT INC         | 25      | 25     | 142         | 22,549    | 0.0    |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST  | 52      | 61     | 1,664       | 262,520   | 0.2    |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 14      | 14     | 291         | 45,962    | 0.0    |
| FARMLAND PARTNERS INC        | 29      | 29     | 345         | 54,496    | 0.0    |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV  | 1,011   | 1,011  | 96          | 15,149    | 0.0    |
| PARK HOTELS & RESORTS INC    | 123     | 130    | 1,856       | 292,797   | 0.2    |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 200     | 217    | 15,445      | 2,436,273 | 1.6    |
| INVITATION HOMES INC         | 333     | 363    | 11,613      | 1,831,749 | 1.2    |
| JBG SMITH PROPERTIES         | 51      | 57     | 887         | 139,974   | 0.1    |
| ALEXANDER & BALDWIN INC      | 42      | 48     | 850         | 134,146   | 0.1    |
| CLIPPER REALTY INC           | 11      | —      | —           | —         | —      |
| GLADSTONE LAND CORP          | 18      | 18     | 204         | 32,257    | 0.0    |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC      | 36      | 36     | 277         | 43,818    | 0.0    |
| VICI PROPERTIES INC          | 601     | 672    | 19,821      | 3,126,414 | 2.1    |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC   | 153     | 167    | 3,619       | 570,892   | 0.4    |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 36      | 36     | 134         | 21,154    | 0.0    |
| BRIT APARTMENTS CORP         | 8       | 8      | 145         | 22,955    | 0.0    |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 17      | 17     | 1,201       | 189,560   | 0.1    |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY  | 92      | 111    | 3,518       | 555,018   | 0.4    |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 20      | 25     | 438         | 69,232    | 0.0    |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST      | 202     | 202    | —           | —         | —      |
| PRIME US REIT                | 348     | 383    | 67          | 10,578    | 0.0    |
| NETSTREIT CORP               | 39      | 55     | 776         | 122,409   | 0.1    |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT   | 477     | 477    | 97          | 15,446    | 0.0    |
| BROADSTONE NET LEASE INC     | 111     | 117    | 1,865       | 294,292   | 0.2    |
| APARTMENT INCOME REIT CO     | 83      | —      | —           | —         | —      |
| CTO REALTY GROWTH INC        | 12      | 16     | 327         | 51,609    | 0.0    |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 8       | 8      | 149         | 23,528    | 0.0    |
| POSTAL REALTY TRUST INC-A    | 11      | 11     | 154         | 24,304    | 0.0    |
| OUTFRONT MEDIA INC           | —       | 86     | 1,529       | 241,177   | 0.2    |
| ORION OFFICE REIT INC        | 36      | 36     | 141         | 22,314    | 0.0    |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 423     | 570    | 330         | 52,172    | 0.0    |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 69      | 78     | 2,927       | 461,810   | 0.3    |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES  | 15      | 9      | 285         | 45,048    | 0.0    |

