

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合 |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 信託期間 | 無期限【当初、2031年5月20日まで】(2021年5月25日設定) |
| 運用方針 | <p>投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式、債券、不動産投資信託証券、コモディティおよびオルタナティブ資産（非伝統的資産および非伝統的な運用手法における投資対象資産をいいます。）に投資を行います。また投資信託証券への投資を通じて、上記の各資産のデリバティブ取引を利用する場合があります。なお、上記の投資対象資産の一部のみに実質的な投資を行う場合があります。</p> <p>投資する投資信託証券は、指定投資信託証券の中から流動性等を勘案して選定します。なお、選定する投資信託証券は適宜見直しを行います。</p> <p>安定性を重視してあらかじめ設定した目標リスク水準に応じて各資産の資産配分比率を決定し、この比率に基づき、指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券に投資を行います。資産配分比率は、グローバル市場の長期見通しに関する分析等をふまえて定期的に決定します。ただし、市況動向等の事情によっては臨時に資産配分比率を決定することがあります。またグローバル市場の短期見通しを考慮し決定した資産配分比率を調整することがあります。なお当該調整を行う際、目標リスク水準どおりとならないことがあります。</p> <p>指定投資信託証券は定量・定性の評価等を勘案して適宜見直しを行います。この際、指定投資信託証券として指定されていた投資信託証券を指定から外したり、新たに投資信託証券（この投資信託の設定以降に設定された投資信託証券を含みます。）を指定投資信託証券として指定する場合があります。投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。</p> <p>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。</p> |
| 主要運用対象 | 投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | <p>株式への直接投資は行いません。</p> <p>投資信託証券への投資割合に制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。</p> |
| 分配方針 | <p>経費等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。</p> <p>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。）</p> |

運用報告書（全体版）

MUFG

ウェルス・インサイト・ファンド （保守型）



第3期（決算日：2024年5月20日）



信託期間を従来の2031年5月20日から無期限へ延長しました。

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「MUFG ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）」は、去る5月20日に第3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。



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。

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。

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 標準価額 | | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|----------------|---------------|------|------|------|--------|--------|--------|--------|------------|-------|
| | | 税分配 | み金騰 | 期中落 | | | | | | |
| (設定日) | 円 | 円 | % | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 2021年5月25日 | 10,000 | — | — | — | — | — | — | — | — | 20 |
| 1期(2022年5月20日) | 10,024 | 0 | 0.2 | 20.6 | 0.8 | 52.5 | 0.0 | 21.0 | 4,233 | |
| 2期(2023年5月22日) | 10,442 | 10 | 4.3 | 18.3 | 0.5 | 54.5 | 0.0 | 23.7 | 6,886 | |
| 3期(2024年5月20日) | 11,510 | 10 | 10.3 | 13.0 | 0.4 | 52.5 | 0.1 | 29.1 | 9,516 | |

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|-----------|-----------|-----------|-----------|---------------------|
| | 円 | 騰 落 率 | | | | | |
| (期 首) | 円 | % | % | % | % | % | % |
| 2023年5月22日 | 10,442 | — | 18.3 | 0.5 | 54.5 | 0.0 | 23.7 |
| 5月末 | 10,495 | 0.5 | 18.3 | 0.5 | 55.1 | 0.0 | 23.9 |
| 6月末 | 10,814 | 3.6 | 10.4 | 0.4 | 62.3 | 0.0 | 22.3 |
| 7月末 | 10,695 | 2.4 | 10.8 | 0.5 | 62.4 | 0.0 | 21.7 |
| 8月末 | 10,809 | 3.5 | 10.6 | 0.4 | 62.3 | 0.0 | 21.5 |
| 9月末 | 10,669 | 2.2 | 11.7 | 0.5 | 59.4 | 0.0 | 23.3 |
| 10月末 | 10,465 | 0.2 | 11.7 | 0.4 | 57.1 | 0.0 | 25.9 |
| 11月末 | 10,866 | 4.1 | 12.0 | 0.3 | 58.4 | 0.0 | 26.5 |
| 12月末 | 10,927 | 4.6 | 12.7 | 0.5 | 56.8 | 0.0 | 26.4 |
| 2024年1月末 | 11,099 | 6.3 | 12.9 | 0.4 | 57.0 | 0.0 | 26.1 |
| 2月末 | 11,236 | 7.6 | 13.2 | 0.4 | 57.2 | 0.0 | 26.0 |
| 3月末 | 11,421 | 9.4 | 13.3 | 0.5 | 53.7 | 0.0 | 29.3 |
| 4月末 | 11,460 | 9.7 | 13.1 | 0.4 | 52.8 | 0.1 | 29.5 |
| (期 末) | | | | | | | |
| 2024年5月20日 | 11,520 | 10.3 | 13.0 | 0.4 | 52.5 | 0.1 | 29.1 |

(注) 当ファンドの基準価額は、投資対象とする投資信託証券については、前営業日の基準価額を基に計算しております。

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(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。

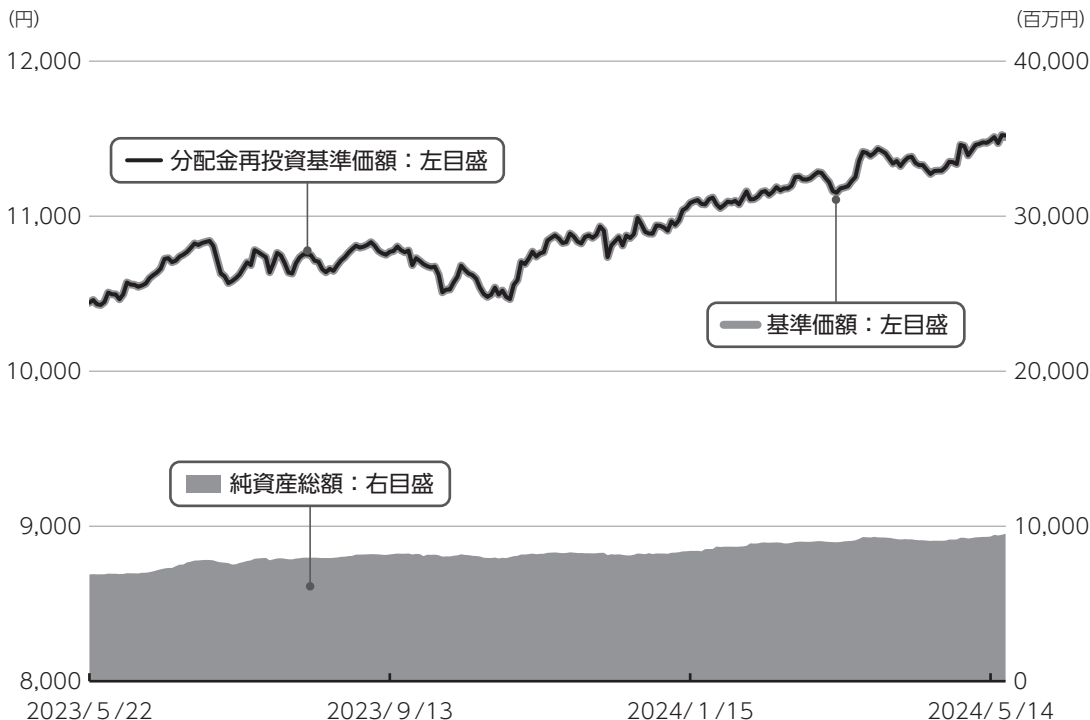
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第3期：2023年5月23日～2024年5月20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3期首 | 10,442円 |
| 第3期末 | 11,510円 |
| 既払分配金 | 10円 |
| 騰落率 | 10.3% |

(分配金再投資ベース)

※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はありません。

※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10.3%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

投資対象ファンド別では主に米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンドなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

第3期：2023年5月23日～2024年5月20日

▶ 投資環境について

▶ 株式市況

先進国の株式市況は、一部企業の好調な決算などを背景に、上昇しました。新興国の株式市況は上昇しました。

▶ 債券市況

先進国の債券市況は、主要中央銀行による利下げ観測などを背景に、上昇しました。国内債券市況は、下落しました。新興国の債券市況は、上昇しました。

▶ リート市況

先進国のリート市況は、主要中央銀行による利下げ観測などを背景に、主要先進国の金利上昇が一服したことなどから、上昇しました。国内リート市況は、下落しました。

▶ 商品市況

原油は、地政学リスクの高まりが原油供給に悪影響を与えるとの見方が強まったことなどから、上昇しました。

金価格は、中東情勢の緊張などを背景に安全資産としての需要が高まったことなどから、上昇しました。

▶ 為替市況

米ドルは日米金利差拡大などから、対円で上昇しました。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

投資信託証券への投資を通じて、主として、日本を含む世界各国の株式、債券、不動産投資信託証券（リート）に分散投資を行いました。

投資にあたっては、三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社 投資顧問部からの投資助言を基に、当ファンドの目標リスク水準（年率標準偏差6.0%程度）に応じて各投資信託証券の組入比率を決定し、この比率に基づいて投資を行いました。

※目標リスク水準は、ファンドの価格変動リスクの目安を表示したものです。ファンドのポートフォリオを構築する際の目標値として使用するものであり、リターンや利回りを示したものではありません。なお、ファ

ンドの実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があり、運用成果を保証するものではありません。

長期市場見通しに基づく資産配分比率を2023年6月に見直し、米国投資適格債券などを中心に配分比率を調整しました。

短期市場見通しに基づくアセットアロケーションについて、6月と9月には、新興国債券などの資産配分比率を調整しました。10月には新興国債券、米国投資適格債券の資産配分比率を調整しました。12月と2024年3月には、米国ハイイールド債券などの資産配分比率を調整しました。

（ご参考）

■ 組入比率

| 資産区分 | 指定投資信託証券の名称 | 期首 | 期末 |
|------|---------------------------------|-------|-------|
| 株式 | TOPIXマザーファンド | 6.2% | 5.0% |
| | S&P500インデックスマザーファンド | 11.0% | 6.3% |
| | 新興国株式インデックスマザーファンド | 1.8% | 2.1% |
| | iシェアーズ・ストックス・ヨーロッパ600 UCITS ETF | 0.9% | 1.8% |
| 債券 | 日本債券インデックスマザーファンド | 40.1% | 33.8% |
| | 米国国債7-10年ラダーマザーファンド | 4.1% | 7.9% |
| | 米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド | 10.8% | 11.5% |
| | iシェアーズ・コア・ユーロ国債 UCITS ETF | 1.8% | 3.2% |
| | 米国投資適格債券マザーファンド | 4.8% | 12.0% |
| | 米国ハイイールド債券マザーファンド | 11.0% | 6.4% |
| リート | 東証REIT指数マザーファンド | 4.9% | 4.3% |
| | MUAMGRREITマザーファンド | 0.6% | 1.9% |

（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

（注）上記は指定投資信託証券の中から選定した投資信託証券を記載しています。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。従って、ベンチマークおよび参考指数との対比は表記できません。

▶ 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す。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、1万円当たり、税込み）

| 項目 | 第3期 |
|----------------|-----------------------|
| | 2023年5月23日～2024年5月20日 |
| 当期分配金（対基準価額比率） | 10（0.087%） |
| 当期の収益 | 10 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,510 |

（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。）

グローバル市場についての長期および短期見直しに関する分析をふまえ、日本を含む世界各国の様々な資産に分散投資を行っていきます。

分散投資の枠組みの維持と適切な基本資産配分比率の管理を通じて、目標リスク水準（年率標準偏差6.0%程度）に沿った運用を行い、中長期に渡ってファンド価値の増大を目指します。

2023年5月23日～2024年5月20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 | 133 | 1.220 | (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） | (79) | (0.722) | 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） | (51) | (0.470) | 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） | (3) | (0.027) | 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 | 1 | 0.005 | (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 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) | (0.004) | |
| （先物・オプション） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | (0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | (0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 2 | 0.015 | (d) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| （保管費用） | (1) | (0.011) | 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 |
| （監査費用） | (0) | (0.003) | 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) | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計 | 136 | 1.241 | |

期中の平均基準価額は、10,910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まず。

(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

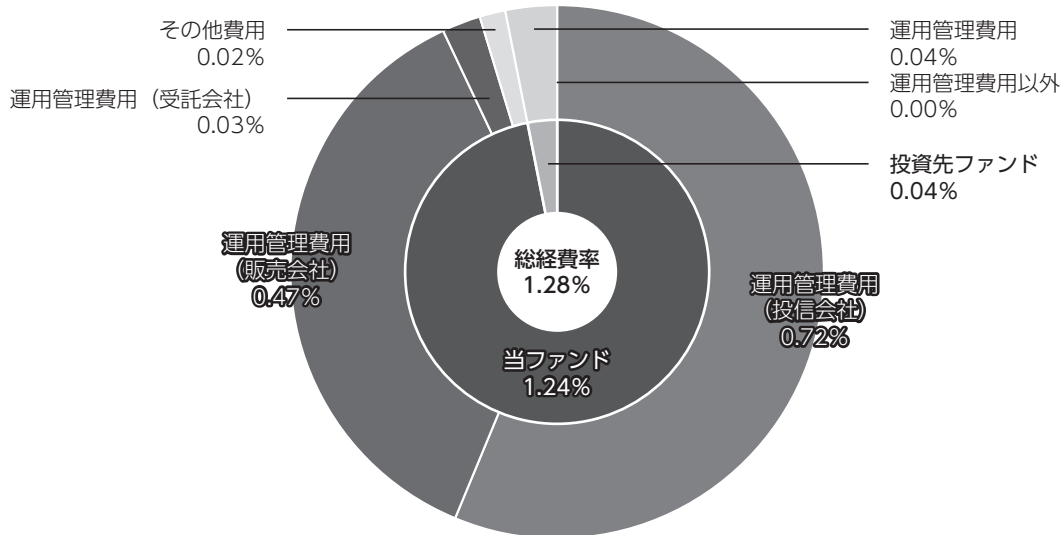
(注) 当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当たりの費用明細」が取得できるものについては「組入れ上位ファンドの概要」に表示することとしております。

(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1.28%**です。



| | | |
|----------------------|-----|------|
| 総経費率 (①+②+③) | (%) | 1.28 |
| ①当ファンドの費用の比率 | (%) | 1.24 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | (%) | 0.04 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | (%) | 0.00 |

(注) ①の費用は、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) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用の内訳が開示されていない場合、運用管理費用を最大と想定し算出してあります。

(注) 入手し得る情報において含まれていない費用はありません。

(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

(2023年5月23日～2024年5月20日)

投資信託証券

| 銘 | 柄 | 買付 | | 売付 | |
|---|-------------------------------|----|-------|----|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 | ユーロ | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| | ドイツ | | | | |
| | I SHARES STOXXE600 DE EUR DIS | 10 | 486 | — | — |
| | 小計 | 10 | 486 | — | — |
| 国 | アイルランド | | | | |
| | I SHARES CORE EURO GOVT BOND | 14 | 1,586 | 6 | 658 |
| | 小計 | 14 | 1,586 | 6 | 658 |
| | ユーロ計 | 24 | 2,072 | 6 | 658 |

(注) 金額は受渡代金。

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 | 柄 | 設定 | | 解約 | |
|---------------------------|---|-----------|-----------|---------|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | | 87,544 | 202,760 | 42,130 | 101,000 |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | | 9,173 | 30,370 | — | — |
| 東証REIT指数マザーファンド | | 57,389 | 204,640 | 37,259 | 131,000 |
| S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド | | 32,098 | 146,000 | 126,294 | 496,370 |
| 米国国債7-10年ラダーマザーファンド | | 450,075 | 580,990 | 142,122 | 185,840 |
| 米国ハイイールド債券マザーファンド | | 281,871 | 417,110 | 501,488 | 675,480 |
| 米国投資適格債券マザーファンド | | 899,391 | 1,106,660 | 348,100 | 432,680 |
| 米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド | | 898,899 | 928,050 | 766,887 | 836,690 |
| T O P I Xマザーファンド | | 42,959 | 120,660 | 66,520 | 194,190 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | | 1,061,672 | 1,365,110 | 592,165 | 765,970 |

○株式売買比率

(2023年5月23日～2024年5月20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 | | | |
|-----|-----------------|-----------------------|--------------------|---------------------------|------------------|
| | | MUAM G-R E I Tマザーファンド | 新興国株式インデックスマザーファンド | S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド | T O P I Xマザーファンド |
| (a) | 期中の株式売買金額 | 31,045千円 | 317,017,335千円 | 1,548,116,695千円 | 672,645,312千円 |
| (b) | 期中の平均組入株式時価総額 | —千円 | 554,197,122千円 | 3,053,492,774千円 | 1,201,545,736千円 |
| (c) | 売買高比率 (a) / (b) | — | 0.57 | 0.50 | 0.55 |

(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23日～2024年5月20日）

利害関係人との取引状況

<MUF G ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-----|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |

<MUAM G-REITマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-----|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |

平均保有割合 0.2%

※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。

<新興国株式インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-----|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |

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。

<東証REIT指数マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-------------|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |
| 不動産投信指数先物取引 | 10,320 | 4,279 | 41.5 | 9,265 | 6,123 | 66.1 |

平均保有割合 0.3%

※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。

<S&P500インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|------------------|------------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 1,389,529 | 百万円 1,198,498 | % 86.3 | 百万円 17,977 | 百万円 16,857 | % 93.8 |

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ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

<米国国債7-10年ラダーマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 10,128 | 百万円 3,761 | % 37.1 | 百万円 12,388 | 百万円 6,528 | % 52.7 |

平均保有割合 2.1%

※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。

<米国ハイイールド債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 14,814 | 百万円 7,384 | % 49.8 | 百万円 10,024 | 百万円 10,024 | % 100.0 |

平均保有割合 5.0%

※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。

<米国投資適格債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|--------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 26,401 | 百万円 25,478 | % 96.5 | 百万円 3,616 | 百万円 3,594 | % 99.4 |

平均保有割合 4.3%

※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。

<米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 18,626 | 百万円 16,292 | % 87.5 | 百万円 11,565 | 百万円 11,565 | % 100.0 |

平均保有割合 7.1%

※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。

<TOPIXマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 434,953 | 百万円 60,024 | % 13.8 | 百万円 237,691 | 百万円 23,549 | % 9.9 |

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。

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 公社債 | 百万円 452,662 | 百万円 92,877 | % 20.5 | 百万円 213,400 | 百万円 39,638 | % 18.6 |

平均保有割合 0.4%

※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。

(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

<TOPIXマザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|---------------|--------------|---------------|
| 株式 | 百万円 10,067 | 百万円 5,579 | 百万円 37,909 |

<日本債券インデックスマザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|--------------|--------------|--------------|
| 公社債 | 百万円 1,094 | 百万円 2,699 | 百万円 2,110 |

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 1,782 |

<TOPIXマザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|------------|
| 株式 | 百万円 883 |

<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 18,501 |

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) | 437千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0.645千円 |
| (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を含みます。

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

（2024年5月20日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| 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…ドイツ) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| ISHARES STOXXE600 DE EUR DIS | 9 | 19 | 1,020 | 173,038 | 1.8 |
| 小 計 | 9 | 19 | 1,020 | 173,038 | 1.8 |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | |
| ISHARES CORE EURO GOVT BOND | 7 | 16 | 1,786 | 302,933 | 3.2 |
| 小 計 | 7 | 16 | 1,786 | 302,933 | 3.2 |
| 合 計 | 16 | 35 | 2,806 | 475,971 | 5.0 |

(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) 比率はM U F G ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）の純資産総額に対する比率。

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | | 千口 | 千口 | 千円 |
| | | 19,256 | 64,670 | 179,233 |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | | 38,745 | 47,918 | 195,274 |
| 東証REIT指数マザーファンド | | 95,375 | 115,504 | 409,060 |
| S&P500インデックスマザーファンド | | 206,880 | 112,684 | 600,698 |
| 米国国債7-10年ラダーマザーファンド | | 226,699 | 534,651 | 750,757 |
| 米国ハイイールド債券マザーファンド | | 613,661 | 394,045 | 611,597 |
| 米国投資適格債券マザーファンド | | 285,470 | 836,762 | 1,140,758 |
| 米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド | | 762,937 | 894,949 | 1,098,461 |
| TOPIXマザーファンド | | 164,535 | 140,973 | 478,634 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | | 2,106,034 | 2,575,541 | 3,221,230 |

○有価証券の貸付及び借入の状況

東証REIT指数マザーファンドにおいて、2024年5月20日現在における貸付口数の総口数は21,046口です。

TOPIXマザーファンドにおいて、2024年5月20日現在における貸付株数の総株数は15,456,100株です。

○投資信託財産の構成

（2024年5月20日現在）

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資証券 | 475,971 | 5.0 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド | 179,233 | 1.9 |
| 新興国株式インデックスマザーファンド | 195,274 | 2.0 |
| 東証REIT指数マザーファンド | 409,060 | 4.3 |
| S&P500インデックスマザーファンド | 600,698 | 6.3 |
| 米国国債7-10年ラダーマザーファンド | 750,757 | 7.8 |
| 米国ハイイールド債券マザーファンド | 611,597 | 6.4 |
| 米国投資適格債券マザーファンド | 1,140,758 | 11.9 |
| 米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド | 1,098,461 | 11.5 |
| T O P I Xマザーファンド | 478,634 | 5.0 |
| 日本債券インデックスマザーファンド | 3,221,230 | 33.6 |
| コール・ローン等、その他 | 423,251 | 4.3 |
| 投資信託財産総額 | 9,584,924 | 100.0 |

(注) MUAM G-R E I Tマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（135,053,461千円）の投資信託財産総額（135,177,297千円）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（845,286,348千円）の投資信託財産総額（845,826,992千円）に対する比率は99.9%です。

(注) S & P 5 0 0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（4,819,320,572千円）の投資信託財産総額（4,825,845,412千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 米国国債7-10年ラダーマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（30,545,003千円）の投資信託財産総額（30,702,257千円）に対する比率は99.5%です。

(注) 米国ハイイールド債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（16,115,421千円）の投資信託財産総額（16,750,181千円）に対する比率は96.2%です。

(注) 米国投資適格債券マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産（31,098,455千円）の投資信託財産総額（31,861,589千円）に対する比率は97.6%です。

(注) 米ドル建て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（19,796,327千円）の投資信託財産総額（19,807,813千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 期末における外貨建純資産（480,037千円）の投資信託財産総額（9,584,924千円）に対する比率は5.0%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=155.91円 | 1 カナダドル=114.58円 | 1 メキシコペソ=9.3991円 | 1 ブラジルリアル=30.5323円 |
| 100チリペソ=17.4894円 | 100コロンビアペソ=4.0696円 | 1 ユーロ=169.57円 | 1 イギリスポンド=198.10円 |
| 1 トルコリラ=4.8497円 | 1 チェココルナ=6.8659円 | 100ハンガリーフォリント=43.8171円 | 1 ポーランドズロチ=39.7888円 |
| 1 オーストラリアドル=104.51円 | 1 ニューゼalandドル=95.65円 | 1 香港ドル=19.98円 | 1 シンガポールドル=115.94円 |
| 1 マレーシアリンギット=33.2564円 | 1 タイバーツ=4.31円 | 1 フィリピンペソ=2.7054円 | 100インドネシアルピア=0.98円 |
| 100韓国ウォン=11.51円 | 1 ニュー台湾ドル=4.8384円 | 1 インドルピー=1.88円 | 1 オフショア元=21.5513円 |
| 1 アラブディルハム=42.52円 | 1 クウェートディナール=508.35円 | 1 サウジアラビアリアル=41.63円 | 1 イスラエルシェケル=42.0193円 |
| 1 カタールリアル=42.84円 | 1 南アフリカランド=8.58円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年5月20日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 9,584,924,278 |
| コール・ローン等 | 423,246,157 |
| 投資証券(評価額) | 475,971,739 |
| MUAM G-R E I Tマザーファンド(評価額) | 179,233,503 |
| 新興国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 195,274,256 |
| 東証R E I T指数マザーファンド(評価額) | 409,060,004 |
| S & P 5 0 0インデックスマザーファンド(評価額) | 600,698,031 |
| 米国国債7-10年ラダーマザーファンド(評価額) | 750,757,945 |
| 米国ハイイールド債券マザーファンド(評価額) | 611,597,334 |
| 米国投資適格債券マザーファンド(評価額) | 1,140,758,231 |
| 米国建て新興国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 1,098,461,401 |
| T O P I Xマザーファンド(評価額) | 478,634,795 |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 3,221,230,143 |
| 未収利息 | 739 |
| (B) 負債 | 68,461,157 |
| 未払収益分配金 | 8,267,877 |
| 未払解約金 | 7,063,691 |
| 未払信託報酬 | 53,006,044 |
| その他未払費用 | 123,545 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 9,516,463,121 |
| 元本 | 8,267,877,088 |
| 次期繰越損益金 | 1,248,586,033 |
| (D) 受益権総口数 | 8,267,877,088口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,510円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 6,594,751,700円
 期中追加設定元本額 3,701,542,709円
 期中一部解約元本額 2,028,417,321円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1510円です。

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2023年5月23日～ 2024年5月20日 |
|---------------------------|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 191,831,543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 | 543,792,321円 |
| 収益調整金額 | 404,623,094円 |
| 分配準備積立金額 | 116,606,952円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 1,256,853,910円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 1,520円 |
| 1万口当たり分配金額 | 10円 |
| 収益分配金金額 | 8,267,877円 |

○損益の状況（2023年5月23日～2024年5月20日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 6,478,174 |
| 受取配当金 | 6,267,400 |
| 受取利息 | 49,223 |
| その他収益金 | 5,777 |
| 支払利息 | 155,774 |
| (B) 有価証券売買損益 | 830,760,258 |
| 売買益 | 1,034,054,514 |
| 売買損 | △ 203,294,256 |
| (C) 信託報酬等 | △ 101,614,568 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 735,623,864 |
| (E) 前期繰越損益金 | 116,606,952 |
| (F) 追加信託差損益金 | 404,623,094 |
| (配当等相当額) | (95,828,664) |
| (売買損益相当額) | (308,794,430) |
| (G) 計(D+E+F) | 1,256,853,910 |
| (H) 収益分配金 | △ 8,267,877 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 1,248,586,033 |
| 追加信託差損益金 | 404,623,094 |
| (配当等相当額) | (102,047,238) |
| (売買損益相当額) | (302,575,856) |
| 分配準備積立金 | 843,962,939 |

- (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。

○分配金のお知らせ

| | |
|-----------------|-----|
| 1 万口当たり分配金（税込み） | 10円 |
|-----------------|-----|

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

*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】

- ①有価証券の貸付（マザーファンドで貸付を行った場合を含む）の品貸料の一部を信託報酬として収受可能とするための記載を追加し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年8月22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新N I S A（成長投資枠）の要件対応のため、信託期間を延長（無期限化）し、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年11月2日)
- ④新N I S A（成長投資枠）の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年12月29日)
- ⑤M U F G ウェルス・インサイト・ファンドのシリーズファンド新規設定に伴い、スイッチング対象および償還条項の変更を行うため、信託約款に所要の変更を行いました。
(2024年5月13日)

T O P I X 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]

「T O P I X 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（T O P I X）（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。 |
| 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 | | 東証株価指数 (T O P I X) (配当込み) | | 株組入比率 | 株先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|---------------------------------|-------|-------|-------|-----------|
| | 期騰落率 | 期中騰落率 | 期騰落率 | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 19期(2020年3月25日) | 15,695 | △ 7.3 | 2,174.58 | △ 7.4 | 95.4 | 4.2 | 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) 東証株価指数（T O P I X）（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数です。T O P I X の指数値及び T O P I X に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など T O P I X に関するすべての権利・ノウハウ及び T O P I X に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X 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 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 株 価 指 数 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|----------------------|---------|-------|-------------------|-------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | (TOPIX) (配当込み) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2023年 3月27日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 23,227 | — | 3,217.73 | — | 100.8 | 1.4 |
| 3 月末 | 24,001 | 3.3 | 3,324.74 | 3.3 | 98.1 | 1.9 |
| 4 月末 | 24,649 | 6.1 | 3,414.45 | 6.1 | 98.3 | 1.5 |
| 5 月末 | 25,540 | 10.0 | 3,537.93 | 10.0 | 98.2 | 1.3 |
| 6 月末 | 27,469 | 18.3 | 3,805.00 | 18.3 | 98.3 | 1.0 |
| 7 月末 | 27,880 | 20.0 | 3,861.80 | 20.0 | 99.2 | 0.6 |
| 8 月末 | 28,000 | 20.5 | 3,878.51 | 20.5 | 99.3 | 0.7 |
| 9 月末 | 28,145 | 21.2 | 3,898.26 | 21.1 | 98.0 | 1.3 |
| 10 月末 | 27,305 | 17.6 | 3,781.64 | 17.5 | 98.9 | 1.4 |
| 11 月末 | 28,784 | 23.9 | 3,986.65 | 23.9 | 98.8 | 1.0 |
| 12 月末 | 28,722 | 23.7 | 3,977.63 | 23.6 | 99.9 | 0.3 |
| 2024年 1 月末 | 30,966 | 33.3 | 4,288.36 | 33.3 | 98.6 | 0.9 |
| 2 月末 | 32,490 | 39.9 | 4,499.61 | 39.8 | 99.1 | 0.6 |
| (期 末) 2024年 3月25日 | 33,729 | 45.2 | 4,671.17 | 45.2 | 99.4 | 0.7 |

(注) 騰落率は期首比。

(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（T O P I X）（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、乖離は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 | 円 | % | (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 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 | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| 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あります。

(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あります。

○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 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 158,320 | 367,806,306 | 103,472 | 221,861,655 |
| | | (141,005) | (24,138) | | |

(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 | 千円 | 千円 | 証券 | 千円 |
| | — | — | — | — | — |
| | (63,400) | (—) | (63,400) | (—) | (—) |

(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 173,269 | 百万円 179,468 | 百万円 - | 百万円 - |

○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 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|--------------------|----------------|------|--------------------|----------------|-----|
| | うち利害関係人 との取引状況B | B A | % | うち利害関係人 との取引状況D | D C | % |
| 株式 | 百万円 41,519 | 百万円 367,806 | 11.3 | 百万円 5,228 | 百万円 221,861 | 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 7,975 | 百万円 5,258 | 百万円 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 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 目 | 当 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MUFJ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 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | |
| 極洋 | 16.3 | 20.6 | 79,516 | |
| ニッセイ | 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 | |
| 鉱業 (0.3%) | | | | |
| 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 | |
| 建設業 (2.1%) | | | | |
| 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 | |
| Robot Home | 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 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 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 | |
| 飛鳥建設 | 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 | |
| 銭高組 | 2.5 | 1.9 | 8,483 | |
| 鹿島建設 | 665.6 | 773.9 | 2,429,272 | |
| 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 | |
| ナカノフドー建設 | 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 | |
| 浅沼組 | 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 | |
|------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東亜建設工業 | 25.7 | 26.9 | 137,997 | |
| 日本国土開発 | 90 | 99.3 | 52,331 | |
| 若築建設 | 13.4 | 12.1 | 44,346 | |
| 東洋建設 | 97.2 | 87.9 | 126,136 | |
| 五洋建設 | 425.6 | 494.8 | 385,053 | |
| 世紀東急工業 | 39.6 | 44.8 | 87,404 | |
| 福田組 | 11.3 | 13.2 | 75,108 | |
| 住友林業 | 230.3 | 301.7 | 1,366,399 | |
| 日本基礎技術 | 15.7 | 9 | 4,626 | |
| 巴コーポレーション | 24.5 | 18.7 | 12,379 | |
| 大和ハウス工業 | 838.9 | 965.2 | 4,366,564 | |
| ライト工業 | 57.2 | 71.8 | 140,656 | |
| 積水ハウス | 940.4 | 1,058.6 | 3,614,060 | |
| 日特建設 | 28.6 | 33.3 | 39,926 | |
| 北陸電気工事 | 20.6 | 23.9 | 28,990 | |
| ユアテック | 66.1 | 76.9 | 113,119 | |
| 日本リーテック | 19.8 | 27.3 | 36,008 | |
| 四電工 | 12.6 | 14.6 | 58,911 | |
| 中電工 | 46.6 | 54.2 | 166,123 | |
| 関電工 | 164.5 | 218.6 | 377,740 | |
| きんでん | 211.3 | 245.7 | 673,709 | |
| 東京エネシス | 29.9 | 34.7 | 42,021 | |
| トーエネック | 10 | 11.6 | 67,512 | |
| 住友電設 | 28.6 | 33.2 | 111,552 | |
| 日本電設工業 | 49.3 | 65.5 | 136,829 | |
| エクシオグループ | 138.3 | 170.6 | 564,344 | |
| 新日本空調 | 16.7 | 22.6 | 79,891 | |
| 九電工 | 73 | 75.4 | 484,671 | |
| 三機工業 | 66.6 | 75.4 | 161,431 | |
| 日揮ホールディングス | 296.9 | 345.3 | 521,748 | |
| 中外炉工業 | 9.8 | 11.4 | 35,397 | |
| ヤマト | 16.1 | 12.4 | 13,255 | |
| 太平電業 | 18.6 | 21.7 | 98,084 | |
| 高砂熱学工業 | 72.4 | 93.5 | 446,930 | |
| 三晃金属工業 | 2.7 | 1.9 | 9,918 | |
| 朝日工業社 | 12.5 | 16.3 | 55,746 | |
| 明星工業 | 51.6 | 67.5 | 91,395 | |
| 大気社 | 36.1 | 40.2 | 190,950 | |
| ダイダン | 19.7 | 45.9 | 112,684 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日比谷総合設備 | 25.8 | 25.3 | 75,697 | |
| フィル・カンパニー | 5.3 | 5.4 | 4,773 | |
| テスホールディングス | 32.3 | 75.2 | 34,667 | |
| インフロニア・ホールディングス | 314.6 | 402.4 | 598,167 | |
| 東洋エンジニアリング | 39.7 | 51.3 | 49,196 | |
| レイズネクスト | 43.4 | 50.5 | 119,382 | |
| 食料品 (3.1%) | | | | |
| ニッポン | 81.2 | 104.9 | 252,599 | |
| 日清製粉グループ本社 | 278.7 | 324 | 703,890 | |
| 日東富士製粉 | 5.4 | 6.2 | 33,294 | |
| 昭和産業 | 26.3 | 33.9 | 120,853 | |
| 鳥越製粉 | 15.6 | 12.4 | 8,928 | |
| 中部飼料 | 41.7 | 48.5 | 59,218 | |
| フィード・ワン | 44 | 51.2 | 51,712 | |
| 東洋精糖 | 3.7 | 2.8 | 7,120 | |
| 日本甜菜製糖 | 17.5 | 20.4 | 44,206 | |
| DM三井製糖ホールディングス | 29.9 | 34.8 | 114,144 | |
| 塩水港精糖 | 25.7 | 19.6 | 6,095 | |
| ウエルネオシュガー | 15.6 | 17.5 | 42,017 | |
| 森永製菓 | 55.8 | 150 | 397,875 | |
| 中村屋 | 7.5 | 8.7 | 28,014 | |
| 江崎グリコ | 86.2 | 100.2 | 431,761 | |
| 名糖産業 | 11.9 | 13.8 | 25,116 | |
| 井村屋グループ | 16.5 | 20.9 | 54,319 | |
| 不二家 | 20.7 | 24 | 59,688 | |
| 山崎製パン | 201.7 | 234.5 | 920,647 | |
| 第一屋製パン | 3.7 | 2.7 | 1,830 | |
| モロゾフ | 9.7 | 11.3 | 48,646 | |
| 亀田製菓 | 19.2 | 20 | 85,900 | |
| 寿スピリッツ | 32.1 | 165.7 | 333,636 | |
| カルビー | 138 | 160.4 | 556,106 | |
| 森永乳業 | 54.8 | 122.4 | 389,599 | |
| 六甲バター | 22.1 | 25.7 | 35,491 | |
| ヤクルト本社 | 215.3 | 500.8 | 1,557,988 | |
| 明治ホールディングス | 186.8 | 429.6 | 1,472,668 | |
| 雪印メグミルク | 72.9 | 84.7 | 230,214 | |
| プリマハム | 40.5 | 47.1 | 110,449 | |
| 日本ハム | 117.8 | 150.7 | 787,558 | |
| 林兼産業 | 6.5 | 5 | 2,980 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 丸大食品 | 30.3 | 35.3 | 58,174 |
| S Foods | 33.2 | 38.6 | 129,696 |
| 柿安本店 | 11.8 | 13.7 | 40,908 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 234.2 | 53.5 | 227,107 |
| サッポロホールディングス | 99.2 | 115.3 | 687,072 |
| アサヒグループホールディングス | 696.3 | 809.7 | 4,393,432 |
| キリンホールディングス | 1,359.9 | 1,459.7 | 3,059,531 |
| 宝ホールディングス | 205.7 | 239.2 | 266,468 |
| オエノンホールディングス | 90.1 | 104.7 | 37,377 |
| 養命酒製造 | 9.9 | 11.5 | 21,850 |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ | 236.1 | 274.5 | 625,997 |
| ライフドリンク カンパニー | — | 5.2 | 23,920 |
| サントリー食品インターナショナル | 212.2 | 246.7 | 1,284,566 |
| ダイドーグループホールディングス | 17.1 | 39.7 | 108,976 |
| 伊藤園 | 102.1 | 118.7 | 429,575 |
| キーコーヒー | 33.8 | 39.3 | 80,486 |
| ユニカフェ | 6.5 | 5 | 4,580 |
| ジャパンフーズ | 3.1 | 2.3 | 3,636 |
| 日清オイリオグループ | 42.4 | 49.4 | 259,350 |
| 不二製油グループ本社 | 70.2 | 81.6 | 213,914 |
| かどや製油 | 1.9 | 1.5 | 6,045 |
| J-オイルミルズ | 30.7 | 40.1 | 80,681 |
| キッコーマン | 199.7 | 232.2 | 2,302,959 |
| 味の素 | 737.5 | 832.7 | 4,566,526 |
| ブルドックソース | 12 | 18.6 | 40,157 |
| キュービー | 162 | 188.3 | 531,006 |
| ハウス食品グループ本社 | 92.3 | 120.7 | 374,049 |
| カゴメ | 140.4 | 150.7 | 557,740 |
| 焼津水産化学工業 | 8.7 | 6.6 | 9,398 |
| アリアケジャパン | 26.3 | 34.9 | 184,621 |
| ピエトロ | 2.8 | 2 | 3,720 |
| エバラ食品工業 | 8.1 | 8.4 | 25,200 |
| やまみ | 1.9 | 1.3 | 5,083 |
| ニチレイ | 138.1 | 160.6 | 660,066 |
| 東洋水産 | 152.3 | 177.1 | 1,721,766 |
| イートアンドホールディングス | 12.8 | 16.6 | 33,565 |
| 大冷 | 2.4 | 2 | 3,892 |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 19.1 | 15.9 | 21,003 |
| 日清食品ホールディングス | 106 | 369.6 | 1,583,736 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 永谷園ホールディングス | 14.8 | 17.2 | 39,078 |
| 一正蒲鉾 | 8.3 | 6.4 | 4,755 |
| フジッコ | 31 | 36 | 70,416 |
| ロック・フィールド | 33.7 | 42.8 | 70,834 |
| 日本たばこ産業 | 1,983.9 | 2,129.3 | 8,455,450 |
| ケンコーマヨネーズ | 20.7 | 24.1 | 48,947 |
| わらべや日洋ホールディングス | 22.2 | 23.5 | 63,614 |
| なとり | 18.9 | 22 | 47,520 |
| イフジ産業 | 3.7 | 2.8 | 4,132 |
| ファーマフーズ | 46.6 | 50.3 | 46,024 |
| ユウグレナ | 194 | 218.1 | 134,785 |
| 紀文食品 | 23.5 | 30.4 | 37,908 |
| ピックスホールディングス | 17.7 | 20.5 | 24,272 |
| ミヨシ油脂 | 6.9 | 5.5 | 6,990 |
| 理研ビタミン | 26 | 30.3 | 78,113 |
| 繊維製品 (0.49%) | | | |
| 片倉工業 | 28.2 | 32.8 | 61,139 |
| グンゼ | 23 | 25.3 | 140,668 |
| 東洋紡 | 132.5 | 154.1 | 176,290 |
| ユニチカ | 92.5 | 115.3 | 19,370 |
| 富士紡ホールディングス | 12.1 | 15.6 | 68,952 |
| 倉敷紡績 | 22.9 | 25.3 | 91,206 |
| シキボウ | 11 | 18.9 | 23,076 |
| 日本毛織 | 80.8 | 91.4 | 129,056 |
| ダイトボウ | 34.2 | 24.6 | 2,386 |
| トーア紡コーポレーション | 7.7 | 6 | 2,688 |
| ダイドーリミテッド | 30.1 | 21.8 | 15,870 |
| 帝国繊維 | 34.6 | 40.2 | 90,691 |
| 帝人 | 294.5 | 342.5 | 475,561 |
| 東レ | 2,054 | 2,388.4 | 1,756,907 |
| 住江織物 | 3.6 | 2.8 | 7,084 |
| 日本フェルト | 11.9 | 8.7 | 3,906 |
| イチカワ | 2.5 | 1.9 | 3,686 |
| 日東製網 | 2.3 | 1.6 | 2,694 |
| アツギ | 15 | 10.3 | 6,324 |
| ダイニック | 6.8 | 4.5 | 3,541 |
| セーレン | 59.2 | 68.8 | 181,150 |
| ソトー | 7.7 | 4.8 | 3,470 |
| 東海染工 | 2.4 | 1.4 | 1,150 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小松マテール | 44.4 | 51.7 | 40,015 |
| ワコールホールディングス | 59.1 | 73.1 | 273,978 |
| ホギメディカル | 41.1 | 47.1 | 175,918 |
| クラウディアホールディングス | 4.5 | 3.5 | 1,477 |
| T S I ホールディングス | 103.2 | 115.9 | 88,199 |
| マツオカコーポレーション | 6.1 | 4.5 | 7,191 |
| ワールド | 39.4 | 50.3 | 104,070 |
| 三陽商会 | 9.3 | 13.4 | 35,590 |
| ナイガイ | 7.1 | 5.1 | 1,310 |
| オンワードホールディングス | 198.8 | 210.2 | 111,826 |
| ルックホールディングス | 5.7 | 9.9 | 26,225 |
| キムラタン | 120.7 | 96.3 | 1,733 |
| ゴールドウイン | 54.3 | 63.1 | 609,230 |
| デサント | 52.8 | 61.4 | 212,137 |
| キング | 9.9 | 5.7 | 4,104 |
| ヤマトインターナショナル | 15.6 | 11.9 | 3,665 |
| パルプ・紙 (0.2%) | | | |
| 特種東海製紙 | 13.7 | 19.5 | 79,657 |
| 王子ホールディングス | 1,277.1 | 1,485 | 935,995 |
| 日本製紙 | 159.7 | 201.1 | 244,336 |
| 三菱製紙 | 26.9 | 20.3 | 12,464 |
| 北越コーポレーション | 193.7 | 175.2 | 433,795 |
| 中越パルプ工業 | 8 | 6 | 11,592 |
| 巴川コーポレーション | 6.2 | — | — |
| 大王製紙 | 135.4 | 157.5 | 189,945 |
| 阿波製紙 | 4.7 | 3.7 | 1,957 |
| レンゴー | 279.2 | 324.7 | 379,087 |
| トーマク | 17.7 | 20.6 | 55,372 |
| ザ・バック | 22.8 | 26.5 | 97,387 |
| 化学 (5.7%) | | | |
| 北の達人コーポレーション | 129.2 | 150.2 | 30,040 |
| クラレ | 487.4 | 519.5 | 831,719 |
| 旭化成 | 1,914.5 | 2,411.6 | 2,699,786 |
| 共和レザー | 11.4 | 8.7 | 7,229 |
| 巴川コーポレーション | — | 4.3 | 3,706 |
| レゾナック・ホールディングス | 296.3 | 344.5 | 1,233,310 |
| 住友化学 | 2,274.2 | 2,645.4 | 886,209 |
| 住友精化 | 12.8 | 16.7 | 86,339 |
| 日産化学 | 145.6 | 167.4 | 990,171 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------|---------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ラサ工業 | 11.8 | 13.7 | 36,414 |
| クレハ | 26.2 | 78 | 217,308 |
| 多木化学 | 11.9 | 13.8 | 51,405 |
| テイカ | 20.6 | 30.8 | 48,787 |
| 石原産業 | 55.5 | 59.1 | 101,061 |
| 片倉コープアグリ | 4.7 | 3.5 | 3,860 |
| 日本曹達 | 32.9 | 42.1 | 259,336 |
| 東ソー | 409.3 | 475.9 | 1,001,055 |
| トクヤマ | 99 | 115.1 | 310,654 |
| セントラル硝子 | 49.2 | 38.1 | 110,490 |
| 東亜合成 | 153.7 | 171.4 | 274,582 |
| 大阪ソーダ | 18.4 | 24.9 | 243,522 |
| 関東電化工業 | 59.3 | 68.9 | 69,037 |
| デンカ | 111.5 | 129.6 | 315,900 |
| 信越化学工業 | 509.7 | 3,196.7 | 21,577,725 |
| 日本カーバイド工業 | 7.5 | 15 | 28,170 |
| 堺化学工業 | 23.3 | 27.1 | 53,576 |
| 第一稀元素化学工業 | 27.9 | 39 | 37,206 |
| エア・ウォーター | 289.3 | 336.3 | 789,800 |
| 日本酸素ホールディングス | 297.4 | 345.8 | 1,663,643 |
| 日本化学工業 | 10.2 | 13.1 | 31,702 |
| 東邦アセチレン | 4.2 | 16.6 | 6,673 |
| 日本パーカライジニング | 151.8 | 158.8 | 195,959 |
| 高圧ガス工業 | 44.5 | 51.8 | 47,086 |
| チタン工業 | 2.4 | 2 | 2,198 |
| 四国化成ホールディングス | 36.4 | 45.6 | 83,356 |
| 戸田工業 | 7 | 8.1 | 14,458 |
| ステラ ケミファ | 18.1 | 19.3 | 72,954 |
| 保土谷化学工業 | 8.7 | 11.2 | 40,152 |
| 日本触媒 | 46.7 | 51.9 | 310,050 |
| 大日精化工業 | 21.3 | 24.8 | 71,473 |
| カネカ | 70 | 90.5 | 348,063 |
| 三菱瓦斯化学 | 228.9 | 260.2 | 683,415 |
| 三井化学 | 252.8 | 294 | 1,307,712 |
| J S R | 286.2 | 388.3 | 1,680,174 |
| 東京応化工業 | 53.6 | 170.1 | 773,614 |
| 大阪有機化学工業 | 23.1 | 29.8 | 94,019 |
| 三菱ケミカルグループ | 2,068.8 | 2,606 | 2,448,597 |
| KHネオケム | 51 | 54.4 | 121,312 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ダイセル | 450.8 | 458.2 | 684,550 | |
| 住友ベークライト | 45.4 | 49.9 | 457,682 | |
| 積水化学工業 | 627 | 716.3 | 1,595,200 | |
| 日本ゼオン | 183.9 | 244.4 | 322,241 | |
| アイカ工業 | 77.4 | 90 | 338,400 | |
| UBE | 158 | 169.6 | 465,128 | |
| 積水樹脂 | 44.6 | 53.2 | 128,531 | |
| タキロンシーアイ | 67 | 90.9 | 60,812 | |
| 旭有機材 | 20.4 | 23.7 | 123,003 | |
| ニチバン | 19 | 19.3 | 38,175 | |
| リケンテクノス | 66 | 76.8 | 75,417 | |
| 大倉工業 | 14.2 | 16.5 | 52,140 | |
| 積水化成成品工業 | 43 | 50 | 25,500 | |
| 群栄化学工業 | 7.2 | 8.4 | 31,542 | |
| タイガースポリマー | 10.1 | 6.8 | 7,779 | |
| ミライアル | 6.7 | 5.2 | 8,013 | |
| ダイキアクシス | 7.3 | 5.9 | 4,141 | |
| ダイキョーニシカワ | 67.7 | 78.7 | 62,330 | |
| 竹本容器 | 6.7 | 5.3 | 4,176 | |
| 森六ホールディングス | 15.5 | 18.5 | 51,004 | |
| 恵和 | 19.8 | 25.6 | 28,953 | |
| 日本化薬 | 234.2 | 272.3 | 358,891 | |
| カーリットホールディングス | 27.5 | 38.4 | 40,588 | |
| 日本精化 | 17.4 | 23.6 | 62,492 | |
| 扶桑化学工業 | 28.5 | 37.8 | 184,275 | |
| トリケミカル研究所 | 40.9 | 43.3 | 216,067 | |
| ADEKA | 106.9 | 124.3 | 405,590 | |
| 日油 | 94.8 | 107.6 | 705,318 | |
| 新日本理化 | 29.8 | 20.8 | 3,910 | |
| ハリマ化成グループ | 13.9 | 22.2 | 20,890 | |
| 花王 | 746.5 | 806 | 4,496,674 | |
| 第一工業製薬 | 11 | 14.2 | 51,759 | |
| 石原ケミカル | 14 | 15.9 | 29,971 | |
| 日華化学 | 8 | 6 | 5,718 | |
| ニイタカ | 3.9 | 2.8 | 5,499 | |
| 三洋化成工業 | 18.9 | 21.9 | 97,893 | |
| 有機合成薬品工業 | 14.7 | 11.7 | 3,755 | |
| 大日本塗料 | 37.4 | 39.5 | 46,412 | |
| 日本ペイントホールディングス | 1,356.6 | 1,892.9 | 2,032,028 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 関西ペイント | 280.8 | 349.3 | 770,381 | |
| 神東塗料 | 16.5 | 12.5 | 1,625 | |
| 中国塗料 | 50.4 | 73.2 | 166,896 | |
| 日本特殊塗料 | 12.6 | 10.7 | 15,236 | |
| 藤倉化成 | 41.2 | 41.1 | 19,851 | |
| 太陽ホールディングス | 46.6 | 62.1 | 208,966 | |
| D I C | 119.8 | 139.3 | 404,875 | |
| サカタインクス | 68.2 | 79.3 | 122,835 | |
| a r t i e n c e | 60 | 77.6 | 230,006 | |
| T & K T O K A | 27.2 | 34.1 | 47,808 | |
| 富士フィルムホールディングス | 589 | 662.2 | 6,817,349 | |
| 資生堂 | 640.9 | 745.3 | 3,045,295 | |
| ライオン | 368.3 | 467.2 | 619,273 | |
| 高砂香料工業 | 20.8 | 26.8 | 95,944 | |
| マンダム | 66.3 | 77.1 | 105,781 | |
| ミルボン | 45.5 | 48.5 | 156,170 | |
| ファンケル | 134.3 | 156.1 | 318,912 | |
| コーセー | 62.4 | 72.6 | 551,106 | |
| コタ | 25.7 | 32.9 | 55,502 | |
| シーボン | 2.8 | 2 | 2,998 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 157.4 | 183 | 260,775 | |
| ノエビアホールディングス | 27.4 | 31.8 | 166,314 | |
| アジュバンホールディングス | 4.8 | 3.6 | 3,290 | |
| 新日本製薬 | 17.5 | 20.4 | 35,006 | |
| I n e | - | 7.1 | 12,929 | |
| アクシージア | 10.5 | 17.6 | 14,044 | |
| エステー | 23.7 | 27.5 | 43,395 | |
| アグロ カネショウ | 12.3 | 14.3 | 17,975 | |
| コニシ | 51.3 | 103.1 | 162,898 | |
| 長谷川香料 | 63.5 | 68.2 | 207,328 | |
| 星光PMC | 10.1 | - | - | |
| 小林製薬 | 89.3 | 103.8 | 524,812 | |
| 荒川化学工業 | 26 | 30.2 | 35,515 | |
| メック | 25.3 | 29.4 | 120,099 | |
| 日本高純度化学 | 7.6 | 8.1 | 24,105 | |
| タカラバイオ | 82.7 | 96.2 | 95,238 | |
| J C U | 34.7 | 39.9 | 153,615 | |
| 新田ゼラチン | 12.3 | 9.9 | 7,405 | |
| O A T アグリオ | 8.1 | 11.8 | 22,774 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| デクセリアルズ | 88.6 | 89.6 | 569,766 | |
| アース製薬 | 27.8 | 32.4 | 138,996 | |
| 北興化学工業 | 30.9 | 35.9 | 42,469 | |
| 大成ラミック | 9.7 | 10.3 | 31,312 | |
| クミアイ化学工業 | 121.9 | 141.8 | 115,141 | |
| 日本農薬 | 56.3 | 65.5 | 49,649 | |
| アキレス | 20 | 22.5 | 35,347 | |
| 有沢製作所 | 49.7 | 62.5 | 72,750 | |
| 日東電工 | 222.8 | 229.3 | 3,244,595 | |
| レック | 43.7 | 45.7 | 52,874 | |
| 三光合成 | 38.6 | 44.9 | 32,328 | |
| きもと | 32.9 | 25.1 | 5,747 | |
| 藤森工業 | 24.3 | 28.2 | 120,555 | |
| 前澤化成工業 | 19.8 | 23 | 38,893 | |
| 未来工業 | 11 | 12.8 | 57,344 | |
| ウェーブロックホールディングス | 7.9 | 5.2 | 3,614 | |
| J S P | 21.6 | 25.1 | 57,353 | |
| エフピコ | 58.1 | 67.5 | 185,355 | |
| 天馬 | 26.1 | 25.9 | 60,761 | |
| 信越ポリマー | 56.7 | 77 | 120,736 | |
| 東リ | 49 | 34.9 | 14,623 | |
| ニフコ | 110.7 | 106.7 | 411,755 | |
| バルカー | 25.7 | 29.8 | 156,748 | |
| ユニ・チャーム | 639.5 | 743.6 | 3,578,203 | |
| ショーエイコーポレーション | 5.7 | 4.5 | 2,853 | |
| 医薬品 (4.3%) | | | | |
| 協和キリン | 370.8 | 431.2 | 1,180,841 | |
| 武田薬品工業 | 2,716.5 | 3,158.9 | 13,788,598 | |
| アステラス製薬 | 2,941.7 | 3,130.9 | 5,176,943 | |
| 住友ファーマ | 227.7 | 264.8 | 106,979 | |
| 塩野義製薬 | 392.3 | 450 | 3,515,400 | |
| わかもと製薬 | 20.9 | 15.9 | 3,529 | |
| 日本新薬 | 72.4 | 93.5 | 427,014 | |
| 中外製薬 | 960.9 | 1,117.3 | 6,536,205 | |
| 科研製薬 | 52.6 | 61.1 | 219,410 | |
| エーザイ | 373.4 | 434.2 | 2,734,157 | |
| ロート製薬 | 297.3 | 345.7 | 1,092,066 | |
| 小野薬品工業 | 592.2 | 757.5 | 1,891,477 | |
| 久光製薬 | 68.2 | 79.3 | 316,010 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 持田製薬 | 36.8 | 41 | 132,635 | |
| 参天製薬 | 577.7 | 650.5 | 964,366 | |
| 扶桑薬品工業 | 9.7 | 12.6 | 29,219 | |
| 日本ケミファ | 2.3 | 1.7 | 2,859 | |
| ツムラ | 96.6 | 112.4 | 437,348 | |
| キッセイ薬品工業 | 47.4 | 59.1 | 207,441 | |
| 生化学工業 | 58.5 | 60.5 | 46,464 | |
| 栄研化学 | 49.8 | 65.5 | 128,249 | |
| 鳥居薬品 | 16.5 | 19.2 | 76,992 | |
| J C R ファーマ | 103.9 | 120.8 | 105,096 | |
| 東和薬品 | 47.2 | 54.8 | 159,468 | |
| 富士製薬工業 | 19.8 | 26.4 | 42,847 | |
| ゼリア新薬工業 | 42.6 | 49.5 | 107,712 | |
| そーせいグループ | 84.8 | 117.2 | 184,941 | |
| 第一三共 | 2,674.2 | 3,109.4 | 14,993,526 | |
| 杏林製薬 | 66.6 | 77.4 | 141,951 | |
| 大幸薬品 | 55.6 | 74.1 | 30,084 | |
| ダイト | 21.5 | 27.2 | 62,995 | |
| 大塚ホールディングス | 702.3 | 742.4 | 4,690,483 | |
| 大正製薬ホールディングス | 68.2 | — | — | |
| ペプチドリーム | 148.8 | 173 | 247,303 | |
| セルソース | — | 9.9 | 14,117 | |
| あすか製薬ホールディングス | 31.5 | 36.6 | 77,775 | |
| サワイグループホールディングス | 70.2 | 81.6 | 492,700 | |
| 石油・石炭製品 (0.5%) | | | | |
| 日本コークス工業 | 276.8 | 362.1 | 46,710 | |
| ニチレキ | 36.3 | 46.4 | 117,067 | |
| ユシロ化学工業 | 15.9 | 18.5 | 41,662 | |
| ビービー・カストロール | 7.7 | 5.9 | 5,811 | |
| 富士石油 | 62.6 | 104 | 49,504 | |
| MORESCO | 7.1 | 5.4 | 7,678 | |
| 出光興産 | 340.9 | 1,982 | 2,089,028 | |
| ENEOSホールディングス | 5,545.8 | 5,650.7 | 4,146,483 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 121.3 | 105.8 | 801,011 | |
| ゴム製品 (0.7%) | | | | |
| 横浜ゴム | 174.7 | 180.5 | 743,660 | |
| TOYO TIRE | 176.4 | 205.1 | 576,638 | |
| ブリヂストン | 980.2 | 1,044.8 | 6,997,025 | |
| 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 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 藤倉コンボジット | 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 | |
| ガラス・土石製品 (0.7%) | | | | |
| 日東紡績 | 34.5 | 45.2 | 274,364 | |
| AGC | 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 | |
| TOTO | 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 | |
| ユ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 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ニチハ | 38.4 | 44.7 | 152,874 | |
| 鉄鋼 (1.0%) | | | | |
| 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 | |
| 日本鑄鉄管 | 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 | |
| 非鉄金属 (0.7%) | | | | |
| 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 | |
|--------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 住友金属鉱山 | 366.1 | 425.7 | 1,905,433 | |
| DOWAホールディングス | 70.9 | 90.7 | 489,689 | |
| 古河機械金属 | 46.3 | 48.4 | 88,620 | |
| エス・サイエンス | 94.3 | 75.5 | 1,963 | |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 46.3 | 63.7 | 166,957 | |
| 東邦チタニウム | 57.1 | 75.9 | 116,278 | |
| UACJ | 44.3 | 51.5 | 228,145 | |
| CKサンエツ | 7.6 | 8.9 | 35,733 | |
| 古河電気工業 | 105.1 | 122.3 | 393,683 | |
| 住友電気工業 | 1,090.4 | 1,373.6 | 3,263,673 | |
| フジクラ | 338.6 | 433.1 | 940,693 | |
| SWCC | 35.3 | 41 | 153,340 | |
| タツタ電線 | 64.2 | 65.4 | 46,041 | |
| カナレ電気 | 3.1 | 2.5 | 4,350 | |
| 平河ヒューテック | 18.2 | 23.5 | 33,158 | |
| リョービ | 33.6 | 39.1 | 115,931 | |
| アールスティ | 22.6 | 17.1 | 14,158 | |
| AREホールディングス | 127.7 | 137.9 | 274,421 | |
| 金属製品 (0.5%) | | | | |
| 稲葉製作所 | 18.5 | 18.1 | 33,159 | |
| 宮地エンジニアリンググループ | 8.7 | 18.4 | 79,672 | |
| トーカロ | 86.8 | 105.9 | 185,113 | |
| アルファCo | 7.5 | 5.7 | 9,935 | |
| SUMCO | 601.2 | 662.4 | 1,581,743 | |
| 川田テクノロジーズ | 7.4 | 8.7 | 89,871 | |
| RS Technologies | 21.1 | 24.6 | 68,904 | |
| ジェイテックコーポレーション | 2.7 | 2 | 3,906 | |
| 信和 | 13.1 | 9.9 | 7,553 | |
| 東洋製罐グループホールディングス | 209 | 210.6 | 531,659 | |
| ホッカンホールディングス | 17 | 17.9 | 34,726 | |
| コロナ | 17.6 | 20.5 | 20,336 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 41.7 | 57.4 | 168,813 | |
| 駒井ハルテック | 3.3 | 2.7 | 5,788 | |
| 高田機工 | 1.8 | 1.2 | 4,446 | |
| 三和ホールディングス | 290.8 | 368.9 | 978,507 | |
| 文化シャッター | 90.9 | 96.1 | 164,427 | |
| 三協立山 | 36.1 | 46.2 | 42,180 | |
| アルインコ | 24.1 | 28 | 28,896 | |
| 東洋シャッター | 4.7 | 3.5 | 2,527 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| LIXIL | 460.1 | 573.3 | 1,100,736 | |
| 日本フィルコン | 13.3 | 10.1 | 5,605 | |
| ノーリツ | 46.5 | 60.8 | 104,211 | |
| 長府製作所 | 31.8 | 36.5 | 79,132 | |
| リンナイ | 57.3 | 175.7 | 611,787 | |
| ダイニチ工業 | 10.1 | 7.7 | 5,551 | |
| 日東精工 | 45.8 | 53.2 | 33,622 | |
| 三洋工業 | 2.6 | 1.8 | 6,183 | |
| 岡部 | 50.8 | 65.6 | 49,856 | |
| ジーテクト | 35.2 | 46.8 | 99,169 | |
| 東プレ | 55.6 | 64.7 | 165,826 | |
| 高周波熱練 | 51.5 | 56.6 | 63,561 | |
| 東京製綱 | 18.6 | 23.8 | 34,129 | |
| サンコール | 18.1 | 32.6 | 15,974 | |
| モリテック スチール | 16.5 | 13.1 | 3,327 | |
| パイオラックス | 43.6 | 45.6 | 123,986 | |
| エイチワン | 32.5 | 37.8 | 27,405 | |
| 日本発條 | 279.3 | 324.8 | 487,200 | |
| 中央発條 | 17.5 | 27.2 | 30,736 | |
| アドバネクス | 2.8 | 2 | 2,814 | |
| 立川ブラインド工業 | 14.3 | 16.6 | 24,319 | |
| 三益半導体工業 | 24.4 | 33.1 | 101,286 | |
| 機械 (5.5%) | | | | |
| 日本ドライケミカル | 4.8 | 3.5 | 9,247 | |
| 日本製鋼所 | 85.1 | 99 | 317,889 | |
| 三浦工業 | 129.1 | 150.1 | 436,415 | |
| タクマ | 95 | 121.5 | 231,943 | |
| ツガミ | 68.7 | 79.9 | 93,163 | |
| オークマ | 30.9 | 31.4 | 229,502 | |
| 芝浦機械 | 30.9 | 35.9 | 131,753 | |
| アマダ | 493.2 | 573.5 | 1,032,586 | |
| アイダエンジニアリング | 63.6 | 83.2 | 76,294 | |
| TAKISAWA | 6.1 | - | - | |
| FUJI | 134.4 | 169.2 | 453,033 | |
| 牧野フライス製作所 | 34.2 | 39.8 | 247,556 | |
| オーエスジー | 147.6 | 158.4 | 341,035 | |
| ダイジェット工業 | 2.2 | 1.5 | 1,288 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 86.3 | 82.9 | 81,573 | |
| DMG森精機 | 187.4 | 217.9 | 903,413 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-----|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| ソディック | 85.2 | | 87.5 | 63,000 |
| ディスコ | 49.6 | | 173.1 | 9,416,640 |
| 日東工器 | 15 | | 17.4 | 33,077 |
| 日進工具 | 25.8 | | 33.3 | 33,200 |
| パンチ工業 | 18.2 | | 14.6 | 6,643 |
| 富士ダイス | 10.7 | | 21.3 | 14,846 |
| 豊和工業 | 10.9 | | 8.3 | 6,889 |
| 石川製作所 | 5.5 | | 3.9 | 5,245 |
| リケンNPR | — | | 39 | 118,170 |
| 東洋機械金属 | 13.8 | | 11 | 8,800 |
| 津田駒工業 | 3.6 | | 2.7 | 1,282 |
| エンシュウ | 4.7 | | 3.6 | 2,476 |
| 島精機製作所 | 49.2 | | 57.2 | 78,878 |
| オプトラン | 45.7 | | 59 | 120,183 |
| NCホールディングス | 5.4 | | 3.6 | 6,480 |
| イワキポンプ | 20.6 | | 23.9 | 65,844 |
| ブリュー | 32.4 | | 33.9 | 41,764 |
| ヤマシンフィルタ | 73.7 | | 86.3 | 38,835 |
| 日阪製作所 | 30 | | 39.2 | 40,180 |
| やまびこ | 50.5 | | 58.7 | 116,284 |
| 野村マイクロ・サイエンス | 10.5 | | 12.2 | 228,384 |
| 平田機工 | 14.8 | | 17.2 | 134,332 |
| PEGASUS | 34.1 | | 39.7 | 21,080 |
| マルマエ | 14.9 | | 15.6 | 32,354 |
| タツモ | 17 | | 21.7 | 83,545 |
| ナブテスコ | 194 | | 225.6 | 567,609 |
| 三井海洋開発 | 38.7 | | 45.5 | 142,187 |
| レオン自動車 | 32.5 | | 41.6 | 63,273 |
| SMC | 100.2 | | 107.6 | 9,252,524 |
| ホソカワミクロン | 23.7 | | 23 | 108,100 |
| ユニオンツール | 13.6 | | 15.8 | 69,046 |
| 瑞光 | — | | 25.9 | 37,451 |
| オイレス工業 | 43.2 | | 48.7 | 111,425 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 14.1 | | 14.3 | 75,933 |
| サトーホールディングス | 44 | | 51.1 | 120,289 |
| 技研製作所 | 32.3 | | 33.8 | 67,904 |
| 日本エアータック | 15.6 | | 16.8 | 19,740 |
| カワタ | 6.3 | | 4.7 | 5,052 |
| 日精樹脂工業 | 22.9 | | 26.7 | 32,680 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-----|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| オカダアイオン | 6.7 | | 5.1 | 15,325 |
| ワイエイシイホールディングス | 8.5 | | 13.5 | 33,898 |
| 小松製作所 | 1,448.4 | | 1,684.8 | 7,477,142 |
| 住友重機械工業 | 182.9 | | 212.6 | 1,008,361 |
| 日立建機 | 123.1 | | 143.1 | 651,534 |
| 日工 | 45.8 | | 53.2 | 41,708 |
| 巴工業 | 13.3 | | 14 | 58,590 |
| 井関農機 | 28.9 | | 33.6 | 34,608 |
| TOWA | 31.5 | | 40 | 385,600 |
| 丸山製作所 | 3.3 | | 2.6 | 6,502 |
| 北川鉄工所 | 12.2 | | 14.1 | 24,054 |
| ローツェ | 16.2 | | 18.8 | 384,084 |
| タカキタ | 6.5 | | 5 | 2,475 |
| クボタ | 1,635.8 | | 1,879.1 | 4,365,149 |
| 荏原実業 | 14.8 | | 18.9 | 67,851 |
| 三菱化工機 | 10 | | 12.6 | 50,211 |
| 月島ホールディングス | 41.8 | | 48.6 | 69,838 |
| 帝国電機製作所 | 22.4 | | 25.3 | 65,274 |
| 東京機械製作所 | 6.2 | | 4 | 1,876 |
| 新東工業 | 62.5 | | 72.6 | 84,143 |
| 澁谷工業 | 29 | | 33.7 | 116,939 |
| アイチ コーポレーション | 43.7 | | 50 | 57,100 |
| 小森コーポレーション | 71.6 | | 88.5 | 115,492 |
| 鶴見製作所 | 23.6 | | 27.4 | 101,928 |
| 日本ギア工業 | 7.6 | | 5.8 | 3,683 |
| 酒井重工業 | 3.5 | | 5.6 | 38,360 |
| 荏原製作所 | 126.5 | | 147.5 | 1,986,825 |
| 石井鐵工所 | 2.5 | | 1.7 | 4,965 |
| 西島製作所 | 26.7 | | 30.9 | 86,736 |
| 北越工業 | 31.1 | | 36.1 | 71,478 |
| ダイキン工業 | 369 | | 429.1 | 8,755,785 |
| オルガノ | 42.4 | | 43.2 | 311,040 |
| トーヨーカネツ | 11.7 | | 12.2 | 57,645 |
| 栗田工業 | 172.9 | | 201 | 1,256,250 |
| 椿本チエイン | 43.8 | | 50.9 | 264,680 |
| 大同工業 | 8.7 | | 6.7 | 5,366 |
| 木村化工機 | 23.6 | | 27.4 | 19,426 |
| アネスト岩田 | 52.6 | | 55.6 | 74,281 |
| ダイフク | 159.4 | | 606.6 | 2,198,925 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| サムコ | 10.1 | 9.6 | 47,808 | |
| 加藤製作所 | 10.2 | 7.7 | 11,696 | |
| 油研工業 | 3.3 | 2.5 | 6,145 | |
| タダノ | 163 | 206.8 | 260,257 | |
| フジテック | 113.2 | 84 | 324,408 | |
| CKD | 85.5 | 99.4 | 303,667 | |
| 平和 | 102.8 | 106.3 | 219,084 | |
| 理想科学工業 | 27.5 | 28.7 | 90,692 | |
| SANKYO | 60.7 | 413.3 | 700,956 | |
| 日本金銭機械 | 34 | 43.4 | 56,463 | |
| マースグループホールディングス | 18.2 | 18.1 | 58,372 | |
| フクシマガリレイ | 22.7 | 23.5 | 140,295 | |
| オーイズミ | 7.5 | 5.7 | 2,428 | |
| ダイコク電機 | 16.9 | 17.7 | 73,720 | |
| 竹内製作所 | 56.1 | 65.2 | 373,596 | |
| アマノ | 87.7 | 102 | 410,652 | |
| JUKI | 47.9 | 55.7 | 30,300 | |
| サンデン | 29.8 | 22.7 | 3,859 | |
| ジャノメ | 31.3 | 36.4 | 25,916 | |
| マックス | 38.1 | 50.6 | 167,486 | |
| グローリー | 80.1 | 86.3 | 252,556 | |
| 新晃工業 | 31.1 | 36.2 | 136,836 | |
| 大和冷機工業 | 47.4 | 55.1 | 85,680 | |
| セガサミーホールディングス | 248.5 | 321 | 599,949 | |
| 日本ビストンリング | 7.8 | — | — | |
| リケン | 12.2 | — | — | |
| TPR | 35.3 | 45.6 | 109,440 | |
| ツバキ・ナカシマ | 76.2 | 72 | 58,104 | |
| ホシザキ | 199 | 212.1 | 1,179,276 | |
| 大豊工業 | 26.7 | 31.1 | 29,358 | |
| 日本精工 | 567.9 | 665.4 | 576,302 | |
| NTN | 609.4 | 779.5 | 248,504 | |
| ジェイテクト | 275 | 319.8 | 452,836 | |
| 不二越 | 22.8 | 26.5 | 91,955 | |
| 日本トムソン | 75.7 | 97.8 | 65,330 | |
| THK | 178.4 | 207.4 | 694,997 | |
| ユーシン精機 | 24.5 | 28.5 | 19,693 | |
| 前澤給装工業 | 21.7 | 25.8 | 33,978 | |
| イーグル工業 | 34.2 | 39.7 | 72,849 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 前澤工業 | 12.9 | 8.7 | 9,474 | |
| 日本ビラー工業 | 28.7 | 33.3 | 197,136 | |
| キッツ | 113.8 | 120.3 | 155,668 | |
| マキタ | 384.6 | 409.9 | 1,708,463 | |
| 三井E&S | 142.1 | 178.4 | 345,382 | |
| 日立造船 | 253.3 | 317.1 | 414,132 | |
| 三菱重工業 | 540.6 | 628.6 | 8,542,674 | |
| I H I | 194.7 | 267.6 | 985,570 | |
| サノヤスホールディングス | 24.3 | 19.5 | 3,822 | |
| スター精密 | 58.3 | 66.1 | 122,086 | |
| 電気機器 (17.3%) | | | | |
| 日清紡ホールディングス | 251.6 | 270.2 | 327,617 | |
| イビデン | 177.3 | 187.5 | 1,236,750 | |
| コニカミノルタ | 690.4 | 802.8 | 398,911 | |
| ブラザー工業 | 413 | 480.2 | 1,351,042 | |
| ミネベアミツミ | 537.7 | 625.2 | 1,833,399 | |
| 日立製作所 | 1,503.1 | 1,727.5 | 23,865,412 | |
| 東芝 | 594.9 | — | — | |
| 三菱電機 | 3,194.8 | 4,000.6 | 10,183,527 | |
| 富士電機 | 188 | 218.6 | 2,155,177 | |
| 東洋電機製造 | 7.1 | 5 | 5,910 | |
| 安川電機 | 366.3 | 390.4 | 2,529,011 | |
| シンフォニアテクノロジー | 34.1 | 39.6 | 123,156 | |
| 明電舎 | 46.9 | 66.6 | 184,948 | |
| オリジン | 4.9 | 3.4 | 4,148 | |
| 山洋電気 | 13.4 | 15.5 | 108,035 | |
| デンヨー | 23.5 | 27.4 | 64,554 | |
| PHCホールディングス | 43 | 67.2 | 87,763 | |
| KOKUSAI ELECTRIC | — | 138.9 | 520,875 | |
| ソシオネクスト | 31.8 | 260.9 | 1,091,605 | |
| 東芝テック | 46.2 | 46 | 139,150 | |
| 芝浦メカトロニクス | 5.9 | 20.5 | 134,480 | |
| マブチモーター | 76.8 | 176.8 | 489,559 | |
| ニデック | 752.1 | 793.6 | 5,030,630 | |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 22.7 | 22.6 | 8,746 | |
| トレックス・セミコンダクター | 14.5 | 18.5 | 33,910 | |
| 東光高岳 | 18.6 | 21.7 | 53,034 | |
| ダブル・スコープ | 101.1 | 102.9 | 57,624 | |
| ダイヘン | 27.9 | 36.1 | 342,950 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヤーマン | 53.4 | 69.9 | 68,082 | |
| JVCケンウッド | 281.6 | 283.7 | 270,649 | |
| ミマキエン지니어リング | 29.3 | 34.1 | 37,203 | |
| I-PEX | 17.1 | 24.9 | 44,894 | |
| 日新電機 | 72.5 | - | - | |
| 大崎電気工業 | 73.3 | 78.7 | 53,516 | |
| オムロン | 283.3 | 274.5 | 1,512,495 | |
| 日東工業 | 41.7 | 48.5 | 215,097 | |
| IDEC | 45.6 | 53.1 | 148,892 | |
| 正興電機製作所 | 7.5 | 5.2 | 6,458 | |
| 不二電機工業 | 4 | 3 | 3,369 | |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 101.5 | 140.3 | 437,736 | |
| サクサホールディングス | 5 | 3.5 | 11,392 | |
| メルコホールディングス | 8.2 | 11.3 | 40,171 | |
| テクノメディカ | 7.5 | 8.7 | 15,346 | |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 10.4 | 13.4 | 10,318 | |
| 日本電気 | 437.2 | 472.1 | 5,204,902 | |
| 富士通 | 308 | 330.8 | 8,311,350 | |
| 沖電気工業 | 139.8 | 162.5 | 189,475 | |
| 岩崎通信機 | 8.7 | 6.9 | 4,809 | |
| 電気興業 | 12.5 | 16.1 | 34,937 | |
| サンケン電気 | 28.7 | 33.4 | 214,628 | |
| ナカヨ | 3.5 | 2.4 | 2,880 | |
| アイホン | 18.8 | 19.4 | 59,849 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 2,016.9 | 2,345.7 | 6,087,091 | |
| セイコーエプソン | 411.7 | 461.2 | 1,203,962 | |
| ワコム | 244.8 | 273.4 | 178,530 | |
| アルバック | 73.4 | 78.8 | 772,397 | |
| アクセル | 8.2 | 14.3 | 28,957 | |
| EIZO | 22.6 | 26.3 | 138,864 | |
| ジャパンディスプレイ | 1,186.8 | 1,549.3 | 35,633 | |
| 日本信号 | 70.4 | 81.9 | 86,158 | |
| 京三製作所 | 64.7 | 75.3 | 40,059 | |
| 能美防災 | 41.8 | 48.6 | 109,787 | |
| ホーチキ | 23.1 | 26.8 | 59,549 | |
| 星和電機 | 7.9 | 6.3 | 3,433 | |
| エレコム | 73.9 | 85.9 | 134,004 | |
| パナソニック ホールディングス | 3,651.4 | 4,246.1 | 6,171,706 | |
| シャープ | 372.2 | 605.9 | 498,898 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| アンリツ | 217.7 | 253.2 | 318,019 | |
| 富士通ゼネラル | 87.6 | 101.9 | 194,629 | |
| ソニーグループ | 2,165 | 2,517.4 | 32,852,070 | |
| TDK | 489.5 | 569.1 | 4,226,136 | |
| 帝国通信工業 | 13.9 | 15.7 | 29,782 | |
| タムラ製作所 | 132.6 | 143.2 | 83,199 | |
| アルプスアルパイン | 276.1 | 321 | 369,792 | |
| 池上通信機 | 6.3 | 4.8 | 3,897 | |
| 日本電波工業 | 37.1 | 43.1 | 55,340 | |
| 鈴木 | 16.5 | 19.2 | 22,944 | |
| メイコー | 33.7 | 35.7 | 185,640 | |
| 日本トリム | 6.9 | 8.1 | 31,995 | |
| ローランド ディー・ジー | 17.4 | 19.7 | 106,577 | |
| フォスター電機 | 28.6 | 26.6 | 32,132 | |
| SMK | 7.4 | 9.6 | 26,044 | |
| ヨコオ | 24.6 | 31.7 | 48,437 | |
| ティアック | 32.8 | 25 | 2,550 | |
| ホシデン | 72.1 | 81.7 | 158,416 | |
| ヒロセ電機 | 51.1 | 53.1 | 823,581 | |
| 日本航空電子工業 | 63.4 | 86 | 219,042 | |
| TOA | 35.2 | 40.9 | 47,075 | |
| マクセル | 67.2 | 79.4 | 126,087 | |
| 古野電気 | 40.2 | 46.7 | 110,772 | |
| スミダコーポレーション | 28.3 | 48.1 | 58,922 | |
| アイコム | 11.9 | 13.8 | 48,852 | |
| リオン | 12.7 | 14.8 | 43,793 | |
| 横河電機 | 338.2 | 393.2 | 1,380,525 | |
| 新元元工業 | 11.8 | 13.8 | 43,401 | |
| アズビル | 213.8 | 244.8 | 1,028,894 | |
| 東亜ディーケーケー | 10.6 | 7 | 6,545 | |
| 日本光電工業 | 141.4 | 152.6 | 601,244 | |
| チノー | 12.7 | 14.8 | 39,767 | |
| 共和電業 | 18.7 | 14 | 5,936 | |
| 日本電子材料 | 20.2 | 21.9 | 56,502 | |
| 堀場製作所 | 68.2 | 67.9 | 1,062,974 | |
| アドバンテスト | 241.2 | 1,019.6 | 6,862,927 | |
| 小野測器 | 7.3 | 5.9 | 3,894 | |
| エスベック | 24.5 | 28.5 | 87,067 | |
| キーエンス | 306.2 | 356 | 25,051,720 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日置電機 | 16.1 | 16.8 | 117,600 | |
| シスメックス | 264 | 307.1 | 2,496,723 | |
| 日本マイクロニクス | 50.4 | 63.9 | 524,619 | |
| メガチップス | 25.1 | 28.1 | 110,854 | |
| OBARA GROUP | 14.3 | 19.4 | 72,750 | |
| 澤藤電機 | 2.6 | 1.8 | 2,361 | |
| 原田工業 | 10.1 | 6.7 | 5,011 | |
| コーセル | 36.8 | 38 | 57,456 | |
| イリソ電子工業 | 28.1 | 32.7 | 99,735 | |
| オブテックスグループ | 56.1 | 65.3 | 127,988 | |
| 千代田インテグレ | 10.6 | 13.9 | 37,238 | |
| レーザーテック | 140.3 | 163.1 | 6,879,558 | |
| スタンレー電気 | 217.8 | 227.8 | 612,212 | |
| 岩崎電気 | 9.6 | — | — | |
| ウシオ電機 | 159.9 | 180.8 | 364,402 | |
| 岡谷電機産業 | 15.3 | 11.5 | 3,220 | |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 18.3 | 14.7 | 8,232 | |
| エノモト | 5.9 | 4.2 | 6,862 | |
| 日本セラミック | 31.2 | 29 | 78,764 | |
| 遠藤照明 | 9.9 | 6.8 | 10,404 | |
| 古河電池 | 22.5 | 26.2 | 26,462 | |
| 双信電機 | 10.3 | 6 | 1,866 | |
| 山一電機 | 26.7 | 32 | 74,880 | |
| 函研 | 26.6 | 31 | 143,065 | |
| 日本電子 | 76.7 | 89.2 | 558,927 | |
| カシオ計算機 | 228 | 257.1 | 330,373 | |
| ファナック | 300.4 | 1,735.4 | 7,455,278 | |
| 日本シイエムケイ | 65 | 83.5 | 51,102 | |
| エンプラス | 8.9 | 10.4 | 78,416 | |
| 大真空 | 37.3 | 53 | 42,771 | |
| ローム | 141.5 | 658 | 1,651,580 | |
| 浜松ホトニクス | 245.6 | 285.6 | 1,535,385 | |
| 三井ハイテック | 31.6 | 31.5 | 275,751 | |
| 新光電気工業 | 108.3 | 125.9 | 713,097 | |
| 京セラ | 475.4 | 2,211.2 | 4,594,873 | |
| 太陽誘電 | 149 | 173.3 | 616,948 | |
| 村田製作所 | 928.2 | 3,237.8 | 9,230,967 | |
| 双葉電子工業 | 58.3 | 67.8 | 34,442 | |
| 北陸電気工業 | 8 | 5.6 | 8,069 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|----------|----------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ニチコン | 62.5 | 93.4 | 121,980 | |
| 日本ケミコン | 30.2 | 37.9 | 55,182 | |
| KOA | 46.3 | 53.9 | 79,987 | |
| 市光工業 | 44.1 | 64.1 | 34,934 | |
| 小糸製作所 | 368.1 | 368.7 | 731,869 | |
| ミツバ | 57.4 | 66.7 | 106,586 | |
| SCREENホールディングス | 52.3 | 121.7 | 2,272,139 | |
| キャノン電子 | 33.8 | 39.3 | 94,044 | |
| キャノン | 1,679.2 | 1,775 | 7,923,600 | |
| リコー | 767.4 | 892.3 | 1,191,666 | |
| 象印マホービン | 91.4 | 96.6 | 138,331 | |
| MUTOHホールディングス | 2.7 | 1.9 | 4,489 | |
| 東京エレクトロン | 215.9 | 753.2 | 29,163,904 | |
| イノテック | 20.4 | 23.7 | 47,139 | |
| 輸送用機器 (9.5%) | | | | |
| トヨタ紡織 | 128.9 | 149.9 | 388,840 | |
| 芦森工業 | 4.1 | 3 | 8,235 | |
| ユニプレス | 54.9 | 63.9 | 74,507 | |
| 豊田自動織機 | 223.8 | 303.5 | 4,833,237 | |
| モリタホールディングス | 53.7 | 62.4 | 102,211 | |
| 三櫻工業 | 46.7 | 54.3 | 61,250 | |
| デンソー | 631.3 | 2,936.2 | 8,544,342 | |
| 東海理化電機製作所 | 86.3 | 100.3 | 263,187 | |
| 川崎重工業 | 230.6 | 290.5 | 1,449,885 | |
| 名村造船所 | 55.4 | 88.6 | 181,364 | |
| 日本車輛製造 | 11.8 | 11.7 | 28,080 | |
| 三菱ロジスネクスト | 48.8 | 56.8 | 102,410 | |
| 近畿車輛 | 3.2 | 2 | 5,002 | |
| 日産自動車 | 4,347.7 | 4,802.7 | 3,020,418 | |
| いすゞ自動車 | 889.8 | 1,034.6 | 2,169,556 | |
| トヨタ自動車 | 16,805.9 | 19,541.3 | 74,843,179 | |
| 日野自動車 | 394.6 | 535.3 | 278,623 | |
| 三菱自動車工業 | 1,194 | 1,388.3 | 689,013 | |
| エフテック | 13.7 | 10.5 | 8,053 | |
| レシップホールディングス | 8.5 | 6.5 | 4,186 | |
| GMB | 3.9 | 2.9 | 3,352 | |
| ファルテック | 3.7 | 2.7 | 1,533 | |
| 武蔵精密工業 | 74.8 | 87 | 146,160 | |
| 日産車体 | 54 | 36.1 | 37,977 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 新明和工業 | 96.1 | 102.5 | 128,740 | |
| 極東開発工業 | 53.8 | 58.8 | 155,408 | |
| トビー工業 | 24.8 | 28.8 | 86,112 | |
| ティラド | 7.7 | 7.9 | 32,074 | |
| 曙ブレーキ工業 | 186.8 | 217.2 | 31,276 | |
| タチエス | 48.4 | 65.7 | 133,830 | |
| NOK | 118.9 | 138.3 | 296,031 | |
| フタバ産業 | 82 | 95.4 | 112,953 | |
| カヤバ | 29.5 | 34.3 | 175,273 | |
| 大同メタル工業 | 59.8 | 69.6 | 47,188 | |
| プレス工業 | 136.7 | 142.2 | 100,393 | |
| ミクニ | 24.9 | 19 | 9,272 | |
| 太平洋工業 | 70.2 | 81.6 | 142,065 | |
| 河西工業 | 26.3 | 21.1 | 5,148 | |
| アイシン | 236.1 | 274.5 | 1,680,763 | |
| マツダ | 1,012.4 | 1,177.2 | 2,089,530 | |
| 今仙電機製作所 | 14.1 | 9.5 | 6,146 | |
| 本田技研工業 | 2,487.9 | 8,678.6 | 16,307,089 | |
| スズキ | 562.1 | 653.6 | 4,428,793 | |
| SUBARU | 968.4 | 1,103.7 | 3,785,691 | |
| 安永 | 8.6 | 6.6 | 5,042 | |
| ヤマハ発動機 | 481 | 1,538.1 | 2,116,425 | |
| TBK | 21.6 | 16.3 | 6,389 | |
| エクセディ | 50.1 | 58.2 | 179,256 | |
| 豊田合成 | 89.3 | 101.9 | 343,199 | |
| 愛三工業 | 50.5 | 58.9 | 100,895 | |
| 盟和産業 | 3.1 | 2.1 | 2,144 | |
| 日本プラスチック | 15.5 | 12.3 | 6,912 | |
| ヨロズ | 28.7 | 33.3 | 33,799 | |
| エフ・シー・シー | 54.2 | 63.1 | 141,154 | |
| シマノ | 125.2 | 143.8 | 3,213,211 | |
| テイ・エス テック | 140.1 | 126.7 | 256,124 | |
| ジャムコ | 12.5 | 17.2 | 21,482 | |
| 精密機器 (2.2%) | | | | |
| テルモ | 941.3 | 995 | 5,504,340 | |
| クリエートメディック | 6.5 | 4.9 | 4,718 | |
| 日機装 | 71.3 | 82.9 | 101,801 | |
| 日本エム・ディ・エム | 18.2 | 28.2 | 20,952 | |
| 島津製作所 | 372.8 | 472.8 | 2,050,060 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| JMS | 28.3 | 32.9 | 17,700 | |
| クボテック | 4.6 | 3.6 | 849 | |
| 長野計器 | 22.2 | 25.9 | 59,052 | |
| プイ・テクノロジー | 15 | 18.7 | 46,656 | |
| 東京計器 | 23.5 | 27.3 | 70,434 | |
| 愛知時計電機 | 11.9 | 15.4 | 36,975 | |
| インターアクション | 14.5 | 21.4 | 26,814 | |
| オーバル | 19.2 | 13.2 | 7,088 | |
| 東京精密 | 67.1 | 72.8 | 874,692 | |
| マニー | 134.6 | 142.4 | 282,165 | |
| ニコン | 475.8 | 514.5 | 809,565 | |
| トプコン | 161.1 | 173 | 305,085 | |
| オリンパス | 1,913.3 | 2,190.6 | 4,732,791 | |
| 理研計器 | 19 | 25.2 | 187,992 | |
| タムロン | 22.9 | 21.8 | 148,022 | |
| HOYA | 653.7 | 700.6 | 13,363,945 | |
| シード | 10 | 7.5 | 4,957 | |
| ノーリツ鋼機 | 29 | 33.7 | 106,660 | |
| A&Dホロンホールディングス | 44.6 | 51.9 | 142,776 | |
| 朝日インテック | 342 | 433.8 | 1,189,696 | |
| シチズン時計 | 336.5 | 327.4 | 330,019 | |
| リズム | 6.7 | 3.4 | 14,705 | |
| 大研医器 | 17 | 13 | 7,527 | |
| メニコン | 105.1 | 122.4 | 194,004 | |
| シンシア | 1.8 | 1.4 | 711 | |
| 松風 | 13.8 | 16.1 | 48,251 | |
| セイコーグループ | 47.4 | 49.6 | 194,184 | |
| ニプロ | 255.1 | 296.6 | 355,326 | |
| その他製品 (2.3%) | | | | |
| KYORITSU | 29.4 | 22.5 | 4,207 | |
| 中本パックス | 6 | 4.8 | 7,872 | |
| スノーピーク | 52.4 | 50.8 | 63,347 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 70.7 | 74 | 195,064 | |
| トランザクション | 23.5 | 23.5 | 53,791 | |
| 粧美堂 | 5.3 | 4.1 | 2,402 | |
| ニホンフラッシュ | 28.7 | 33.4 | 32,598 | |
| 前田工業 | 25.8 | 30.1 | 111,219 | |
| 永大産業 | 23.4 | 17.9 | 5,477 | |
| 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 | 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 |
| SHOE I | 32.3 | — | 80.4 | 187,251 |
| フランスベ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 | — | — | — |
| TOPPAN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 |
| TAKARA & COMPANY | 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 | 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 |
| 神縄電力 | 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%) | | | | |
| SBS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 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 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 | |
| ハマキョウレックス | 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 | |
| SG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 | |
| NS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 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 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 | |
| 澁澤倉庫 | 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 | |
| キューソー流通システム | 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%) | | | | |
| NECネットエスアイ | 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 | |
| 手間いらず | 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 | |
|------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| T I S | 345 | 390.4 | 1,296,908 | |
| テクミラホールディングス | 9.7 | 6.9 | 3,208 | |
| グリー | 82.3 | 119.6 | 58,125 | |
| GMOベバボ | 4.4 | 4.4 | 6,072 | |
| コーエーテクモホールディングス | 192.3 | 223.6 | 377,884 | |
| 三菱総合研究所 | 15 | 17.5 | 88,025 | |
| ボルテージ | 5.7 | 4.4 | 1,139 | |
| 電算 | 2.3 | 1.8 | 2,718 | |
| AGS | 8.3 | 6.2 | 5,511 | |
| ファインデックス | 24.4 | 28.3 | 31,413 | |
| ブレインパッド | 23 | 29.7 | 43,094 | |
| KL a b | 61.1 | 65.6 | 24,796 | |
| ポールトゥウィンホールディングス | 52.4 | 60.9 | 30,389 | |
| ネクソン | 793.8 | 799.1 | 2,043,698 | |
| アイスタイル | 89.2 | 116.5 | 60,114 | |
| エムアップホールディングス | 37.6 | 43.7 | 54,275 | |
| エイチーム | 22.6 | 21.1 | 13,293 | |
| エニグモ | 39 | 45.4 | 18,477 | |
| テクノスジャパン | 16.3 | 13.1 | 8,200 | |
| e n i s h | 14.9 | 11.9 | 3,224 | |
| コロブラ | 119 | 138.5 | 83,931 | |
| オルトプラス | 15.1 | 12.1 | 1,633 | |
| ブロードリーフ | 179.3 | 169.4 | 95,033 | |
| クロス・マーケティンググループ | 8 | 6.4 | 3,513 | |
| デジタルハーツホールディングス | 19.1 | 22.3 | 21,296 | |
| システム情報 | 27.1 | - | - | |
| メディアドゥ | 12.4 | 16.1 | 23,667 | |
| じげん | 89.5 | 104.1 | 64,021 | |
| ブイキューブ | 36.8 | 42.8 | 11,384 | |
| エンカレッジ・テクノロジー | 4.6 | 3.6 | 2,322 | |
| サイバーリンクス | 6.3 | 5.1 | 4,513 | |
| ディー・エル・イー | 14.1 | 10.7 | 1,936 | |
| フィックスターズ | 34.6 | 40.3 | 89,103 | |