| 銘柄                            | 期首(前期末)  |        | 当期末     |           |             |
|-------------------------------|----------|--------|---------|-----------|-------------|
|                               | 口数       | 口数     | 評価額     |           | 比率          |
|                               |          |        | 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        | %           |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP    | 39       | 50     | 1,517   | 239,308   | 0.2         |
| NEXPPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 16       | 30     | 187     | 29,514    | 0.0         |
| PEAKSTONE REALTY TRUST        | 21       | 21     | 248     | 39,209    | 0.0         |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY     | 8        | 8      | 272     | 42,914    | 0.0         |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC  | —        | 97     | 2,749   | 433,674   | 0.3         |
| LINEAGE INC                   | —        | 38     | 2,278   | 359,391   | 0.2         |
| MODIV INDUSTRIAL INC          | —        | 5      | 85      | 13,509    | 0.0         |
| CURBLINE PROPERTIES CORP      | —        | 61     | 1,441   | 227,392   | 0.2         |
| SILA REALTY TRUST INC         | —        | 35     | 851     | 134,293   | 0.1         |
| HOST HOTELS & RESORTS INC     | 408      | 446    | 7,787   | 1,228,366 | 0.8         |
| SAFEHOLD INC                  | 27       | 27     | 512     | 80,810    | 0.1         |
| PUBLIC STORAGE                | 92       | 100    | 30,225  | 4,767,526 | 3.2         |
| SIMON PROPERTY GROUP INC      | 189      | 195    | 34,463  | 5,435,997 | 3.6         |
| VORNADO REALTY TRUST          | 93       | 105    | 4,496   | 709,195   | 0.5         |
| KIMCO REALTY CORP             | 384      | 430    | 9,967   | 1,572,236 | 1.0         |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC     | 82       | 90     | 19,865  | 3,133,361 | 2.1         |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A   | 84       | 84     | 762     | 120,286   | 0.1         |
| 小計                            | 口数・金額    | 15,558 | 17,287  | 735,992   | 116,088,169 |
|                               | 銘柄数 <比率> | 140    | 142     | —         | <76.9%>     |
| (カナダ)                         |          |        | 千カナダドル  |           |             |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST  | 13       | 14     | 966     | 105,651   | 0.1         |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV  | 41       | 47     | 1,170   | 127,890   | 0.1         |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA  | 48       | 51     | 2,256   | 246,541   | 0.2         |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV  | 12       | 6      | 109     | 11,999    | 0.0         |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS  | 74       | 88     | 835     | 91,292    | 0.1         |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR   | 76       | 92     | 1,722   | 188,260   | 0.1         |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT  | 36       | 43     | 763     | 83,427    | 0.1         |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT  | 36       | 36     | 276     | 30,195    | 0.0         |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME  | 30       | 30     | 405     | 44,333    | 0.0         |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT  | 66       | 66     | 301     | 32,992    | 0.0         |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME  | 18       | —      | —       | —         | —           |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST  | 41       | 41     | 431     | 47,119    | 0.0         |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE  | 79       | 87     | 1,060   | 115,868   | 0.1         |
| MORGARD NORTH AMERICAN RESI   | 10       | 10     | 189     | 20,712    | 0.0         |
| CHOICE PROPERTIES REIT        | 92       | 103    | 1,395   | 152,446   | 0.1         |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR  | 29       | 29     | 430     | 47,093    | 0.0         |
| SLATE GROCERY REIT-CL U       | 20       | 20     | 279     | 30,595    | 0.0         |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE  | 34       | 39     | 688     | 75,243    | 0.0         |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E  | 5        | —      | —       | —         | —           |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE   | 12       | 12     | 166     | 18,186    | 0.0         |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN  | 64       | 64     | 1,111   | 121,517   | 0.1         |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T  | 52       | —      | —       | —         | —           |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT         | 14       | 27     | 210     | 22,976    | 0.0         |
| PRIMARIS REIT                 | 31       | 31     | 485     | 53,013    | 0.0         |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT T  | 13       | —      | —       | —         | —           |