| CARTA HOLDINGS | 14.4 | 16.7 | 26,536 | |
| オブティム | 25.2 | 36.7 | 37,397 | |
| セレス | 12.3 | 14.4 | 25,516 | |
| SHI FT | 22.4 | 23.7 | 569,155 | |
| ティーガイア | 32.1 | 37.3 | 77,621 | |
| セック | 3.1 | 4.4 | 21,604 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| テクマトリックス | 56 | 65.2 | 122,706 | |
| プロシップ | 13.4 | 17.1 | 26,145 | |
| 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ペイメントゲートウェイ | 70.1 | 71.3 | 702,376 | |
| ザッパラス | 7.3 | 3.6 | 1,760 | |
| システムリサーチ | 9.6 | 12.2 | 41,236 | |
| インターネットイニシアティブ | 171.3 | 170.6 | 483,053 | |
| さくらインターネット | 34.4 | 40.1 | 263,457 | |
| ヴィンクス | 5.9 | - | - | |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス | 9.4 | 10.9 | 33,844 | |
| S R Aホールディングス | 15.7 | 18.3 | 73,474 | |
| システムインテグレータ | 6.7 | 4.4 | 1,799 | |
| 朝日ネット | 33 | 38.3 | 24,626 | |
| e B A S E | 43.2 | 50.2 | 37,148 | |
| アパントグループ | 38.8 | 45.1 | 58,584 | |
| アドソル日進 | 12.9 | 15 | 25,185 | |
| ODKソリューションズ | 4.4 | 2.8 | 1,898 | |
| フリービット | 16.1 | 15.6 | 22,245 | |
| コムチュア | 40.6 | 51.5 | 102,588 | |
| サイバーコム | 3.2 | - | - | |
| アステリア | 24 | 27.9 | 19,195 | |
| アイル | 17.2 | 16.7 | 50,434 | |
| マークライنز | 16.6 | 19.3 | 61,567 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 45.8 | 42.6 | 24,878 | |
| g u m i | 44.9 | 57.9 | 24,318 | |
| ショーケース | 4.6 | 3.5 | 1,291 | |
| モバイルファクトリー | 4.1 | 3.2 | 2,374 | |
| テラスカイ | 13.2 | 15.4 | 22,607 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 17.7 | 18.6 | 33,628 | |
| P C Iホールディングス | 8.3 | 5.8 | 5,573 | |
| アイビーシー | 3.1 | 2.3 | 1,016 | |
| ネオジャパン | 10.2 | 11.9 | 15,017 | |
| P R T I M E S | 7.7 | 7.2 | 14,788 | |
| ラクス | 145.2 | 168.8 | 348,318 | |
| ランドコンピュータ | 4.8 | 7.3 | 6,467 | |
| ダブルスタンダード | 12.4 | 10.8 | 20,692 | |
| オープンドア | 21.5 | 20.8 | 17,472 | |
| マイネット | 6.4 | 4.9 | 1,710 | |
| アカツキ | 14.6 | 17 | 43,724 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ベネフィットジャパン | 1.6 | 0.9 | 1,142 |
| Ubicomホールディングス | 9.5 | 11.1 | 14,030 |
| カナミックネットワーク | 44.1 | 38.4 | 18,201 |
| ノムラシステムコーポレーション | 18.5 | 14.7 | 1,734 |
| チェンジホールディングス | 75.2 | 77.7 | 98,368 |
| シンクロ・フード | 10.7 | 8.5 | 5,278 |
| オークネット | 15.1 | 13.2 | 31,363 |
| キャピタル・アセット・プランニング | 3.8 | 2.8 | 2,184 |
| セグエグループ | 5.5 | 12.9 | 7,675 |
| エイトレッド | 3 | 2.2 | 3,205 |
| マクロミル | 60.2 | 70 | 53,830 |
| ビーグリー | 3.3 | 2.7 | 3,075 |
| オロ | 9.2 | 12.9 | 35,088 |
| ユーザーローカル | 11 | 15.1 | 35,379 |
| テモナ | 3.8 | 3 | 708 |
| ニーズウェル | 6.1 | 8.3 | 8,150 |
| マネーフォワード | 73.9 | 79.6 | 517,798 |
| サインポスト | 6.8 | 5.4 | 3,493 |
| Sun Asterisk | 16.3 | 25.3 | 23,655 |
| プラスアルファ・コンサルティング | — | 21.1 | 49,521 |
| 電算システムホールディングス | 14.8 | 15.8 | 42,265 |
| Appier Group | 87.2 | 122.1 | 195,970 |
| ビジョナル | — | 27.4 | 261,122 |
| ソルクシーズ | 16.1 | 12.3 | 4,206 |
| フェイス | 5.5 | 4.3 | 1,999 |
| プロトコーポレーション | 38.4 | 39.1 | 55,443 |
| ハイマックス | 9.6 | 11.2 | 16,744 |
| 野村総合研究所 | 629.7 | 790.7 | 3,317,777 |
| サイバネットシステム | 25.7 | — | — |
| CEホールディングス | 10.2 | 7.7 | 4,227 |
| 日本システム技術 | 7.5 | 13.2 | 50,622 |
| インテージホールディングス | 34.7 | 40.4 | 65,044 |
| 東邦システムサイエンス | 5.5 | 13.3 | 16,837 |
| ソースネクスト | 156.1 | 163.3 | 40,171 |
| インフォコム | 39.6 | 46 | 126,500 |
| シンプレクス・ホールディングス | 51.6 | 54 | 153,090 |
| HEROZ | 10.3 | 14 | 23,996 |
| ラクスル | 86.8 | 86 | 98,040 |
| メルカリ | 138.5 | 173.7 | 340,799 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| I P S | 10 | 10.3 | 25,338 |
| F I G | 22.9 | 17.5 | 6,177 |
| システムサポート | 11.9 | 13.8 | 29,904 |
| イソル | 19.7 | 25.7 | 21,228 |
| アルテリア・ネットワークス | 28.6 | — | — |
| 東海ソフト | 3.3 | 2.2 | 2,761 |
| ウイングアーク1st | 31.6 | 37.1 | 113,155 |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン | 8.2 | 9.5 | 10,792 |
| サーバーワークス | 6.2 | 7.3 | 26,499 |
| 東名 | 1.5 | 1.2 | 2,872 |
| ヴィッツ | 1.9 | 1.4 | 1,090 |
| トビラシステムズ | 4.9 | 3.9 | 3,143 |
| Sansan | 100.4 | 117.1 | 205,627 |
| Link-Uグループ | 3.8 | 3 | 1,968 |
| ギフティ | 33.4 | 31.3 | 41,879 |
| メドレー | 30.9 | 47.9 | 225,609 |
| ベース | 10.4 | 12.5 | 43,562 |
| JMDC | 50.4 | 60.9 | 218,143 |
| フォーカスシステムズ | 22.4 | 23.9 | 31,309 |
| クレスコ | 23.7 | 29.3 | 63,200 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 294.9 | 342.8 | 637,436 |
| オービック | 102.6 | 119.3 | 2,718,847 |
| ジャストシステム | 44.1 | 51.3 | 137,022 |
| TDCソフト | 25.9 | 33.4 | 76,319 |
| LINEヤフー | 4,368.4 | 5,081.4 | 1,988,351 |
| トレンドマイクロ | 177.3 | 168.7 | 1,284,144 |
| IDホールディングス | 20.7 | 24 | 36,336 |
| 日本オラクル | 58.7 | 68.3 | 778,961 |
| アルファシステムズ | 9.7 | 9.4 | 30,785 |
| フューチャー | 76.4 | 76.1 | 128,304 |
| CAC Holdings | 18.8 | 19.1 | 35,736 |
| SBテクノロジー | 13 | 15.1 | 31,679 |
| トーセ | 5.2 | 4.2 | 2,977 |
| オービックビジネスコンサルタント | 60.4 | 50.2 | 356,369 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 164.8 | — | — |
| アイティフォー | 40.4 | 45.7 | 61,740 |
| 東計電算 | 4.3 | 10 | 35,600 |
| エックスネット | 3.3 | 2 | 2,432 |
| 大塚商会 | 174 | 177 | 1,168,377 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-----------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サイボウズ | 42.3 | 49.1 | 86,072 |
| 電通総研 | 37.3 | 43.4 | 213,962 |
| ACCESS | 36.3 | 37.1 | 62,513 |
| デジタルガレージ | 54.5 | 57 | 187,245 |
| EMシステムズ | 51.2 | 59.5 | 42,840 |
| ウェザーニューズ | 9.5 | 11 | 55,880 |
| C I J | 25.5 | 59.3 | 65,407 |
| ビジネスエンジニアリング | 4.8 | 6.7 | 25,795 |
| 日本エンタープライズ | 20.5 | 15.6 | 2,043 |
| WOWOW | 17.3 | 26.9 | 30,961 |
| スカラ | 28.4 | 33.1 | 24,030 |
| インテリジェント ウェイブ | 10.5 | 8 | 9,208 |
| ANYCOLOR | — | 37.8 | 100,170 |
| WOW WORLD GROUP | 2.9 | — | — |
| IMAGICA GROUP | 25.6 | 35.7 | 24,168 |
| ネットワンシステムズ | 114.4 | 144.1 | 399,373 |
| システムソフト | 106.8 | 124.2 | 7,452 |
| アルゴグラフィックス | 28.1 | 32.7 | 141,918 |
| マーベラス | 49.8 | 58 | 42,166 |
| エイベックス | 52.1 | 60.8 | 79,222 |
| B I P R O G Y | 113 | 116.8 | 538,798 |
| 兼松エレクトロニクス | 19.1 | — | — |
| 都築電気 | 16.2 | 18.8 | 45,383 |
| TBSホールディングス | 157.1 | 179.5 | 748,515 |
| 日本テレビホールディングス | 271.8 | 316 | 702,784 |
| 朝日放送グループホールディングス | 28.7 | 33.4 | 22,545 |
| テレビ朝日ホールディングス | 74.5 | 86.7 | 189,873 |
| スカパーJ SATホールディングス | 272.3 | 277.2 | 291,614 |
| テレビ東京ホールディングス | 22.1 | 25.7 | 79,156 |
| 日本BS放送 | 7.1 | 5.4 | 4,903 |
| ビジョン | 40.4 | 53.8 | 64,129 |
| スマートバリュー | 4.8 | 3.6 | 1,494 |
| USEN-NEXT HOLDINGS | 27.5 | 40 | 208,400 |
| ワイヤレスゲート | 8.6 | 6.6 | 1,419 |
| 日本通信 | 283.3 | 351.4 | 72,388 |
| クロップス | 3.9 | 2 | 2,204 |
| 日本電信電話 | 3,933.3 | 106,170.2 | 19,429,146 |
| KDDI | 2,372 | 2,758.1 | 12,450,063 |
| ソフトバンク | 4,931.2 | 5,745.2 | 11,648,393 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 光通信 | 36.1 | 36 | 999,720 |
| エムティーアイ | 28 | 24.5 | 18,399 |
| GMOインターネットグループ | 114 | 131.9 | 365,297 |
| ファイバーゲート | 16.5 | 19.2 | 21,504 |
| アイドマーケティングコミュニケーション | 4.5 | 3.5 | 826 |
| KADOKAWA | 162.3 | 188.7 | 508,546 |
| 学研ホールディングス | 51.1 | 59.4 | 55,836 |
| ゼンリン | 52.5 | 61 | 53,192 |
| 昭文社ホールディングス | 8.5 | 6.5 | 2,554 |
| インプレスホールディングス | 17.5 | 13.9 | 2,376 |
| アイネット | 18.6 | 21.6 | 49,809 |
| 松竹 | 17.5 | 18.5 | 186,850 |
| 東宝 | 192.1 | 198.6 | 1,016,236 |
| 東映 | 8.5 | 11.8 | 231,516 |
| NTTデータグループ | 963.1 | 933.3 | 2,297,317 |
| ビー・シー・エー | 17.6 | 20.5 | 36,018 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 13.1 | 14 | 30,478 |
| DTS | 65.4 | 75.2 | 302,680 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 154.3 | 163.1 | 982,025 |
| シーイーシー | 43 | 45 | 69,795 |
| カブコン | 305 | 319.2 | 1,921,903 |
| アイ・エス・ビー | 15.6 | 18.2 | 25,025 |
| ジャステック | 18.8 | 21.9 | 31,557 |
| S C S K | 250.5 | 249.8 | 719,673 |
| NSW | 11.9 | 15.9 | 50,323 |
| アイネス | 21.5 | 27.8 | 43,618 |
| TKC | 55.1 | 56.6 | 209,703 |
| 富士ソフト | 34.7 | 71.8 | 435,108 |
| NSD | 109.5 | 127.4 | 381,180 |
| コナミグループ | 131.4 | 133.7 | 1,369,088 |
| 福井コンピュータホールディングス | 21.3 | 22 | 58,366 |
| J B C Cホールディングス | 22.4 | 23.7 | 79,869 |
| ミロク情報サービス | 27.9 | 32.4 | 58,417 |
| ソフトバンクグループ | 1,774.8 | 1,760.7 | 16,166,747 |
| 卸売業 (7.59%) | | | |
| 高千穂交易 | 7.5 | 11.9 | 47,778 |
| オルパヘルスケアホールディングス | 3.5 | 2.4 | 4,783 |
| 伊藤忠食品 | 7.3 | 8.5 | 63,325 |
| エレマテック | 29.1 | 33.8 | 66,045 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| あらた | 24.8 | 57.6 | 185,184 | |
| トーメンデバイス | 4.7 | 5.4 | 36,504 | |
| 東京エレクトロン デバイス | 12 | 37.5 | 246,375 | |
| 円谷フィールズホールディングス | 55.6 | 64.7 | 111,154 | |
| 双日 | 343.8 | 419.2 | 1,693,568 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 325 | 377.9 | 859,722 | |
| 横浜冷凍 | 88.2 | 102.5 | 109,162 | |
| 神栄 | 3.1 | 2.3 | 3,935 | |
| ラサ商事 | 9.6 | 15.3 | 31,089 | |
| アルコニックス | 42.6 | 49.6 | 73,308 | |
| 神戸物産 | 250.5 | 291.3 | 1,074,314 | |
| ハイパー | 3.9 | 3.1 | 951 | |
| あい ホールディングス | 51.8 | 60.3 | 144,720 | |
| ディーブイエックス | 7.2 | 4.3 | 4,553 | |
| ダイワボウホールディングス | 132.3 | 166.7 | 424,751 | |
| マクニカホールディングス | 79.4 | 89.1 | 657,201 | |
| ラクト・ジャパン | 12.5 | 14.6 | 34,426 | |
| グリムス | 13.4 | 15.8 | 34,507 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 47.3 | 57 | 71,706 | |
| 八洲電機 | 26.2 | 30.4 | 49,339 | |
| メディアスホールディングス | 20.7 | 21.9 | 16,819 | |
| レスターホールディングス | 31 | 32 | 96,640 | |
| ジオリーブグループ | 4.1 | 3.3 | 4,880 | |
| 大光 | 8.9 | 6.8 | 4,460 | |
| OCHIホールディングス | 4.7 | 3.5 | 5,999 | |
| TOKAIホールディングス | 159.9 | 204.5 | 205,727 | |
| 黒谷 | 5.7 | 4.3 | 2,631 | |
| Cominix | 3.7 | 2.9 | 2,769 | |
| 三洋貿易 | 33.2 | 42.5 | 56,865 | |
| ビューティガレージ | 5.1 | 11.9 | 27,465 | |
| ウイン・パートナーズ | 23.6 | 24.4 | 30,573 | |
| ミタチ産業 | 5.3 | 4 | 4,884 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 116.4 | 135.3 | 298,201 | |
| 明治電機工業 | 12 | 14 | 21,588 | |
| デリカフーズホールディングス | 8.2 | 6.6 | 3,900 | |
| スターティアホールディングス | 4.8 | 3.6 | 5,479 | |
| コマダホールディングス | 79.3 | 92.3 | 252,717 | |
| ビーバンドットコム | 2.9 | 1.9 | 773 | |
| アセンテック | 10.8 | 14.4 | 8,899 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 富士興産 | 5.3 | 4.2 | 8,358 | |
| 協栄産業 | 2.1 | 1.6 | 4,648 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 32.2 | 33.5 | 73,733 | |
| ヤマエグループホールディングス | 18.3 | 24.9 | 68,001 | |
| 小野建 | 29.7 | 37 | 70,559 | |
| 南陽 | 4 | 3.2 | 8,460 | |
| 佐島電機 | 13.1 | 21 | 51,534 | |
| エコートレーディング | 4.4 | 3 | 3,714 | |
| 伯東 | 18.5 | 21.6 | 126,792 | |
| コンドーテック | 24.9 | 28.9 | 36,847 | |
| 中山福 | 11.1 | 8.4 | 3,208 | |
| ナガイレーベン | 40.9 | 47.6 | 114,811 | |
| 三菱食品 | 29.9 | 34.8 | 191,052 | |
| 松田産業 | 24.6 | 28.6 | 70,642 | |
| 第一興商 | 62.6 | 145.7 | 287,976 | |
| メディパルホールディングス | 335.8 | 382.9 | 890,433 | |
| S P K | 14.4 | 16.7 | 34,068 | |
| 萩原電気ホールディングス | 12.4 | 16.2 | 72,333 | |
| アズワン | 46.1 | 59 | 315,945 | |
| スズデン | 11.3 | 13.2 | 28,960 | |
| 尾家産業 | 4.9 | 3.7 | 6,515 | |
| シモジマ | 22.2 | 25.2 | 35,985 | |
| ドウシシャ | 34.2 | 34.8 | 74,402 | |
| 小津産業 | 4.7 | 3.6 | 6,271 | |
| 高速 | 16.8 | 22.3 | 52,405 | |
| たけびし | 12.3 | 14.4 | 29,908 | |
| リックス | 4.3 | 7.6 | 31,008 | |
| 丸文 | 28.9 | 33.6 | 51,744 | |
| ハビネット | 27.5 | 32 | 99,360 | |
| 橋本総業ホールディングス | 12.8 | 14.9 | 21,083 | |
| 日本ライフライン | 94.9 | 110.4 | 140,097 | |
| タカショー | 28.2 | 32.8 | 17,580 | |
| I DOM | 97.9 | 99.6 | 104,480 | |
| 進和 | 21.4 | 23 | 61,065 | |
| エスケイジャパン | 5.1 | 3.8 | 2,800 | |
| ダイトロン | 12.8 | 14.8 | 49,654 | |
| シークス | 46.1 | 53.7 | 92,686 | |
| 田中商事 | 6.5 | 4.4 | 4,149 | |
| 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 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 白銅 | 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 | |
| キャ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 | |
| ナイス | 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 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 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 | |
| ミツウロ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 | |
| リョーサン | 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 | |
| モスフードサービス | 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 | |
| 立花エレテック | 23.6 | 25 | 83,500 | |
| フォーバル | 12.7 | 14.8 | 18,662 | |
| PALTA 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Wismettac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 | |
| コア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 | |
|-------------------|---------|-----|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 北恵 | 4.7 | | 3.7 | 3,230 |
| イエローハット | 57.1 | | 59.8 | 115,115 |
| J Kホールディングス | 25.5 | | 28.9 | 31,183 |
| 日伝 | 19.2 | | 25.5 | 70,125 |
| 北沢産業 | 11.1 | | 8.9 | 3,079 |
| 杉本商事 | 14.4 | | 18.2 | 41,405 |
| 因幡電機産業 | 83.9 | | 97.6 | 352,824 |
| 東テク | 10.8 | | 12.6 | 113,400 |
| ミスミグループ本社 | 488.6 | | 568.5 | 1,162,014 |
| アルテック | 11.6 | | 8.4 | 2,570 |
| タキヒヨー | 5.7 | | 3.7 | 4,206 |
| 蔵王産業 | 4.1 | | 2.7 | 6,982 |
| スズケン | 100.7 | | 143.3 | 657,890 |
| ジェコス | 20.9 | | 22.5 | 26,437 |
| グローセル | 22.9 | | 44 | 32,824 |
| 小売業 (4.2%) | | | | |
| ローソン | 80.4 | | 80.1 | 825,430 |
| サンエー | 24.7 | | 28.7 | 134,890 |
| カワチ薬品 | 25.3 | | 29.4 | 77,910 |
| ユービーシー・マート | 47.2 | | 164.8 | 474,459 |
| ハードオフコーポレーション | 9.3 | | 13.4 | 23,450 |
| アスクル | 67 | | 90.9 | 189,617 |
| ゲオホールディングス | 34.1 | | 42.2 | 81,361 |
| アダストリア | 39.1 | | 45.5 | 172,672 |
| ジーフット | 12.7 | | 10.1 | 2,878 |
| シー・ヴィ・エス・バイエリア | 3.1 | | 2 | 1,444 |
| くら寿司 | 37.9 | | 44.1 | 203,080 |
| キャンドウ | 11.5 | | 13.4 | 36,917 |
| IKホールディングス | 6.7 | | 5.1 | 1,968 |
| バルグループホールディングス | 31.8 | | 73.9 | 187,188 |
| エディオン | 128.2 | | 149.1 | 231,105 |
| サーラコーポレーション | 68 | | 79.1 | 65,969 |
| ワッツ | 10.2 | | 7.7 | 5,028 |
| ハローズ | 14.7 | | 17.1 | 78,318 |
| フジオフードグループ本社 | 26.9 | | 42.2 | 58,151 |
| あみやき亭 | 7.8 | | 9.1 | 46,046 |
| ひらまつ | 44.8 | | 35.8 | 10,489 |
| 大黒天物産 | 9.9 | | 11.6 | 115,188 |
| ハニーズホールディングス | 25.5 | | 33.4 | 57,548 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-----|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| ファーマライズホールディングス | 4.5 | | 3.5 | 2,299 |
| アルペン | 26.7 | | 31.1 | 61,920 |
| ハブ | 6.9 | | 5.1 | 3,886 |
| クオールホールディングス | 44.5 | | 51.8 | 92,359 |
| ジンスホールディングス | 19.2 | | 22.3 | 98,231 |
| ビックカメラ | 215.3 | | 200.3 | 257,385 |
| DCMホールディングス | 197.7 | | 199 | 293,525 |
| ベッパーフードサービス | 69.3 | | 87.4 | 10,750 |
| Monotaro | 459.1 | | 533.8 | 936,018 |
| 東京一番フーズ | 4.8 | | 3.6 | 1,882 |
| DDグループ | 11.1 | | 8.9 | 11,365 |
| きちりホールディングス | 5.6 | | 3.7 | 3,466 |
| アークランドサービスホールディングス | 26.5 | | - | - |
| J. フロント リテイリング | 402.6 | | 432.1 | 717,718 |
| ドトール・日レスホールディングス | 57.4 | | 66.8 | 138,276 |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 196.4 | | 685 | 1,653,247 |
| ブロンコビリー | 17.3 | | 22.1 | 81,880 |
| ZOZO | 214 | | 239.9 | 949,044 |
| トレジャー・ファクトリー | 12.4 | | 20.7 | 30,077 |
| 物語コーポレーション | 54.1 | | 62.9 | 292,799 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 545.1 | | 634.2 | 1,582,646 |
| Hamee | 11.2 | | 15.2 | 18,969 |
| マーケットエンタープライズ | 2.1 | | 1.4 | 1,107 |
| ウエルシアホールディングス | 168 | | 195.3 | 508,072 |
| クリエイトSDホールディングス | 53.5 | | 53.4 | 173,817 |
| 丸善CHIホールディングス | 24.7 | | 18.7 | 6,208 |
| ミサワ | 4.3 | | 3.3 | 2,065 |
| ティーライフ | 2.8 | | 2.1 | 2,816 |
| エー・ビーホールディングス | 4.1 | | 3.3 | 3,455 |
| チムニー | 6.5 | | 4.9 | 6,894 |
| シュッピン | 24.1 | | 34 | 41,990 |
| オイシックス・ラ・大地 | 43.5 | | 50.6 | 67,601 |
| ネクステージ | 73.9 | | 86 | 237,446 |
| ジョイフル本田 | 96.2 | | 109.5 | 242,433 |
| 鳥貴族ホールディングス | 12 | | 13.9 | 66,581 |
| ホットランド | 24.8 | | 28.8 | 55,958 |
| すかいらーくホールディングス | 442.7 | | 514.7 | 1,220,353 |
| SFPホールディングス | 17.7 | | 20.6 | 39,531 |
| 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 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヨシックスホールディングス | 4.1 | 7.7 | 23,600 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 105.5 | 105.1 | 104,679 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 14.6 | 17 | 10,336 |
| BEENOS | 18.3 | 15.4 | 30,892 |
| あさひ | 27 | 34.9 | 46,347 |
| 日本調剤 | 22 | 25.6 | 41,395 |
| コスモス薬品 | 32 | 31.9 | 454,894 |
| トーエル | 9.3 | 7 | 5,754 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 1,116 | 3,893 | 8,325,180 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 243.6 | 254.9 | 267,390 |
| ツルハホールディングス | 68 | 79.1 | 863,376 |
| サンマルクホールディングス | 26.1 | 30.3 | 67,175 |
| フェリシモ | 4.7 | 3.5 | 3,241 |
| トリドールホールディングス | 80.5 | 105.5 | 451,223 |
| TOKYO BASE | 33.3 | 42.8 | 13,353 |
| ウイルプラスホールディングス | 4 | 2.6 | 2,631 |
| JMホールディングス | 27.5 | 28.4 | 74,067 |
| サツドラホールディングス | 9.5 | 6.8 | 5,868 |
| アレンザホールディングス | 24.2 | 28.1 | 29,420 |
| 串カツ田中ホールディングス | 8.6 | 10 | 17,070 |
| パロックジャパンリミテッド | 21 | 29.3 | 22,238 |
| クスリのアオキホールディングス | 28.9 | 113.3 | 358,594 |
| 力の源ホールディングス | 11.2 | 19.3 | 31,767 |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 186 | 200.8 | 594,167 |
| メディカルシステムネットワーク | 28.1 | 40.8 | 26,968 |
| 一家ホールディングス | 4.5 | 3.5 | 2,534 |
| ジャパンクラフトホールディングス | 6.5 | 9.2 | 1,462 |
| はるやまホールディングス | 9.9 | 7.6 | 4,993 |
| ノジマ | 105.7 | 109.2 | 185,094 |
| カッパ・クリエイト | 50.9 | 59.2 | 97,976 |
| ライトオン | 15.8 | 12 | 5,088 |
| 良品計画 | 417.8 | 411 | 983,728 |
| バリミキホールディングス | 26.1 | 19.9 | 8,557 |
| アドヴァングループ | 30.8 | 35.8 | 42,924 |
| アルビス | 10.6 | 12.3 | 34,280 |
| コナカ | 22.8 | 17.3 | 7,266 |
| ハウス オブ ローゼ | 2.6 | 2 | 3,318 |
| G-7ホールディングス | 40.3 | 41 | 59,081 |
| イオン北海道 | 47.9 | 111.3 | 99,724 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| コジマ | 62.4 | 62.2 | 50,879 |
| ヒマラヤ | 6.6 | 5.1 | 4,651 |
| コーナン商事 | 43.7 | 46.2 | 199,122 |
| エコス | 12 | 14 | 32,354 |
| ワタミ | 39.1 | 39.8 | 39,481 |
| マルシェ | 6.9 | 5.5 | 1,556 |
| 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 |
| 西松屋チェーン | 71.7 | 74.1 | 181,470 |
| ゼンショーホールディングス | 177.2 | 191.7 | 1,217,295 |
| 幸楽苑ホールディングス | 21.1 | 27.9 | 39,478 |
| ハークスレイ | 8.8 | 5.6 | 5,314 |
| サイゼリヤ | 53.8 | 55.7 | 284,627 |
| VTホールディングス | 123 | 143 | 76,791 |
| 魚力 | 10 | 13.1 | 32,343 |
| ポプラ | 4.6 | 3.6 | 954 |
| フジ・コーポレーション | 18.3 | 17.9 | 31,325 |
| ユナイテッドアローズ | 34.6 | 44.2 | 87,913 |
| ハイデイ日高 | 48 | 55.8 | 148,483 |
| YU-WA Creation Holdi | 12.4 | 8.9 | 1,557 |
| コロワイド | 149.2 | 161.9 | 353,346 |
| ビーシーデポコーポレーション | 36.1 | - | - |
| 沓番屋 | 25.6 | 148.7 | 178,142 |
| トップカルチャー | 6.7 | 5.2 | 816 |
| PLANT | 4.9 | 3.6 | 6,332 |
| スギホールディングス | 65.2 | 227.6 | 579,924 |
| 葉王堂ホールディングス | 18.1 | 18.4 | 48,962 |
| ヴィア・ホールディングス | 27.8 | 22.2 | 2,997 |
| スクロール | 48 | 56.1 | 54,865 |
| ヨンドシーホールディングス | 27.8 | 35.6 | 67,568 |
| 木曾路 | 49 | 57 | 152,247 |
| SRSホールディングス | 53.4 | 62.1 | 73,526 |
| 千趣会 | 59.6 | 69.3 | 20,512 |
| タカキュー | 14.3 | 11.2 | 761 |
| リテールパートナーズ | 48 | 55.9 | 101,961 |
| ケーヨー | 52.2 | - | - |
| 上新電機 | 28.8 | 37.3 | 87,431 |
| 日本瓦斯 | 173.5 | 199.5 | 518,999 |
| ロイヤルホールディングス | 62.8 | 66.4 | 165,402 |
| 東天紅 | 1.5 | 1.2 | 1,126 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| いなげや | 31.5 | 36.6 | 51,313 | |
| チョダ | 30.9 | 36 | 31,392 | |
| ライフコーポレーション | 28.3 | 39.5 | 151,877 | |
| リンガーハット | 41.8 | 48.6 | 112,606 | |
| MrMaxHD | 45.3 | 47.4 | 29,482 | |
| テンアライド | 21.2 | 17 | 5,304 | |
| AOKIホールディングス | 60.2 | 80.7 | 93,047 | |
| オークワ | 51.8 | 54.2 | 45,907 | |
| コメリ | 49.8 | 57.9 | 205,545 | |
| 青山商事 | 69.2 | 80.5 | 148,039 | |
| しまむら | 38 | 88.4 | 788,086 | |
| はせがわ | 11.2 | 7.5 | 2,610 | |
| 高島屋 | 244.1 | 260.2 | 628,903 | |
| 松屋 | 54.9 | 63.8 | 66,352 | |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 157.6 | 166.6 | 327,702 | |
| 近鉄百貨店 | 10.4 | 16.1 | 38,318 | |
| 丸井グループ | 238.8 | 249.9 | 620,501 | |
| アクシアル リテイリング | 22.1 | 25.7 | 107,040 | |
| 井筒屋 | 9.9 | 7.5 | 2,827 | |
| イオン | 1,097.8 | 1,276.4 | 4,559,300 | |
| イズミ | 49.2 | 66.8 | 234,668 | |
| 平和堂 | 54.1 | 62.9 | 126,051 | |
| フジ | 49.7 | 57.8 | 106,698 | |
| ヤオコー | 36.6 | 44.5 | 420,302 | |
| ゼビオホールディングス | 43.9 | 51 | 50,643 | |
| ケーズホールディングス | 257.5 | 252.9 | 335,345 | |
| Olympicグループ | 9.3 | 6.9 | 3,594 | |
| 日産東京販売ホールディングス | 31.1 | 23.6 | 14,466 | |
| シルバーライフ | 7.4 | 7.2 | 6,696 | |
| Genky DrugStores | 14.2 | 16.5 | 108,570 | |
| ナルミヤ・インターナショナル | 4.5 | 2.6 | 3,133 | |
| ブックオフグループホールディングス | 12.3 | 21.9 | 31,251 | |
| ギフトホールディングス | 6.8 | 15.9 | 56,842 | |
| アインホールディングス | 44.6 | 51.9 | 283,841 | |
| 元氣寿司 | 9.2 | 21.3 | 68,905 | |
| ヤマダホールディングス | 1,327.8 | 1,158.1 | 516,860 | |
| アークランズ | 47.4 | 112 | 196,224 | |
| ニトリホールディングス | 131 | 137.1 | 3,302,739 | |
| グルメ杵屋 | 26.2 | 30.5 | 34,068 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 愛眼 | 15.5 | 11.7 | 2,246 | |
| ケーユーホールディングス | 18.9 | 17.6 | 20,891 | |
| 吉野家ホールディングス | 126.7 | 138.7 | 460,622 | |
| 松屋フーズホールディングス | 15.3 | 17.8 | 103,774 | |
| サガミホールディングス | 52 | 56.5 | 88,196 | |
| 関西フードマーケット | 29.2 | 25.5 | 45,288 | |
| 王将フードサービス | 21.3 | 27.9 | 221,247 | |
| ミニストップ | 23.5 | 27.4 | 41,154 | |
| アークス | 59.4 | 69.1 | 215,592 | |
| パローホールディングス | 61.8 | 71.8 | 180,864 | |
| バルク | 16.1 | 18.7 | 127,908 | |
| 大庄 | 11.3 | 18.1 | 22,371 | |
| ファーストリテイリング | 145.7 | 169.4 | 7,983,822 | |
| サンドラッグ | 122.9 | 127 | 613,918 | |
| サックスパー ホールディングス | 30.8 | 31.8 | 29,001 | |
| ヤマザワ | 4.4 | 3.4 | 4,263 | |
| やまや | 4.3 | 3.3 | 10,890 | |
| ペルーナ | 77.9 | 90.6 | 56,806 | |
| 銀行業 (7.4%) | | | | |
| いよぎんホールディングス | 358.7 | 417.1 | 501,562 | |
| しずおかフィナンシャルグループ | 681.2 | 778.7 | 1,165,713 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 253.8 | 295.1 | 371,826 | |
| 楽天銀行 | — | 121.9 | 379,109 | |
| 京都フィナンシャルグループ | — | 444.1 | 1,236,818 | |
| 島根銀行 | 6.7 | 4.3 | 2,515 | |
| じもとホールディングス | 14 | 11.2 | 7,179 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 1,495.8 | 1,739.2 | 868,382 | |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 38.6 | 44.9 | 212,377 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 530.4 | 678.3 | 780,723 | |
| ゆうちょ銀行 | 858.3 | 3,851.6 | 6,507,278 | |
| 富山第一銀行 | 75.1 | 111.3 | 107,293 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 1,661.4 | 1,880.7 | 1,480,675 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 190.9 | 197.8 | 382,149 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 27 | 31.3 | 65,260 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 47.3 | 55 | 251,625 | |
| ひろぎんホールディングス | 393.3 | 498.9 | 554,776 | |
| おきなわフィナンシャルグループ | 28.7 | 29.9 | 79,563 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 39.1 | 45.4 | 218,828 | |
| 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 | |
|-------------------|----------|----------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ブロックレアホールディングス | 36.9 | 40 | 76,400 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 42.2 | 53.9 | 147,147 | |
| SBI新生銀行 | 88.9 | — | — | |
| あおぞら銀行 | 189.5 | 251.9 | 622,444 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 19,139.1 | 21,345.3 | 33,736,246 | |
| りそなホールディングス | 3,809.9 | 4,053.6 | 3,842,407 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 547.8 | 1,259.6 | 4,238,554 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 2,202.8 | 2,492 | 22,305,892 | |
| 千葉銀行 | 840.1 | 976.8 | 1,248,350 | |
| 群馬銀行 | 584.9 | 680.1 | 600,528 | |
| 武蔵野銀行 | 38.7 | 48.9 | 146,944 | |
| 千葉興業銀行 | 45.6 | 66.2 | 71,098 | |
| 筑波銀行 | 132.3 | 153.8 | 46,909 | |
| 七十七銀行 | 96.5 | 102 | 414,630 | |
| 秋田銀行 | 20.2 | 23.5 | 49,726 | |
| 山形銀行 | 33.5 | 38.9 | 46,485 | |
| 岩手銀行 | 20.6 | 22.2 | 58,497 | |
| 東邦銀行 | 238.4 | 277.2 | 101,732 | |
| 東北銀行 | 9.5 | 7.2 | 9,345 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 240.6 | 305.2 | 1,253,456 | |
| スルガ銀行 | 265.7 | 308.9 | 275,229 | |
| 八十二銀行 | 618.3 | 752.1 | 769,022 | |
| 山梨中央銀行 | 31 | 39.3 | 76,084 | |
| 大垣共立銀行 | 57.5 | 66.8 | 152,237 | |
| 福井銀行 | 26.9 | 31.3 | 61,974 | |
| 清水銀行 | 12 | 13.9 | 22,948 | |
| 富山銀行 | 3.3 | 2.5 | 5,112 | |
| 滋賀銀行 | 50.1 | 58.3 | 247,483 | |
| 南都銀行 | 45.4 | 52.7 | 165,741 | |
| 百五銀行 | 283.6 | 329.7 | 217,931 | |
| 京都銀行 | 95.5 | — | — | |
| 紀陽銀行 | 107.8 | 125.4 | 238,260 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 191.6 | 216.9 | 414,821 | |
| 山陰合同銀行 | 188.7 | 219.4 | 275,785 | |
| 鳥取銀行 | 6.7 | 5.2 | 8,216 | |
| 百十四銀行 | 27.5 | 34.5 | 104,362 | |
| 四国銀行 | 47.9 | 51.4 | 62,708 | |
| 阿波銀行 | 44.5 | 49.2 | 140,908 | |
| 大分銀行 | 18.1 | 21.1 | 63,405 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 宮崎銀行 | 19.7 | 21.1 | 62,392 | |
| 佐賀銀行 | 17.7 | 20.5 | 43,993 | |
| 琉球銀行 | 69.1 | 74.6 | 90,788 | |
| セブン銀行 | 1,079.8 | 1,098.6 | 325,515 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 4,359.4 | 4,731.1 | 14,401,468 | |
| 高知銀行 | 6.7 | 5.1 | 5,518 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 332.8 | 343.7 | 552,669 | |
| 長野銀行 | 6.5 | — | — | |
| 名古屋銀行 | 19.9 | 22.7 | 152,090 | |
| 北洋銀行 | 456.7 | 531.1 | 239,526 | |
| 大光銀行 | 6.3 | 4.8 | 7,497 | |
| 愛媛銀行 | 40.6 | 47.2 | 54,138 | |
| トマト銀行 | 6.4 | 5.2 | 6,812 | |
| 京葉銀行 | 140 | 144.3 | 111,399 | |
| 栃木銀行 | 138 | 175 | 64,750 | |
| 北日本銀行 | 10.6 | 11.4 | 28,819 | |
| 東和銀行 | 55.3 | 64.3 | 47,582 | |
| 福島銀行 | 22.4 | 15.5 | 4,836 | |
| 大東銀行 | 9.3 | 6.5 | 5,271 | |
| トモニホールディングス | 243.6 | 331.7 | 140,972 | |
| フィデアホールディングス | 31.1 | 36.2 | 59,730 | |
| 池田泉州ホールディングス | 386 | 486.2 | 193,021 | |
| 証券、商品先物取引業 (0.99%) | | | | |
| FPG | 122.3 | 118.5 | 257,263 | |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 24.6 | 56.8 | 61,571 | |
| マーキュリアホールディングス | 11.4 | 7.5 | 8,062 | |
| SBIホールディングス | 436.3 | 513.7 | 2,089,217 | |
| 日本アジア投資 | 16.7 | 10.8 | 2,505 | |
| ジャフコ グループ | 100.6 | 104.4 | 193,087 | |
| 大和証券グループ本社 | 2,155.5 | 2,715.2 | 3,232,445 | |
| 野村ホールディングス | 5,551.4 | 5,894.3 | 5,779,950 | |
| 岡三証券グループ | 264.6 | 307.7 | 262,468 | |
| 丸三証券 | 100.3 | 116.6 | 136,422 | |
| 東洋証券 | 100 | 93 | 39,804 | |
| 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 | |
| 光世証券 | 4.4 | 3.4 | 3,060 | |
| 水戸証券 | 80.9 | 103.5 | 53,509 | |
| いちよし証券 | 55.5 | 65.6 | 56,088 | |
| 松井証券 | 178 | 172.5 | 149,212 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-----|---------|------------|
| | 株 数 | 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 |
| 保険業 (2.7%) | | | | |
| かんぽ生命保険 | 366 | | 357 | 1,064,752 |
| F P パートナー | — | | 7 | 45,990 |
| SOMPO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 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 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 |
| その他金融業 (1.2%) | | | | |
| 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 |
| リコーリース | 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 | 株 数 | 評 価 額 |
| | | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三菱HC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 |
| アサクス | 11 | | 6.8 | 5,569 |
| NECキャピタルソリューション | 14.8 | | 17.2 | 67,940 |
| 不動産業 (2.0%) | | | | |
| Robot Home | — | | 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 |
| SREホールディングス | 14.8 | | 15.1 | 60,777 |
| AD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 |
| コーセーアールイー | 6.2 | | 4.7 | 3,717 |
| 地主 | 23 | | 26.8 | 62,336 |
| プレサンスコーポレーション | 39.6 | | 55.6 | 97,633 |
| THEグローバル社 | 11.3 | | 8.6 | 3,672 |
| ハウスコム | 3.7 | | 2.4 | 2,472 |
| JPMC | 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 |
| オープンハウスグループ | 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 |
| イギリスランド | 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 |
| And Do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 | |
|------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ケイアイスター不動産 | 14.5 | 16.9 | 63,037 | |
| アグレ都市デザイン | 3.5 | 2.7 | 4,463 | |
| グッドコムアセット | 28 | 32.5 | 26,000 | |
| ジェイ・エス・ビー | 7.5 | 17.4 | 45,414 | |
| ロードスターキャピタル | 12.9 | 22.8 | 59,895 | |
| テンボイノベーション | 5.9 | 4.4 | 4,290 | |
| グローバル・リンク・マネジメント | 3.7 | 2.7 | 7,673 | |
| フェイスネットワーク | 2.7 | 4 | 5,156 | |
| 霞ヶ関キャピタル | — | 9.5 | 159,600 | |
| パーク24 | 234.9 | 227.6 | 402,965 | |
| バラカ | 10.6 | 12.4 | 24,589 | |
| ミガロホールディングス | — | 2.3 | 5,106 | |
| 宮越ホールディングス | 13.7 | 16 | 21,184 | |
| 三井不動産 | 1,310.1 | 1,620.9 | 7,730,072 | |
| 三菱地所 | 1,818.8 | 2,291.1 | 6,081,724 | |
| 平和不動産 | 48.9 | 56.9 | 226,462 | |
| 東京建物 | 287.3 | 306.2 | 729,674 | |
| 京阪神ビルディング | 38 | 65.5 | 99,625 | |
| 住友不動産 | 544.9 | 506.9 | 2,666,294 | |
| テーオーシー | 54.5 | 62.4 | 42,369 | |
| 東京楽天地 | 5.2 | — | — | |
| レオバレス21 | 339.3 | 350.7 | 174,297 | |
| スターツコーポレーション | 43.3 | 50.3 | 158,696 | |
| フジ住宅 | 42.2 | 44.1 | 33,427 | |
| 空港施設 | 36.4 | 49.4 | 30,578 | |
| 明和地所 | 9.9 | 20 | 22,240 | |
| ゴールドクレスト | 28.7 | 28.6 | 71,156 | |
| エスリード | 14.2 | 16.5 | 59,317 | |
| 日神グループホールディングス | 48.4 | 56.2 | 29,842 | |
| 日本エスコ | 67.7 | 65.6 | 67,764 | |
| MIRARTHホールディングス | 152.3 | 161 | 82,271 | |
| AVANTIA | 9.9 | 7.9 | 6,762 | |
| イオンモール | 156.3 | 181.7 | 320,246 | |
| 毎日コムネット | 7.2 | 5.4 | 4,201 | |
| ファースト住建 | 7.9 | 5.9 | 6,743 | |
| ランド | 1,814.2 | 1,945.4 | 15,563 | |
| カチタス | 81 | 94.2 | 184,820 | |
| トーセイ | 50.1 | 58.3 | 134,381 | |
| 穴吹興産 | 4.6 | 2.8 | 5,972 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| サンフロンティア不動産 | 50.2 | 51.9 | 92,278 | |
| FJネクストホールディングス | 31.7 | 36.9 | 51,180 | |
| インテリックス | 4.7 | 3.5 | 2,152 | |
| ランドビジネス | 7.1 | 5.4 | 1,468 | |
| サンネクスタグループ | 6.4 | 4.3 | 4,300 | |
| グランディハウス | 14.4 | 26.3 | 17,752 | |
| 日本空港ビルデング | 106.6 | 124 | 759,748 | |
| サービス業 (4.5%) | | | | |
| 明豊ファシリティワークス | 9.3 | 7.5 | 6,765 | |
| 日本工営 | 19 | — | — | |
| LIFULL | 107.6 | 125.1 | 21,642 | |
| MIXI | 71.6 | 78.5 | 210,223 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 28.4 | 132.2 | 101,000 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 539.9 | 582.9 | 560,458 | |
| メンバーズ | 9.2 | 12.5 | 11,262 | |
| 中広 | 3.3 | 2.5 | 1,060 | |
| UTグループ | 46.2 | 47.1 | 167,440 | |
| アイティメディア | 11.9 | 13.9 | 27,730 | |
| ケアネット | — | 56.1 | 37,699 | |
| E・Jホールディングス | 18.4 | 21.4 | 36,915 | |
| オープンアップグループ | 94.3 | 109.9 | 223,426 | |
| コシダカホールディングス | 94.2 | 109.5 | 103,477 | |
| アルトナー | 4.9 | 3.9 | 9,016 | |
| パソナグループ | 38.2 | 44.4 | 123,876 | |
| CDS | 5.1 | 3.8 | 6,566 | |
| リンクアンドモチベーション | 90.6 | 105.3 | 58,862 | |
| エス・エム・エス | 119.7 | 128.2 | 321,205 | |
| サニーサイドアップグループ | 7.1 | 4.6 | 3,468 | |
| パーソルホールディングス | 352.2 | 3,724.2 | 800,703 | |
| リニカル | 11.5 | 9.1 | 3,658 | |
| クックパッド | 86.1 | 100.1 | 13,413 | |
| エスクリ | 9.2 | 6.3 | 1,921 | |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 10 | 7.5 | 6,090 | |
| 学情 | 14.2 | 18.6 | 32,364 | |
| スタジオアリス | 15.7 | 18.3 | 37,606 | |
| シミックホールディングス | 17.3 | — | — | |
| エプロ | 4.3 | 3.5 | 2,978 | |
| NJS | 6.9 | 8 | 24,800 | |
| 総合警備保障 | 116.8 | 611.1 | 513,262 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| カカココム | 230.9 | 241.7 | 459,109 | |
| アイロムグループ | 11.3 | 14.8 | 28,504 | |
| セントケア・ホールディング | 20 | 26.6 | 23,886 | |
| サイネックス | 3.5 | 2.7 | 2,243 | |
| ルネサンス | 22 | 28.5 | 30,609 | |
| ディップ | 55.1 | 56 | 153,944 | |
| デジタルホールディングス | 24.5 | 19 | 20,995 | |
| 新日本科学 | 33.4 | 33.2 | 50,962 | |
| キャリアデザインセンター | 4.2 | 3.2 | 5,625 | |
| ベネフィット・ワン | 145.8 | 127.1 | 274,599 | |
| エムスリー | 621.7 | 723 | 1,525,891 | |
| ツカダ・グローバルホールディング | 13.1 | 10 | 4,410 | |
| プラス | 2.7 | 1.8 | 1,220 | |
| アウトソーシング | 187.4 | 234.8 | 410,547 | |
| ウェルネット | 18.1 | 11.8 | 6,560 | |
| ワールドホールディングス | 14.1 | 16.5 | 41,695 | |
| ディー・エヌ・エー | 134.1 | 130 | 192,465 | |
| 博報堂DYホールディングス | 401.3 | 466.6 | 630,376 | |
| ぐるなび | 57.8 | 68.2 | 21,073 | |
| タカミヤ | 42.7 | 49.6 | 28,123 | |
| ジャパンベストレスキューシステム | 19.5 | — | — | |
| ファンコムコミュニケーションズ | 61.6 | 51.2 | 20,684 | |
| ライク | 11.7 | 13.6 | 21,991 | |
| A o b a - B B T | 7.6 | 5.8 | 2,256 | |
| エスプール | 90.4 | 105.1 | 32,581 | |
| W D B ホールディングス | 16.1 | 18.7 | 43,365 | |
| ティア | 11.9 | 9.2 | 4,305 | |
| C D G | 2.2 | 1.7 | 2,104 | |
| アドウェイズ | 43.3 | 50.3 | 21,880 | |
| バリューコマース | 23.7 | 32.1 | 34,956 | |
| インフォマート | 326.6 | 379.8 | 155,718 | |
| J P ホールディングス | 90.5 | 93.5 | 49,835 | |
| エコナックホールディングス | 35.3 | 13.4 | 1,929 | |
| C L ホールディングス | 8.7 | 8.7 | 10,944 | |
| プレスステージ・インターナショナル | 132.3 | 171.2 | 113,848 | |
| アミューズ | 17.1 | 22.3 | 34,698 | |
| ドリムインキュベータ | 9.6 | 12.5 | 35,237 | |
| クイック | 24 | 25.4 | 59,131 | |
| T A C | 11.1 | 7.6 | 1,474 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|---------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 電通グループ | 309.2 | 359.5 | 1,516,730 | |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 9.3 | 14 | 15,974 | |
| びあ | 10.5 | 12.5 | 41,125 | |
| イオンファンタジー | 13.6 | 13.2 | 31,046 | |
| シーティーエス | 34.8 | 46.2 | 36,590 | |
| N E X Y Z . G r o u p | 6.3 | 4.8 | 2,889 | |
| H . U . グループホールディングス | 92.1 | 107.1 | 275,086 | |
| アルプス技研 | 27.4 | 34.7 | 94,939 | |
| サニックス | 50.4 | 58.6 | 19,045 | |
| 日本空調サービス | 33.8 | 39.3 | 35,212 | |
| オリエンタルランド | 333 | 1,936.1 | 9,595,311 | |
| ダスキン | 70 | 81.4 | 272,120 | |
| 明光ネットワークジャパン | 41.4 | 44.4 | 31,968 | |
| ファルコホールディングス | 14.2 | 16.5 | 38,775 | |
| 秀英予備校 | 4.5 | 3.5 | 1,095 | |
| 田谷 | 3.7 | 2.6 | 1,084 | |
| ラウンドワン | 263.1 | 344.3 | 273,718 | |
| リゾートトラスト | 124.2 | 158.9 | 425,136 | |
| ビー・エム・エル | 39 | 45 | 135,225 | |
| りらいあコミュニケーションズ | 51.9 | — | — | |
| リソー教育 | 143 | 187.1 | 42,097 | |
| 早稲田アカデミー | 17.4 | 20.2 | 32,966 | |
| ユー・エス・エス | 323.6 | 410.4 | 1,038,312 | |
| 東京個別指導学院 | 37.3 | 43.4 | 18,662 | |
| サイバーエージェント | 752.9 | 808.5 | 895,009 | |
| 楽天グループ | 1,456.6 | 3,136.5 | 2,768,902 | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 18.4 | 18.4 | 34,978 | |
| S B I グローバルアセットマネジメント | 51.3 | 71.6 | 55,346 | |
| テー・オー・ダブリュ | 61.7 | 71.7 | 26,672 | |
| 山田コンサルティンググループ | 15.9 | 15.9 | 28,794 | |
| セントラルスポーツ | 11.8 | 13.7 | 35,181 | |
| フルキャストホールディングス | 30 | 34.9 | 50,709 | |
| エン・ジャパン | 56.9 | 59.5 | 164,458 | |
| リソルホールディングス | 2.2 | 1.3 | 7,475 | |
| テクノプロ・ホールディングス | 186.1 | 214.2 | 668,732 | |
| アトラグループ | 4.6 | 3.6 | 633 | |
| インターワークス | 5.9 | — | — | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 16.3 | 19 | 25,460 | |
| K e e P e r 技研 | 19.4 | 22.6 | 113,452 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ファーストロジック | 3.1 | 3.5 | 1,925 | |
| 三機サービス | 3.5 | 2.3 | 3,466 | |
| Gunosy | 25 | 29 | 23,780 | |
| デザインワン・ジャパン | 6.1 | 3.8 | 528 | |
| イー・ガーディアン | 11.9 | 13.8 | 18,671 | |
| リブセンス | 9.4 | 7.1 | 1,654 | |
| ジャパンマテリアル | 96.3 | 111.9 | 264,084 | |
| ベクトル | 49.4 | 44.9 | 52,577 | |
| ウチヤマホールディングス | 10.1 | 6.6 | 2,514 | |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 26.2 | 30.5 | 47,153 | |
| キャリアリンク | 11.5 | 13.4 | 36,059 | |
| IBJ | 19.2 | 27.9 | 15,400 | |
| アサンテ | 15.5 | 18.1 | 30,661 | |
| バリューHR | 27.5 | 32 | 42,560 | |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 29.1 | 29.6 | 67,310 | |
| 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 | |
| ERIホールディングス | 5.7 | 3.9 | 7,047 | |
| アピスト | 3.2 | 2.4 | 7,932 | |
| シグマクシス・ホールディングス | 47.7 | 49.3 | 85,338 | |
| ウィルグループ | 26.2 | 30.5 | 34,068 | |
| エスクロー・エージェント・ジャパン | 21.3 | 17.1 | 2,462 | |
| メドピア | 24.8 | 32.1 | 22,823 | |
| レアジョブ | 3.9 | 2.9 | 2,340 | |
| リクルートホールディングス | 2,329.3 | 2,708.5 | 17,605,250 | |
| エラン | 41.6 | 48.4 | 42,688 | |
| 土木管理総合試験所 | 8.5 | 6.7 | 2,257 | |
| 日本郵政 | 4,123.5 | 4,299 | 6,598,965 | |
| ベルシステム24ホールディングス | 42.2 | 39.3 | 61,386 | |
| 鎌倉新書 | 35.7 | 31.2 | 24,367 | |
| SMN | 4.7 | 2.9 | 1,151 | |
| 一蔵 | 2.6 | 2 | 1,234 | |
| グローバルキッズCOMPANY | 3.1 | 2.5 | 1,702 | |
| エアトリ | 20.3 | 26.8 | 45,506 | |
| アトラエ | 24.7 | 21.6 | 9,568 | |
| ストライク | 15.5 | 15.5 | 74,322 | |
| ソラスト | 86.7 | 100.8 | 54,028 | |
| セラク | 11.2 | 11.2 | 12,532 | |
| インソース | 78.1 | 79.4 | 71,301 | |
| バイカレント・コンサルティング | 249 | 268.9 | 788,683 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| Orchestra Holdings | 6.7 | 7.8 | 7,488 | |
| アイモバイル | 16.3 | 46.4 | 19,070 | |
| キャリアインデックス | 7 | 5.2 | 1,045 | |
| MS-Japan | 8.3 | 13.3 | 16,132 | |
| 船場 | 3.5 | 2.7 | 3,545 | |
| 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 | |
| フルテック | 2.9 | 2.1 | 2,366 | |
| グリーンズ | 7.7 | 5.6 | 14,028 | |
| ツナググループ・ホールディングス | 5.7 | 4.3 | 3,147 | |
| GameWith | 6.1 | 4.6 | 1,398 | |
| MS&Consulting | 3 | 2 | 1,214 | |
| ウエルビー | 23.1 | 18.3 | 19,690 | |
| エル・ティー・エス | 4 | 4.3 | 9,933 | |
| ミダックホールディングス | 19.1 | 22.2 | 36,519 | |
| 日総工産 | 23.6 | - | - | |
| キュービーネットホールディングス | 14.9 | 20.9 | 25,644 | |
| RPAホールディングス | 42.6 | 49.7 | 14,562 | |
| スプリックス | 7 | 4.4 | 3,643 | |
| マネジメントソリューションズ | 17.3 | 15.7 | 33,111 | |
| プロレド・パートナーズ | 7.7 | 8.9 | 4,850 | |
| and factory | 5.9 | 4.5 | 1,413 | |
| テクノ・ホールディングス | 2.5 | 2 | 950 | |
| フロンティア・マネジメント | 10.5 | 9.2 | 15,189 | |
| ピアラ | 3.3 | 2.7 | 850 | |
| コプロ・ホールディングス | 4 | 5.1 | 9,190 | |
| ギークス | 3.5 | 2 | 966 | |
| アンビスホールディングス | 26.5 | 39.2 | 93,844 | |
| カープスホールディングス | 96.7 | 99.9 | 80,719 | |
| フォーラムエンジニアリング | 18.3 | 49.8 | 48,057 | |
| Fast Fitness Japan | 10.7 | 12.5 | 13,875 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 37.6 | 37.7 | 11,762 | |
| ポピンズ | 4.7 | 5.4 | 8,159 | |
| LITALICO | 24.5 | 28.5 | 60,277 | |
| コンフィデンス・インターワークス | - | 1.4 | 2,384 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 10.3 | 7.9 | 3,278 | |
| リロググループ | 175.1 | 183.3 | 225,275 | |
| 東祥 | 21.9 | 25.5 | 19,915 | |
| ID&Eホールディングス | - | 22.1 | 93,593 | |
| ビーウィズ | 5.9 | 7.5 | 16,050 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 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 | |
| 燦ホールディングス | 13.9 | 34.3 | 36,358 | |
| スバル興業 | 1.3 | 11.3 | 30,250 | |
| 東京テアトル | 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・コスモス | 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 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 藤田観光 | 14 | 14.6 | 109,792 | |
| KNT-CT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 | |
| メイテ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 | |
| ベ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 | 2,148 | <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< >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 | 百万円 |
| | | 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 | 当 期 末 |
|---------------|----------------|
| | 数 量 |
| 貸付有価証券<株式>総株数 | 株 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 1,400,111,695 | % 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 | 円 |
|-----------------|-------------------|---|
| (A) 資産 | 1,427,857,312,196 | |
| コール・ローン等 | 25,523,880,695 | |
| 株式(評価額) | 1,400,111,695,310 | |
| 未収入金 | 198,464,200 | |
| 未収配当金 | 1,828,554,601 | |
| 未収利息 | 49,236 | |
| その他未収収益 | 12,600,294 | |
| 差入委託証拠金 | 182,067,860 | |
| (B) 負債 | 18,653,673,727 | |
| 未払金 | 4,301,999,593 | |
| 未払解約金 | 3,143,876,446 | |
| 未払利息 | △ 49,010 | |
| 受入担保金 | 11,207,846,698 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,409,203,638,469 | |
| 元本 | 417,799,026,755 | |
| 次期繰越損益金 | 991,404,611,714 | |
| (D) 受益権総口数 | 417,799,026,755口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 33,729円 | |

○損益の状況 (2023年3月28日～2024年3月25日)

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

<注記事項>

| | | |
|---------------------------------------------|------------------|-----------------|
| 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・オープン (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トピックスオープン | | 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プン | | 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 トピックスオープン (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 バランスファンド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・イノベーション (株式重視型) | | 2,014,569,502円 |
| eMAXIS 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 バランスファンド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・イヤーズ・ファンド2040 (確定拠出年金) | | 1,049,994,537円 |
| 三菱UFJ ターゲット・イヤーズ・ファンド2050 (確定拠出年金) | | 1,036,749,488円 |
| 三菱UFJ トピックスオープン | | 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 TOPIX・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VA50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 ウェルス・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 TOPIX・ファンドVA | 70,966,779円 |
| 三菱UFJ バランスファンドVA20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 トピックスオープン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・イヤール・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プン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VA30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)

S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド

《第21期》決算日2024年2月26日

[計算期間：2023年8月26日～2024年2月26日]

「S & P 5 0 0 インデックスマザーファンド」は、2月26日に第21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21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に採用されている米国の株式に投資を行い、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。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。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を行いません。 |
| 主要運用対象 | 米国の株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。 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 5 0 0 指数 | | 株式組入比率 | 株先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|----------------|-------|--------|-------|------------|-----------|
| | 円 | % | (配当込み、円換算ベース) | % | | | | |
| 17期(2022年2月25日) | 30,954 | 1.2 | 30,329 | 1.1 | 93.7 | 3.9 | 2.5 | 1,050,354 |
| 18期(2022年8月25日) | 35,674 | 15.2 | 34,902 | 15.1 | 94.0 | 3.5 | 2.6 | 1,560,101 |
| 19期(2023年2月27日) | 34,288 | △ 3.9 | 33,496 | △ 4.0 | 95.6 | 2.0 | 2.6 | 1,941,316 |
| 20期(2023年8月25日) | 40,847 | 19.1 | 39,846 | 19.0 | 95.7 | 2.1 | 2.3 | 2,658,858 |
| 21期(2024年2月26日) | 49,183 | 20.4 | 47,908 | 20.2 | 96.0 | 2.0 | 2.1 | 3,994,723 |

(注) S & P 5 0 0[®]指数とは、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している株価指数で、米国の代表的な株価指数の1つです。市場規模、流動性、業種等を勘案して選ばれたニューヨーク証券取引所等に上場および登録されている500銘柄を時価総額で加重平均し指数化したものです。

S & P 5 0 0 指数 (配当込み、円換算ベース) は、S & P 5 0 0 指数 (配当込み) をもとに、委託会社が計算したものです。

S & P 5 0 0 指数は、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これ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ブライセンスが三菱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、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切の責任を負いません。

(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) 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 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 5 0 0 指 数 | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------------|-------|-----------|-----------|---------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (配当込み、 円換算ベース) | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2023年8月25日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| 8 月 末 | 40,847 | — | 39,846 | — | 95.7 | 2.1 | 2.3 |
| 9 月 末 | 42,146 | 3.2 | 41,111 | 3.2 | 95.4 | 2.4 | 2.2 |
| 10 月 末 | 41,112 | 0.6 | 40,093 | 0.6 | 94.8 | 3.1 | 2.1 |
| 11 月 末 | 39,857 | △ 2.4 | 38,862 | △ 2.5 | 95.8 | 2.1 | 2.1 |
| 12 月 末 | 42,885 | 5.0 | 41,799 | 4.9 | 96.0 | 1.8 | 2.2 |
| 2024年1月末 | 43,525 | 6.6 | 42,413 | 6.4 | 93.4 | 4.2 | 2.3 |
| (期 末) 2024年2月26日 | 46,657 | 14.2 | 45,459 | 14.1 | 95.1 | 2.9 | 2.2 |
| | 49,183 | 20.4 | 47,908 | 20.2 | 96.0 | 2.0 | 2.1 |

(注) 騰落率は期首比。

(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

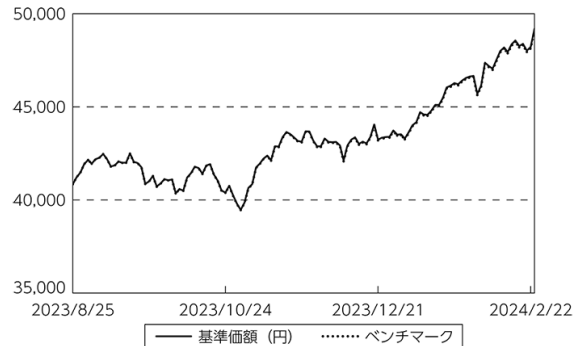
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ20.4%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(20.2%)を0.2%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

◎ 米国株式市況

- ・ 米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米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米国株式市況は上昇しました。

◎ 為替市況

- ・ 米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・米ドル高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ S & P 5 0 0 指数（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
ベンチマークとのカイ離は0.2%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

(2023年8月26日～2024年2月26日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------------------------------------------------|-----------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 円 0 (0) (0) (0) | % 0.001 (0.000) (0.000) (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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 (株 式) (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) (0) | 0.000 (0.000) (0.000) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) | 2 (2) | 0.005 (0.005) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 |
| 合 計 | 2 | 0.006 | |
| 期中の平均基準価額は、43,360円です。 | | | |

(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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年8月26日～2024年2月26日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|------|---------------------------|---------------------------------|--------------------------|---------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 413,688 (2,322) | 千アメリカドル 5,062,639 (△ 803) | 百株 29,505 (3,652) | 千アメリカドル 246,591 (33,422) |

(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 国 | 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 | 84 | 1,690 | — | — |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 21 | 2,616 | — | — |
| | PROLOGIS INC | 108 | 13,154 | — | — |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 28 | 2,683 | 10 | 1,063 |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 49 | 6,595 | — | — |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5 | 1,079 | — | — |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 16 | 2,333 | — | — |
| | WELLTOWER INC | 103 | 9,137 | — | — |
| | BOSTON PROPERTIES INC | 26 | 1,687 | — | — |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 18 | 2,470 | — | — |
| | REALTY INCOME CORP | 207 | 11,168 | — | — |
| | REGENCY CENTERS CORP | 14 | 936 | — | — |
| | UDR INC | 27 | 1,017 | — | — |
| | VENTAS INC | 59 | 2,798 | — | — |
| | WEYERHAEUSER CO | 89 | 2,837 | — | — |
| | AMERICAN TOWER CORP | 52 | 9,891 | — | — |
| | IRON MOUNTAIN INC | 44 | 2,790 | — | — |
| | EQUINIX INC | 10 | 8,474 | — | — |
| | CROWN CASTLE INC | 55 | 5,850 | — | — |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 53 | 3,240 | — | — |
| | INVITATION HOMES INC | 98 | 3,212 | — | — |
| | VICI PROPERTIES INC | 145 | 4,276 | — | — |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 11 | 2,641 | — | — |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 62 | 1,012 | — | — |
| | PUBLIC STORAGE | 21 | 5,843 | — | — |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 40 | 5,423 | — | — |
| | KIMCO REALTY CORP | 161 | 3,173 | 49 | 1,096 |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 13 | 2,413 | — | — |
| | 小 計 | 1,632 | 120,451 | 59 | 2,160 |

(注) 金額は受渡代金。

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 788,436 | 百万円 780,254 | 百万円 - | 百万円 - |

(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8月26日～2024年2月26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 | 788,454,278千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 2,876,852,585千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.27 |

(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8月26日～2024年2月26日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|----------------|---------------|--|----------------|---------------|--|
| | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 582,769 | % 80.8 | | 百万円 9,418 | % 89.4 | |

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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2024年2月26日現在)