| 銘柄                           |         | 期首(前期末) |     | 当期末    |           |     |
|------------------------------|---------|---------|-----|--------|-----------|-----|
|                              |         | 口数      | 口数  | 評価額    |           | 比率  |
|                              |         |         |     | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |     |
| (カナダ)                        |         | 千口      | 千口  | 千カナダドル | 千円        | %   |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT T |         | 13      | —   | —      | —         | —   |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME |         | —       | 19  | 1,396  | 152,656   | 0.1 |
| 小計                           | 口数・金額   | 969     | 966 | 16,654 | 1,820,015 |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 26      | 22  | —      | <1.2%>    |     |
| (ユーロ…ドイツ)                    |         |         |     | 千ユーロ   |           |     |
| HAMBORNER REIT AG            |         | 43      | 43  | 275    | 44,697    | 0.0 |
| 小計                           | 口数・金額   | 43      | 43  | 275    | 44,697    |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 1       | 1   | —      | <0.0%>    |     |
| (ユーロ…イタリア)                   |         |         |     |        |           |     |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ |         | 22      | 22  | 55     | 8,956     | 0.0 |
| 小計                           | 口数・金額   | 22      | 22  | 55     | 8,956     |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 1       | 1   | —      | <0.0%>    |     |
| (ユーロ…フランス)                   |         |         |     |        |           |     |
| GECINA SA                    |         | 30      | 33  | 3,000  | 487,502   | 0.3 |
| KLEPIERRE                    |         | 116     | 140 | 3,971  | 645,290   | 0.4 |
| COVIVIO                      |         | 27      | 33  | 1,648  | 267,770   | 0.2 |
| MERCIALYS                    |         | 54      | 59  | 605    | 98,367    | 0.1 |
| ICADE                        |         | 18      | 18  | 413    | 67,255    | 0.0 |
| ALTAREA                      |         | 2       | 3   | 368    | 59,858    | 0.0 |
| CARMILA                      |         | 31      | 34  | 559    | 90,898    | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    |         | 58      | 63  | 4,677  | 759,950   | 0.5 |
| 小計                           | 口数・金額   | 340     | 387 | 15,246 | 2,476,894 |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 8       | 8   | —      | <1.6%>    |     |
| (ユーロ…オランダ)                   |         |         |     |        |           |     |
| NSI NV                       |         | 12      | 12  | 243    | 39,632    | 0.0 |
| VASTNED RETAIL NV            |         | 6       | —   | —      | —         | —   |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV |         | 24      | 27  | 615    | 100,006   | 0.1 |
| WERELDHAVE NV                |         | 24      | 24  | 340    | 55,387    | 0.0 |
| 小計                           | 口数・金額   | 67      | 64  | 1,200  | 195,027   |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 4       | 3   | —      | <0.1%>    |     |
| (ユーロ…スペイン)                   |         |         |     |        |           |     |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM |         | 32      | —   | —      | —         | —   |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA  |         | 194     | 255 | 2,609  | 423,870   | 0.3 |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI |         | 170     | 211 | 1,098  | 178,496   | 0.1 |
| 小計                           | 口数・金額   | 397     | 466 | 3,707  | 602,367   |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 3       | 2   | —      | <0.4%>    |     |
| (ユーロ…ベルギー)                   |         |         |     |        |           |     |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUS |         | 17      | —   | —      | —         | —   |
| RETAIL ESTATES               |         | 6       | 7   | 455    | 73,959    | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA       |         | 100     | 114 | 2,154  | 349,986   | 0.2 |
| AEDIFICA                     |         | 28      | 30  | 1,688  | 274,261   | 0.2 |
| MONTEA NV                    |         | 9       | 13  | 830    | 134,841   | 0.1 |
| CARE PROPERTY INVEST         |         | 16      | 25  | 290    | 47,154    | 0.0 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV      |         | 16      | 21  | 643    | 104,611   | 0.1 |