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|--------|---------|------------|------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| AMERICAN EXPRESS CO | 2,902 | 3,540 | 75,973 | 11,423,318 | 金融サービス |
| ABBOTT LABORATORIES | 8,476 | 10,624 | 126,920 | 19,083,804 | ヘルスケア機器・サービス |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 1,415 | 1,851 | 24,441 | 3,675,047 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 2,015 | 2,469 | 63,179 | 9,499,657 | 商業・専門サービス |
| AES CORP | 3,065 | 3,598 | 5,758 | 865,772 | 公益事業 |
| AFLAC INC | 2,645 | 3,304 | 26,572 | 3,995,481 | 保険 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 3,527 | 4,366 | 31,140 | 4,682,299 | 保険 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 7,849 | 9,882 | 174,442 | 26,229,126 | 半導体・半導体製造装置 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 3,075 | 3,841 | 144,948 | 21,794,529 | ソフトウェア・サービス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 1,095 | 1,351 | 31,457 | 4,729,966 | 素材 |
| ALASKA AIR GROUP INC | 727 | — | — | — | 運輸 |
| ELEVANCE HEALTH INC | 1,154 | 1,443 | 74,207 | 11,157,894 | ヘルスケア機器・サービス |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 7,071 | 8,786 | 58,868 | 8,851,504 | ヘルスケア機器・サービス |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 2,503 | 3,247 | 13,816 | 2,077,409 | ヘルスケア機器・サービス |
| BOEING CO/THE | 2,752 | 3,493 | 70,154 | 10,548,496 | 資本財 |
| BECTON DICKINSON AND CO | 1,367 | 1,746 | 42,999 | 6,465,452 | ヘルスケア機器・サービス |
| BEST BUY CO INC | 922 | 1,338 | 10,207 | 1,534,820 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 10,234 | 12,240 | 63,236 | 9,508,176 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC | 729 | 862 | 70,159 | 10,549,125 | 金融サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 20,472 | 25,740 | 104,660 | 15,736,778 | 電気通信サービス |
| BALL CORP | 1,595 | 1,870 | 11,765 | 1,769,092 | 素材 |
| ALLSTATE CORP | 1,270 | 1,554 | 24,730 | 3,718,438 | 保険 |
| AVERY DENNISON CORP | 374 | 520 | 11,170 | 1,679,537 | 素材 |
| CHUBB LTD | 2,028 | 2,496 | 63,925 | 9,611,829 | 保険 |
| ANALOG DEVICES INC | 2,470 | 2,993 | 56,902 | 8,555,815 | 半導体・半導体製造装置 |
| AUTOZONE INC | 88 | 109 | 30,264 | 4,550,587 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CVS HEALTH CORP | 6,263 | 7,708 | 59,513 | 8,948,388 | ヘルスケア機器・サービス |
| CORNING INC | 3,744 | 4,555 | 14,890 | 2,238,948 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 14,233 | 17,645 | 324,665 | 48,816,695 | 銀行 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 252 | 344 | 8,533 | 1,283,076 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CATERPILLAR INC | 2,510 | 3,123 | 101,166 | 15,211,444 | 資本財 |
| COCA-COLA CO/THE | 18,957 | 23,802 | 145,672 | 21,903,320 | 食品・飲料・タバコ |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 1,840 | 2,371 | 32,138 | 4,832,334 | 金融サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 911 | 1,270 | 5,393 | 810,926 | 食品・飲料・タバコ |
| CSX CORP | 10,023 | 11,880 | 45,537 | 6,847,052 | 運輸 |
| CHEVRON CORP | 8,668 | 10,741 | 166,123 | 24,978,360 | エネルギー |
| TAPESTRY INC | 1,036 | 1,484 | 7,208 | 1,083,878 | 耐久消費財・アパレル |
| CONOCOPHILLIPS | 5,875 | 7,353 | 82,003 | 12,330,055 | エネルギー |
| CME GROUP INC | 1,766 | 2,150 | 46,868 | 7,047,194 | 金融サービス |
| CARDINAL HEALTH INC | 1,285 | 1,435 | 15,521 | 2,333,748 | ヘルスケア機器・サービス |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 4,093 | 4,926 | 42,491 | 6,389,085 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| DOMINION ENERGY INC | 4,033 | 5,286 | 25,298 | 3,803,955 | 公益事業 |
| DEVON ENERGY CORP | 3,129 | 3,758 | 16,492 | 2,479,748 | エネルギー |
| DEERE & CO | 1,313 | 1,604 | 58,511 | 8,797,792 | 資本財 |
| DANAHER CORP | 3,238 | 4,038 | 102,516 | 15,414,431 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WALT DISNEY CO/THE | 8,906 | 11,234 | 121,044 | 18,200,184 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 572 | 743 | 12,603 | 1,894,997 | 消費者サービス |
| DUKE ENERGY CORP | 3,720 | 4,597 | 42,629 | 6,409,752 | 公益事業 |
| DR HORTON INC | 1,501 | 1,873 | 27,376 | 4,116,332 | 耐久消費財・アパレル |
| TARGET CORP | 2,249 | 2,783 | 42,162 | 6,339,506 | 生活必需品流通・小売り |
| DAVITA INC | 308 | 308 | 3,866 | 581,370 | ヘルスケア機器・サービス |
| DOVER CORP | 662 | 857 | 14,079 | 2,117,011 | 資本財 |
| DTE ENERGY COMPANY | 965 | 1,232 | 13,361 | 2,008,998 | 公益事業 |
| EXXON MOBIL CORP | 19,695 | 24,479 | 254,196 | 38,220,998 | エネルギー |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 2,902 | 3,784 | 33,201 | 4,992,127 | ヘルスケア機器・サービス |
| EOG RESOURCES INC | 2,870 | 3,526 | 39,447 | 5,931,332 | エネルギー |
| EMERSON ELECTRIC CO | 2,773 | 3,465 | 36,702 | 5,518,584 | 資本財 |
| EXELON CORP | 4,943 | 6,301 | 22,768 | 3,423,538 | 公益事業 |
| ECOLAB INC | 1,214 | 1,540 | 34,257 | 5,150,887 | 素材 |
| EQUIFAX INC | 604 | 723 | 19,254 | 2,895,035 | 商業・専門サービス |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 1,138 | 1,357 | 20,355 | 3,060,644 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| EATON CORP PLC | 1,951 | 2,449 | 69,781 | 10,492,409 | 資本財 |
| EDISON INTERNATIONAL | 1,902 | 2,353 | 16,065 | 2,415,634 | 公益事業 |
| ENTERGY CORP | 1,030 | 1,331 | 13,644 | 2,051,585 | 公益事業 |
| EVEREST GROUP LTD | 203 | 270 | 10,014 | 1,505,724 | 保険 |
| NEXTERA ENERGY INC | 9,884 | 12,598 | 71,536 | 10,756,296 | 公益事業 |
| FEDEX CORP | 1,113 | 1,391 | 33,868 | 5,092,496 | 運輸 |
| FORD MOTOR CO | 18,944 | 24,123 | 29,286 | 4,403,521 | 自動車・自動車部品 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 1,500 | 1,500 | 4,053 | 609,496 | 金融サービス |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 188 | 210 | 9,745 | 1,465,385 | 金融サービス |
| FIRSTENERGY CORP | 2,709 | 3,086 | 11,542 | 1,735,485 | 公益事業 |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 7,077 | 8,733 | 34,027 | 5,116,364 | 素材 |
| GENERAL MILLS INC | 2,893 | 3,687 | 24,085 | 3,621,556 | 食品・飲料・タバコ |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 1,093 | 1,355 | 37,100 | 5,578,474 | 資本財 |
| WW GRAINGER INC | 218 | 272 | 26,135 | 3,929,754 | 資本財 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 5,297 | 6,655 | 102,047 | 15,343,801 | 資本財 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 1,254 | 1,507 | 20,060 | 3,016,306 | 金融サービス |
| GENUINE PARTS CO | 663 | 849 | 12,562 | 1,888,927 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 1,617 | 2,007 | 78,522 | 11,806,635 | 金融サービス |
| HALLIBURTON CO | 4,418 | 5,377 | 18,933 | 2,846,874 | エネルギー |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 3,238 | 4,044 | 81,151 | 12,201,928 | 資本財 |
| HP INC | 4,279 | 5,245 | 15,352 | 2,308,436 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 1,454 | 1,799 | 17,253 | 2,594,165 | 保険 |
| HERSHEY CO/THE | 737 | 878 | 17,019 | 2,559,013 | 食品・飲料・タバコ |
| HOME DEPOT INC | 4,934 | 6,126 | 227,896 | 34,266,580 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| HASBRO INC | 627 | 627 | 3,110 | 467,751 | 耐久消費財・アパレル |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 1,091 | 1,383 | 38,992 | 5,862,844 | 資本財 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 4,419 | 5,590 | 103,819 | 15,610,247 | ソフトウェア・サービス |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 1,785 | 2,262 | 7,859 | 1,181,718 | 素材 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 1,361 | 1,659 | 43,180 | 6,492,586 | 資本財 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 1,858 | 2,378 | 7,684 | 1,155,372 | メディア・娯楽 |
| IDEX CORP | 357 | 501 | 11,878 | 1,786,062 | 資本財 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 1,283 | 1,634 | 13,152 | 1,977,625 | 素材 |
| JOHNSON & JOHNSON | 11,733 | 14,698 | 237,884 | 35,768,275 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JABIL INC | — | 818 | 11,416 | 1,716,543 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| KELLANOVA | 1,256 | 1,458 | 8,232 | 1,237,781 | 食品・飲料・タバコ |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 1,659 | 2,152 | 26,184 | 3,937,170 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 6,644 | 8,141 | 60,228 | 9,056,005 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| KROGER CO | 3,147 | 3,918 | 18,890 | 2,840,420 | 生活必需品流通・小売り |
| ELI LILLY & CO | 3,839 | 4,867 | 374,611 | 56,326,555 | 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 | 411 | 542 | 11,886 | 1,787,233 | ヘルスケア機器・サービス |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 3,049 | 3,292 | 11,123 | 1,672,466 | 運輸 |
| LENNAR CORP-A | 1,252 | 1,504 | 23,335 | 3,508,703 | 耐久消費財・アパレル |
| LOWE'S COS INC | 2,902 | 3,556 | 82,714 | 12,437,004 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| BATH & BODY WORKS INC | 1,034 | 1,140 | 5,389 | 810,390 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 1,665 | 2,294 | 12,563 | 1,889,086 | 消費者サービス |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 1,099 | 1,358 | 58,552 | 8,803,963 | 資本財 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 738 | - | - | - | 保険 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 1,260 | 1,545 | 38,853 | 5,842,074 | 消費者サービス |
| MCDONALD'S CORP | 3,546 | 4,441 | 132,235 | 19,882,890 | 消費者サービス |
| S&P GLOBAL INC | 1,598 | 1,992 | 87,329 | 13,130,890 | 金融サービス |
| MEDTRONIC PLC | 6,484 | 7,965 | 68,237 | 10,260,117 | ヘルスケア機器・サービス |
| MERCK & CO. INC. | 12,365 | 15,481 | 200,413 | 30,134,225 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 5,384 | 6,572 | 56,522 | 8,498,666 | 半導体・半導体製造装置 |
| 3M CO | 2,646 | 3,358 | 31,094 | 4,675,434 | 資本財 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 816 | 1,024 | 33,831 | 5,086,910 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 1,520 | 1,858 | 7,912 | 1,189,795 | 消費者サービス |
| MASCO CORP | 1,100 | 1,276 | 9,564 | 1,438,177 | 資本財 |
| M & T BANK CORP | 847 | 923 | 12,755 | 1,917,891 | 銀行 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 2,416 | 3,032 | 61,756 | 9,285,731 | 保険 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 280 | 355 | 14,480 | 2,177,303 | ヘルスケア機器・サービス |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 239 | 411 | 4,731 | 711,480 | 耐久消費財・アパレル |
| MORGAN STANLEY | 6,340 | 7,814 | 67,638 | 10,170,121 | 金融サービス |
| MCKESSON CORP | 661 | 798 | 41,243 | 6,201,442 | ヘルスケア機器・サービス |
| METLIFE INC | 3,137 | 3,878 | 26,886 | 4,042,615 | 保険 |
| MOODY'S CORP | 761 | 948 | 36,567 | 5,498,296 | 金融サービス |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 1,107 | 1,401 | 36,163 | 5,437,614 | 運輸 |
| BANK OF AMERICA CORP | 33,752 | 42,226 | 143,232 | 21,536,473 | 銀行 |
| NISOURCE INC | 1,982 | 2,365 | 6,178 | 929,046 | 公益事業 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 704 | 848 | 39,128 | 5,883,358 | 資本財 |
| NEWMONT CORP | 3,823 | 7,114 | 22,253 | 3,346,106 | 素材 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 1,185 | 1,554 | 10,583 | 1,591,326 | 食品・飲料・タバコ |
| NUCOR CORP | 1,205 | 1,513 | 28,745 | 4,322,228 | 素材 |
| NEWELL BRANDS INC | 1,762 | - | - | - | 耐久消費財・アパレル |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 3,555 | 4,119 | 24,727 | 3,718,074 | エネルギー |
| OMNICOM GROUP | 997 | 1,192 | 10,561 | 1,588,049 | メディア・娯楽 |
| PEPSICO INC | 6,706 | 8,424 | 142,883 | 21,483,925 | 食品・飲料・タバコ |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 414 | 478 | 8,399 | 1,262,923 | 素材 |
| ALTRIA GROUP INC | 8,754 | 10,578 | 43,509 | 6,542,025 | 食品・飲料・タバコ |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 544 | 830 | 5,853 | 880,064 | 公益事業 |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 11,479 | 14,407 | 232,006 | 34,884,528 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 1,951 | 2,417 | 35,322 | 5,311,063 | 銀行 |
| PFIZER INC | 27,516 | 34,709 | 96,353 | 14,487,785 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 1,795 | 2,125 | 22,965 | 3,453,063 | 保険 |
| PULTEGROUP INC | 1,078 | 1,299 | 13,740 | 2,065,956 | 耐久消費財・アパレル |
| PARKER HANNIFIN CORP | 627 | 781 | 41,486 | 6,237,853 | 資本財 |
| PTONEER NATURAL RESOURCES CO | 1,158 | 1,412 | 32,829 | 4,936,303 | エネルギー |
| CITIGROUP INC | 9,520 | 11,787 | 65,928 | 9,912,983 | 銀行 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 1,079 | 1,340 | 10,756 | 1,617,346 | 保険 |
| PPG INDUSTRIES INC | 1,128 | 1,419 | 20,486 | 3,080,333 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| PENTAIR PLC | 799 | 1,060 | 8,142 | 1,224,371 | 資本財 |
| P G & E CORP | 7,803 | 12,632 | 21,513 | 3,234,842 | 公益事業 |
| PPL CORP | 3,686 | 4,383 | 11,746 | 1,766,251 | 公益事業 |
| PROGRESSIVE CORP | 2,876 | 3,580 | 68,500 | 10,299,737 | 保険 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 2,402 | 2,999 | 18,218 | 2,739,397 | 公益事業 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 1,112 | 1,441 | 17,578 | 2,643,131 | 消費者サービス |
| REPUBLIC SERVICES INC | 990 | 1,237 | 22,882 | 3,440,569 | 商業・専門サービス |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 4,817 | 5,663 | 10,353 | 1,556,710 | 銀行 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 515 | 663 | 36,942 | 5,554,712 | ソフトウェア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 2,970 | 3,864 | 10,784 | 1,621,554 | 公益事業 |
| ROBERT HALF INC | 575 | 575 | 4,606 | 692,703 | 商業・専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 550 | 725 | 20,364 | 3,062,043 | 資本財 |
| SCHLUMBERGER LTD | 7,019 | 8,615 | 42,059 | 6,323,993 | エネルギー |
| STRYKER CORP | 1,649 | 2,075 | 73,692 | 11,080,406 | ヘルスケア機器・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 7,256 | 8,921 | 57,487 | 8,643,782 | 金融サービス |
| SEMPRA | 3,060 | 3,733 | 26,870 | 4,040,281 | 公益事業 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 1,127 | 1,423 | 45,833 | 6,891,583 | 素材 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 727 | 843 | 7,517 | 1,130,376 | 資本財 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 1,105 | 1,355 | 29,961 | 4,505,079 | 保険 |
| SOUTHERN CO/THE | 5,356 | 6,502 | 44,016 | 6,618,362 | 公益事業 |
| AT&T INC | 34,881 | 43,932 | 73,807 | 11,097,631 | 電気通信サービス |
| WESTERN DIGITAL CORP | 1,560 | 2,071 | 11,613 | 1,746,197 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| STATE STREET CORP | 1,676 | 1,804 | 13,278 | 1,996,517 | 金融サービス |
| SYSCO CORP | 2,527 | 3,163 | 25,566 | 3,844,145 | 生活必需品流通・小売り |
| SEALED AIR CORP | 803 | — | — | — | 素材 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 4,424 | 5,590 | 91,504 | 13,758,618 | 半導体・半導体製造装置 |
| TERADYNE INC | 742 | 844 | 8,454 | 1,271,266 | 半導体・半導体製造装置 |
| GLOBE LIFE INC | 408 | 499 | 6,334 | 952,469 | 保険 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 3,384 | 4,268 | 24,946 | 3,750,887 | 資本財 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 1,880 | 2,372 | 133,972 | 20,144,084 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXTRON INC | 999 | 1,205 | 10,367 | 1,558,903 | 資本財 |
| UNION PACIFIC CORP | 2,970 | 3,725 | 95,701 | 14,389,606 | 運輸 |
| RTX CORP | 7,105 | 8,838 | 79,552 | 11,961,439 | 資本財 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 4,534 | 5,649 | 297,880 | 44,789,324 | ヘルスケア機器・サービス |
| US BANCORP | 6,751 | 9,417 | 38,951 | 5,856,676 | 銀行 |
| MARATHON OIL CORP | 3,155 | 3,123 | 7,427 | 1,116,751 | エネルギー |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 3,529 | 4,443 | 66,046 | 9,930,739 | 運輸 |
| VALERO ENERGY CORP | 1,731 | 2,093 | 29,640 | 4,456,678 | エネルギー |
| PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B | 2,358 | 2,358 | 2,643 | 397,543 | メディア・娯楽 |
| VF CORP | 1,781 | 1,781 | 2,846 | 427,966 | 耐久消費財・アパレル |
| VULCAN MATERIALS CO | 655 | 787 | 20,252 | 3,045,203 | 素材 |
| WILLIAMS COS INC | 6,054 | 7,554 | 26,395 | 3,968,878 | エネルギー |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 3,581 | 4,260 | 9,257 | 1,391,964 | 生活必需品流通・小売り |
| WEC ENERGY GROUP INC | 1,532 | 1,853 | 14,616 | 2,197,767 | 公益事業 |
| WALMART INC | 6,835 | 8,713 | 152,981 | 23,002,283 | 生活必需品流通・小売り |
| WELLS FARGO & CO | 18,268 | 22,248 | 119,828 | 18,017,483 | 銀行 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 1,830 | 2,203 | 45,839 | 6,892,419 | 商業・専門サービス |
| WATERS CORP | 304 | 351 | 11,631 | 1,748,914 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WHIRLPOOL CORP | 281 | 281 | 3,113 | 468,192 | 耐久消費財・アパレル |
| XCEL ENERGY INC | 2,616 | 3,347 | 19,861 | 2,986,319 | 公益事業 |
| KEYCORP | 4,640 | 5,712 | 8,145 | 1,224,799 | 銀行 |
| CARMAX INC | 756 | 900 | 6,603 | 992,970 | 一般消費財・サービス流通・小売り |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | | 業種等 |
|-----------------------------|--------|--------|-----------|-------------|------------------------|
| | | 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 | |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 1,039 | 1,320 | 17,052 | 2,564,038 | ヘルスケア機器・サービス |
| YUM! BRANDS INC | 1,341 | 1,644 | 22,742 | 3,419,511 | 消費者サービス |
| TJX COMPANIES INC | 5,620 | 6,878 | 68,360 | 10,278,613 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CLOROX COMPANY | 590 | 781 | 11,950 | 1,796,863 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CELANESE CORP | 521 | 623 | 9,306 | 1,399,373 | 素材 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 1,345 | 1,636 | 49,660 | 7,466,959 | ソフトウェア・サービス |
| CARNIVAL CORP | 4,877 | 5,976 | 9,101 | 1,368,523 | 消費者サービス |
| FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 2,853 | 3,723 | 23,933 | 3,598,612 | 金融サービス |
| CONAGRA BRANDS INC | 2,214 | 3,192 | 9,034 | 1,358,456 | 食品・飲料・タバコ |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 1,696 | 1,989 | 17,493 | 2,630,335 | 公益事業 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 3,199 | 4,058 | 13,605 | 2,045,753 | 銀行 |
| INTEL CORP | 20,324 | 25,791 | 110,878 | 16,671,719 | 半導体・半導体製造装置 |
| CISCO SYSTEMS INC | 19,959 | 24,777 | 121,062 | 18,202,982 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINTAS CORP | 426 | 537 | 34,017 | 5,114,810 | 商業・専門サービス |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 2,161 | 2,706 | 199,709 | 30,028,348 | 生活必需品流通・小売り |
| APPLIED MATERIALS INC | 4,109 | 5,185 | 102,246 | 15,373,796 | 半導体・半導体製造装置 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 1,239 | 1,408 | 20,084 | 3,019,864 | メディア・娯楽 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 1,480 | 1,787 | 9,618 | 1,446,219 | 食品・飲料・タバコ |
| GEN DIGITAL INC | 2,895 | 2,895 | 6,411 | 964,033 | ソフトウェア・サービス |
| ROSS STORES INC | 1,645 | 2,070 | 30,655 | 4,609,410 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 2,701 | 3,398 | 28,152 | 4,233,024 | 半導体・半導体製造装置 |
| NIKE INC -CL B | 6,012 | 7,363 | 77,783 | 11,695,543 | 耐久消費財・アパレル |
| AMGEN INC | 2,600 | 3,278 | 94,820 | 14,257,193 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COMERICA INC | 588 | 924 | 4,579 | 688,570 | 銀行 |
| NORTHERN TRUST CORP | 988 | 1,341 | 10,933 | 1,644,018 | 金融サービス |
| MICROSOFT CORP | 36,235 | 45,342 | 1,860,587 | 279,757,863 | ソフトウェア・サービス |
| ANSYS INC | 424 | 507 | 17,299 | 2,601,099 | ソフトウェア・サービス |
| CENTENE CORP | 2,637 | 3,352 | 26,892 | 4,043,600 | ヘルスケア機器・サービス |
| STARBUCKS CORP | 5,579 | 6,850 | 65,501 | 9,848,750 | 消費者サービス |
| ORACLE CORP | 7,491 | 9,722 | 108,847 | 16,366,314 | ソフトウェア・サービス |
| NETFLIX INC | 2,166 | 2,677 | 156,246 | 23,493,214 | メディア・娯楽 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 301 | 358 | 37,889 | 5,697,112 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 3,525 | - | - | - | メディア・娯楽 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 739 | 1,007 | 10,461 | 1,573,028 | 半導体・半導体製造装置 |
| HENRY SCHEIN INC | 632 | 877 | 7,010 | 1,054,028 | ヘルスケア機器・サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 552 | 639 | 15,552 | 2,338,451 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| POOL CORP | 190 | 259 | 10,065 | 1,513,500 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LAM RESEARCH CORP | 656 | 792 | 73,600 | 11,066,546 | 半導体・半導体製造装置 |
| COPART INC | 4,285 | 5,467 | 28,093 | 4,224,185 | 商業・専門サービス |
| WYNN RESORTS LTD | 527 | 478 | 4,984 | 749,433 | 消費者サービス |
| COMCAST CORP-CLASS A | 20,287 | 24,713 | 103,547 | 15,569,435 | メディア・娯楽 |
| PACCAR INC | 2,583 | 3,230 | 35,786 | 5,380,888 | 資本財 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 964 | 1,406 | 4,768 | 717,015 | ヘルスケア機器・サービス |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 341 | 400 | 12,680 | 1,906,653 | ヘルスケア機器・サービス |
| GILEAD SCIENCES INC | 6,088 | 7,671 | 56,422 | 8,483,651 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 1,707 | 2,161 | 84,237 | 12,665,947 | ヘルスケア機器・サービス |
| INTUIT INC | 1,366 | 1,720 | 113,515 | 17,068,219 | ソフトウェア・サービス |
| PAYCHEX INC | 1,536 | 2,020 | 25,185 | 3,786,930 | 商業・専門サービス |
| ON SEMICONDUCTOR | 2,067 | 2,480 | 18,902 | 2,842,170 | 半導体・半導体製造装置 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 433 | 553 | 24,345 | 3,660,653 | 運輸 |
| AUTODESK INC | 1,060 | 1,300 | 33,445 | 5,028,829 | ソフトウェア・サービス |
| SALESFORCE INC | 4,768 | 5,954 | 174,354 | 26,215,941 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| AXON ENTERPRISE INC | 345 | 388 | 10,510 | 1,580,311 | 資本財 |
| ALPHABET INC-CL A | 28,921 | 41,411 | 596,158 | 89,638,350 | メディア・娯楽 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 240 | 311 | 8,575 | 1,289,421 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 182 | 221 | 4,759 | 715,623 | 金融サービス |
| GARMIN LTD | 748 | 989 | 13,411 | 2,016,602 | 耐久消費財・アパレル |
| TRIMBLE INC | 1,254 | 1,606 | 9,872 | 1,484,392 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| QUALCOMM INC | 5,429 | 6,814 | 105,562 | 15,872,445 | 半導体・半導体製造装置 |
| HOLOGIC INC | 1,143 | 1,470 | 11,199 | 1,683,961 | ヘルスケア機器・サービス |
| SYNOPSYS INC | 749 | 913 | 52,594 | 7,908,159 | ソフトウェア・サービス |
| AMAZON.COM INC | 43,503 | 55,490 | 971,027 | 146,003,624 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 1,110 | 1,382 | 15,340 | 2,306,578 | 金融サービス |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 570 | 673 | 8,562 | 1,287,461 | ヘルスケア機器・サービス |
| KLA CORP | 675 | 821 | 54,952 | 8,262,621 | 半導体・半導体製造装置 |
| STEEL DYNAMICS INC | 806 | 931 | 11,829 | 1,778,619 | 素材 |
| VERISIGN INC | 461 | 562 | 11,063 | 1,663,548 | ソフトウェア・サービス |
| EBAY INC | 2,707 | 3,097 | 13,631 | 2,049,669 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| NVIDIA CORP | 12,052 | 15,070 | 1,187,789 | 178,596,033 | 半導体・半導体製造装置 |
| DOLLAR TREE INC | 997 | 1,273 | 18,573 | 2,792,702 | 生活必需品流通・小売り |
| BOOKING HOLDINGS INC | 179 | 214 | 75,066 | 11,286,940 | 消費者サービス |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 8,689 | 11,102 | 463,203 | 69,647,338 | 金融サービス |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 6,599 | 8,150 | 28,723 | 4,318,890 | 銀行 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 3,557 | 4,811 | 26,769 | 4,025,114 | 金融サービス |
| BORGWARNER INC | 1,165 | 1,165 | 3,543 | 532,836 | 自動車・自動車部品 |
| JM SMUCKER CO/THE | 528 | 649 | 8,174 | 1,229,076 | 食品・飲料・タバコ |
| CENCORA INC | 791 | 1,010 | 23,967 | 3,603,695 | ヘルスケア機器・サービス |
| ASSURANT INC | 241 | 302 | 5,391 | 810,625 | 保険 |
| AMEREN CORPORATION | 1,290 | 1,737 | 12,442 | 1,870,844 | 公益事業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 2,537 | 3,359 | 27,699 | 4,164,882 | 公益事業 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 2,695 | 3,433 | 18,351 | 2,759,326 | 食品・飲料・タバコ |
| HESS CORP | 1,323 | 1,770 | 26,396 | 3,968,999 | エネルギー |
| JUNIPER NETWORKS INC | 1,532 | 2,085 | 7,752 | 1,165,600 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| F5 INC | 288 | 377 | 7,019 | 1,055,402 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 758 | 848 | 9,176 | 1,379,745 | ソフトウェア・サービス |
| NETAPP INC | 1,071 | 1,252 | 10,949 | 1,646,310 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| INCYTE CORP | 941 | 1,250 | 7,576 | 1,139,262 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC | 717 | 925 | 20,657 | 3,106,001 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ILLUMINA INC | 759 | 1,018 | 13,548 | 2,037,164 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADOBE INC | 2,234 | 2,783 | 154,069 | 23,165,874 | ソフトウェア・サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 1,259 | 1,545 | 66,472 | 9,994,761 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 2,464 | 2,978 | 23,770 | 3,574,140 | ソフトウェア・サービス |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 763 | 919 | 11,043 | 1,660,459 | 運輸 |
| FASTENAL CO | 2,781 | 3,402 | 24,560 | 3,692,858 | 資本財 |
| FISERV INC | 2,976 | 3,599 | 54,261 | 8,158,719 | 金融サービス |
| APPLE INC | 72,052 | 89,187 | 1,627,851 | 244,763,728 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 734 | 986 | 11,127 | 1,673,108 | 保険 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 6,795 | 9,396 | 12,083 | 1,816,857 | 銀行 |
| ZIONS BANCORP NA | 634 | 903 | 3,525 | 530,117 | 銀行 |
| COSTAR GROUP INC | 1,971 | 2,411 | 20,447 | 3,074,465 | 不動産管理・開発 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 522 | 752 | 5,519 | 829,881 | 運輸 |
| ONEOK INC | 2,176 | 3,624 | 26,446 | 3,976,542 | エネルギー |
| BUNGE LTD | 715 | - | - | - | 食品・飲料・タバコ |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 773 | 1,008 | 24,934 | 3,749,207 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| NVR INC | 14 | 19 | 14,744 | 2,217,021 | 耐久消費財・アパレル |
| COOPER COS INC/THE | 232 | 1,223 | 11,834 | 1,779,429 | ヘルスケア機器・サービス |
| EQT CORP | 1,769 | 2,195 | 8,124 | 1,221,567 | エネルギー |
| AMPHENOL CORP-CL A | 2,890 | 3,653 | 39,267 | 5,904,276 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| WR BERKLEY CORP | 965 | 1,106 | 9,442 | 1,419,767 | 保険 |
| HUBBELL INC | - | 344 | 12,589 | 1,892,886 | 資本財 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 3,729 | 4,591 | 25,388 | 3,817,457 | 食品・飲料・タバコ |
| EXPEDIA GROUP INC | 702 | 827 | 11,282 | 1,696,498 | 消費者サービス |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 947 | 1,080 | 8,690 | 1,306,638 | 素材 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 512 | 611 | 24,913 | 3,745,963 | 金融サービス |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN | 2,760 | 3,436 | 47,555 | 7,150,470 | 金融サービス |
| NASDAQ INC | 1,589 | 2,085 | 11,814 | 1,776,440 | 金融サービス |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 679 | 801 | 7,635 | 1,148,133 | メディア・娯楽 |
| CBRE GROUP INC - A | 1,541 | 1,777 | 16,015 | 2,408,066 | 不動産管理・開発 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 133 | 164 | 43,602 | 6,556,006 | 消費者サービス |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 859 | 1,022 | 5,876 | 883,557 | 食品・飲料・タバコ |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 220 | 294 | 21,256 | 3,196,056 | 半導体・半導体製造装置 |
| BROWN & BROWN INC | 1,204 | 1,423 | 11,995 | 1,803,583 | 保険 |
| CUMMINS INC | 677 | 854 | 22,548 | 3,390,444 | 資本財 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 305 | 374 | 20,560 | 3,091,422 | 素材 |
| RALPH LAUREN CORP | 186 | 291 | 5,495 | 826,328 | 耐久消費財・アパレル |
| ALLIANT ENERGY CORP | 1,176 | 1,367 | 6,660 | 1,001,422 | 公益事業 |
| MASTERCARD INC - A | 4,075 | 5,054 | 239,285 | 35,978,953 | 金融サービス |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 632 | 878 | 11,078 | 1,665,730 | 商業・専門サービス |
| FIRST SOLAR INC | 465 | 622 | 8,889 | 1,336,599 | 半導体・半導体製造装置 |
| MOSAIC CO/THE | 1,662 | 2,179 | 6,860 | 1,031,492 | 素材 |
| TRANSNIGM GROUP INC | 255 | 332 | 39,896 | 5,998,814 | 資本財 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO | 598 | 737 | 14,857 | 2,233,999 | 商業・専門サービス |
| INSULET CORP | 349 | 431 | 7,947 | 1,194,994 | ヘルスケア機器・サービス |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 504 | 621 | 17,245 | 2,592,980 | 保険 |
| BLACKSTONE INC | - | 4,284 | 53,606 | 8,060,330 | 金融サービス |
| TE CONNECTIVITY LTD | 1,508 | 1,958 | 28,033 | 4,215,100 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 1,253 | 1,530 | 18,625 | 2,800,533 | 金融サービス |
| LULULEMON ATHLETICA INC | - | 711 | 32,565 | 4,896,493 | 耐久消費財・アパレル |
| LOEWS CORP | 939 | 1,231 | 9,260 | 1,392,416 | 保険 |
| ULTA BEAUTY INC | 253 | 288 | 15,851 | 2,383,394 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| LKQ CORP | 1,227 | 1,859 | 9,700 | 1,458,531 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| HORMEL FOODS CORP | 1,405 | 1,998 | 6,097 | 916,891 | 食品・飲料・タバコ |
| EASTMAN CHEMICAL CO | 630 | 630 | 5,463 | 821,509 | 素材 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 911 | 1,144 | 24,553 | 3,691,857 | 資本財 |
| HUMANA INC | 617 | 768 | 27,899 | 4,194,958 | ヘルスケア機器・サービス |
| NRG ENERGY INC | 1,116 | 1,450 | 7,477 | 1,124,283 | 公益事業 |
| INVESCO LTD | 2,375 | 2,375 | 3,643 | 547,870 | 金融サービス |
| MSCI INC | 396 | 492 | 28,039 | 4,216,005 | 金融サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 978 | 978 | 6,112 | 919,041 | 食品・飲料・タバコ |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 7,555 | 9,509 | 87,071 | 13,092,050 | 食品・飲料・タバコ |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 7,884 | 9,727 | 275,868 | 41,479,544 | 金融サービス |
| KEURIG DR PEPPER INC | 4,122 | 5,828 | 17,597 | 2,645,938 | 食品・飲料・タバコ |
| COTERRA ENERGY INC | 3,689 | 4,780 | 12,420 | 1,867,537 | エネルギー |
| T-MOBILE US INC | 2,825 | 3,035 | 49,880 | 7,500,102 | 電気通信サービス |
| RESMED INC | 713 | 868 | 15,982 | 2,403,058 | ヘルスケア機器・サービス |
| GARTNER INC | 390 | 462 | 21,317 | 3,205,229 | ソフトウェア・サービス |

| 銘柄 | 株数 | 当期 | | | 業種等 |
|------------------------------|--------|--------|---------|------------|------------------------|
| | | 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 | |
| AMETEK INC | 1,154 | 1,447 | 25,794 | 3,878,507 | 資本財 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 1,807 | 2,274 | 19,853 | 2,985,119 | 保険 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 1,202 | 1,451 | 14,575 | 2,191,522 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 410 | 489 | 10,430 | 1,568,285 | 運輸 |
| QUANTA SERVICES INC | 692 | 901 | 21,131 | 3,177,321 | 資本財 |
| FMC CORP | 645 | 645 | 3,378 | 508,032 | 素材 |
| WABTEC CORP | 847 | 1,062 | 14,697 | 2,209,889 | 資本財 |
| EVERSOURCE ENERGY | 1,714 | 2,312 | 13,614 | 2,047,033 | 公益事業 |
| DELTA AIR LINES INC | 3,114 | 3,995 | 16,669 | 2,506,453 | 運輸 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 951 | 1,147 | 13,645 | 2,051,690 | 公益事業 |
| VERISK ANALYTICS INC | 704 | 874 | 21,411 | 3,219,412 | 商業・専門サービス |
| DOLLAR GENERAL CORP | 1,061 | 1,266 | 17,781 | 2,673,692 | 生活必需品流通・小売り |
| FORTINET INC | 3,170 | 3,760 | 25,433 | 3,824,244 | ソフトウェア・サービス |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 1,689 | 1,864 | 8,487 | 1,276,129 | 運輸 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 107 | 132 | 16,087 | 2,418,959 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GENERAL MOTORS CO | 6,769 | 8,523 | 33,779 | 5,079,074 | 自動車・自動車部品 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 1,252 | 1,604 | 38,331 | 5,763,468 | 半導体・半導体製造装置 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 1,182 | 1,578 | 15,665 | 2,355,479 | 素材 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 197 | 271 | 7,809 | 1,174,273 | 資本財 |
| NORDSON CORP | 256 | 305 | 8,366 | 1,257,944 | 資本財 |
| HCA HEALTHCARE INC | 987 | 1,192 | 37,601 | 5,653,686 | ヘルスケア機器・サービス |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 2,097 | 2,296 | 38,940 | 5,855,112 | エネルギー |
| ATMOS ENERGY CORP | 741 | 904 | 10,199 | 1,533,610 | 公益事業 |
| DEXCOM INC | 1,878 | 2,395 | 27,845 | 4,186,839 | ヘルスケア機器・サービス |
| XYLEM INC | 1,144 | 1,400 | 17,595 | 2,645,676 | 資本財 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 528 | 640 | 62,884 | 9,455,257 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILLIPS 66 | 2,197 | 2,650 | 38,998 | 5,863,758 | エネルギー |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 10,780 | 13,545 | 655,651 | 98,583,766 | メディア・娯楽 |
| CMS ENERGY CORP | 1,384 | 1,892 | 10,919 | 1,641,829 | 公益事業 |
| ALBEMARLE CORP | 577 | 768 | 9,272 | 1,394,221 | 素材 |
| KINDER MORGAN INC | 9,493 | 11,117 | 19,178 | 2,883,621 | エネルギー |
| APTIV PLC | 1,312 | 1,714 | 13,238 | 1,990,557 | 自動車・自動車部品 |
| ABBVIE INC | 8,595 | 10,799 | 192,322 | 28,917,625 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 224 | 282 | 12,215 | 1,836,671 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TESLA INC | 13,130 | 16,894 | 324,328 | 48,766,064 | 自動車・自動車部品 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 922 | 1,220 | 14,467 | 2,175,329 | 金融サービス |
| ZOETIS INC | 2,263 | 2,759 | 54,426 | 8,183,555 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 362 | 430 | 15,803 | 2,376,228 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NEWS CORP - CLASS A | 1,719 | 2,184 | 5,773 | 868,123 | メディア・娯楽 |
| NEWS CORP - CLASS B | 824 | 824 | 2,274 | 341,964 | メディア・娯楽 |
| SNAP-ON INC | 258 | 297 | 8,051 | 1,210,549 | 資本財 |
| REVVITY INC | 606 | 753 | 7,864 | 1,182,496 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIO-TECHNE CORP | 738 | 876 | 6,278 | 943,991 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 344 | 401 | 7,069 | 1,062,916 | 金融サービス |
| SERVICENOW INC | 992 | 1,258 | 97,048 | 14,592,161 | ソフトウェア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 317 | 317 | 5,212 | 783,712 | ヘルスケア機器・サービス |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 343 | 442 | 12,432 | 1,869,337 | 金融サービス |
| ALLEGION PLC | 390 | 476 | 6,147 | 924,322 | 資本財 |
| ALPHABET INC-CL C | 24,938 | 25,108 | 364,799 | 54,851,253 | メディア・娯楽 |
| UNITED RENTALS INC | 339 | 422 | 27,777 | 4,176,694 | 資本財 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 2,912 | 4,434 | 6,709 | 1,008,868 | 運輸 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 888 | 1,169 | 28,925 | 4,349,269 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | | 業種等 |
|-------------------------------|-------|--------|---------|------------|------------------------|
| | | 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 | |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 1,277 | 1,631 | 33,361 | 5,016,296 | 消費者サービス |
| DIAMONDBACK ENERGY INC | 852 | 1,096 | 19,335 | 2,907,244 | エネルギー |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 870 | 1,050 | 15,758 | 2,369,410 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 745 | 999 | 15,098 | 2,270,245 | メディア・娯楽 |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING | 1,931 | 2,155 | 3,485 | 524,149 | 消費者サービス |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 1,490 | 1,907 | 53,798 | 8,089,101 | ソフトウェア・サービス |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 2,117 | 2,535 | 10,173 | 1,529,725 | 金融サービス |
| QORVO INC | 506 | 506 | 5,709 | 858,545 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 1,044 | 1,340 | 32,831 | 4,936,613 | 保険 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 2,337 | 3,241 | 10,096 | 1,518,094 | 銀行 |
| TARGA RESOURCES CORP | 1,075 | 1,424 | 13,818 | 2,077,768 | エネルギー |
| WESTROCK CO | 1,254 | 1,675 | 7,355 | 1,105,992 | 素材 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 3,870 | 4,620 | 16,658 | 2,504,770 | 食品・飲料・タバコ |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 5,487 | 6,512 | 38,530 | 5,793,436 | 金融サービス |
| EPAM SYSTEMS INC | 267 | 326 | 9,850 | 1,481,159 | ソフトウェア・サービス |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 225 | 354 | 6,548 | 984,617 | 商業・専門サービス |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 6,509 | 7,145 | 10,796 | 1,623,405 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CDW CORP/DE | 672 | 834 | 20,631 | 3,102,183 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | 265 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| ARISTA NETWORKS INC | 1,220 | 1,509 | 40,393 | 6,073,628 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 106 | 106 | 3,600 | 541,336 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DOMINO'S PIZZA INC | 175 | 215 | 9,361 | 1,407,615 | 消費者サービス |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 499 | 584 | 17,497 | 2,630,924 | メディア・娯楽 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 410 | 517 | 29,795 | 4,480,028 | ヘルスケア機器・サービス |
| SMITH (A.O.) CORP | 653 | 653 | 5,316 | 799,397 | 資本財 |
| FORTIVE CORP | 1,778 | 2,200 | 18,945 | 2,848,618 | 資本財 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 1,716 | 2,444 | 16,100 | 2,420,867 | 資本財 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 670 | 937 | 9,626 | 1,447,493 | 食品・飲料・タバコ |
| TELEFLEX INC | 236 | 304 | 7,231 | 1,087,385 | ヘルスケア機器・サービス |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 492 | 665 | 13,125 | 1,973,484 | 金融サービス |
| DXC TECHNOLOGY CO | 1,218 | — | — | — | ソフトウェア・サービス |
| ROLLINS INC | 1,171 | 1,805 | 7,686 | 1,155,741 | 商業・専門サービス |
| FAIR ISAAC CORP | 118 | 149 | 19,215 | 2,889,274 | ソフトウェア・サービス |
| BAKER HUGHES CO | 4,863 | 5,870 | 17,547 | 2,638,463 | エネルギー |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 2,212 | 2,500 | 17,493 | 2,630,395 | 素材 |
| INGERSOLL-RAND INC | 2,011 | 2,479 | 22,442 | 3,374,478 | 資本財 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 208 | 275 | 12,057 | 1,812,948 | ソフトウェア・サービス |
| PTC INC | 530 | 760 | 13,763 | 2,069,462 | ソフトウェア・サービス |
| BROADCOM INC | 2,031 | 2,679 | 347,394 | 52,234,274 | 半導体・半導体製造装置 |
| EVERGY INC | 1,135 | 1,456 | 7,367 | 1,107,776 | 公益事業 |
| THE CIGNA GROUP | 1,448 | 1,761 | 60,652 | 9,119,684 | ヘルスケア機器・サービス |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 1,034 | 1,260 | 5,248 | 789,124 | 消費者サービス |
| FOX CORP - CLASS A | 1,367 | 1,367 | 4,133 | 621,576 | メディア・娯楽 |
| FOX CORP - CLASS B | 590 | 1,132 | 3,134 | 471,250 | メディア・娯楽 |
| DOW INC | 3,386 | 4,453 | 25,110 | 3,775,635 | 素材 |
| STERIS PLC | 497 | 630 | 14,879 | 2,237,252 | ヘルスケア機器・サービス |
| UBER TECHNOLOGIES INC | — | 12,586 | 98,426 | 14,799,468 | 運輸 |
| CORTEVA INC | 3,374 | 4,481 | 24,604 | 3,699,554 | 素材 |
| AMCOR PLC | 7,240 | 9,132 | 8,465 | 1,272,891 | 素材 |
| ETSY INC | 622 | 622 | 4,603 | 692,145 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| MODERNA INC | 1,569 | 1,910 | 18,427 | 2,770,777 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| DAYFORCE INC | 755 | 907 | 6,484 | 974,978 | 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 | | |
| GENERAC HOLDINGS INC | 281 | 314 | 3,543 | 532,838 | 資本財 | |
| AON PLC-CLASS A | 1,006 | 1,203 | 37,940 | 5,704,743 | 保険 | |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 1,980 | 2,572 | 24,060 | 3,617,715 | 資本財 | |
| CARRIER GLOBAL CORP | 3,997 | 5,230 | 28,350 | 4,262,846 | 資本財 | |
| CATALENT INC | 980 | 903 | 5,311 | 798,595 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| MATCH GROUP INC | 1,307 | 1,393 | 5,136 | 772,348 | メディア・娯楽 | |
| VIATRIS INC | 5,801 | 6,842 | 9,257 | 1,391,947 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ENPHASE ENERGY INC | 683 | 825 | 9,757 | 1,467,177 | 半導体・半導体製造装置 | |
| AIRBNB INC-CLASS A | — | 2,618 | 39,971 | 6,010,149 | 消費者サービス | |
| APA CORP | 1,513 | 1,973 | 5,927 | 891,304 | エネルギー | |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC | — | 771 | 14,556 | 2,188,737 | 資本財 | |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 921 | 1,069 | 9,409 | 1,414,766 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ORGANON & CO | 1,128 | — | — | — | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CONSTELLATION ENERGY | 1,595 | 1,973 | 26,440 | 3,975,595 | 公益事業 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 10,748 | 13,487 | 11,612 | 1,746,043 | メディア・娯楽 | |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 597 | 785 | 11,544 | 1,735,801 | 商業・専門サービス | |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGY | 1,913 | 2,262 | 20,155 | 3,030,563 | ヘルスケア機器・サービス | |
| LINDE PLC | 2,383 | 2,961 | 132,531 | 19,927,498 | 素材 | |
| KENVUE INC | 8,397 | 10,341 | 19,834 | 2,982,349 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| VERALTO CORP | — | 1,227 | 10,639 | 1,599,818 | 商業・専門サービス | |
| BUNGE GLOBAL SA | — | 798 | 7,474 | 1,123,934 | 食品・飲料・タバコ | |
| 合 計 | 株 数 | 金 額 | 1,495,100 | 1,877,953 | 25,496,841 | 3,833,705,135 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | 474 | 474 | — | < 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) 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 | | | |
|------------------------------|--------------|-------|---------|------------|------------|--|
| | 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 | % | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 279 | 364 | 6,064 | 911,895 | 0.0 | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 73 | 94 | 11,548 | 1,736,392 | 0.0 | |
| PROLOGIS INC | 449 | 557 | 74,315 | 11,174,152 | 0.3 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 52 | 70 | 6,654 | 1,000,568 | 0.0 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 138 | 188 | 25,919 | 3,897,204 | 0.1 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 31 | 36 | 8,283 | 1,245,580 | 0.0 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 105 | 121 | 17,078 | 2,567,943 | 0.1 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 37 | 37 | 3,699 | 556,309 | 0.0 | |
| WELLTOWER INC | 239 | 343 | 32,059 | 4,820,498 | 0.1 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 73 | 100 | 6,518 | 980,196 | 0.0 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 53 | 71 | 9,081 | 1,365,478 | 0.0 | |
| REALTY INCOME CORP | 324 | 531 | 28,143 | 4,231,630 | 0.1 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 72 | 87 | 5,295 | 796,254 | 0.0 | |
| UDR INC | 144 | 172 | 6,182 | 929,548 | 0.0 | |
| VENTAS INC | 202 | 262 | 11,575 | 1,740,549 | 0.0 | |
| WEYERHAEUSER CO | 363 | 453 | 15,134 | 2,275,647 | 0.1 | |
| AMERICAN TOWER CORP | 228 | 280 | 53,206 | 8,000,117 | 0.2 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 138 | 182 | 13,714 | 2,062,057 | 0.1 | |
| EQUINIX INC | 45 | 56 | 49,921 | 7,506,231 | 0.2 | |
| CROWN CASTLE INC | 209 | 265 | 28,819 | 4,333,247 | 0.1 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 170 | 223 | 13,476 | 2,026,334 | 0.1 | |
| INVITATION HOMES INC | 278 | 377 | 12,564 | 1,889,222 | 0.0 | |
| VICI PROPERTIES INC | 487 | 632 | 19,018 | 2,859,562 | 0.1 | |
| SBA COMMUNICATIONS CORP | 53 | 65 | 14,019 | 2,108,016 | 0.1 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 339 | 402 | 8,164 | 1,227,588 | 0.0 | |
| PUBLIC STORAGE | 77 | 98 | 28,147 | 4,232,324 | 0.1 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 162 | 202 | 30,500 | 4,585,980 | 0.1 | |
| KIMCO REALTY CORP | 301 | 414 | 8,092 | 1,216,789 | 0.0 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 69 | 83 | 14,584 | 2,192,953 | 0.1 | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 5,207 | 6,779 | 561,786 | 84,470,278 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 29 | 29 | - | < 2.1% > | |

(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 | 百万円 | 百万円 |
| | SP EMINI | 81,692 | - |

(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2月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 3,833,705,135 | % 96.0 |
| 投資証券 | 84,470,278 | 2.1 |
| コール・ローン等、その他 | 76,552,918 | 1.9 |
| 投資信託財産総額 | 3,994,728,331 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (3,988,750,078千円) の投資信託財産総額 (3,994,728,331千円) 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=150.36円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年2月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 4,006,070,972,922 |
| コール・ローン等 | 48,322,818,651 |
| 株式(評価額) | 3,833,705,135,020 |
| 投資証券(評価額) | 84,470,278,568 |
| 未収入金 | 12,776,909,096 |
| 未収配当金 | 3,763,354,893 |
| 差入委託証拠金 | 23,032,476,694 |
| (B) 負債 | 11,347,253,916 |
| 未払金 | 11,346,180,523 |
| 未払解約金 | 1,072,789 |
| 未払利息 | 604 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 3,994,723,719,006 |
| 元本 | 812,212,760,364 |
| 次期繰越損益金 | 3,182,510,958,642 |
| (D) 受益権総口数 | 812,212,760,364口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 49,183円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 650,934,696,266円
 期中追加設定元本額 172,905,113,932円
 期中一部解約元本額 11,627,049,834円
 また、1口当たり純資産額は、期末4.9183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)

| | |
|--------------------------------------------|------------------|
| eMAXIS Slim 米国株式(S&P500) | 769,100,490,026円 |
| eMAXIS S&P500インデックス | 11,957,717,055円 |
| MAXIS 米国株式(S&P500) 上場投信 | 10,644,385,638円 |
| MAXIS 米国株式(S&P500) 上場投信(為替ヘッジあり) | 6,930,095,594円 |
| つみたて米国株式(S&P500) | 6,616,233,752円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 2,577,366,525円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 1,937,812,325円 |
| MUAM S&P500インデックスファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定) | 1,599,747,811円 |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07(適格機関投資家限定) | 193,251,440円 |
| MUKAM S&P500インデックスファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定) | 121,706,006円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 106,778,784円 |
| S&P500インデックスファンドV(適格機関投資家限定) | 94,754,066円 |
| 日米コアバランス(FOFs用)(適格機関投資家限定) | 72,454,886円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定) | 56,160,521円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定) | 55,551,068円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定) | 54,895,994円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定) | 48,583,006円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定) | 44,775,867円 |
| 合計 | 812,212,760,364円 |

○損益の状況 (2023年8月26日～2024年2月26日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 24,308,621,735 |
| 受取配当金 | 22,687,504,457 |
| 受取利息 | 1,620,874,552 |
| その他収益金 | 771,891 |
| 支払利息 | △ 529,165 |
| (B) 有価証券売買損益 | 591,555,931,341 |
| 売買益 | 641,187,098,155 |
| 売買損 | △ 49,631,166,814 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 11,955,565,119 |
| 取引益 | 15,007,525,646 |
| 取引損 | △ 3,051,960,527 |
| (D) 保管費用等 | △ 140,672,984 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 627,679,445,211 |
| (F) 前期繰越損益金 | 2,007,923,602,301 |
| (G) 追加信託差損益金 | 585,972,483,642 |
| (H) 解約差損益金 | △ 39,064,572,512 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 3,182,510,958,642 |
| 次期繰越損益金(I) | 3,182,510,958,642 |

(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) (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。

【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（DR（預託証券）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。 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 (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 組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|-------------------------------------------|-------|--------|--------|--------------|----------------|
| | 円 | % | 期騰落率 | 期中率 | | | | |
| 11期(2020年5月12日) | 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の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(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) 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 月 日 | 基 準 価 額 | | 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) | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 券 組 入 比 率 |
|----------------------|-------------|-----------|---------------------------------------------------|-----------|--------------|--------------|----------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2023年 5月12日 | 円 30,486 | % — | 67,352.97 | % — | % 98.1 | % 1.5 | % 0.1 |
| 5月末 | 31,500 | 3.3 | 69,490.71 | 3.2 | 97.9 | 2.4 | 0.1 |
| 6月末 | 33,382 | 9.5 | 73,692.91 | 9.4 | 96.1 | 3.8 | 0.1 |
| 7月末 | 34,463 | 13.0 | 76,068.40 | 12.9 | 95.5 | 4.4 | 0.1 |
| 8月末 | 33,932 | 11.3 | 74,900.75 | 11.2 | 95.7 | 4.2 | 0.1 |
| 9月末 | 33,220 | 9.0 | 73,348.35 | 8.9 | 95.4 | 4.6 | 0.1 |
| 10月末 | 32,412 | 6.3 | 71,634.43 | 6.4 | 96.3 | 4.2 | 0.1 |
| 11月末 | 34,035 | 11.6 | 75,243.22 | 11.7 | 96.4 | 3.8 | 0.1 |
| 12月末 | 34,206 | 12.2 | 75,649.14 | 12.3 | 93.6 | 6.3 | 0.1 |
| 2024年 1月末 | 34,132 | 12.0 | 75,477.28 | 12.1 | 95.6 | 4.9 | 0.1 |
| 2月末 | 36,223 | 18.8 | 80,166.84 | 19.0 | 96.1 | 3.9 | 0.1 |
| 3月末 | 37,284 | 22.3 | 82,516.03 | 22.5 | 97.3 | 2.6 | 0.1 |
| 4月末 | 39,105 | 28.3 | 86,560.95 | 28.5 | 97.9 | 1.9 | 0.1 |
| (期 末) 2024年 5月13日 | 円 39,657 | % 30.1 | 87,810.97 | % 30.4 | % 96.3 | % 3.6 | % 0.1 |

(注) 騰落率は期首比。

(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

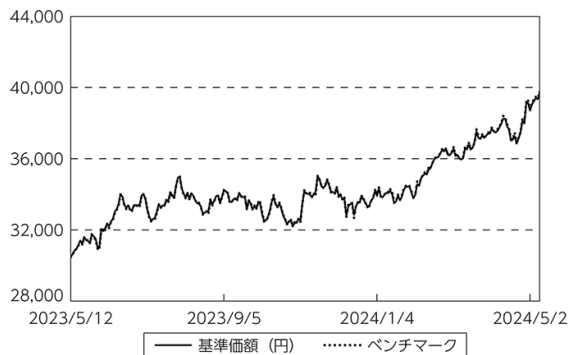
◎基準価額の動き

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

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(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 $\Delta 0.3\%$ 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 | 円 | % | (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 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) | 11 | 0.033 | |
| (投資信託証券) | (9) | (0.027) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (2) | (0.005) | |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 | 11 | 0.033 | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株 式) | (11) | (0.033) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 43 | 0.124 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用) | (37) | (0.107) | |
| (そ の 他) | (6) | (0.017) | |
| 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あります。

(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あります。

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

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------------------|----------|------------------------|-------------------------------------|---------------------|------------------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | 韓国 | 百株 39,871 (739) | 千韓国ウォン 301,107,372 (58,163) | 百株 7,010 (-) | 千韓国ウォン 31,753,346 (84,065) |
| | 台湾 | 851,160 (11,668) | 千ニュー台湾ドル 8,632,742 (△ 21,561) | 74,235 | 千ニュー台湾ドル 711,856 |
| | インド | 522,770 (31,843) | 千インドルピー 27,520,580 (332,465) | 18,879 (48) | 千インドルピー 1,924,086 (333,930) |
| | 中国オフショア | 599,766 (6,074) | 千オフショア元 713,891 (-) | 142,610 | 千オフショア元 160,810 |
| | アラブ首長国連邦 | 85,056 (16,945) | 千アラブディルハム 68,702 (-) | 8,664 | 千アラブディルハム 1,969 |
| | クウェート | 57,636 (9,629) | 千クウェートディナール 4,265 (-) | 12,200 | 千クウェートディナール 514 |
| | サウジアラビア | 62,910 (9,298) | 千サウジアラビアリアル 286,486 (-) | 8,897 | 千サウジアラビアリアル 22,710 |
| | カタール | 101,750 | 千カタールリアル 53,774 | - | 千カタールリアル - |
| | 南アフリカ | 77,805 (-) | 千南アフリカランド 983,656 (△ 3,661) | 17,275 | 千南アフリカランド 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 | 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 (9) | 51,008 (—) | — | — |
| | 小計 | 929 (9) | 57,971 (—) | — | — |
| 国 | 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | — (47) | — (87) | 47 | 73 |
| | 小計 | — (47) | — (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 352,466 | 百万円 333,382 | 百万円 — | 百万円 — |