| 銘柄                           |         | 期首(前期末) |       | 当期末      |           |     |
|------------------------------|---------|---------|-------|----------|-----------|-----|
|                              |         | 口数      | 口数    | 評価額      |           | 比率  |
|                              |         |         |       | 外貨建金額    | 邦貨換算金額    |     |
| (ユーロ…ベルギー)                   |         | 千口      | 千口    | 千ユーロ     | 千円        | %   |
| COFINIMMO                    |         | 21      | 24    | 1,365    | 221,773   | 0.1 |
| 小計                           | 口数・金額   | 217     | 237   | 7,426    | 1,206,588 |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 8       | 7     | —        | <0.8%>    |     |
| (ユーロ…アイルランド)                 |         |         |       |          |           |     |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES |         | 229     | 332   | 300      | 48,804    | 0.0 |
| 小計                           | 口数・金額   | 229     | 332   | 300      | 48,804    |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 1       | 1     | —        | <0.0%>    |     |
| (ユーロ…ガーニジー)                  |         |         |       |          |           |     |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD    |         | 19      | 19    | 680      | 110,505   | 0.1 |
| 小計                           | 口数・金額   | 19      | 19    | 680      | 110,505   |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 1       | 1     | —        | <0.1%>    |     |
| (ユーロ…シンガポール)                 |         |         |       |          |           |     |
| STONEWEG EUROPEAN REAL ESTAT |         | 199     | 199   | 317      | 51,533    | 0.0 |
| 小計                           | 口数・金額   | 199     | 199   | 317      | 51,533    |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 1       | 1     | —        | <0.0%>    |     |
| ユ一口計                         | 口数・金額   | 1,537   | 1,772 | 29,209   | 4,745,372 |     |
|                              | 銘柄数<比率> | 28      | 25    | —        | <3.1%>    |     |
| (イギリス)                       |         |         |       | 千イギリスポンド |           |     |
| BRITISH LAND CO PLC          |         | 533     | 643   | 2,330    | 456,859   | 0.3 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC   |         | 155     | 255   | 739      | 145,001   | 0.1 |
| HAMMERSOM PLC                |         | 2,333   | 282   | 786      | 154,216   | 0.1 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC    |         | 440     | 480   | 2,784    | 545,764   | 0.4 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES    |         | 742     | 851   | 788      | 154,596   | 0.1 |
| SEGRO PLC                    |         | 711     | 864   | 6,007    | 1,177,622 | 0.8 |
| WORKSPACE GROUP PLC          |         | 72      | 86    | 426      | 83,666    | 0.1 |
| BIG YELLOW GROUP PLC         |         | 112     | 123   | 1,164    | 228,256   | 0.2 |
| DERWENT LONDON PLC           |         | 63      | 70    | 1,385    | 271,590   | 0.2 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC    |         | 623     | 1,306 | 2,337    | 458,220   | 0.3 |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC       |         | 121     | 137   | 909      | 178,324   | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC      |         | 1,083   | 1,593 | 2,120    | 415,696   | 0.3 |
| ASSURA PLC                   |         | 1,769   | 1,889 | 722      | 141,674   | 0.1 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM |         | 308     | 308   | 159      | 31,185    | 0.0 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC |         | 372     | 461   | 389      | 76,383    | 0.1 |
| REGIONAL REIT LTD            |         | 125     | 105   | 123      | 24,150    | 0.0 |
| NEWRIVER REIT PLC            |         | 188     | 282   | 206      | 40,458    | 0.0 |
| UNITE GROUP PLC/THE          |         | 231     | 265   | 2,158    | 423,035   | 0.3 |
| CARE REIT PLC                |         | 246     | 246   | 203      | 39,796    | 0.0 |
| LXI REIT PLC                 |         | 989     | —     | —        | —         | —   |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT  |         | 464     | —     | —        | —         | —   |
| SOCIAL HOUSING REIT PLC      |         | 175     | 273   | 162      | 31,915    | 0.0 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD   |         | 360     | 360   | 228      | 44,736    | 0.0 |
| AEW UK REIT PLC              |         | 118     | 118   | 120      | 23,708    | 0.0 |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC      |         | 1,105   | 1,268 | 1,587    | 311,167   | 0.2 |
| BALANCED COMM PROPERTY TRUST |         | 417     | —     | —        | —         | —   |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE |         | 291     | 291   | 226      | 44,386    | 0.0 |