(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 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|----------|--------------------|---------------|----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 478,680 | 百万円 3,971 | % 0.8 | 百万円 238,287 | 百万円 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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年5月13日現在)

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|------------|------------|---------|-----------|------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千アメリカドル | 千円 | |
| 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 |
| TENCENT 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 INTERNATIONA | 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 | 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・小売り |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | | 0.02 | — | — | — | 生活必需品流通・小売り |
| 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 銘柄 数 < 比 率 > | 13,383,749 | 13,426,013 | 139,284 | 21,725,598 | |
| | | 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・小売り |
| CEMEX SAB-CPO | | 70,806 | 108,049 | 143,598 | 1,335,404 | 素材 |
| GRUPO TELEVISIA 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 銘柄 数 < 比 率 > | 330,298 | 403,695 | 2,124,838 | 19,760,145 | |
| | | 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 SANEAMENTO 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 | 株数 | 当 期 | | 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------------|-----------|-----------|-----------|------------|------------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千ブラジルレアル | 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・小売り |
| 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・小売り |
| 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 |
| PRIO 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・小売り |
| 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 |
| ATACADA0 SA | 3,439 | 3,439 | 3,827 | 115,723 | | 生活必需品流通・小売り |
| 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・小売り |
| 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・小売り |
| 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 | | | | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | | | | |
| | | 367,493 | 535,636 | 1,279,092 | 38,672,067 | |
| | | 47 | 49 | - | <4.7%> | |
| (チリ) | | | 千チリペソ | | | |
| 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・小売り |
| 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・小売り |
| 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 | 株数 | 当 期 | | 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------------|---------|-----------|------------|------------------|-------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (チリ) | 百株 | 百株 | 千チリペソ | 千円 | | |
| BANCO DE CHILE | 202,820 | 293,715 | 3,163,314 | 532,196 | 銀行 | |
| ENEL CHILE SA | 122,118 | 137,988 | 809,991 | 136,273 | 公益事業 | |
| CIA SUD AMERICANA DE VAPORES | 65,029 | 117,078 | 873,753 | 147,000 | 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) | | | 千コロンビアペソ | | | |
| BANCOLOMBIA SA-PREF | 1,906 | 2,375 | 7,934,504 | 318,022 | 銀行 | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA | 2,416 | 2,416 | 4,513,723 | 180,914 | 公益事業 | |
| BANCOLOMBIA SA | 1,147 | 2,100 | 7,288,873 | 292,145 | 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) | | | 千ユーロ | | | |
| HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA | 950 | 1,758 | 2,537 | 426,159 | 電気通信サービス | |
| ALPHA SERVICES AND HOLDINGS | 9,741 | 11,844 | 1,947 | 327,069 | 銀行 | |
| NATIONAL BANK OF GREECE | 2,013 | 6,479 | 5,248 | 881,471 | 銀行 | |
| EUROBANK ERGASIAS SERVICES A | 12,049 | 19,077 | 3,966 | 666,166 | 銀行 | |
| PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S | — | 6,801 | 2,625 | 440,939 | 銀行 | |
| PUBLIC POWER CORP | 1,118 | 1,118 | 1,307 | 219,674 | 公益事業 | |
| OPAP SA | 886 | 1,035 | 1,596 | 268,092 | 消費者サービス | |
| MOTOR OIL (HELLAS) SA | 272 | 409 | 1,124 | 188,936 | エネルギー | |
| FF GROUP | 58 | 58 | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| JUMBO SA | 668 | 668 | 1,844 | 309,831 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| MYTILINEOS S. A. | 653 | 599 | 2,339 | 392,992 | 資本財 | |
| TERNA ENERGY SA | 320 | — | — | — | 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) | | | 千トルコリラ | | | |
| AKBANK T. A. S. | 13,300 | 22,967 | 132,751 | 641,798 | 銀行 | |
| TURKIYE IS BANKASI-C | 15,417 | 49,251 | 66,538 | 321,685 | 銀行 | |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 6,504 | 6,504 | 54,633 | 264,132 | 電気通信サービス | |
| YAPI VE KREDI BANKASI | 13,483 | 19,483 | 60,437 | 292,188 | 銀行 | |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 4,922 | 7,546 | 141,279 | 683,027 | エネルギー | |
| HACI OMER SABANCI HOLDING | 4,788 | 5,607 | 54,227 | 262,168 | 銀行 | |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 6,318 | 8,848 | 41,447 | 200,383 | 素材 | |
| KOC HOLDING AS | 3,986 | 5,754 | 136,506 | 659,953 | 資本財 | |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 6,881 | 14,074 | 74,525 | 360,301 | 資本財 | |
| FORD OTOMOTIV SANAYI AS | 320 | 414 | 47,649 | 230,364 | 自動車・自動車部品 | |
| TURK HAVA YOLLARI AO | 2,572 | 3,998 | 127,145 | 614,699 | 運輸 | |
| TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | — | 535 | 14,615 | 70,657 | 自動車・自動車部品 | |
| COCA-COLA ICECEK AS | — | 677 | 50,101 | 242,219 | 食品・飲料・タバコ | |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 2,060 | 3,236 | 137,450 | 664,519 | 生活必需品流通・小売り | |
| KOZA ALTIN ISLETMELERI AS | 4,918 | — | — | — | 素材 | |
| ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | 3,187 | 7,155 | 45,364 | 219,318 | 資本財 | |
| HEKTAS TICARET T. A. S | 4,736 | — | — | — | 素材 | |
| SASA POLYESTER SANAYI | 1,890 | 7,557 | 33,784 | 163,333 | 素材 | |
| PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | 238 | 238 | 23,897 | 115,536 | 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) | | | 千チェココルナ | | | |
| CEZ AS | 750 | 1,447 | 130,632 | 880,462 | 公益事業 | |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|---------|---------|-------------|-----------|------------------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (チェコ) | 百株 | 百株 | 千チェココルナ | 千円 | | |
| KOMERCNI 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 | 2,602 | 3,592 | 179,422 | 1,209,306 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | - | <0.1%> | |
| (ハンガリー) | | | 千ハンガリーフォリント | | | |
| 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 | 3,653 | 5,191 | 4,273,284 | 1,850,229 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | - | <0.2%> | |
| (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 | 20,242 | 26,421 | 196,790 | 7,681,128 | |
| | 銘柄数<比率> | 14 | 14 | - | <0.9%> | |
| (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 | 株数 | 当期 | | | 業種等 |
|------------------------------|---------|---------|-----------|------------|------------------------|
| | | 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 TAIPING INSURANCE HOLD | 7,232 | 7,232 | 5,828 | 116,346 | 保険 |
| TSINGTAO BREWERY CO LTD-H | 2,700 | 4,560 | 28,408 | 567,039 | 食品・飲料・タバコ |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 18,200 | 20,180 | 11,199 | 223,550 | 素材 |
| AVICHINA INDUSTRY & TECH-H | 12,470 | 12,470 | 4,688 | 93,586 | 資本財 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 33,320 | 49,940 | 51,338 | 1,024,712 | 保険 |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 610 | 680 | 8,806 | 175,767 | 運輸 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 34,820 | 53,760 | 62,146 | 1,240,445 | 保険 |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD | 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 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 9,320 | 11,100 | 23,421 | 467,483 | 公益事業 |
| LI NING CO LTD | 11,140 | 15,065 | 33,594 | 670,555 | 耐久消費財・アパレル |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 14,970 | 26,010 | 44,112 | 880,494 | 食品・飲料・タバコ |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 29,995 | 47,770 | 197,051 | 3,933,142 | 保険 |
| AIR CHINA LTD-H | 7,580 | 12,200 | 4,953 | 98,865 | 運輸 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 50,205 | 62,755 | 19,516 | 389,555 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CHINA OILFIELD SERVICES-H | 8,240 | 11,040 | 9,406 | 187,745 | エネルギー |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 29,389 | 45,332 | 1,681,817 | 33,569,071 | メディア・娯楽 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 44,829 | 58,619 | 35,230 | 703,191 | 銀行 |
| ZTE CORP-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 |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 25,860 | 39,980 | 72,443 | 1,445,977 | 素材 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 454,295 | 662,395 | 373,591 | 7,456,877 | 銀行 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 3,846 | 6,017 | 51,866 | 1,035,256 | 耐久消費財・アパレル |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 22,920 | 22,920 | 7,792 | 155,544 | 公益事業 |
| MINTH GROUP LTD | 3,640 | - | - | - | 自動車・自動車部品 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 12,360 | 12,360 | 3,720 | 74,258 | 自動車・自動車部品 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 16,175 | 22,925 | 83,676 | 1,670,177 | エネルギー |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 7,220 | - | - | - | 素材 |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H | 4,600 | 6,790 | 11,801 | 235,548 | 素材 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 12,320 | 20,872 | 11,333 | 226,216 | ヘルスケア機器・サービス |
| BANK OF CHINA LTD-H | 376,070 | 546,430 | 204,364 | 4,079,121 | 銀行 |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 19,581 | - | - | - | 商業・専門サービス |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 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 |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 18,605 | 25,655 | 97,106 | 1,938,237 | 銀行 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 266,833 | 451,473 | 204,517 | 4,082,169 | 銀行 |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 3,766 | 5,206 | 39,903 | 796,483 | 公益事業 |
| KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD | 4,495 | - | - | - | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 11,320 | 11,320 | 4,369 | 87,215 | 資本財 |
| CHINA COAL ENERGY CO-H | 11,490 | 11,490 | 10,168 | 202,966 | エネルギー |
| SHENZHEN INTL HOLDINGS | 8,160 | - | - | - | 運輸 |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 18,375 | 27,910 | 42,981 | 857,908 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 39,500 | 60,400 | 29,354 | 585,913 | 銀行 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 5,738 | 8,908 | 82,131 | 1,639,349 | 耐久消費財・アパレル |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 15,860 | 22,850 | 9,642 | 192,468 | 資本財 |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 3,025 | 4,830 | 13,789 | 275,241 | 家庭用品・パーソナル用品 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 15,100 | 22,500 | 72,225 | 1,441,611 | 不動産管理・開発 |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD | 14,340 | 21,540 | 9,908 | 197,771 | 公益事業 |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD | 13,245 | 13,245 | 6,529 | 130,334 | 資本財 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 20,360 | 46,740 | 15,844 | 316,263 | 素材 |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 7,568 | 13,038 | 22,008 | 439,282 | 資本財 |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 15,156 | 21,166 | 24,764 | 494,293 | 運輸 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 25,140 | 34,430 | 15,803 | 315,435 | 食品・飲料・タバコ |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | | 業種等 |
|------------------------------|---------|---------|--------|-----------|------------------------|
| | | 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・小売り |
| 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・小売り |
| 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 PHARMACEUTI-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 HUIZHAN 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・小売り |
| 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 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | | | | 外貨建金額 | |
| (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 |
| CIOC 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 TECH | 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 | 9,900 | 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 | 株数 | 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 | |
| KUAI SHOU 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 | |
| JIU MAOJIU 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 | 165,896,463 |
| 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 | 株数 | 期末 | | | | 業種等 |
|------------------------------|---------|---------|-------------|-----------|--------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | 業種等 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千マレーシアリンギット | 千円 | | |
| 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 HOLDIN | 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・小売り | |
| 小計 | 株数・金額 | 404,594 | 574,774 | 324,547 | 10,672,604 | |
| | 銘柄数<比率> | 34 | 32 | — | <1.3%> | |
| (タイ) | | | 千タイバート | | | |
| 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・小売り | |
| 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 POKPHAND 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・小売り | |
| 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・小売り | |
| 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・小売り | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 | | 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|------------|---------|-------------|-----------|------------|------------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千タイバート | 千円 | | |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 7,518 | 9,436 | 27,836 | 118,025 | | 公益事業 |
| BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR | 35,394 | 35,394 | 29,023 | 123,057 | | 運輸 |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 3,551 | — | — | — | | 金融サービス |
| MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR | 4,028 | 4,028 | 19,334 | 81,977 | | 金融サービス |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR | 6,117 | — | — | — | | 公益事業 |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 13,628 | 15,562 | 64,582 | 273,828 | | 公益事業 |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 3,726 | 3,726 | 18,723 | 79,386 | | 公益事業 |
| OSOTSPA PCL-NVDR | 9,372 | — | — | — | | 食品・飲料・タバコ |
| JMT NETWORK SERVICES-NVDR | 3,984 | — | — | — | | 金融サービス |
| CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR | 9,555 | 9,555 | 29,382 | 124,580 | | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| ASSET WORLD CORP PCL-NVDR | 36,679 | 36,679 | 15,625 | 66,251 | | 消費者サービス |
| PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR | 11,939 | 17,872 | 32,527 | 137,914 | | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| CARABAO GROUP PCL-NVDR | 1,396 | — | — | — | | 食品・飲料・タバコ |
| SCG PACKAGING PCL-NVDR | 5,616 | 5,616 | 17,409 | 73,816 | | 素材 |
| SCB X PCL-NVDR | 3,704 | 4,720 | 50,976 | 216,138 | | 銀行 |
| TRUE CORP PCL/NEW-NVDR | 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) | | | 千フィリピンペソ | | | |
| 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) | | | 千インドネシアルピア | | | |
| 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 MARMUR 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 | 株数 | 当 期 | | 業 種 等 | | |
|-------------------------------|------------|-----------|-------------|---------------|--------------------|--|
| | | 期首(前期末) | 末 | | | |
| | | 株 数 | 株 数 | | | |
| (インドネシア) | 百株 | 百株 | 千インドネシアルピア | 千円 | | |
| ADARO ENERGY INDONESIA TBK P | 69,656 | 98,458 | 28,257,446 | 276,922 | エネルギー | |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 34,457 | 137,687 | 64,299,829 | 630,138 | 銀行 | |
| CHAROEN POKHPAND INDONESIA PT | 30,677 | 41,368 | 21,925,040 | 214,865 | 食品・飲料・タバコ | |
| INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | 12,464 | 13,293 | 12,661,582 | 124,083 | 素材 | |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 10,107 | 11,533 | 12,426,807 | 121,782 | 食品・飲料・タバコ | |
| SARANA MENARA NUSANTARA PT | 111,862 | 111,862 | 8,893,029 | 87,151 | 電気通信サービス | |
| SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P | 70,917 | 103,765 | 29,884,320 | 292,866 | 生活必需品流通・小売り | |
| BARITO PACIFIC TBK PT | 133,372 | 133,372 | 13,070,524 | 128,091 | 素材 | |
| MERDEKA COPPER GOLD TBK PT | 64,164 | 48,273 | 13,081,983 | 128,203 | 素材 | |
| GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT | — | 7,892,773 | 52,881,579 | 518,239 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| AMMAN MINERAL INTERNASIONAL | — | 37,321 | 35,454,950 | 347,458 | 素材 | |
| 小 計 | 株 数 | 1,851,429 | 10,466,210 | 1,298,690,062 | 12,727,162 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 21 | 22 | — | < 1.6% > | |
| (韓国) | | | | 千韓国ウォン | | |
| 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|-------|------------|-----------|------------------------|
| | | 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|------------------------------|--------------|---------|------------|-------------|------------------------|--|
| | | 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 | | |
| POSCO FUTURE M CO LTD | 122 | 202 | 5,670,027 | 645,249 | 資本財 | |
| LOTTE ENERGY MATERIALS CORP | 109 | — | — | — | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| L&F CO LTD | 105 | 160 | 2,466,443 | 280,681 | 資本財 | |
| ECOPRO CO LTD | — | 690 | 6,785,129 | 772,147 | 資本財 | |
| HLB INC | 492 | 813 | 8,216,350 | 935,020 | ヘルスケア機器・サービス | |
| CELLTRION PHARM INC | 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 | |
| PEARL ABYSS CORP | 174 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC | 2,556 | 4,407 | 6,403,429 | 728,710 | 銀行 | |
| SK BIOPHARMACEUTICALS 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 | |
| SK IE TECHNOLOGY CO LTD | 120 | 178 | 1,043,080 | 118,702 | 資本財 | |
| HYBE CO LTD | 81 | 119 | 2,392,566 | 272,274 | メディア・娯楽 | |
| KAKAOBANK CORP | 648 | 1,039 | 2,498,795 | 284,362 | 銀行 | |
| ECOPRO BM CO LTD | 255 | 342 | 7,449,157 | 847,714 | 資本財 | |
| SK BIOSCIENCE CO LTD | 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 | |
| KAKAOPAY CORP | 112 | 112 | 403,240 | 45,888 | 金融サービス | |
| F&F CO LTD / NEW | 92 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル | |
| KRAFTON INC | 130 | 189 | 4,912,194 | 559,007 | メディア・娯楽 | |
| SD BIOSENSOR INC | 100 | — | — | — | ヘルスケア機器・サービス | |
| KAKAO GAMES CORP | 163 | — | — | — | メディア・娯楽 | |
| SK SQUARE CO LTD | 490 | 638 | 5,132,736 | 584,105 | 資本財 | |
| LG ENERGY SOLUTION | 164 | 347 | 13,336,212 | 1,517,660 | 資本財 | |
| MERITZ FINANCIAL GROUP INC | 473 | 674 | 5,554,427 | 632,093 | 金融サービス | |
| HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES | 91 | 124 | 1,690,120 | 192,335 | 資本財 | |
| COSMOAM&T 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 | |
| HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD | — | 328 | 4,564,705 | 519,463 | 半導体・半導体製造装置 | |
| KUM YANG CO LTD | — | 180 | 1,769,400 | 201,357 | 素材 | |
| POSCO DX CO LTD | — | 302 | 1,241,220 | 141,250 | ソフトウェア・サービス | |
| ECOPRO MATERIALS CO LTD | — | 116 | 1,171,600 | 133,328 | 資本財 | |
| 小 計 | 株 数 | 74,202 | 107,802 | 829,644,383 | 94,413,530 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 102 | 99 | — | < 11.5% > | |
| (台湾) | | | | 千ニュー台湾ドル | | |
| COMPAL ELECTRONICS | 20,067 | 28,307 | 103,040 | 495,520 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| DELTA ELECTRONICS INC | 9,122 | 13,932 | 444,437 | 2,137,298 | 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 | 52,093 | 250,515 | 資本財 | |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 19,476 | 28,026 | 192,258 | 924,570 | 素材 | |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 58,522 | 85,072 | 1,441,982 | 6,934,494 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 55,880 | 78,100 | 407,682 | 1,960,542 | 半導体・半導体製造装置 | |
| NAN YA PLASTICS CORP | 22,355 | 35,985 | 205,117 | 986,411 | 素材 | |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 2,560 | 3,690 | 101,290 | 487,106 | 生活必需品流通・小売り | |
| TAIWAN CEMENT | 28,626 | 40,586 | 135,154 | 649,958 | 素材 | |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 116,260 | 168,770 | 13,535,354 | 65,091,517 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 3,237 | 4,957 | 233,261 | 1,121,755 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | 14,380 | 18,870 | 47,741 | 229,586 | 半導体・半導体製造装置 | |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 2,107 | 3,167 | 163,735 | 787,403 | 半導体・半導体製造装置 | |
| YAGEO CORPORATION | 1,607 | 2,187 | 138,898 | 667,963 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| QUANTA COMPUTER INC | 12,211 | 18,291 | 494,785 | 2,379,421 | 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 | 354,276 | 1,703,717 | 保険 | |
| ACER INC | 13,641 | 16,641 | 79,547 | 382,542 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 53,838 | 81,034 | 185,973 | 894,344 | 銀行 | |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 15,614 | 22,774 | 128,902 | 619,892 | 素材 | |

| 銘柄 | 株数 | 当期末 | | | 業種等 |
|------------------------------|--------|---------|-----------|-----------|--------------------|
| | | 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 | |
| WAN HAI LINES LTD | 3,228 | 3,228 | 20,597 | 99,053 | 運輸 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 34,829 | 51,585 | 370,384 | 1,781,178 | 保険 |
| MEDIATEK INC | 7,162 | 10,392 | 1,137,963 | 5,472,466 | 半導体・半導体製造装置 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 49,349 | 88,627 | 166,619 | 801,271 | 銀行 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 83,309 | 119,339 | 446,926 | 2,149,270 | 銀行 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 7,804 | 13,564 | 142,422 | 684,907 | 電気通信サービス |
| CHINA STEEL CORP | 55,869 | 84,019 | 208,368 | 1,002,043 | 素材 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 2,780 | 4,100 | 241,080 | 1,159,353 | 半導体・半導体製造装置 |
| ADVANTECH 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 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 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 |
| AUO 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 |
| INVENTEC CORP | 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 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 17,620 | 26,000 | 326,300 | 1,569,176 | 電気通信サービス |
| WPG HOLDINGS LTD | 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 |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 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 |
| GIANT MANUFACTURING | 1,520 | — | — | — | 耐久消費財・アパレル |
| GLOBAL UNICHIP CORP | — | 570 | 72,390 | 348,123 | 半導体・半導体製造装置 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 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 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 48,552 | 63,021 | 202,297 | 972,850 | 金融サービス |
| INNOLUX CORP | 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 |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 44,001 | 52,281 | 137,237 | 659,976 | 銀行 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 58,088 | 69,488 | 63,026 | 303,092 | 保険 |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 7,440 | 14,190 | 120,189 | 577,990 | 電気通信サービス |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 8,944 | 11,454 | 57,270 | 275,414 | 自動車・自動車部品 |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 4,591 | 5,971 | 41,979 | 201,880 | エネルギー |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 52,560 | 76,467 | 313,132 | 1,505,854 | 銀行 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 50,331 | 83,346 | 232,536 | 1,118,268 | 銀行 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 488 | 738 | 164,618 | 791,650 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 22,416 | 32,686 | 252,337 | 1,213,492 | 食品・飲料・タバコ |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 21,486 | 28,583 | 53,165 | 255,675 | 銀行 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 71,862 | 129,832 | 183,713 | 883,476 | 保険 |
| LITE-ON TECHNOLOGY 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 |
| ASIA CEMENT CORP | 11,132 | 13,122 | 60,364 | 290,294 | 素材 |
| POU CHEN | 10,665 | 22,875 | 85,095 | 409,221 | 耐久消費財・アパレル |
| WISTRON CORP | — | 18,140 | 206,796 | 994,481 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | 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 |
| E INK HOLDINGS INC | 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 |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD | 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 |
| PEGATRON CORP | 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 |
| CHINA AIRLINES LTD | 15,820 | 15,820 | 35,832 | 172,317 | 運輸 |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO | 63,582 | 99,770 | 284,346 | 1,367,421 | 銀行 |
| WALSIN LIHWA CORP | 13,140 | 16,290 | 58,236 | 280,060 | 資本財 |
| EVA AIRWAYS CORP | 10,610 | 25,690 | 96,594 | 464,522 | 運輸 |
| EVERGREEN MARINE CORP LTD | 4,603 | 7,263 | 140,549 | 675,901 | 運輸 |
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | 630 | 930 | 108,345 | 521,031 | 資本財 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 47,553 | 80,675 | 214,597 | 1,031,998 | 銀行 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 1,440 | 1,818 | 111,310 | 535,292 | 一般消費財・サービス流通・小売り |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 9,612 | 8,651 | 35,038 | 168,498 | 不動産管理・開発 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 29,770 | 62,794 | 107,378 | 516,383 | 銀行 |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 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 | 株数 | 当期末 | | | | 業種等 |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|------------|------------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | 業種等 | |
| | | | 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 LT | 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 | 医薬品・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 | 医薬品・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 | |
| SHRIRAM 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 | |
| CPLA LTD | 2,248 | 3,446 | 461,690 | 867,978 | 医薬品・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 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 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・ライフサイエンス |
| 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・ライフサイエンス |
| 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・ライフサイエンス |
| 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 |
| ETICHER 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------|--------|-----------|-----------|------------------------|
| | | 株数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 千円 | |
| 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 |
| PIDLITE 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・小売り |
| 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 | 医薬品・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・小売り |
| 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 |
| LTIMINDTREE 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|------------------------------|------------|---------|-----------|------------|------------------------|--|
| | | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (インド) | 百株 | 百株 | 千インドルピー | 千円 | | |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN | 119 | 161 | 135,747 | 255,206 | 金融サービス | |
| INDIAN HOTELS CO LTD | 3,723 | 5,461 | 296,832 | 558,045 | 消費者サービス | |
| ABB INDIA LTD | 249 | 320 | 229,707 | 431,849 | 資本財 | |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT | 543 | 650 | 264,546 | 497,347 | 自動車・自動車部品 | |
| HINDUSTAN AERONAUTICS LTD | — | 1,281 | 496,327 | 933,095 | 資本財 | |
| MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD | — | 5,833 | 473,322 | 889,845 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SONA BLW PRECISION FORGINGS | — | 3,299 | 194,718 | 366,071 | 自動車・自動車部品 | |
| CUMMINS INDIA LTD | — | 917 | 312,862 | 588,180 | 資本財 | |
| SUPREME INDUSTRIES LTD | — | 381 | 201,055 | 377,984 | 素材 | |
| JIO FINANCIAL SERVICES LTD | — | 19,006 | 661,131 | 1,242,927 | 金融サービス | |
| APL APOLLO TUBES LTD | — | 934 | 143,411 | 269,612 | 素材 | |
| ONE 97 COMMUNICATIONS LTD | — | 1,259 | 44,020 | 82,759 | 金融サービス | |
| PERSISTENT SYSTEMS LTD | — | 746 | 251,215 | 472,285 | ソフトウェア・サービス | |
| POLYCAB INDIA LTD | — | 247 | 152,044 | 285,843 | 資本財 | |
| SUZLON ENERGY LTD | — | 73,274 | 292,366 | 549,649 | 資本財 | |
| UNION BANK OF INDIA | — | 11,457 | 162,689 | 305,856 | 銀行 | |
| PUNJAB NATIONAL BANK | — | 16,703 | 206,950 | 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 | |
| UNISPLENDOR 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 TECHNOLO-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 HENGRUI 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 | 株数 | 当 期 | | 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------|--------|---------|---------|--------|------------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (中国オフショア) | 百株 | 百株 | 千オフショア元 | 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 | 402,095 | | 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 L-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 SANJIU 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-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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------|--------|--------|---------|------------------------|
| | | 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 | 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 | 医薬品・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 |
| HUNDSUN 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|--------|--------|---------|---------|------------------------|
| | | 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 CHUANYOU 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 PIENZHEHUANG 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|------------------------------|-------|-------|--------|---------|------------------------|
| | | 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 | 千円 | |
| ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A | — | 8,382 | 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 APPTTEC 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 | 株数 | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|--------|--------|-------|---------|--------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (中国オフショア) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | |
| ASYM-CHEM 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 HAIID 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 TECHNOLO-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 | 株数 | 当期末 | | | 業種等 |
|------------------------------|--------|--------|---------|---------|------------------------|
| | | 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 | |
| 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 INDUSTR-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 | 株数 | 当期 | | 期末 | | 業種等 |
|-------------------------------|-------|--------|-------|---------|--------|------------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (中国オフショア) | 百株 | 百株 | 千円 | 千円 | | |
| TIANFENG SECURITIES CO LTD-A | — | 5,676 | 1,657 | 35,719 | | 金融サービス |
| TIANJIN712 COMMUNICATION &-A | 90 | 90 | 216 | 4,664 | | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A | 2,013 | 2,013 | 1,654 | 35,660 | | 半導体・半導体製造装置 |
| GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A | 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 | 614 | 2,013 | 43,389 | | 半導体・半導体製造装置 |
| THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A | 124 | 124 | 587 | 12,669 | | ソフトウェア・サービス |
| SG MICRO CORP-A | 60 | 78 | 605 | 13,046 | | 半導体・半導体製造装置 |
| CHINA GREAT WALL SECURITIE-A | 580 | 580 | 439 | 9,474 | | 金融サービス |
| DAAN GENE CO LTD-A | 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 | 582 | 12,561 | | 半導体・半導体製造装置 |
| APELOA PHARMACEUTICAL CO-A | 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 | 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 | 4,372 | 94,222 | | 銀行 |
| CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 2,412 | 10,935 | 3,247 | 69,992 | | 銀行 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | 565 | 6,506 | 3,051 | 65,760 | | 銀行 |
| DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A | 164 | 197 | 435 | 9,393 | | 生活必需品流通・小売り |
| FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A | 737 | 737 | 664 | 14,310 | | 資本財 |
| ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A | 59 | 59 | 564 | 12,167 | | 食品・飲料・タバコ |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A | 1,643 | 925 | 2,406 | 51,861 | | 自動車・自動車部品 |
| GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A | 78 | — | — | — | | 資本財 |
| GUANGZHOU YUOXIU CAPITAL H-A | 1,102 | 1,102 | 639 | 13,782 | | 金融サービス |
| GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A | 516 | 516 | 539 | 11,632 | | 金融サービス |
| HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A | 445 | 623 | 1,670 | 35,995 | | 半導体・半導体製造装置 |
| HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A | 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 | 636 | 13,721 | | 半導体・半導体製造装置 |
| JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A | 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 | 575 | 12,402 | | 耐久消費財・アパレル |
| JIUGUI LIQUOR CO LTD-A | 36 | 36 | 199 | 4,292 | | 食品・飲料・タバコ |
| KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A | 474 | 474 | 922 | 19,879 | | 資本財 |
| SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A | 247 | 247 | 526 | 11,356 | | 食品・飲料・タバコ |
| SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A | 208 | 208 | 690 | 14,890 | | 素材 |
| SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A | 86 | 86 | 589 | 12,694 | | 半導体・半導体製造装置 |
| SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A | 471 | 471 | 790 | 17,043 | | 素材 |
| SKSHU PAINT CO LTD-A | 96 | 135 | 497 | 10,722 | | 素材 |
| SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 384 | 631 | 6,732 | 145,100 | | 資本財 |
| YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A | 752 | 752 | 1,221 | 26,319 | | 運輸 |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A | 326 | 960 | 3,287 | 70,846 | | 金融サービス |
| ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A | 114 | 114 | 654 | 14,107 | | 耐久消費財・アパレル |
| YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A | 237 | 237 | 756 | 16,308 | | 食品・飲料・タバコ |
| JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A | 723 | 2,905 | 2,902 | 62,562 | | 素材 |
| YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A | — | 1,220 | 1,842 | 39,715 | | 素材 |
| HUAFON CHEMICAL CO LTD -A | 1,066 | 1,066 | 889 | 19,166 | | 素材 |
| SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A | 847 | 847 | 1,686 | 36,342 | | 素材 |
| HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A | 120 | 120 | 1,306 | 28,163 | | 自動車・自動車部品 |
| AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A | 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 | 56 | 674 | 14,542 | | 半導体・半導体製造装置 |
| PHARMARON BEIJING CO LTD-A | 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 | 1,856 | 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 DEVELOPME-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 YAHUA 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 | 株数 | 当 期 末 | | | 業 種 等 | |
|-------------------------------|---------|---------|-----------|-----------|------------------------|--|
| | | 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 SHENHUO 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 | |
| HUAI BEI 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 | 医薬品・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 | |
| CAMBRI CON 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 JIANGHUAI 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 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (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アル | | | |
| 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 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|-------------------------------|---------|---------|-------------|-----------|------------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (サウジアラビア) | 百株 | 百株 | 千サウジアラビヤリアル | 千円 | | |
| MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 2,287 | 2,287 | 2,727 | 113,586 | 電気通信サービス | |
| DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 422 | 560 | 17,396 | 724,582 | ヘルスケア機器・サービス | |
| MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 235 | 604 | 8,084 | 336,701 | ヘルスケア機器・サービス | |
| SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP | 155 | 238 | 5,776 | 240,583 | メディア・娯楽 | |
| ACWA POWER CO | 364 | 667 | 25,819 | 1,075,381 | 公益事業 | |
| ELM CO | 102 | 189 | 16,469 | 685,958 | ソフトウェア・サービス | |
| SAUDI INVESTMENT BANK/THE | 2,683 | 3,354 | 4,474 | 186,359 | 銀行 | |
| SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING | 224 | 293 | 7,112 | 296,240 | 金融サービス | |
| ARABIAN INTERNET & COMMUNICA | 107 | 167 | 5,563 | 231,723 | ソフトウェア・サービス | |
| NAHDI MEDICAL CO | 188 | 188 | 2,511 | 104,622 | 生活必需品流通・小売り | |
| DALLAH HEALTHCARE CO | 177 | 177 | 2,960 | 123,314 | ヘルスケア機器・サービス | |
| POWER & WATER UTILITY CO FOR | — | 341 | 2,317 | 96,540 | 公益事業 | |
| SAUDI ARAMCO BASE OIL CO | — | 268 | 3,960 | 164,942 | 素材 | |
| ADES HOLDING CO | — | 3,029 | 5,368 | 223,582 | エネルギー | |
| 小計 | 株数・金額 | 109,810 | 173,121 | 748,689 | 31,182,916 | |
| | 銘柄数<比率> | 40 | 41 | — | <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 | 銀行 | |
| OOREDOO QPSC | 3,976 | 3,976 | 3,956 | 169,551 | 電気通信サービス | |
| QATAR NATIONAL BANK | 21,605 | 31,289 | 43,429 | 1,860,962 | 銀行 | |
| INDUSTRIES QATAR | 6,643 | 8,321 | 10,085 | 432,155 | 資本財 | |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 2,662 | 2,662 | 3,966 | 169,979 | 公益事業 | |
| QATAR ISLAMIC BANK | 7,680 | 11,999 | 21,286 | 912,142 | 銀行 | |
| BARWA REAL ESTATE CO | 8,926 | 31,053 | 9,315 | 399,186 | 不動産管理・開発 | |
| COMMERCIAL BANK PSQC | 15,416 | 23,566 | 9,714 | 416,248 | 銀行 | |
| QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT) | 12,248 | 18,570 | 7,595 | 325,456 | エネルギー | |
| MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI | 21,425 | 50,785 | 9,049 | 387,791 | 素材 | |
| QATAR FUEL QSC | 2,889 | 4,226 | 6,161 | 264,037 | エネルギー | |
| QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC | 4,297 | 5,557 | 5,762 | 246,940 | 銀行 | |
| DUKHAN BANK | — | 11,043 | 4,224 | 180,999 | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 | 136,403 | 238,154 | 142,925 | 6,124,349 | |
| | 銘柄数<比率> | 12 | 13 | — | <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 | 素材 | |
| NEDBANK GROUP LTD | 2,213 | 3,328 | 77,531 | 655,144 | 銀行 | |
| SASOL LTD | 2,583 | 4,643 | 63,664 | 537,961 | 素材 | |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 1,974 | — | — | — | 素材 | |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 4,068 | 5,900 | 57,117 | 482,642 | 素材 | |
| GOLD FIELDS LTD | 4,189 | 6,436 | 203,137 | 1,716,508 | 素材 | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 4,808 | 8,105 | 49,324 | 416,792 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| SANLAM LTD | 8,469 | 12,666 | 89,579 | 756,947 | 保険 | |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 2,247 | 3,400 | 87,886 | 742,644 | 生活必需品流通・小売り | |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 6,384 | 9,029 | 167,255 | 1,413,311 | 銀行 | |
| REMGRO LTD | 2,321 | 4,299 | 54,202 | 458,008 | 金融サービス | |
| NASPERS LTD-N SHS | 1,025 | 1,282 | 483,632 | 4,086,695 | 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 | 電気通信サービス | |
| KUMBA IRON ORE LTD | 350 | 350 | 17,870 | 151,009 | 素材 | |
| HARMONY GOLD MINING CO LTD | 2,526 | 3,250 | 56,045 | 473,586 | 素材 | |
| FIRSTSTRAND LTD | 23,754 | 33,711 | 226,205 | 1,911,438 | 金融サービス | |
| THE FOSCHINI GROUP LTD | 1,317 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り | |

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

外国投資信託証券

| 銘柄 | 口数 | 口数 | 当期末 | | 比率 | |
|------------------------------|---------|-------|-----------|---------|---------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (メキシコ) | 千口 | 千口 | 千メキシコペソ | 千円 | % | |
| TRUST FIBRA UNO | 1,521 | 1,759 | 44,279 | 411,777 | 0.1 | |
| PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA | — | 701 | 46,655 | 433,873 | 0.1 | |
| OPERADORA DE SITIOS MEX- A-1 | 648 | 648 | 13,456 | 125,141 | 0.0 | |
| 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 | |
|-----|--------|---------|---------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 | 株式先物取引 | MINI MS | 百万円 29,736 | 百万円 - |

(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 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 788,658,888 | % 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 チェココロナ=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 アラブディルハム=42.54円 | 1 クウェートディナール=508.24円 | 1 サウジアラビアリアル=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 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 820,618,916,675 |
| コール・ローン等 | 22,107,823,354 |
| 株式(評価額) | 788,658,888,796 |
| 投資証券(評価額) | 970,791,971 |
| 未収入金 | 1,904,661,728 |
| 未収配当金 | 1,643,527,093 |
| 未収利息 | 2,107 |
| 差入委託証拠金 | 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 |

<注記事項>

- 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)

| | |
|---------------------------------|-----------------|
| eMAXIS Slim 全世界株式(オール・カントリー) | 85,921,627,512円 |
| eMAXIS Slim 新興国株式インデックス | 40,381,036,847円 |
| 三菱UFJ DC新興国株式インデックスファンド | 16,921,699,337円 |
| eMAXIS Slim 全世界株式(除く日本) | 13,335,929,820円 |
| eMAXIS 新興国株式インデックス | 10,231,986,211円 |
| eMAXIS Slim 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 |
| eMAXIS 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 |
| eMAXIS 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 |
| MAXIS 全世界株式(オール・カントリー) 上場投信 | 1,277,146,996円 |
| eMAXIS Slim 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 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 882,009,128円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(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 |
|--------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 15,897,219,286 |
| 受取配当金 | 15,095,411,830 |
| 受取利息 | 793,026,649 |
| その他収益金 | 9,293,846 |
| 支払利息 | △ 513,039 |
| (B) 有価証券売買損益 | 143,809,456,989 |
| 売買益 | 184,429,175,065 |
| 売買損 | △ 40,619,718,076 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 1,045,981,779 |
| 取引益 | 4,886,701,381 |
| 取引損 | △ 3,840,719,602 |
| (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え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 |
| eMAXIS バランス (波乗り型) | 298,650,528円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイフォワード) | 229,515,300円 |
| eMAXIS 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 ウェルス・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 |
| eMAXIS 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 |
| eMAXIS 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 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,376,986円 |
| eMAXIS 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)

iシェアーズ・ストックス・ヨーロッパ600 UCITS ETF

(ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE))

損益計算書、ファンド資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORTから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書 (※Share classesベース)

| | iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE) | |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|
| (2023年4月30日に終了する会計年度) | | |
| I. 収益 | | |
| 1 受取配当金-国内発行体 ⁵⁾ | EUR | 22,611,175.42 |
| 2 受取配当金-外国発行体(源泉徴収税前) ⁶⁾ | EUR | 162,293,827.06 |
| 3 国内流動性投資からの利子 | EUR | 1,051.63 |
| 4 外国源泉徴収税控除 | EUR | -8,902,658.10 |
| 5 その他収益 | EUR | 0.03 |
| 収益合計 | EUR | 176,003,396.04 |
| II. 費用 | | |
| 1 借入利息 | EUR | -9,099.15 |
| 2 運用受託報酬 | EUR | -10,564,476.18 |
| 3 その他費用 | EUR | -4,134,386.97 |
| 費用合計 | EUR | -14,707,962.30 |
| III. 経常純利益 | EUR | 161,295,433.74 |
| IV. 実現損益 | | |
| 1 実現利益 | EUR | 374,426,888.64 |
| 2 実現損失 | EUR | -159,554,127.66 |
| 実現損益 | EUR | 214,872,760.98 |
| V. 年間実現損益 | | |
| 1 未実現評価益 | EUR | -181,875,642.89 |
| 2 未実現評価損 | EUR | 107,517,221.42 |
| VI. 年間未実現損益 | EUR | -74,358,421.47 |
| VII. 会計年度の結果 | EUR | 301,809,773.25 |

5) ドイツREIT法第19条第1項に該当する配当金(22,709,00ユーロ)を含む。

6) ドイツREIT法第19条第1項に該当する配当金(1,597,928.38ユーロ)を含む。

マイナス金利は「国内流動性投資からの利子」に含まれています。
これは、「国内流動性投資からの利子」にマイナスの金額が表示される可能性があります。

2. ファンド資産変動計算書 (※Share classesベース)

iShares STOXX Europe 600
UCITS ETF (DE)
2022/2023

(2023年4月30日に終了する会計年度)

| I. 会計年度開始時のファンド資産の価値 | | EUR | 6,549,341,141.88 |
|----------------------------|-----|-------------------|------------------|
| 1. 前年度の分配 | | EUR | -70,170,360.98 |
| 2. 中間分配 | | EUR | -89,917,730.70 |
| 3. キャッシュ・インフロー/アウトフロー(ネット) | | EUR | -386,387,261.63 |
| a) ユニットの販売による収益 | EUR | 663,622,247.60 | |
| b) ユニットの償還のための支払 | EUR | -1,050,009,509.23 | |
| 4. 収益調整・費用計上 | | EUR | -8,299.95 |
| 5. 会計年度の結果 | | EUR | 301,809,773.25 |
| 未実現利益 | EUR | -181,875,642.89 | |
| 未実現損失 | EUR | 107,517,221.42 | |
| II. 年度末のファンド資産の価値 | | EUR | 6,304,667,261.87 |

3. 投資明細表 (※マスターファンドベース)