| 銘柄                           | 期首(前期末)  |        | 当期末        |           |           |
|------------------------------|----------|--------|------------|-----------|-----------|
|                              | 口数       | 口数     | 評価額        |           | 比率        |
|                              |          |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |           |
| (イギリス)                       | 千口       | 千口     | 千イギリスポンド   | 千円        | %         |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC  | 754      | 754    | 519        | 101,816   | 0.1       |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST  | 189      | 189    | 12         | 2,547     | 0.0       |
| HOME REIT PLC                | 398      | 398    | 151        | 29,746    | 0.0       |
| PRS REIT PLC/THE             | 310      | 310    | 341        | 66,863    | 0.0       |
| WAREHOUSE REIT PLC           | 260      | 260    | 204        | 40,180    | 0.0       |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC     | 260      | 318    | 330        | 64,722    | 0.0       |
| CLS HOLDINGS PLC             | 90       | 90     | 72         | 14,184    | 0.0       |
| HELICAL PLC                  | 60       | 60     | 107        | 21,025    | 0.0       |
| LIFE SCIENCE REIT PLC        | 209      | 209    | 79         | 15,665    | 0.0       |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC   | 371      | 371    | 311        | 61,133    | 0.0       |
| 小計                           | 口数・金額    | 17,066 | 15,533     | 30,200    | 5,920,295 |
|                              | 銘柄数 <比率> | 37     | 34         | —         | <3.9%>    |
| (オーストラリア)                    |          |        | 千オーストラリアドル |           |           |
| VICINITY CENTRES             | 2,220    | 2,476  | 5,348      | 525,633   | 0.3       |
| ABACUS GROUP                 | 258      | 258    | 294        | 28,938    | 0.0       |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP    | 236      | 236    | 1,104      | 108,549   | 0.1       |
| CHARTER HALL GROUP           | 270      | 305    | 4,477      | 440,031   | 0.3       |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 195      | 195    | 511        | 50,233    | 0.0       |
| CROMWELL PROPERTY GROUP      | 821      | 821    | 324        | 31,882    | 0.0       |
| REGION RE LTD                | 703      | 772    | 1,638      | 160,990   | 0.1       |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 156      | 156    | 379        | 37,260    | 0.0       |
| NATIONAL STORAGE REIT        | 744      | 910    | 2,157      | 211,976   | 0.1       |
| GDI PROPERTY GROUP           | 148      | —      | —          | —         | —         |
| DEXUS INDUSTRIA REIT         | 114      | 134    | 352        | 34,659    | 0.0       |
| SCENTRE GROUP                | 2,989    | 3,324  | 11,734     | 1,153,146 | 0.8       |
| ARENA REIT                   | 193      | 270    | 1,075      | 105,679   | 0.1       |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS   | 115      | 115    | 434        | 42,687    | 0.0       |
| WAYPOINT REIT                | 384      | 443    | 1,064      | 104,646   | 0.1       |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT  | 398      | 419    | 1,609      | 158,145   | 0.1       |
| CENTURIA OFFICE REIT         | 223      | 223    | 257        | 25,313    | 0.0       |
| RURAL FUNDS TRUST            | 228      | 228    | 405        | 39,829    | 0.0       |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT     | 327      | 327    | 945        | 92,870    | 0.1       |
| CENTURIA CAPITAL GROUP       | 502      | 502    | 905        | 88,960    | 0.1       |
| HOMEKO DAILY NEEDS REIT      | 1,044    | 1,180  | 1,387      | 136,345   | 0.1       |
| DEXUS/AU                     | 623      | 677    | 4,594      | 451,496   | 0.3       |
| HEALTHCO REIT                | 303      | 303    | 301        | 29,676    | 0.0       |
| HMC CAPITAL LTD              | 151      | —      | —          | —         | —         |
| ABACUS STORAGE KING          | 349      | 349    | 402        | 39,515    | 0.0       |
| GPT GROUP                    | 1,092    | 1,208  | 5,402      | 530,877   | 0.4       |
| MIRVAC GROUP                 | 2,346    | 2,530  | 4,795      | 471,219   | 0.3       |
| STOCKLAND                    | 1,373    | 1,532  | 7,509      | 737,912   | 0.5       |
| BWP TRUST                    | 286      | 378    | 1,265      | 124,341   | 0.1       |
| CHARTER HALL RETAIL REIT     | 320      | 320    | 1,026      | 100,869   | 0.1       |

| 銘柄                               |          | 期首(前期末) |        | 当期末         |            |     |
|----------------------------------|----------|---------|--------|-------------|------------|-----|
|                                  |          | 口数      | 口数     | 評価額         |            | 比率  |
|                                  |          |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |     |
| (オーストラリア)                        |          | 千口      |        | 千円          | 千円         | %   |
| GOODMAN GROUP                    |          | 1,004   | 1,220  | 44,581      | 4,381,049  | 2.9 |
| 小計                               | 口数・金額    | 20,131  | 21,825 | 106,286     | 10,444,735 |     |
|                                  | 銘柄数 <比率> | 31      | 29     | —           | <6.9%>     |     |
| (ニュージーランド)                       |          |         |        | 千ニュージーランドドル | —          | —   |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD          |          | 876     | —      | —           | —          | 0.1 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST           |          | 596     | 663    | 1,366       | 121,225    | —   |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP        |          | 831     | —      | —           | —          | —   |
| ARGOSY PROPERTY LTD              |          | 451     | —      | —           | —          | —   |
| 小計                               | 口数・金額    | 2,755   | 663    | 1,366       | 121,225    |     |
|                                  | 銘柄数 <比率> | 4       | 1      | —           | <0.1%>     |     |
| (香港)                             |          |         |        | 千香港ドル       | —          | —   |
| LINK REIT                        |          | 1,487   | 1,647  | 54,538      | 1,106,048  | 0.7 |
| CHAMPION REIT                    |          | 1,129   | 1,129  | 1,896       | 38,465     | 0.0 |
| PROSPERITY REIT                  |          | 760     | —      | —           | —          | —   |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT    |          | 1,304   | 1,304  | 1,238       | 25,122     | 0.0 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST      |          | 635     | 635    | 1,168       | 23,695     | 0.0 |
| FORTUNE REIT                     |          | 855     | 984    | 3,985       | 80,819     | 0.1 |
| 小計                               | 口数・金額    | 6,170   | 5,699  | 62,827      | 1,274,151  |     |
|                                  | 銘柄数 <比率> | 6       | 5      | —           | <0.8%>     |     |
| (シンガポール)                         |          |         |        | 千シンガポールドル   | —          | —   |
| SUNTEC REIT                      |          | 1,267   | 1,388  | 1,680       | 193,344    | 0.1 |
| KEPPEL REIT                      |          | 1,267   | 1,552  | 1,374       | 158,156    | 0.1 |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST          |          | 1,381   | 1,563  | 1,414       | 162,800    | 0.1 |
| ESR-REIT                         |          | 3,783   | 4,283  | 1,113       | 128,167    | 0.1 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS           |          | 427     | 427    | 378         | 43,559     | 0.0 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST        |          | 653     | 779    | 1,676       | 192,964    | 0.1 |
| STARHILL GLOBAL REIT             |          | 704     | 894    | 456         | 52,487     | 0.0 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST        |          | 1,896   | 2,207  | 2,869       | 330,265    | 0.2 |
| CAPITALAND CHINA TRUST           |          | 703     | 703    | 520         | 59,943     | 0.0 |
| AIMS APAC REIT                   |          | 411     | 411    | 526         | 60,541     | 0.0 |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE          |          | 234     | 268    | 1,015       | 116,841    | 0.1 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST       |          | 1,217   | 1,341  | 3,044       | 350,363    | 0.2 |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST     |          | 1,393   | 1,492  | 1,850       | 212,950    | 0.1 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST       |          | 677     | 677    | 416         | 47,928     | 0.0 |
| OUE REAL ESTATE INVESTMENT T     |          | —       | 1,449  | 413         | 47,553     | 0.0 |
| PARAGON REIT                     |          | 719     | —      | —           | —          | —   |
| KEPPEL DC REIT                   |          | 758     | 1,114  | 2,485       | 285,986    | 0.2 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL   |          | 1,768   | 1,907  | 1,707       | 196,472    | 0.1 |
| EC WORLD REIT                    |          | 199     | 199    | 55          | 6,425      | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT   |          | 272     | 272    | 186         | 21,481     | 0.0 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL      |          | 1,007   | 1,007  | 563         | 64,895     | 0.0 |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL |          | 2,909   | 3,534  | 6,962       | 801,237    | 0.5 |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT         |          | 2,052   | 2,267  | 5,986       | 688,952    | 0.5 |
| 小計                               | 口数・金額    | 25,705  | 29,744 | 36,698      | 4,223,319  |     |
|                                  | 銘柄数 <比率> | 22      | 22     | —           | <2.8%>     |     |