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/ 4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート 期間内 | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^① |
|----------------------------------------------------------------|--------------|----|-------------------|---------------------|--------------------------|------------------|----------------|-------------------------|-----------------------------|
| Securities | | | | | | | | 6,238,276,521.22 | 98.94 |
| Exchange-traded securities | | | | | | | | 6,238,276,521.22 | 98.94 |
| Shares | | | | | | | | 6,108,663,107.47 | 98.85 |
| 3i Group PLC Registered Shares LS -,738636 | GB0081YW4409 | | Units | 614,880 | 95,668 | 111,945 | GBP 17.670 | 12,369,685.37 | 0.20 |
| A.P.Møller-Mærsk A/S Navne-Aktier B DK 1000 | DK0010244508 | | Units | 2,990 | 564 | 1,253 | DKK 12,195,000 | 4,892,112.83 | 0.08 |
| A2A S.p.A. Azioni nom. EO 0,52 | IT0001233417 | | Units | 935,105 | 114,085 | 197,382 | EUR 1.600 | 1,496,168.00 | 0.02 |
| AAK AB Namn-Aktier SK 1,67 | SE0011337708 | | Units | 123,989 | 31,632 | 21,503 | SEK 206.400 | 2,259,918.55 | 0.04 |
| Aalberts N.V. Aandelen aan toonder EO -,25 | NL0000852564 | | Units | 63,711 | 12,990 | 11,252 | EUR 41.780 | 2,661,845.58 | 0.04 |
| AB Sagax Namn-Aktier B o.N. | SE0005127818 | | Units | 132,935 | 32,536 | 23,779 | SEK 251.000 | 2,946,544.46 | 0.05 |
| ABB Ltd. Namens-Aktien SF 0,12 | CH0012221716 | | Units | 997,014 | 182,910 | 206,250 | CHF 32.120 | 32,590,668.35 | 0.52 |
| ABN AMRO Bank N.V. Aand. op naam Dep. Rec. EO 1 | NL0011540547 | | Units | 283,641 | 31,448 | 55,376 | EUR 14.515 | 4,117,049.12 | 0.07 |
| Abrdn PLC Reg. Shares LS -,139682539 | GB00BF806K64 | | Units | 1,302,050 | 146,991 | 262,808 | GBP 2.127 | 3,153,021.18 | 0.05 |
| Acciona S.A. Acciones Port. EO 1 | ES0125220311 | | Units | 16,434 | 3,210 | 2,568 | EUR 168.000 | 2,760,912.00 | 0.04 |
| ACCOR S.A. Actions Port. EO 3 | NL0000120404 | | Units | 110,296 | 12,354 | 28,954 | EUR 32.120 | 3,542,707.52 | 0.06 |
| Ackermans & van Haaren N.V. Actions Nom. o.N. | BE0003764785 | | Units | 13,692 | 1,440 | 2,520 | EUR 159.600 | 2,185,243.20 | 0.03 |
| ACS, Act.de Constr.y Serv. SA Acciones Port. EO -,50 | ES160750915 | | Units | 139,125 | 15,374 | 35,600 | EUR 31.200 | 4,340,700.00 | 0.07 |
| Addtech AB Namn-Aktier B SK -,1875 | SE0014781795 | | Units | 173,133 | 36,225 | 31,139 | SEK 205.000 | 3,134,250.13 | 0.05 |
| Adecco Group AG Namens-Aktien SF 0,1 | CH0012138605 | | Units | 102,640 | 16,354 | 19,685 | CHF 30.530 | 3,189,039.67 | 0.05 |
| adidas AG Namens-Aktien o.N. | DE000A1EWWW0 | | Units | 103,414 | 14,005 | 25,903 | EUR 159.440 | 16,488,328.16 | 0.26 |
| Admiral Group PLC Registered Shares LS -,001 | GB00802J6398 | | Units | 175,219 | 30,503 | 31,542 | GBP 23.110 | 4,610,126.90 | 0.07 |
| Adyen N.V. Aandelen op naam EO-,01 | NL0012969182 | | Units | 17,824 | 3,049 | 3,688 | EUR 1,452,000 | 25,880,448.00 | 0.41 |
| Aedifica S.A. Actions au Port. o.N. | BE0003851681 | | Units | 26,699 | 7,034 | 6,208 | EUR 75.750 | 2,022,449.25 | 0.03 |
| AEGON N.V. Aandelen op naam(demat.)EO-,12 | NL0000303709 | | Units | 1,074,610 | 118,288 | 255,450 | EUR 4.123 | 4,430,617.03 | 0.07 |
| Aena SME S.A. Acciones Port. EO 10 | ES105046009 | | Units | 46,781 | 7,731 | 8,514 | EUR 152.900 | 7,152,814.90 | 0.11 |
| AGEAS SANV Actions Nominatives o.N. | BE0974264930 | | Units | 107,271 | 11,788 | 23,899 | EUR 40.390 | 4,332,675.69 | 0.07 |
| Ahold Delhaize N.V., Konkinkl. Aandelen aan toonder EO -,01 | NL0011794037 | | Units | 619,114 | 92,338 | 148,455 | EUR 31.220 | 19,328,739.08 | 0.31 |
| AiB Group PLC Registered Shares EO -,625 | IE00BF0L3536 | | Units | 705,292 | 718,618 | 13,326 | EUR 3.898 | 2,749,228.22 | 0.04 |
| Air France-KLM S.A. Actions Port. EO 1 | FR0000031122 | | Units | 851,969 | 869,117 | 17,148 | EUR 1.569 | 1,336,313.38 | 0.02 |
| Air Liquide-SA Ét. Expl.P.G.Cl. Actions Port. EO 5,50 | FR0000120073 | | Units | 326,231 | 81,232 | 64,877 | EUR 163.180 | 53,234,374.58 | 0.84 |
| Airbus SE Aandelen op naam EO 1 | NL0000235190 | | Units | 364,735 | 58,653 | 70,709 | EUR 127.140 | 46,372,407.90 | 0.74 |
| AIXTRON SE Namens-Aktien o.N. | DE000A0WMPJ6 | | Units | 68,165 | 80,304 | 12,139 | EUR 25.630 | 1,747,068.95 | 0.03 |
| Aker BP ASA Navne-Aksjer NK 1 | NO0010345853 | | Units | 198,817 | 150,358 | 22,446 | NOK 254.500 | 4,286,963.53 | 0.07 |
| Akzo Nobel N.V. Aandelen aan toonder EO0,5 | NL0013267909 | | Units | 109,818 | 14,383 | 20,644 | EUR 75.140 | 8,251,724.52 | 0.13 |
| Alcon AG Namens-Aktien SF -,04 | CH0432492467 | | Units | 309,681 | 43,623 | 58,514 | CHF 64.820 | 20,428,668.49 | 0.32 |
| Alfa Laval AB Namn-Aktier SK 2,5 | SE0000695876 | | Units | 177,900 | 19,418 | 34,122 | SEK 375.500 | 5,899,100.93 | 0.09 |
| ALK-Abellø AS Navne-Aktier DK -,50 | DK0061802139 | | Units | 79,654 | 9,792 | 16,218 | DKK 85.400 | 912,659.82 | 0.01 |
| Allegro.eu Registered Shares ZY -,01 | LU2237380790 | | Units | 304,322 | 107,534 | 53,269 | PLN 32.715 | 2,173,278.50 | 0.03 |
| Allfunds Group Ltd. Registered Shares EO-,0025 | GB000NTJ3546 | | Units | 241,893 | 28,750 | 48,934 | EUR 5.995 | 1,450,148.54 | 0.02 |
| Allianz SE vink.Namens-Aktien o.N. | DE0008404005 | | Units | 251,727 | 38,442 | 53,371 | EUR 227.450 | 57,255,306.15 | 0.91 |
| Allreal Holdings AG Namens-Aktien SF 1,00 | CH0008837566 | | Units | 9,349 | 1,658 | 1,678 | CHF 158.200 | 1,505,178.87 | 0.02 |
| Alstom S.A. Actions Port. EO 7 | FR0010220475 | | Units | 187,723 | 25,165 | 36,079 | EUR 22.740 | 4,268,821.02 | 0.07 |
| Allen S.A. Actions au Porteur EO 1,05 | FR0000071946 | | Units | 19,559 | 6,031 | 5,268 | EUR 154.000 | 3,012,086.00 | 0.05 |
| Amadeus IT Group S.A. Acciones Port. EO 0,01 | ES0109067019 | | Units | 282,772 | 42,672 | 51,096 | EUR 63.740 | 18,023,887.28 | 0.29 |
| Ambu A/S Navne-Aktier B DK -,50 | DK0060946788 | | Units | 110,260 | 13,104 | 23,319 | DKK 107.200 | 1,585,828.60 | 0.03 |
| Amplifon S.p.A. Azioni nom. EO -,02 | IT0004056880 | | Units | 78,954 | 13,202 | 15,528 | EUR 33.280 | 2,627,589.12 | 0.04 |
| ams-OSRAM AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000A18XM4 | | Units | 166,541 | 31,867 | 34,122 | CHF 6.140 | 1,040,653.17 | 0.02 |
| Amundi S.A. Actions au Porteur EO 2,5 | FR0004125920 | | Units | 41,529 | 9,179 | 7,172 | EUR 59.350 | 2,464,746.15 | 0.04 |
| Andritz AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000730007 | | Units | 42,743 | 4,743 | 8,418 | EUR 58.850 | 2,515,425.55 | 0.04 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位 | 2023/4/30 現在の 単位の単位 | 購入/ 追加 レポート 期間内 | 販売/ 処分 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^② |
|-----------------------------------------------------------|--------------|----|-------|---------------------------|--------------------------|-----------|---------------|----------------|-----------------------------|
| Anglo American PLC Registered Shares DL - 54945 | GB0081XZS820 | | Units | 781,116 | 134,158 | 164,117 | GBP 24.450 | 21,743,333.84 | 0.34 |
| Anheuser-Busch InBev S.A./N.V. Actions au Port. o.N. | BE0974293251 | | Units | 557,886 | 82,479 | 110,432 | EUR 59.100 | 32,971,062.60 | 0.52 |
| Antofagasta PLC Registered Shares LS -,05 | GB0000456144 | | Units | 249,487 | 42,276 | 45,733 | GBP 14.605 | 4,148,405.67 | 0.07 |
| Arcadis N.V. Aandelen aan toonder EO -,02 | NL0006237562 | | Units | 44,508 | 5,184 | 8,960 | EUR 37.460 | 1,667,269.68 | 0.03 |
| ArcelorMittal S.A. Actions Nouvelles Nominat. oN | LU1598757687 | | Units | 292,640 | 38,578 | 137,618 | EUR 25.710 | 7,523,774.40 | 0.12 |
| argenx SE Aandelen aan toonder EO -,10 | NL0010832176 | | Units | 34,310 | 7,399 | 6,042 | EUR 348.700 | 11,963,897.00 | 0.19 |
| Arkema S.A. Actions au Porteur EO 10 | FR0010313833 | | Units | 35,918 | 7,084 | 13,670 | EUR 89.620 | 3,218,971.16 | 0.05 |
| Aroundtown SA Bearer Shares EO -,01 | LU1673108939 | | Units | 557,524 | 68,009 | 149,464 | EUR 1.230 | 686,033.28 | 0.01 |
| Ashtead Group PLC Registered Shares LS -,10 | GB0000536739 | | Units | 279,731 | 39,690 | 51,362 | GBP 45.770 | 14,576,499.67 | 0.23 |
| ASM International N.V. Bearer Shares EO 0,04 | NL0000334118 | | Units | 27,608 | 3,835 | 6,523 | EUR 328.050 | 9,056,804.40 | 0.14 |
| ASML Holding N.V. Aandelen op naam EO -,09 | NL0010273215 | | Units | 251,617 | 38,953 | 51,355 | EUR 573.500 | 144,302,349.50 | 2.29 |
| ASR Nederland N.V. Aandelen op naam EO -,16 | NL0011872643 | | Units | 91,412 | 16,389 | 16,292 | EUR 39.840 | 3,641,854.08 | 0.06 |
| Assa-Abloy AB Namn-Aktier B SK -,33 | SE0007100581 | | Units | 614,405 | 86,930 | 112,994 | SEK 243.900 | 13,233,248.84 | 0.21 |
| Assicurazioni Generali S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0000062072 | | Units | 701,888 | 126,607 | 182,562 | EUR 18.880 | 13,251,645.44 | 0.21 |
| Associated British Foods PLC Registered Shares LS -,0568 | GB0006731235 | | Units | 229,397 | 37,747 | 41,809 | GBP 19.560 | 5,108,440.29 | 0.08 |
| AstraZeneca PLC Registered Shares DL -,25 | GB0009895292 | | Units | 967,312 | 151,241 | 190,329 | GBP 117.460 | 129,356,515.60 | 2.05 |
| Atlas Copco AB Namn-Aktier A SK -,052125 | SE0017486889 | | Units | 1,613,404 | 1,875,393 | 261,989 | SEK 148.100 | 21,100,761.34 | 0.33 |
| Aurubis AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0006766504 | | Units | 18,940 | 2,122 | 3,528 | EUR 84.800 | 1,606,112.00 | 0.03 |
| Auto Trader Group PLC Registered Shares LS 0,01 | GB008YVYVW23 | | Units | 578,837 | 64,473 | 112,045 | GBP 6.356 | 4,188,629.13 | 0.07 |
| Avanza Bank Holding AB Namn-Aktier SK 0,50 | SE0012454072 | | Units | 74,512 | 16,939 | 15,387 | SEK 217.700 | 1,432,466.87 | 0.02 |
| Aviva PLC Registered Shares LS -,33 | GB00PQBYM860 | | Units | 1,755,367 | 2,081,741 | 326,374 | GBP 4.230 | 8,453,567.67 | 0.13 |
| AXA S.A. Actions Port. EO 2,29 | FR0000120628 | | Units | 1,242,966 | 199,488 | 288,378 | EUR 29.570 | 36,754,504.62 | 0.58 |
| Axfood AB Namn-Aktier o.N. | SE0006993770 | | Units | 65,339 | 76,975 | 11,636 | SEK 254.200 | 1,466,722.54 | 0.02 |
| Azimut Holding S.p.A. Azioni nom. EUR o.N. | IT0003261697 | | Units | 69,621 | 71,013 | 1,392 | EUR 20.240 | 1,409,129.04 | 0.02 |
| Aéroports de Paris S.A. Actions au Port. EO 3 | FR0010340141 | | Units | 14,110 | 1,622 | 5,832 | EUR 144.100 | 2,033,251.00 | 0.03 |
| B & M Europ.Value Retail S.A. Actions Nominatives LS -,10 | LU1072616219 | | Units | 585,062 | 65,942 | 115,461 | GBP 4.797 | 3,195,238.98 | 0.05 |
| Bachem Holding AG Namens-Aktien SF 0,01 | CH1176493729 | | Units | 39,620 | 46,676 | 7,056 | CHF 97.100 | 3,915,165.95 | 0.06 |
| BAE Systems PLC Registered Shares LS -,025 | GB0002634946 | | Units | 1,906,836 | 203,914 | 358,078 | GBP 10.140 | 22,013,192.65 | 0.35 |
| Bakkafrost P/F Navne-Aktier DK 1,- | FO0000000179 | | Units | 29,853 | 3,456 | 5,901 | NOK 776.000 | 1,962,719.28 | 0.03 |
| Balfour Beatty PLC Registered Shares LS -,50 | GB0000961622 | | Units | 390,031 | 399,336 | 9,305 | GBP 3.830 | 1,700,707.54 | 0.03 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argent. Acciones Nom. EO 0,49 | ES0113211835 | | Units | 3,736,988 | 546,322 | 1,125,745 | EUR 6.650 | 24,850,970.20 | 0.39 |
| Banco BPM S.p.A. Azioni o.N. | IT0005218380 | | Units | 909,291 | 102,060 | 180,101 | EUR 3.685 | 3,350,737.34 | 0.05 |
| Banco de Sabadell S.A. Acciones Nom. Serie A EO -,125 | ES0113860A34 | | Units | 3,589,341 | 639,545 | 665,193 | EUR 0.945 | 3,391,209.38 | 0.05 |
| Banco Santander S.A. Acciones Nom. EO 0,50 | ES0113900J37 | | Units | 10,497,531 | 1,614,899 | 2,341,929 | EUR 3.187 | 33,450,382.53 | 0.53 |
| Bank of Ireland Group PLC Registered Shares EO 1 | IE00B01R6P16 | | Units | 681,698 | 225,722 | 177,007 | EUR 9.370 | 6,387,510.26 | 0.10 |
| Bank Polska Kasa Opieki S.A. Inhaber-Aktien ZY 1 | PLPEKAO00016 | | Units | 104,449 | 12,058 | 21,126 | PLN 95.980 | 2,188,366.92 | 0.03 |
| Bankinter S.A. Acciones Nom. EO -,30 | ES0113679137 | | Units | 388,693 | 44,700 | 77,732 | EUR 5.362 | 2,084,171.87 | 0.03 |
| Banque Cantonale Vaudoise Namens-Aktien SF 1 | CH0531751755 | | Units | 17,306 | 17,712 | 406 | CHF 93.900 | 1,653,783.92 | 0.03 |
| Barclays PLC Registered Shares LS 0,25 | GB0031348658 | | Units | 9,301,574 | 1,480,403 | 2,273,521 | GBP 1.599 | 16,930,988.78 | 0.27 |
| Barratt Developments PLC Registered Shares LS -,10 | GB0000811801 | | Units | 609,678 | 68,839 | 118,913 | GBP 5.000 | 3,470,581.64 | 0.06 |
| Barry Callebaut AG Namensaktien SF 0,02 | CH0009002962 | | Units | 2,303 | 684 | 705 | CHF 1,904.000 | 4,462,491.02 | 0.07 |
| BASF SE Namens-Aktien o.N. | DE000BASF111 | | Units | 555,623 | 87,577 | 126,446 | EUR 46.850 | 26,030,937.55 | 0.41 |
| Bavarian Nordic Navne-Aktier DK 10 | DK0015998017 | | Units | 54,601 | 55,635 | 1,034 | DKK 185.300 | 1,357,436.39 | 0.02 |
| BAWAG Group AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000BAWAG2 | | Units | 53,354 | 5,915 | 10,462 | EUR 44.160 | 2,356,112.64 | 0.04 |
| Bayer AG Namens-Aktien o.N. | DE000BAY0017 | | Units | 613,890 | 103,852 | 125,820 | EUR 59.760 | 36,686,066.40 | 0.58 |
| Bayerische Motoren Werke AG Stammaktien EO 1 | DE0005190003 | | Units | 198,523 | 27,548 | 36,336 | EUR 101.440 | 20,138,173.12 | 0.32 |
| BE Semiconductor Inds N.V. Aandelen op Naam EO-,01 | NL0012866412 | | Units | 48,953 | 11,613 | 9,374 | EUR 81.340 | 3,981,837.02 | 0.06 |
| Beazley PLC Registered Shares LS -,05 | GB000BYJQC66 | | Units | 410,307 | 90,133 | 73,467 | GBP 5.955 | 2,781,777.75 | 0.04 |
| Bechtle AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0005158703 | | Units | 49,429 | 5,752 | 9,630 | EUR 42.050 | 2,078,489.45 | 0.03 |
| Beiersdorf AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0005200000 | | Units | 61,587 | 9,120 | 11,136 | EUR 126.600 | 7,796,914.20 | 0.12 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^① | |
|---------------------------------------------------------------|---------------|----|-------------------|-----------------|----------------------|------------------|-----|---------------|-----------------------------|------|
| Beijer Ref AB Namn-Aktier B O.N. | SE0015949748 | | Units | 202,610 | 95,288 | 50,783 | SEK | 167,400 | 2,995,134.07 | 0.05 |
| BELIMO Holding AG Namens-Aktien SF -.05 | CH1101098163 | | Units | 6,168 | 576 | 1,008 | CHF | 429,800 | 2,697,908.71 | 0.04 |
| Bellway PLC Registered Shares LS -.125 | GB0000904986 | | Units | 74,563 | 8,640 | 14,851 | GBP | 24,120 | 2,047,540.09 | 0.03 |
| Berkeley Group Holdings PLC Reg.Ordinary Shares LS-.054141 | GB00BLJNLX82 | | Units | 69,575 | 7,776 | 13,476 | GBP | 44,470 | 3,522,508.76 | 0.06 |
| Big Yellow Group PLC Registered Shares LS 0,10 | GB0002869419 | | Units | 109,613 | 13,066 | 22,145 | GBP | 12,240 | 1,527,478.90 | 0.02 |
| Billerud AB Namn-Aktier SK 12,50 | SE0000862997 | | Units | 135,065 | 70,636 | 53,682 | SEK | 98,360 | 1,173,170.90 | 0.02 |
| bioMerieux Actions au Porteur (P.S.) o.N. | FR0013280286 | | Units | 32,390 | 11,042 | 10,311 | EUR | 94,900 | 3,073,811.00 | 0.05 |
| BKW AG Namens-Aktien SF 2,50 | CH0130293662 | | Units | 11,835 | 12,067 | 232 | CHF | 153,000 | 1,842,791.36 | 0.03 |
| BNP Paribas S.A. Actions Port. EO 2 | FR0000131104 | | Units | 710,659 | 102,933 | 138,722 | EUR | 58,590 | 41,637,510.81 | 0.66 |
| Boliden AB Namn-Aktier o.N. | SE0017768716 | | Units | 173,387 | 201,711 | 28,324 | SEK | 366,200 | 5,607,054.92 | 0.09 |
| Bolloré SE Actions Port. EO 0,16 | FR0000039299 | | Units | 536,654 | 60,626 | 106,241 | EUR | 6,120 | 3,284,322.48 | 0.05 |
| Bouygues S.A. Actions Port. EO 1 | FR0000120503 | | Units | 174,461 | 19,008 | 38,701 | EUR | 33,200 | 5,792,105.20 | 0.09 |
| BP PLC Registered Shares DL -.25 | GB00007980591 | | Units | 11,792,142 | 2,009,518 | 2,930,012 | GBP | 5,344 | 71,744,875.54 | 5.14 |
| BPER Banca S.p.A. Azioni nom. EO 3 | IT0000066123 | | Units | 617,491 | 629,857 | 12,366 | EUR | 2,545 | 1,571,514.60 | 0.02 |
| Brenntag SE Namens-Aktien o.N. | DE000A1DAHH0 | | Units | 97,166 | 14,468 | 17,642 | EUR | 73,780 | 7,168,907.48 | 0.11 |
| British American Tobacco PLC Registered Shares LS -.25 | GB0002875804 | | Units | 1,281,027 | 184,412 | 274,215 | GBP | 29,270 | 42,688,681.63 | 0.68 |
| British Land Co. PLC, The Registered Shares LS -.25 | GB0001367019 | | Units | 524,315 | 60,061 | 103,083 | GBP | 4,002 | 2,388,917.23 | 0.03 |
| British PLC Registered Shares LS -.20 | GB00B0N8QD54 | | Units | 159,536 | 19,038 | 32,661 | GBP | 9,135 | 1,659,200.95 | 0.03 |
| Brunello Cucinelli S.P.A. Azioni nom. | IT0004764699 | | Units | 20,711 | 21,095 | 384 | EUR | 86,700 | 1,795,643.70 | 0.03 |
| BT Group PLC Registered Shares LS 0,05 | GB0030913577 | | Units | 4,248,582 | 535,289 | 803,048 | GBP | 1,589 | 7,683,568.38 | 0.12 |
| Bucher Industries AG Namens-Aktien SF -.20 | CH0002432174 | | Units | 3,937 | 288 | 587 | CHF | 400,800 | 1,605,867.10 | 0.03 |
| Bunzl PLC Registered Shares LS -.3214857 | GB0080744B38 | | Units | 214,239 | 43,352 | 47,506 | GBP | 31,640 | 7,717,324.18 | 0.12 |
| Burberry Group PLC Registered Shares LS-.0005 | GB0031743007 | | Units | 242,386 | 26,340 | 46,319 | GBP | 25,910 | 7,150,010.53 | 0.11 |
| Bureau Veritas SA Actions au Porteur EO -.12 | FR0006174348 | | Units | 176,711 | 27,843 | 33,729 | EUR | 26,140 | 4,619,225.54 | 0.07 |
| Bâloise Holding AG Namens-Aktien SF 0,10 | CH0012410517 | | Units | 27,761 | 4,482 | 5,040 | CHF | 149,100 | 4,212,396.30 | 0.07 |
| Caixabank S.A. Acciones Port. EO 1 | ES0140609019 | | Units | 2,513,367 | 467,306 | 768,107 | EUR | 3,352 | 8,424,806.18 | 0.13 |
| Cappemini SE Actions Port. EO 8 | FR0000125338 | | Units | 108,586 | 18,443 | 21,894 | EUR | 164,900 | 17,905,831.40 | 0.28 |
| Carl Zeiss Meditec AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0005313704 | | Units | 22,075 | 2,304 | 4,032 | EUR | 121,800 | 2,688,735.00 | 0.04 |
| Carlsberg AS Navne-Aktier B DK 20 | DK0010181759 | | Units | 62,771 | 11,390 | 14,744 | DKK | 1,117,500 | 9,411,309.39 | 0.15 |
| Carrefour S.A. Actions Port. EO 2,5 | FR0000120172 | | Units | 356,107 | 44,769 | 84,209 | EUR | 18,860 | 6,716,178.02 | 0.11 |
| Castellum AB Namn-Aktier o.N. | SE0000379190 | | Units | 173,332 | 42,218 | 67,965 | SEK | 124,300 | 1,902,610.17 | 0.03 |
| Celnex Telecom S.A. Acciones Port. EO -.25 | ES0105066007 | | Units | 352,226 | 65,402 | 61,768 | EUR | 38,170 | 13,444,466.42 | 0.21 |
| Cembra Money Bank AG Namens-Aktien SF 1 | CH0225173167 | | Units | 18,298 | 18,634 | 336 | CHF | 71,450 | 1,330,522.83 | 0.02 |
| Centrica PLC Reg. Shares LS -.061728395 | GB00B033F229 | | Units | 3,780,548 | 659,337 | 690,407 | GBP | 1,145 | 4,928,241.48 | 0.08 |
| Christian Dior SE Actions Port. EO 2 | FR0000130403 | | Units | 2,704 | 288 | 504 | EUR | 832,000 | 2,249,728.00 | 0.04 |
| Christian Hansen Holding AS Navne-Aktier DK 10 | DK00060227585 | | Units | 66,389 | 11,235 | 11,612 | DKK | 525,800 | 4,683,388.45 | 0.07 |
| Cie Financière Richemont AG Namens-Aktien SF 1 | CH0210483332 | | Units | 325,804 | 55,212 | 67,273 | CHF | 146,950 | 48,723,948.54 | 0.77 |
| Cie Génie Étis Michelin SCPA Actions Nom. EO -.50 | FR001400AJ45 | | Units | 442,620 | 515,236 | 72,616 | EUR | 28,830 | 12,760,734.60 | 0.20 |
| Clariant AG Namens-Aktien SF 2,60 | CH0012142631 | | Units | 134,840 | 15,546 | 26,702 | CHF | 14,860 | 2,039,172.79 | 0.03 |
| Close Brothers Group PLC Registered Shares LS -.25 | GB0007668071 | | Units | 90,987 | 11,128 | 19,150 | GBP | 9,080 | 940,582.58 | 0.01 |
| CNH Industrial N.V. Aandelen op naam EO -.01 | NL0010545661 | | Units | 605,684 | 73,959 | 114,982 | EUR | 12,745 | 7,719,442.58 | 0.12 |
| Coca-Cola HBC AG Nam.-Aktien SF 6,70 | CH0198251305 | | Units | 137,223 | 31,653 | 24,650 | GBP | 24,240 | 3,786,964.74 | 0.06 |
| Cofinimmo S.A. Actions Porteur o.N. | BE0003593044 | | Units | 21,485 | 7,473 | 3,556 | EUR | 86,650 | 1,861,675.25 | 0.03 |
| Coloplast AS Navne-Aktier B DK 1 | DK0060448595 | | Units | 74,879 | 12,454 | 13,636 | DKK | 973,000 | 9,774,990.58 | 0.16 |
| Commerzbank AG Inhaber-Aktien o.N. | DE000CBK1001 | | Units | 672,350 | 101,837 | 154,858 | EUR | 10,065 | 6,767,202.75 | 0.11 |
| Compagnie de Saint-Gobain S.A. Actions au Porteur (C.R.) EO 4 | FR0000125007 | | Units | 322,096 | 51,784 | 74,444 | EUR | 52,420 | 16,884,272.32 | 0.27 |
| Compass Group PLC Registered Shares LS -.1105 | GB00BDE6K4575 | | Units | 1,119,734 | 191,805 | 226,705 | GBP | 20,970 | 26,732,835.91 | 0.42 |
| Computacenter PLC Registered Shares LS -.075555 | GB00B0V9FP302 | | Units | 48,413 | 49,588 | 1,175 | GBP | 22,960 | 1,265,510.10 | 0.02 |
| Continental AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0005439004 | | Units | 65,615 | 9,429 | 12,484 | EUR | 63,420 | 4,161,303.30 | 0.07 |
| ConvaTec Group PLC Registered Shares WI LS -.10 | GB00B03VFW73 | | Units | 995,380 | 424,807 | 469,930 | GBP | 2,198 | 2,490,854.36 | 0.04 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート レポート 期間内 | 販売/ 処分 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^② | |
|------------------------------------------------------------|---------------|----|-------------------|-----------------|----------------------------------|-----------|-----|---------------|-----------------------------|------|
| Corporacion Acciona Energias R Acciones Port. EO 1 | ES0105563003 | | Units | 34,723 | 35,535 | 812 | EUR | 1,130,580.88 | 0.02 | |
| Covestro AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0006062144 | | Units | 117,302 | 15,586 | 22,540 | EUR | 4,667,446.58 | 0.07 | |
| Covivio S.A. Actions Port. EO 3 | FR0000064578 | | Units | 28,059 | 3,168 | 5,544 | EUR | 1,445,038.50 | 0.02 | |
| Credit Suisse Group AG Namens-Aktien SF -,04 | CH0012138530 | | Units | 2,202,724 | 880,139 | 304,731 | CHF | 1,794,252.82 | 0.03 | |
| Crih Plc Registered Shares EO -,32 | IE0018270411 | | Units | 467,619 | 77,424 | 124,527 | EUR | 43,780 | 20,472,359.82 | 0.32 |
| Croda International PLC Regist.Shares LS -,10609756 | GB00BJFFLV09 | | Units | 90,774 | 15,172 | 16,224 | GBP | 69,800 | 7,213,543.13 | 0.11 |
| Crédit Agricole S.A. Actions Port. EO 3 | FR0000045072 | | Units | 810,365 | 128,792 | 212,344 | EUR | 11,084 | 8,982,085.66 | 0.14 |
| CTS Eventim AG & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N. | DE0005470306 | | Units | 36,609 | 4,138 | 7,056 | EUR | 59,600 | 2,181,896.40 | 0.03 |
| Dleteren Group S.A. Parts Sociales au Port. o.N. | BE0974259880 | | Units | 13,711 | 1,440 | 2,520 | EUR | 170,500 | 2,337,725.50 | 0.04 |
| Daimler Truck Holding AG Namens-Aktien o.N. | DE000DTROCK8 | | Units | 292,727 | 64,880 | 76,496 | EUR | 29,940 | 8,764,246.38 | 0.14 |
| Danone S.A. Actions Port. EO -,25 | FR0000120644 | | Units | 397,571 | 59,539 | 82,599 | EUR | 59,990 | 23,850,284.29 | 0.38 |
| Danske Bank AS Navne-Aktier DK 10 | DK0010274414 | | Units | 425,234 | 59,635 | 78,742 | DKK | 142,550 | 8,132,773.46 | 0.13 |
| Dassault Aviation S.A. Actions Port. EO -,80 | FR0014004L86 | | Units | 13,950 | 1,440 | 2,520 | EUR | 177,300 | 2,473,335.00 | 0.04 |
| Dassault Systemes SE Actions Port. EO 0,10 | FR0014003TT8 | | Units | 454,523 | 84,480 | 95,248 | EUR | 36,670 | 16,667,358.41 | 0.26 |
| Dawidz Campari-Milano N.V. Aandelen op naam EO -,01 | NL0015435975 | | Units | 349,336 | 65,549 | 62,877 | EUR | 11,680 | 4,080,244.48 | 0.06 |
| DCC PLC Registered Shares EO -,25 | IE0002424939 | | Units | 66,523 | 12,314 | 11,592 | GBP | 49,440 | 3,744,398.18 | 0.06 |
| Dechra Pharmaceuticals PLC Registered Shares LS -,01 | GB0009633180 | | Units | 75,200 | 18,169 | 12,818 | GBP | 37,300 | 3,193,437.41 | 0.05 |
| Delivery Hero SE Namens-Aktien o.N. | DE000A2E4K43 | | Units | 119,383 | 36,147 | 30,415 | EUR | 36,130 | 4,313,307.79 | 0.07 |
| Demant AS Navne Aktier A DK 0,2 | DK0006738599 | | Units | 61,886 | 7,200 | 12,108 | DKK | 289,400 | 2,395,127.34 | 0.04 |
| Derwent London PLC Registered Shares LS -,05 | GB0002652740 | | Units | 62,279 | 7,306 | 12,331 | GBP | 24,020 | 1,703,124.40 | 0.03 |
| Deutsche Bank AG Namens-Aktien o.N. | DE0005140008 | | Units | 1,275,718 | 220,845 | 282,139 | EUR | 9,943 | 12,684,464.07 | 0.20 |
| Deutsche Börse AG Namens-Aktien o.N. | DE0005810055 | | Units | 118,588 | 21,345 | 25,517 | EUR | 172,900 | 20,503,865.20 | 0.33 |
| Deutsche Lufthansa AG vink.Namens-Aktien o.N. | DE0008232125 | | Units | 365,268 | 98,414 | 117,706 | EUR | 9,730 | 3,554,057.64 | 0.06 |
| Deutsche Post AG Namens-Aktien o.N. | DE0005552004 | | Units | 614,112 | 100,941 | 125,319 | EUR | 43,520 | 26,726,154.24 | 0.42 |
| Deutsche Telekom AG Namens-Aktien o.N. | DE0005557508 | | Units | 2,164,276 | 337,697 | 416,764 | EUR | 21,880 | 47,354,358.88 | 0.75 |
| Diageo PLC Reg. Shares LS -,28935185 | GB0002374006 | | Units | 1,416,259 | 210,898 | 296,133 | GBP | 36,220 | 58,401,347.19 | 0.93 |
| Diasorin S.p.A. Azioni nom. EO 1 | IT0003492391 | | Units | 15,728 | 1,728 | 3,024 | EUR | 98,480 | 1,548,893.44 | 0.02 |
| Dino Polska S.A. Inhaber-Aktien ZY -,10 | PLDINPL00011 | | Units | 31,876 | 6,572 | 5,612 | PLN | 423,400 | 2,946,115.58 | 0.05 |
| Diploma PLC Registered Shares LS -,05 | GB0001826634 | | Units | 76,383 | 8,746 | 15,028 | GBP | 26,860 | 2,335,793.56 | 0.04 |
| Direct Line Insurance Grp PLC Reg.Shares LS-,109090909 | GB0008Y9D0Y18 | | Units | 766,419 | 148,651 | 153,326 | GBP | 1,716 | 1,497,758.54 | 0.02 |
| DKSH Holding AG Nam.-Aktien SF -,10 | CH0126673539 | | Units | 21,483 | 2,410 | 4,052 | CHF | 70,950 | 1,551,185.73 | 0.02 |
| DNB Bank ASA Navne-Aksjer NK 100 | NO0010161896 | | Units | 559,545 | 87,665 | 102,706 | NOK | 187,200 | 8,874,611.50 | 0.14 |
| Dowlati Group Plc Registered Share LS -,01 | GB00BMRWZ071 | | Units | 828,693 | 828,693 | - | GBP | 1,326 | 1,251,033.48 | 0.02 |
| Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | DE000PAG9113 | | Units | 71,894 | 73,190 | 1,296 | EUR | 113,400 | 8,152,779.60 | 0.13 |
| Drax Group PLC Registered Shares LS -,1155172 | GB00B1VNSX38 | | Units | 246,230 | 28,891 | 49,484 | GBP | 6,296 | 1,764,970.38 | 0.03 |
| DS Smith PLC Registered Shares LS -,10 | GB0008220112 | | Units | 843,318 | 94,850 | 165,679 | GBP | 3,101 | 2,977,315.60 | 0.05 |
| DSM-Firmenich AG Namens-Aktien EO -,01 | CH1216478797 | | Units | 111,012 | 111,012 | - | EUR | 118,760 | 13,183,785.12 | 0.21 |
| DSV A/S Indehaver Bonus-Aktier DK 1 | DK0060079531 | | Units | 111,472 | 15,799 | 34,193 | DKK | 1,270,500 | 19,001,327.10 | 0.30 |
| Dufry AG Nam.-Aktien SF 5 | CH0023405456 | | Units | 43,516 | 5,002 | 8,830 | CHF | 41,070 | 1,818,821.77 | 0.03 |
| E.ON SE Namens-Aktien o.N. | DE000ENAG999 | | Units | 1,262,142 | 186,791 | 291,342 | EUR | 12,005 | 15,152,014.71 | 0.24 |
| Edenred SE Actions Port. EO 2 | FR0010908533 | | Units | 156,640 | 25,518 | 28,629 | EUR | 58,920 | 9,229,228.80 | 0.15 |
| EDP - Energias de Portugal SA Acções Nom. EO 1 | PTEDP0AM0009 | | Units | 1,599,354 | 160,934 | 293,752 | EUR | 5,000 | 7,996,770.00 | 0.13 |
| EDP Renováveis S.A. Acciones Port. EO 5 | ES0127797019 | | Units | 143,758 | 15,006 | 27,006 | EUR | 20,160 | 2,898,161.28 | 0.05 |
| Eiffage S.A. Actions Port. EO 4 | FR0000130452 | | Units | 62,614 | 10,602 | 11,088 | EUR | 107,900 | 6,756,050.60 | 0.11 |
| Electrolux, AB Namn-Aktier B | SE0016589188 | | Units | 160,219 | 51,189 | 40,117 | SEK | 154,550 | 2,186,668.58 | 0.03 |
| Elekta AB Namn-Aktier B SK 2 | SE0000163628 | | Units | 219,387 | 26,377 | 45,327 | SEK | 86,060 | 1,667,293.93 | 0.03 |
| Elija Group Actions au Port. o.N. | BE0003822393 | | Units | 21,145 | 3,750 | 3,978 | EUR | 124,400 | 2,630,438.00 | 0.04 |
| Elis S.A. Actions au Porteur EO 1,- | FR0012435121 | | Units | 115,862 | 48,204 | 47,665 | EUR | 18,000 | 2,081,916.00 | 0.03 |
| Elisa Oyj Registered Shares Class A o.N. | FI0009007884 | | Units | 90,150 | 9,792 | 17,136 | EUR | 56,320 | 5,077,248.00 | 0.08 |
| Embraer Group AB Namn-Aktier AK Class B o.N. | SE0016828511 | | Units | 465,369 | 474,312 | 8,943 | SEK | 53,410 | 2,194,926.42 | 0.03 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 単位: 市場 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^① |
|-----------------------------------------------------|---------------|----------------------|-----------------|----------------------|-------------|-----------|---------------|-----------------------------|
| Ems-Chemie Holding AG Namens-Aktien SF -.01 | CH0016440353 | Units | 4,450 | 841 | 797 CHF | 731.500 | 3,312,766.42 | 0.05 |
| Enagas S.A. Acciones Port. EO 1,50 | ES0130960018 | Units | 123,139 | - | 23,360 EUR | 18.155 | 2,235,588.55 | 0.04 |
| ENCAVIS AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0006095003 | Units | 73,701 | 75,489 | 1,788 EUR | 15.675 | 1,155,263.18 | 0.02 |
| Endesa S.A. Acciones Port. EO 1,20 | ES0130670112 | Units | 206,096 | 37,954 | 37,022 EUR | 20.370 | 4,198,175.52 | 0.07 |
| ENEL S.p.A. Azioni nom. EO 1 | IT0003128367 | Units | 4,837,605 | 760,119 | 967,646 EUR | 6.199 | 29,988,313.40 | 0.48 |
| Energiean PLC Registered Shares (WI) LS -.01 | GB00BG12Y042 | Units | 84,595 | 86,323 | 1,728 GBP | 12.380 | 1,192,331.66 | 0.02 |
| Engie S.A. Actions Port. EO 1 | FR0010208488 | Units | 1,168,464 | 178,711 | 212,217 EUR | 14.516 | 16,961,423.42 | 0.27 |
| ENI S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0003132476 | Units | 1,538,998 | 209,802 | 294,904 EUR | 13.746 | 21,155,066.51 | 0.34 |
| Entain PLC Registered Shares EO -.01 | IM00B5VQMV65 | Units | 356,363 | 46,731 | 67,975 GBP | 14.440 | 5,858,568.83 | 0.09 |
| Epiroc AB Namn-Aktier A o.N. | SE0015658109 | Units | 382,784 | 47,876 | 72,837 SEK | 205.000 | 6,929,590.56 | 0.11 |
| EQT AB Namn-Aktier o.N. | SE0012853455 | Units | 475,637 | 110,103 | 79,051 SEK | 219.800 | 9,232,158.60 | 0.15 |
| Equinor ASA Navne-Aksjer NK 2,50 | N00010096985 | Units | 653,281 | 89,004 | 142,707 NOK | 305.000 | 16,881,395.82 | 0.27 |
| Erste Group Bank AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000652011 | Units | 202,921 | 25,666 | 38,649 EUR | 32.910 | 6,678,130.11 | 0.11 |
| EssilorLuxottica S.A. Actions Port. EO 0,18 | FR0000121667 | Units | 190,028 | 32,800 | 40,065 EUR | 179.400 | 34,091,023.20 | 0.54 |
| Essity AB Namn-Aktier B | SE0009922164 | Units | 378,221 | 58,480 | 69,056 SEK | 310.700 | 10,377,358.72 | 0.16 |
| Eurazeo SE Actions au Porteur o.N. | FR0000121121 | Units | 31,307 | 6,515 | 6,028 EUR | 64.850 | 2,023,997.55 | 0.03 |
| Eurofins Scientific S.E. Actions Port. EO 0,01 | FR0014000MR3 | Units | 79,239 | 8,640 | 15,010 EUR | 63.260 | 5,012,659.14 | 0.08 |
| Euronext N.V. Aandelen an toonder WI EO 1,60 | NL0006294274 | Units | 49,800 | 5,472 | 9,530 EUR | 72.100 | 3,590,580.00 | 0.06 |
| Evolution AB (publ) Namn-Aktier SK-.003 | SE0012673267 | Units | 119,016 | 16,714 | 21,720 SEK | 1,365.400 | 14,350,438.97 | 0.23 |
| Evonik Industries AG Namens-Aktien o.N. | DE000EVNK013 | Units | 136,637 | 35,868 | 23,956 EUR | 19.760 | 2,699,947.12 | 0.04 |
| Evotec SE Inhaber-Aktien o.N. | DE0005664809 | Units | 91,288 | 10,762 | 27,572 EUR | 16.625 | 1,517,663.00 | 0.02 |
| EXOR N.V. Aandelen aan toonder o.N. | NL0012059018 | Units | 62,875 | 9,345 | 19,968 EUR | 74.480 | 4,682,930.00 | 0.07 |
| Experian PLC Registered Shares DL -.10 | GB00B19N1V48 | Units | 574,313 | 84,763 | 138,095 GBP | 28.100 | 18,373,280.43 | 0.29 |
| Fabege AB Namn-Aktier SK 15,41 | SE0011166974 | Units | 168,881 | 20,528 | 34,495 SEK | 82.100 | 1,224,401.59 | 0.02 |
| Fastighets AB Balder Namn-Aktier B SK 0,16666 | SE0017832488 | Units | 395,083 | 465,873 | 70,790 SEK | 47.590 | 1,660,366.59 | 0.03 |