| 銘柄                           | 期首(前期末) |        | 当期末        |           |             |
|------------------------------|---------|--------|------------|-----------|-------------|
|                              | 口数      | 口数     | 評価額        |           | 比率          |
|                              |         |        | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |             |
| (韓国)                         |         | 千口     | 千韓国ウォン     | 千円        | %           |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD    | 44      | 65     | 378,553    | 40,580    | 0.0         |
| LOTTE REIT CO LTD            | 80      | 80     | 253,109    | 27,133    | 0.0         |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 96      | 96     | 428,797    | 45,967    | 0.0         |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD  | —       | 29     | 129,210    | 13,851    | 0.0         |
| JR GLOBAL REIT               | 87      | 115    | 320,636    | 34,372    | 0.0         |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT      | 18      | 30     | 128,179    | 13,740    | 0.0         |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD     | 42      | —      | —          | —         | —           |
| SK REITS CO LTD              | 62      | 88     | 405,816    | 43,503    | 0.0         |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD       | 32      | —      | —          | —         | —           |
| 小計                           | 口数・金額   | 463    | 506        | 2,044,303 | 219,149     |
|                              | 銘柄数<比率> | 8      | 7          | <0.1%>    |             |
| (イスラエル)                      |         |        | 千イスラエルシェケル |           |             |
| REIT 1 LTD                   | 109     | 109    | 2,127      | 92,079    | 0.1         |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 113     | 128    | 1,242      | 53,773    | 0.0         |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD    | 406     | 406    | 841        | 36,436    | 0.0         |
| 小計                           | 口数・金額   | 629    | 645        | 4,212     | 182,289     |
|                              | 銘柄数<比率> | 3      | 3          | <0.1%>    |             |
| 合計                           | 口数・金額   | 90,988 | 94,645     | —         | 145,038,724 |
|                              | 銘柄数<比率> | 305    | 290        | —         | <96.0%>     |

(注) 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) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

### 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別                       | 当期末 |       |     |
|---------------------------|-----|-------|-----|
|                           | 買建額 | 売建額   | 百万円 |
| 外国 不動産投信指数先物取引 DJREIT2503 |     | 5,726 | —   |

(注) 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。

## ○投資信託財産の構成

(2025年1月6日現在)

| 項<br>目       | 当<br>期<br>末       |           |
|--------------|-------------------|-----------|
|              | 評<br>価<br>額       | 比<br>率    |
| 投資証券         | 千円<br>145,038,724 | %<br>95.9 |
| コール・ローン等、その他 | 6,187,787         | 4.1       |
| 投資信託財産総額     | 151,226,511       | 100.0     |

(注) 期末における外貨建純資産（150,529,693千円）の投資信託財産総額（151,226,511千円）に対する比率は99.5%です。

(注) 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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                    |                      |               |                    |
|--------------------|----------------------|---------------|--------------------|
| 1 アメリカドル=157.73円   | 1 カナダドル=109.28円      | 1 ユーロ=162.46円 | 1 イギリスポンド=196.03円  |
| 1 オーストラリアドル=98.27円 | 1 ニュージーランドドル=88.72円  | 1 香港ドル=20.28円 | 1 シンガポールドル=115.08円 |
| 100韓国ウォン=10.72円    | 1 イスラエルシェケル=43.2737円 |               |                    |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月6日現在)

| 項目              | 当期末             |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 円               |
| コール・ローン等        | 151,857,797,411 |
| 投資証券(評価額)       | 3,823,178,325   |
| 未収入金            | 145,038,724,637 |
| 未収配当金           | 639,799,481     |
| 未収利息            | 596,932,044     |
| 差入委託証拠金         | 2,945           |
| 1,759,159,979   |                 |
| (B) 負債          | 827,396,515     |
| 未払金             | 825,462,824     |
| 未払解約金           | 1,933,691       |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 151,030,400,896 |
| 元本              | 50,590,420,686  |
| 次期繰越損益金         | 100,439,980,210 |
| (D) 受益権総口数      | 50,590,420,686口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 29,854円         |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 45,483,654,763円  
 期中追加設定元本額 9,006,897,706円  
 期中一部解約元本額 3,900,131,783円  
 また、1口当たり純資産額は、期末2,9854円です。

## ②期末における元本の内訳（当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額）

|                               |                 |
|-------------------------------|-----------------|
| e MAXIS S Slim バランス (8資産均等型)  | 13,105,164,787円 |
| e MAXIS Slim 先進国リートインデックス     | 11,510,194,281円 |
| つみたて8資産均等バランス                 | 6,816,478,992円  |
| e MAXIS 先進国リートインデックス          | 5,907,648,224円  |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド   | 3,360,170,969円  |
| オルタナティブ資産セレクション (ラップ向け)       | 2,255,227,190円  |
| e MAXIS バランス (8資産均等型)         | 2,249,533,160円  |
| 海外リートインデックスファンドS              | 1,073,547,894円  |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート           | 985,282,872円    |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド (標準型)    | 710,973,466円    |
| 三菱UFJ ブライムバランス (8資産) (確定拠出年金) | 639,673,830円    |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド (積極型)    | 503,114,993円    |
| e MAXIS 最適化バランス (マイミッドフィルダー)  | 321,502,070円    |
| e MAXIS 最適化バランス (マイフォワード)     | 274,896,162円    |
| e MAXIS バランス (波乗り型)           | 186,336,137円    |
| 三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド        | 129,975,206円    |
| e MAXIS 最適化バランス (マイストライカー)    | 120,809,151円    |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (2ヵ月分配型)    | 92,004,066円     |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド (成長型)       | 86,567,870円     |
| e MAXIS 最適化バランス (マイディフェンダー)   | 67,639,125円     |
| e MAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)   | 41,550,625円     |

## ○損益の状況 (2024年1月6日～2025年1月6日)

| 項目                 | 当期              |
|--------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益          | 円               |
| 受取配当金              | 5,387,850,351   |
| 受取利息               | 5,229,997,727   |
| その他収益金             | 154,086,555     |
| 支払利息               | 3,768,355       |
| △ 2,286            | △ 2,286         |
| (B) 有価証券売買損益       | 15,446,429,063  |
| 売買益                | 24,073,913,738  |
| 売買損                | △ 8,627,484,675 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 270,030,621   |
| 取引益                | 893,034,310     |
| 取引損                | △ 1,163,064,931 |
| (D) 保管費用等          | △ 59,160,484    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 20,505,088,309  |
| (F) 前期繰越損益金        | 70,973,839,137  |
| (G) 追加信託差損益金       | 15,916,287,464  |
| (H) 解約差損益金         | △ 6,955,234,700 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 100,439,980,210 |
| 次期繰越損益金(I)         | 100,439,980,210 |

(注) (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算によるものを含みます。

(注) (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) (H) 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。

|  |                 |
|--|-----------------|
| 先進国リートインデックスオープンV（適格機関投資家限定）                   | 35,992,349円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）                       | 35,220,452円     |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド（保守型）                      | 31,626,896円     |
| 世界8資産バランスファンドVL（適格機関投資家限定）                     | 22,530,668円     |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）                         | 10,019,081円     |
| eMAXIS／PayPay証券 全世界バランス                        | 9,248,865円      |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）スタンダードコース  | 2,985,263円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s                          | 2,097,903円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s                          | 1,165,306円      |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s                          | 999,597円        |
| マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）                     | 128,662円        |
| MUFG ウエルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース | 114,574円        |
| 合計   | 50,590,420,686円 |

## [お知らせ]

今後も資金流入が見込まれ信託金限度額に到達する可能性が高いため、信託金限度額の引き上げを行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2024年7月25日)