| Faurecia SE Actions Port. EO 7 | FR0000121147 | Units | 101,219 | 36,591 | 19,833 EUR | 18.750 | 1,897,856.25 | 0.03 |
| Ferrari N.V. Aandelen op naam EO -.01 | NL0011585146 | Units | 73,628 | 11,090 | 16,042 EUR | 252.300 | 18,576,344.40 | 0.29 |
| Ferrovial S.A. Acciones Port. EO -.20 | ES0118900010 | Units | 330,515 | 45,999 | 60,614 EUR | 28.430 | 9,396,541.45 | 0.15 |
| FincoBank Banca Fineco S.p.A. Azioni nom. EO -.33 | IT0000072170 | Units | 372,520 | 56,548 | 64,088 EUR | 13.730 | 5,114,699.60 | 0.08 |
| Fischer AG, Georg Namens-Aktien SF 0,05 | CH1169151003 | Units | 54,097 | 10,383 | 9,626 CHF | 64.750 | 3,564,752.87 | 0.06 |
| Flughafen Zürich AG Namens-Aktien SF 10 | CH0319416936 | Units | 11,583 | 1,152 | 2,016 CHF | 171.600 | 2,022,808.70 | 0.03 |
| Flutter Entertainment PLC Registered Shares EO -.09 | IE00BWT6H894 | Units | 110,817 | 17,557 | 19,984 EUR | 181.100 | 20,068,958.70 | 0.32 |
| Fortnox AB Namn-Aktier o.N. | SE0017161243 | Units | 290,940 | 344,777 | 53,837 SEK | 70.520 | 1,811,822.61 | 0.03 |
| Fortum Oyj Registered Shares EO 3,40 | FI0009007132 | Units | 283,346 | 50,867 | 51,036 EUR | 13.530 | 3,833,671.38 | 0.06 |
| freenet AG Namens-Aktien o.N. | DE000A022225 | Units | 71,572 | 8,352 | 19,549 EUR | 25.840 | 1,849,420.48 | 0.03 |
| Fresenius Medical Care KGaA Inhaber-Aktien o.N. | DE0005785802 | Units | 120,896 | 16,039 | 22,754 EUR | 44.040 | 5,324,259.84 | 0.08 |
| Fresenius SE & Co. KGaA Inhaber-Aktien o.N. | DE0005785604 | Units | 260,786 | 42,018 | 47,487 EUR | 26.220 | 6,837,808.92 | 0.11 |
| Frontline PLC Namens-Aktien DL 1 | CY0203052116 | Units | 89,520 | 91,296 | 1,776 NOK | 165.440 | 1,254,784.31 | 0.02 |
| FLUHS PETROLUB SE Namens-Vorzugsakt. o.St.o.N. | DE000A3E5D64 | Units | 41,655 | 4,896 | 8,555 EUR | 35.800 | 1,491,249.00 | 0.02 |
| Future PLC Registered Shares LS -.15 | GB00B9YZN9041 | Units | 68,280 | 8,484 | 14,066 GBP | 11.280 | 876,868.26 | 0.01 |
| Galenica AG Namens-Aktien SF -.10 | CH0360674466 | Units | 30,168 | 3,352 | 5,656 CHF | 79.950 | 2,454,604.13 | 0.04 |
| Galp Energia SGPS S.A. Açções Nominativas EO 1 | PTGAL0AM0009 | Units | 322,447 | 60,611 | 58,153 EUR | 10.990 | 3,543,692.53 | 0.06 |
| Games Workshop Group PLC Registered Shares LS -.05 | GB0003718474 | Units | 19,556 | 2,122 | 3,837 GBP | 99.200 | 2,208,632.39 | 0.04 |
| Gaztransport Technigaz Actions Nom. EO -.01 | FR0011726835 | Units | 20,532 | 23,527 | 2,995 EUR | 96.950 | 1,990,577.40 | 0.03 |
| GEA Group AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0006602006 | Units | 99,453 | 21,527 | 17,750 EUR | 42.540 | 4,230,730.62 | 0.07 |
| Geberit AG Nam.-Akt. (Dispost.) SF -.10 | CH0030170408 | Units | 21,375 | 4,212 | 6,001 CHF | 506.800 | 11,024,507.65 | 0.17 |
| Gecina S.A. Actions Nom. EO 7,50 | FR0010040865 | Units | 31,363 | 6,196 | 5,530 EUR | 100.900 | 3,164,526.70 | 0.05 |
| GENMAB AS Navne Aktier DK 1 | DK0010272202 | Units | 41,588 | 6,783 | 7,540 DKK | 2,780.000 | 15,511,589.49 | 0.25 |
| Genus PLC Registered Shares LS -.1 | GB0002074580 | Units | 38,847 | 4,608 | 8,004 GBP | 26.880 | 1,188,826.53 | 0.02 |
| Geltinge AB Namn-Aktier B (fria) SK 2 | SE0000202624 | Units | 145,162 | 29,600 | 25,560 SEK | 259.900 | 3,331,648.38 | 0.05 |
| Getlink SE Actions Port. EO -.40 | FR0010533075 | Units | 198,533 | 22,282 | 106,784 EUR | 16.960 | 3,367,119.68 | 0.05 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^② | |
|--------------------------------------------------------|---------------|-------|-----------------|----------------------|------------------|-----|---------------|-----------------------------|------|
| | | 市場 | 1,000単位の単位 | | | | 市場価値 | 資産比率% ^② | |
| Givaudan SA Namens-Aktien SF 10 | CH0010645932 | Units | 4,977 | 907 | 1,139 | CHF | 3,122,000 | 15,813,099.84 | 0.25 |
| Gjensidige Forsikring ASA Navne-Aksjer NK 2 | NO0010582521 | Units | 113,574 | 13,210 | 22,606 | NOK | 185,300 | 1,783,047.15 | 0.03 |
| Glanbia PLC Registered Shares EO 0,06 | IE0000669501 | Units | 120,368 | 14,312 | 24,938 | EUR | 13,750 | 1,655,060.00 | 0.03 |
| Glencore PLC Registered Shares DL -.01 | JE00B4T3BW64 | Units | 6,461,882 | 1,017,144 | 1,484,509 | GBP | 4,690 | 34,503,535.82 | 0.55 |
| GN Store Nord AS Navne-Aktier DK 1 | DK0010272632 | Units | 77,438 | 9,060 | 15,218 | DKK | 180,000 | 1,870,122.71 | 0.03 |
| Grafton Group PLC Registered Shares EO -.05 | IE00B00MZ448 | Units | 131,755 | 16,044 | 27,595 | GBP | 8,668 | 1,300,222.70 | 0.02 |
| Greggs PLC Registered Shares LS -.02 | GB00B63QSB39 | Units | 60,333 | 6,912 | 12,410 | GBP | 28,180 | 1,935,653.63 | 0.03 |
| Griofis S.A. Acciones Port. Class A EO -.25 | ES0171996087 | Units | 200,367 | 45,132 | 34,961 | EUR | 9,320 | 1,867,420.44 | 0.03 |
| Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL) Actions au Porteur o.N. | BE0003797140 | Units | 60,703 | 14,734 | 17,296 | EUR | 81,300 | 4,935,153.90 | 0.08 |
| GSK PLC Registered Shares LS-.3125 | GB00BN7SWP63 | Units | 2,563,024 | 2,745,803 | 182,779 | GBP | 14,410 | 42,048,295.00 | 0.67 |
| H & M Hennes & Mauritz AB Namn-Aktier B SK 0,125 | SE0000106270 | Units | 416,234 | 115,584 | 195,640 | SEK | 149,880 | 5,509,106.58 | 0.09 |
| Haleon PLC Reg.Shares LS 0,01 | GB00BMX86B70 | Units | 3,518,200 | 3,722,298 | 204,098 | GBP | 3,510 | 14,059,160.13 | 0.22 |
| Halma PLC Registered Shares LS -.10 | GB0004052071 | Units | 240,132 | 37,453 | 43,592 | GBP | 23,080 | 6,309,828.85 | 0.10 |
| Hannover Ruck SE Namens-Aktien o.N. | DE0008402215 | Units | 37,762 | 5,519 | 6,600 | EUR | 193,600 | 7,310,723.20 | 0.12 |
| Harbour Energy PLC Registered Shares LS 0,00002 | GB00BMBVQG36 | Units | 420,817 | 487,310 | 66,493 | GBP | 2,473 | 1,184,811.14 | 0.02 |
| Hargreaves Lansdown PLC Registered Shares DL-.004 | GB00B1VZ0M25 | Units | 209,522 | 24,281 | 42,077 | GBP | 8,030 | 1,915,476.87 | 0.03 |
| Hays PLC Registered Shares LS -.01 | GB0004161021 | Units | 997,331 | 121,564 | 208,115 | GBP | 1,138 | 1,292,151.15 | 0.02 |
| HeidelbergCement AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0006047004 | Units | 88,377 | 9,504 | 16,876 | EUR | 68,560 | 6,059,127.12 | 0.10 |
| Heineken Holding N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60 | NL0000008977 | Units | 73,713 | 20,051 | 11,737 | EUR | 86,950 | 6,409,345.35 | 0.10 |
| Heineken N.V. Aandelen aan toonder EO 1,60 | NL0000009165 | Units | 161,065 | 34,236 | 27,097 | EUR | 104,050 | 16,758,813.25 | 0.27 |
| HelloFresh SE Inhaber-Aktien o.N. | DE000A161408 | Units | 106,474 | 15,335 | 20,640 | EUR | 24,230 | 2,579,865.02 | 0.04 |
| Helvetia Holding AG Namens-Aktien SF 0,02 | CH0466642201 | Units | 23,350 | 4,968 | 4,080 | CHF | 133,100 | 3,162,870.52 | 0.05 |
| Henkel AG & Co. KGaA Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | DE0006048432 | Units | 100,304 | 10,778 | 25,796 | EUR | 73,280 | 7,350,277.12 | 0.12 |
| Hera S.p.A. Azioni nom. EO 1 | IT0001250932 | Units | 469,961 | 57,739 | 98,152 | EUR | 2,824 | 1,327,169.86 | 0.02 |
| Hermes International S.C.A. Actions au Porteur o.N. | FR0000052292 | Units | 22,014 | 3,363 | 4,174 | EUR | 1,966,800 | 43,297,135.20 | 0.69 |
| Hexagon AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | SE0015961909 | Units | 1,257,802 | 231,337 | 382,121 | SEK | 116,850 | 12,978,991.12 | 0.21 |
| Hexatronicon Group AB Namn-Aktier AK SK -.01 | SE0018040677 | Units | 108,750 | 110,958 | 2,208 | SEK | 86,500 | 830,702.10 | 0.01 |
| Hexpol AB Namn-Aktier B o.N. | SE0007074281 | Units | 155,406 | 18,430 | 32,397 | SEK | 120,700 | 1,656,437.26 | 0.03 |
| Hikma Pharmaceuticals PLC Registered Shares LS -.10 | GB00B0LCLW083 | Units | 101,450 | 11,716 | 20,177 | GBP | 18,410 | 2,126,363.83 | 0.03 |
| Hiscox Ltd. Registered Shares LS -.065 | BMG4593F1389 | Units | 236,259 | 48,736 | 42,507 | GBP | 11,820 | 3,179,344.40 | 0.05 |
| Holcim Ltd. Namens-Aktien SF 2 | CH0012214059 | Units | 328,846 | 57,418 | 94,913 | CHF | 58,820 | 19,684,938.27 | 0.31 |
| Holmen AB Namn-Aktier Cl. B SK 25 | SE0011090018 | Units | 56,612 | 6,442 | 11,088 | SEK | 387,300 | 1,936,225.49 | 0.03 |
| Howden Joinery Group PLC Registered Shares LS -.10 | GB0005576813 | Units | 359,921 | 40,912 | 70,899 | GBP | 6,846 | 2,805,277.44 | 0.04 |
| HSBC Holdings PLC Registered Shares DL -.50 | GB0005405286 | Units | 12,673,028 | 1,856,632 | 2,562,221 | GBP | 5,738 | 82,789,007.29 | 1.31 |
| HUGO BOSS AG Namens-Aktien o.N. | DE000A1PHFF7 | Units | 35,883 | 7,656 | 7,036 | EUR | 68,220 | 2,447,938.26 | 0.04 |
| Huhtamäki Oyj Registered Shares o.N. | FI0009000459 | Units | 57,855 | 6,624 | 11,190 | EUR | 32,640 | 1,888,387.20 | 0.03 |
| Huysarna AB Namn-Aktier B SK 100 | SE0001662230 | Units | 250,004 | 29,274 | 50,430 | SEK | 88,300 | 1,949,429.79 | 0.03 |
| Iberdrola S.A. Acciones Port. EO -.75 | ES0144580Y14 | Units | 3,684,969 | 598,568 | 731,647 | EUR | 11,780 | 43,408,934.82 | 0.69 |
| IG Group Holdings PLC Registered Shares LS 0,00005 | GB00B06QBF75 | Units | 260,634 | 15,752 | 48,538 | GBP | 7,335 | 2,176,521.31 | 0.03 |
| IMCD N.V. Aandelen op naam EO -.16 | NL0010801007 | Units | 34,723 | 4,571 | 6,552 | EUR | 136,200 | 4,729,272.60 | 0.08 |
| IMI PLC Registered Shares LS -.2857 | GB00BGLP8L22 | Units | 159,226 | 25,398 | 31,443 | GBP | 15,950 | 2,891,388.23 | 0.05 |
| Imperial Brands PLC Registered Shares LS -.10 | GB0004544929 | Units | 587,847 | 83,472 | 108,424 | GBP | 19,675 | 13,167,726.10 | 0.21 |
| Inchcape PLC Registered Shares LS -.10 | GB00B61TVQ02 | Units | 266,596 | 58,011 | 47,964 | GBP | 8,085 | 2,453,948.19 | 0.04 |
| Indivior PLC Registered Shares DL0,50 | GB00BN4HT335 | Units | 84,492 | 86,512 | 2,020 | GBP | 15,260 | 1,467,918.22 | 0.02 |
| Industria de Diseño Textil SA Acciones Port. EO 0,03 | ES0148396007 | Units | 692,187 | 120,473 | 146,855 | EUR | 31,160 | 21,568,546.92 | 0.34 |
| Industrivärden AB Namn-Aktier C o.N. | SE0000107203 | Units | 95,325 | 97,519 | 2,194 | SEK | 292,300 | 2,460,569.11 | 0.04 |
| Indutrade AB Aktier SK 1 | SE0001515552 | Units | 175,187 | 33,280 | 31,478 | SEK | 245,700 | 3,801,079.65 | 0.06 |
| Infinion Technologies AG Namens-Aktien o.N. | DE0006231004 | Units | 818,009 | 120,203 | 148,254 | EUR | 32,905 | 26,916,586.15 | 0.43 |
| Infirma PLC Registered Shares LS -.001 | GB00BMJ6DW54 | Units | 896,647 | 97,668 | 171,218 | GBP | 7,226 | 7,376,514.38 | 0.12 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 単位: 市場 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^② | |
|----------------------------------------------------------|--------------|----------------------|-----------------|----------------------|-----------|-----|---------------|-----------------------------|------|
| Infrastrutt. Wireless Italiane Azioni nom. o.N. | IT0005090300 | Units | 212,080 | 46,452 | 42,112 | EUR | 12,595 | 2,671,147.60 | 0.04 |
| ING Groep N.V. Aandelen op naam EO -.01 | NL0011821202 | Units | 2,336,202 | 425,822 | 611,244 | EUR | 11,200 | 26,165,462.40 | 0.41 |
| Immobiliaria Colonial SOCIMI Acciones Port. EO 2.50 | ES0139140174 | Units | 179,834 | 45,673 | 37,914 | EUR | 5,795 | 1,042,138.03 | 0.02 |
| InterContinental Hotels Group Reg. Shares LS -.208521303 | GB00B8JHC057 | Units | 112,706 | 12,096 | 21,188 | GBP | 54,600 | 7,006,020.70 | 0.11 |
| Intermediate Capital Grp PLC Registered Shares LS -.2625 | GB00BY1TDJ19 | Units | 180,228 | 27,362 | 35,101 | GBP | 13,015 | 2,670,534.37 | 0.04 |
| Internat. Cons. Airl. Group SA Acciones Nom. EO -.10 | ES0177542018 | Units | 1,490,509 | 170,431 | 300,077 | GBP | 1,522 | 2,581,893.33 | 0.04 |
| Interpump Group S.p.A. Azioni nom. EO 0.52 | IT0001078911 | Units | 49,613 | 5,578 | 9,820 | EUR | 50,480 | 2,504,464.24 | 0.04 |
| Intertek Group PLC Registered Shares LS -.01 | GB0031638363 | Units | 103,018 | 16,850 | 18,542 | GBP | 41,560 | 4,874,391.30 | 0.08 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0000072618 | Units | 10,564,729 | 1,773,478 | 3,032,159 | EUR | 2,385 | 25,191,596.30 | 0.40 |
| Intl. Distributions Svcs. PLC Registered Shares LS -.01 | GB00BDVZY277 | Units | 456,091 | 142,301 | 245,077 | GBP | 2,532 | 1,314,761.38 | 0.02 |
| Investec PLC Registered Shares LS -.0002 | GB00B17BBQ50 | Units | 363,148 | 42,204 | 73,359 | GBP | 4,433 | 1,832,791.76 | 0.06 |
| Investor AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | SE0015811963 | Units | 1,134,416 | 171,467 | 214,943 | SEK | 219,800 | 22,019,120.54 | 0.35 |
| Ipsen S.A. Actions au Porteur EO 1 | FR0010259150 | Units | 22,067 | 2,304 | 4,052 | EUR | 110,000 | 2,427,370.00 | 0.04 |
| ISS AS Indehaver Aktier DK 1 | DK0060542181 | Units | 91,253 | 10,637 | 18,600 | DKK | 141,000 | 1,726,274.02 | 0.03 |
| Italgas S.P.A. Azioni nom. o.N. | IT0005211237 | Units | 341,610 | 86,005 | 59,289 | EUR | 5,930 | 2,025,747.30 | 0.03 |
| ITV PLC Registered Shares LS -.10 | GB0033986497 | Units | 2,161,953 | 252,471 | 440,529 | GBP | 0,808 | 1,988,299.64 | 0.03 |
| JD Sports Fashion PLC Registered Shares LS -.0005 | GB00BM8Q5M07 | Units | 1,621,148 | 321,515 | 297,342 | GBP | 1,611 | 2,972,453.92 | 0.05 |
| JDE Peet's N.V. Registered Shares EO-.01 | NL0014332678 | Units | 78,677 | 22,302 | 15,296 | EUR | 27,600 | 2,171,485.20 | 0.03 |
| Jerónimo Martins, SGPS, S.A. Aççoes Nominaivas EO 1 | PTJMT0AE0001 | Units | 169,226 | 18,852 | 32,737 | EUR | 22,900 | 3,875,275.40 | 0.06 |
| Johnson, Matthey PLC Registered Shares LS 1,101698 | GB00BZ4BQC70 | Units | 110,774 | 23,665 | 41,641 | GBP | 19,635 | 2,476,284.17 | 0.04 |
| Julius Baer Gruppe AG Namens-Aktien SF -.02 | CH0102484968 | Units | 134,167 | 14,400 | 25,514 | CHF | 63,720 | 8,700,374.55 | 0.14 |
| Just Eat Takeaway.com N.V. Registered Shares EO -.04 | NL0012015705 | Units | 127,106 | 28,151 | 22,782 | EUR | 15,880 | 2,018,443.28 | 0.03 |
| Jyske Bank A/S Navne-Aktier DK 10 | DK0010307958 | Units | 28,133 | 33,083 | 4,950 | DKK | 493,100 | 1,861,206.33 | 0.03 |
| K+S Aktiengesellschaft Namens-Aktien o.N. | DE000KSAG888 | Units | 128,825 | 27,846 | 22,657 | EUR | 18,090 | 2,330,444.25 | 0.04 |
| KBC Groep N.V. Parts Sociales Port. o.N. | BE0003565737 | Units | 151,645 | 18,681 | 28,595 | EUR | 64,780 | 9,823,563.10 | 0.16 |
| Kering S.A. Actions Port. EO 4 | FR0000121485 | Units | 45,104 | 7,361 | 9,232 | EUR | 579,700 | 26,146,788.80 | 0.41 |
| Kerry Group PLC Registered Shares A EO -.125 | IE0004906560 | Units | 97,639 | 13,458 | 20,403 | EUR | 95,440 | 9,318,666.16 | 0.15 |
| Kesko Oyj Registered Shares Cl. B o.N. | FI0009000202 | Units | 164,654 | 18,276 | 31,792 | EUR | 18,905 | 3,110,893.37 | 0.05 |
| KGHM Polska Miedz S.A. Inhaber-Aktien SZ Y10 | PLKGHM000017 | Units | 81,514 | 9,322 | 16,197 | PLN | 119,400 | 2,124,572.92 | 0.03 |
| Kindred Group PLC Shares (SDRs)/1 LS-.000625 | SE0007871645 | Units | 135,863 | 16,423 | 28,731 | SEK | 125,800 | 1,509,321.57 | 0.02 |
| Kingfisher PLC Reg. Shares LS -.157142857 | GB0033195214 | Units | 1,217,021 | 136,118 | 285,538 | GBP | 2,575 | 3,567,853.74 | 0.06 |
| Kingspan Group PLC Registered Shares EO -.13 | IE0004927939 | Units | 95,130 | 12,085 | 18,028 | EUR | 62,700 | 5,964,651.00 | 0.09 |
| Kinnevik AB Namn-Aktier B SK 0.025 | SE0015810247 | Units | 145,097 | 16,810 | 28,755 | SEK | 167,850 | 2,150,699.41 | 0.03 |
| KION GROUP AG Inhaber-Aktien o.N. | DE000KGX8881 | Units | 42,740 | 5,086 | 8,535 | EUR | 37,420 | 1,599,330.80 | 0.03 |
| Klépierre S.A. Actions Port. EO 1.40 | FR0000121964 | Units | 125,414 | 14,210 | 24,604 | EUR | 22,960 | 2,879,505.44 | 0.05 |
| Knorr-Bremse AG Inhaber-Aktien o.N. | DE000KBX1006 | Units | 44,174 | 9,273 | 7,656 | EUR | 63,440 | 2,802,398.56 | 0.04 |
| Kojamo Oyj Registered Shares o.N. | FI4000312251 | Units | 116,997 | 13,900 | 47,174 | EUR | 11,270 | 1,318,556.19 | 0.02 |
| Kon. KPN N.V. Aandelen aan toonder EO -.04 | NL0000009082 | Units | 2,093,250 | 313,445 | 382,376 | EUR | 3,309 | 6,926,564.25 | 0.11 |
| KONE Oyj Registered Shares Cl.B o.N. | FI0009013403 | Units | 249,189 | 42,828 | 55,902 | EUR | 51,700 | 12,883,071.30 | 0.20 |
| Kongsberg Gruppen AS Navne-Aksjer NK 1.25 | NO0003043309 | Units | 53,257 | 6,048 | 10,592 | NOK | 477,800 | 2,155,913.49 | 0.03 |
| Koninklijke Philips N.V. Aandelen aan toonder EO 0.20 | NL0000009538 | Units | 556,869 | 91,016 | 121,754 | EUR | 19,086 | 10,628,401.73 | 0.17 |
| Kühne + Nagel Internat. AG Namens-Aktien SF 1 | CH0025238863 | Units | 35,464 | 5,760 | 6,532 | CHF | 263,900 | 9,524,530.61 | 0.15 |
| L E Lundbergforetagen AB Namn-Aktier B (fria) SK 10 | SE0000108847 | Units | 44,328 | 5,040 | 8,670 | SEK | 490,900 | 1,921,635.91 | 0.03 |
| LA FRANCAISE DES JEUX Actions Port. (Prom.) EO-.40 | FR0013451333 | Units | 69,161 | 11,006 | 13,512 | EUR | 38,740 | 2,679,297.14 | 0.04 |
| Land Securities Group PLC Registered Shares LS 0.106666 | GB00BYW0PQ60 | Units | 414,840 | 62,292 | 80,598 | GBP | 6,742 | 3,184,205.66 | 0.05 |
| Lanxess AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0005470405 | Units | 49,297 | 5,578 | 9,938 | EUR | 36,860 | 1,817,087.42 | 0.03 |
| Latour Investment AB Namn-Aktier B SK -.208325 | SE0010100958 | Units | 93,449 | 10,941 | 18,660 | SEK | 221,500 | 1,827,882.72 | 0.03 |
| LEG Immobilien SE Namens-Aktien o.N. | DE000LEG1110 | Units | 48,597 | 10,814 | 8,520 | EUR | 56,380 | 2,739,898.86 | 0.04 |
| Legal & General Group PLC Registered Shares LS -.025 | GB0005603997 | Units | 3,730,813 | 542,612 | 716,210 | GBP | 2,341 | 9,943,439.41 | 0.16 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^① |
|------------------------------------------------------------|---------------|----|-------------------|-----------------|----------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------------------|
| Legrand S.A. Actions au Port. EO 4 | FR0010307819 | | Units | 165,320 | 28,365 | 35,787 | EUR 85.700 | 14,167,924.00 | 0.22 |
| Leonardo S.p.A. Azioni nom. EO 4,40 | IT0003856405 | | Units | 243,813 | 27,950 | 48,346 | EUR 10.805 | 2,634,399.47 | 0.04 |
| Lifco AB Namn-Aktier B o.N. | SE0015949201 | | Units | 136,011 | 15,522 | 27,015 | SEK 233.500 | 2,804,534.95 | 0.04 |
| Lloyds Banking Group PLC Registered Shares LS -10 | GB0008076128 | | Units | 42,241,869 | 6,438,036 | 10,132,772 | GBP 0.482 | 23,180,452.02 | 0.37 |
| Logitech International S.A. Namens-Aktien SF -25 | CH0025751329 | | Units | 98,152 | 10,656 | 26,625 | CHF 52.520 | 5,246,145.66 | 0.08 |
| London Stock Exchange Group PLC Reg. Shares LS 0,069186047 | GB000805WJX34 | | Units | 233,870 | 62,748 | 42,981 | GBP 83.460 | 22,222,076.22 | 0.35 |
| Londonmetric Property PLC Registered Shares o.N. | GB00B4WFW713 | | Units | 537,833 | 66,775 | 111,344 | GBP 1.926 | 1,179,330.33 | 0.02 |
| Lonza Group AG Namens-Aktien SF 1 | CH0013841017 | | Units | 46,669 | 7,297 | 8,855 | CHF 553.800 | 26,302,553.95 | 0.42 |
| Lotus Bakeries S.A. Actions Nom. o.N. | BE0003604155 | | Units | 275 | 275 | - | EUR 6,260.000 | 1,721,500.00 | 0.03 |
| LPP S.A. Inhaber-Aktien ZY 2 | PLLP00000011 | | Units | 680 | - | - | PLN 12,000.000 | 1,781,251.60 | 0.03 |
| LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE Actions Port. (C.R.) EO 0,3 | FR0000121014 | | Units | 162,003 | 24,227 | 33,267 | EUR 871.000 | 141,104,613.00 | 2.24 |
| M&G PLC Registered Shares LS -05 | GB00BKF81C65 | | Units | 1,552,366 | 173,710 | 301,594 | GBP 2.051 | 3,624,862.35 | 0.06 |
| Man Group PLC Reg. Shares DL-.0342857142 | JE00BJ1DLW90 | | Units | 809,110 | 93,912 | 160,854 | GBP 2.272 | 2,092,895.93 | 0.03 |
| Marks & Spencer Group PLC Registered Shares LS -01 | GB0031274896 | | Units | 1,175,326 | 137,045 | 237,557 | GBP 1.643 | 2,199,174.99 | 0.03 |
| Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA Azioni nom. EO 0,50 | IT0000062957 | | Units | 335,644 | 53,463 | 102,252 | EUR 9.730 | 3,265,816.12 | 0.05 |
| Melrose Industries PLC Registered Share LS-.22857142 | GB00BNGDN821 | | Units | 828,693 | 828,693 | - | GBP 4.090 | 3,858,768.42 | 0.06 |
| Mercedes-Benz Group AG Namens-Aktien o.N. | DE0007100000 | | Units | 491,625 | 67,731 | 127,895 | EUR 70.580 | 34,698,892.50 | 0.55 |
| Merck KGaA Inhaber-Aktien o.N. | DE0006599905 | | Units | 81,552 | 15,310 | 17,413 | EUR 162.550 | 13,256,277.60 | 0.21 |
| Merlin Properties SOCOMI S.A. Acciones Nominativas EO 1 | ES0105025003 | | Units | 204,053 | 41,575 | 40,511 | EUR 8.010 | 1,634,464.53 | 0.03 |
| Metso Outotec Oyj Registered Shares o.N. | FI0009014575 | | Units | 419,400 | 46,450 | 81,909 | EUR 10.000 | 4,194,000.00 | 0.07 |
| Millicom Intl Cellular S.A. Aktier (SDRs)/1 DL 1,50 | SE0001174970 | | Units | 103,277 | 57,515 | 20,192 | SEK 183.850 | 1,674,921.60 | 0.03 |
| Mitro S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT004965148 | | Units | 128,462 | 16,745 | 30,076 | EUR 67.160 | 8,627,507.92 | 0.14 |
| Mondi PLC Registered Shares EO -20 | GB00B1CRLC47 | | Units | 278,436 | 39,999 | 53,310 | GBP 12.650 | 4,010,030.25 | 0.06 |
| Mowi ASA Navne-Aksjer NK 7,50 | NO0003054108 | | Units | 276,354 | 37,258 | 52,434 | NOK 203.700 | 4,755,368.37 | 0.08 |
| MTU Aero Engines AG Namens-Aktien o.N. | DE000A0D9PT0 | | Units | 33,840 | 5,467 | 6,048 | EUR 237.000 | 8,043,768.00 | 0.13 |
| Münchener Rückvers.-Ges. AG vink.Namens-Aktien o.N. | DE0008430026 | | Units | 86,803 | 13,950 | 17,792 | EUR 340.500 | 29,556,421.50 | 0.47 |
| National Grid PLC Reg. Shares LS -.12431289 | GB00BDR05C01 | | Units | 2,292,584 | 366,122 | 451,239 | GBP 11.445 | 29,872,583.99 | 0.47 |
| Naturgy Energy Group S.A. Acciones Port. EO 1 | ES0116870314 | | Units | 119,644 | 23,008 | 46,223 | EUR 28.300 | 3,385,925.20 | 0.05 |
| NatWest Group PLC Registered Shares LS 1,0769 | GB00B8M8PJY71 | | Units | 3,434,573 | 3,682,151 | 247,578 | GBP 2.620 | 10,244,854.14 | 0.16 |
| NEL ASA Navne-Aksjer NK -.20 | NO0010081235 | | Units | 956,220 | 979,718 | 23,498 | NOK 14.605 | 1,183,226.45 | 0.02 |
| Nemetschek SE Inhaber-Aktien o.N. | DE0006452907 | | Units | 39,344 | 9,269 | 10,178 | EUR 70.580 | 2,776,899.52 | 0.04 |
| Neste Oyj Registered Shs o.N. | FI0009013296 | | Units | 266,607 | 47,543 | 58,021 | EUR 43.940 | 11,714,711.58 | 0.19 |
| Nestlé S.A. Namens-Aktien SF -.10 | CH0038863350 | | Units | 1,716,400 | 263,295 | 375,332 | CHF 114.520 | 200,039,757.17 | 3.17 |
| Nexans S.A. Actions Port. EO 1 | FR0000044448 | | Units | 16,779 | 19,617 | 2,838 | EUR 77.850 | 1,306,245.15 | 0.02 |
| Nexi S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0005366767 | | Units | 402,733 | 86,991 | 142,777 | EUR 7.506 | 3,022,913.90 | 0.05 |
| NEXT PLC Registered Shares LS 0,10 | GB0032089863 | | Units | 76,045 | 8,534 | 18,862 | GBP 67.400 | 5,835,288.03 | 0.09 |
| NIBE Industrier AB Namn-Aktier B o.N. | SE0015988019 | | Units | 956,125 | 167,811 | 175,935 | SEK 114.500 | 9,667,631.72 | 0.15 |
| NN Group N.V. Aandelen aan toonder EO -.12 | NL00107773842 | | Units | 164,131 | 27,820 | 69,501 | EUR 33.770 | 5,542,703.87 | 0.09 |
| Nokia Oyj Registered Shares EO 0,06 | FI0009000681 | | Units | 3,332,709 | 467,505 | 614,353 | EUR 3.842 | 12,804,267.98 | 0.20 |
| Nordea Bank Abp Registered Shares o.N. | FI4000297767 | | Units | 2,278,112 | 395,048 | 474,407 | EUR 10.050 | 22,895,025.60 | 0.36 |
| Nordic Semiconductor ASA Navne-Aksjer NK 0,01 | NO0003055501 | | Units | 104,111 | 12,457 | 21,141 | NOK 115.150 | 1,015,708.41 | 0.02 |
| Nordnet AB Namn-Aktier AK o.N. | SE0015192067 | | Units | 102,933 | 122,067 | 19,134 | SEK 160.800 | 1,461,640.65 | 0.02 |
| Norsk Hydro ASA Navne-Aksjer NK 1,098 | NO0005052605 | | Units | 864,628 | 134,137 | 158,215 | NOK 78.220 | 5,730,012.82 | 0.09 |
| Novartis AG Namens-Aktien SF 0,50 | CH0012005267 | | Units | 1,312,288 | 198,011 | 466,961 | CHF 91.130 | 121,704,602.22 | 1.93 |
| Novo-Nordisk AS Navne-Aktier B DK -.20 | DK0060534915 | | Units | 1,023,879 | 156,390 | 212,122 | DKK 1,124.600 | 154,486,376.32 | 2.45 |
| Novozymes A/S Navne-Aktier B DK 2 | DK0060336014 | | Units | 127,865 | 15,761 | 24,112 | DKK 351.400 | 6,028,328.52 | 0.10 |
| Ocado Group PLC Registered Shares LS -.02 | GB00B3MBS747 | | Units | 380,890 | 43,396 | 74,218 | GBP 5.052 | 2,190,759.23 | 0.03 |
| OCI N.V. Registered Shares EO 0,02 | NL0010558797 | | Units | 78,893 | 89,817 | 10,924 | EUR 23.890 | 1,884,753.77 | 0.03 |
| OMV AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000743059 | | Units | 85,455 | 9,373 | 16,368 | EUR 42.840 | 3,660,892.20 | 0.06 |
| Orange S.A. Actions Port. EO 4 | FR0000133308 | | Units | 1,270,469 | 186,428 | 233,702 | EUR 11.816 | 15,011,861.70 | 0.24 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 単位: 市場 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レボート期間内 | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^① |
|--------------------------------------------------------------|---------------|----------------------|-----------------|----------------------|------------------|---------------|---------------|-----------------------------|
| Orion Corp. Registered Shares Cl.B o.N. | FI0009014377 | Units | 71,053 | 15,853 | 12,660 | EUR 42.620 | 3,028,278.86 | 0.05 |
| Orkla ASA Navne-Aksjer NK 1,25 | NO0003738800 | Units | 453,176 | 51,095 | 88,135 | NOK 76.800 | 2,941,061.85 | 0.05 |
| Orsted A/S Indehaver Aktier DK 10 | DK0060094928 | Units | 117,872 | 21,804 | 25,484 | DKK 606.600 | 9,593,046.07 | 0.15 |
| Oreal S.A., L' Actions Port. EO 0.2 | FR0000120321 | Units | 150,861 | 23,577 | 30,012 | EUR 432.750 | 65,285,097.75 | 1.04 |
| OSB GROUP PLC Registered Shares LS 0,01 | GB00BLDRH360 | Units | 267,318 | 32,036 | 54,722 | GBP 4.968 | 1,511,964.26 | 0.02 |
| Pandora A/S Navne-Aktier DK 1 | DK0060252690 | Units | 57,622 | 11,023 | 18,176 | DKK 624.200 | 4,825,647.16 | 0.08 |
| Partners Group Holding AG Namens-Aktien SF -.01 | CH0024608827 | Units | 14,040 | 2,346 | 2,943 | CHF 863.200 | 12,333,746.36 | 0.20 |
| Pearson PLC Registered Shares LS -.25 | GB0006776081 | Units | 460,738 | 100,814 | 127,122 | GBP 8.870 | 4,652,746.48 | 0.07 |
| Pennon Group PLC Registered Shares New LS-.8105 | GB00BNNTLN49 | Units | 168,196 | 19,830 | 33,727 | GBP 8.600 | 1,646,818.93 | 0.03 |
| Pernod Ricard S.A. Actions Port. (C.R.) o.N. | FR0000120693 | Units | 124,394 | 19,702 | 28,112 | EUR 209.400 | 26,048,103.60 | 0.41 |
| Persimmon PLC Registered Shares LS -.10 | GB0006825383 | Units | 191,717 | 21,687 | 36,871 | GBP 13.140 | 2,868,056.66 | 0.05 |
| Phoenix Group Holdings PLC Registered Shares LS -.10 | GB00GQXNP29 | Units | 557,940 | 103,293 | 100,515 | GBP 5.918 | 3,759,189.30 | 0.06 |
| Polski Koncern Naftowy Orlen Inhaber-Aktien ZY 1,25 | PLPKN0000018 | Units | 358,227 | 438,641 | 282,617 | PLN 63.420 | 4,959,291.81 | 0.08 |
| Porsche Automobil Holding SE Inhaber-Vorzugsaktien o.St.o.N | DE000PAH0038 | Units | 93,466 | 11,741 | 17,640 | EUR 50.480 | 4,718,163.68 | 0.07 |
| Poste Italiane S.p.A. Azioni nom. EO -.51 | IT0003796171 | Units | 311,736 | 63,654 | 56,006 | EUR 9.426 | 2,938,423.54 | 0.05 |
| Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski Inhaber-Aktien ZY 1 | PLPKO00000116 | Units | 517,260 | 93,594 | 101,139 | PLN 32.070 | 3,621,120.40 | 0.06 |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen Namens-Aktien ZY 0,10 | PLPZU0000011 | Units | 340,696 | 38,784 | 67,996 | PLN 38.300 | 2,848,399.61 | 0.05 |
| Prosus N.V. Registered Shares EO -.05 | NL0013654783 | Units | 446,508 | 90,027 | 207,233 | EUR 67.870 | 30,304,497.96 | 0.48 |
| Prudential PLC Registered Shares LS -.05 | GB0007099541 | Units | 1,716,193 | 262,167 | 322,756 | GBP 12.115 | 23,671,254.87 | 0.38 |
| Prysmian S.p.A. Azioni nom. EO 0,10 | IT0004176001 | Units | 168,931 | 25,952 | 30,846 | EUR 37.070 | 6,262,272.17 | 0.10 |
| PSP Swiss Property AG Nam.-Aktien SF 0,10 | CH0018294154 | Units | 30,562 | 5,885 | 5,088 | CHF 105.100 | 3,268,894.92 | 0.05 |
| Publicis Groupe S.A. Actions Port. EO 0,40 | FR0000130577 | Units | 147,108 | 25,602 | 27,102 | EUR 74.120 | 10,903,644.96 | 0.17 |
| PUMA SE Inhaber-Aktien o.N. | DE0006969603 | Units | 60,828 | 6,624 | 11,592 | EUR 52.960 | 3,221,450.88 | 0.05 |
| Qiagen N.V. Aandelen op naam EO -.01 | NL0012169213 | Units | 147,383 | 31,610 | 33,352 | EUR 40.510 | 5,970,485.33 | 0.09 |
| Qinetiq Group PLC Registered Shares LS -.01 | GB0080WMMWD03 | Units | 353,710 | 372,156 | 18,446 | GBP 3.714 | 1,495,619.00 | 0.02 |
| Randstad N.V. Aandelen aan toonder EO 0,10 | NL0000379121 | Units | 76,352 | 10,547 | 14,616 | EUR 49.220 | 3,758,045.44 | 0.06 |
| RATIONAL AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0007010803 | Units | 3,150 | 288 | 504 | EUR 665.000 | 2,063,250.00 | 0.03 |
| Reckitt Benckiser Group Registered Shares LS -.10 | GB00824CGK77 | Units | 460,755 | 79,109 | 95,070 | GBP 64.300 | 33,729,722.37 | 0.53 |
| Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA Azioni nom. EO -.125 | IT0003828271 | Units | 60,668 | 6,828 | 11,694 | EUR 41.730 | 2,531,675.64 | 0.04 |
| Red Electrica Corporacion S.A. Acciones Port. EO -.50 | ES0173093024 | Units | 223,269 | - | 48,226 | EUR 16.505 | 3,685,054.85 | 0.06 |
| Relx PLC Registered Shares LS -.144397 | GB0082B0DG97 | Units | 1,203,150 | 191,667 | 272,308 | GBP 26.460 | 36,244,436.49 | 0.57 |
| Renault S.A. Actions Port. EO 3,81 | FR0000131906 | Units | 131,181 | 21,298 | 24,220 | EUR 33.630 | 4,411,617.03 | 0.07 |
| Rentokil Initial PLC Registered Shares LS 0,01 | GB008082RF11 | Units | 1,567,357 | 586,327 | 221,322 | GBP 6.324 | 11,284,739.18 | 0.18 |
| Reply S.p.A. Azioni nom. EO 0,13 | IT0005282865 | Units | 13,505 | 1,440 | 2,520 | EUR 105.500 | 1,424,777.50 | 0.02 |
| Repsol S.A. Acciones Port. EO 1 | ES0173516115 | Units | 825,325 | 155,418 | 318,237 | EUR 13.345 | 11,013,962.13 | 0.17 |
| Rexel S.A. Actions au Porteur EO 5 | FR0010451203 | Units | 157,769 | 29,807 | 28,798 | EUR 21.000 | 3,313,149.00 | 0.05 |
| Rheinmetall AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0007030009 | Units | 27,520 | 4,092 | 5,040 | EUR 285.500 | 7,306,560.00 | 0.12 |
| Rightmove PLC Registered Shares LS -.001 | GB008GDT3G23 | Units | 522,745 | 109,326 | 160,473 | GBP 5.742 | 3,417,313.42 | 0.05 |
| Ringkjøbing Landbobank AS Navne-Aktier DK 1 | DK0060854669 | Units | 17,371 | 1,834 | 3,268 | DKK 949.500 | 2,212,907.50 | 0.04 |
| Rio Tinto PLC Registered Shares LS -.10 | GB0007188757 | Units | 669,973 | 109,323 | 135,546 | GBP 50.490 | 38,511,852.39 | 0.61 |
| Rockwool A/S Navne-Aktier B DK 10 | DK0010219153 | Units | 5,402 | 576 | 1,008 | DKK 1,632.500 | 1,183,181.15 | 0.02 |
| Rolls Royce Holdings PLC Registered Shares LS 0,20 | GB00863H8491 | Units | 5,255,452 | 845,214 | 974,783 | GBP 1.522 | 9,103,612.58 | 0.14 |
| Rotork PLC Registered Shares LS -.005 | GB008VFNZH21 | Units | 522,539 | 61,147 | 107,689 | GBP 3.270 | 1,945,352.02 | 0.03 |
| Royal Unibrew AS Navne-Aktier DK 2 | DK000634707 | Units | 25,239 | 2,880 | 4,670 | DKK 603.800 | 2,044,601.73 | 0.03 |
| RS Group PLC Registered Shares LS -.10 | GB0003096442 | Units | 292,134 | 32,932 | 57,054 | GBP 9.214 | 3,064,517.11 | 0.05 |
| Rubis S.C.A. Actions Port. Nouv. EO 1,25 | FR0013269123 | Units | 58,371 | 6,912 | 12,004 | EUR 26.780 | 1,563,175.38 | 0.02 |
| RWE AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0007037129 | Units | 419,390 | 68,691 | 86,672 | EUR 42.550 | 17,845,044.50 | 0.28 |
| Ryanair Holdings PLC Registered Shares EO -.006 IE00BYTBXV33 | IE00BYTBXV33 | Units | 352,017 | 85,901 | 87,461 | EUR 14.835 | 5,222,172.20 | 0.08 |
| Rémy Cointreau S.A. Actions au Porteur EO 1,60 | FR0000130395 | Units | 13,545 | 2,103 | 2,520 | EUR 156.850 | 2,124,533.25 | 0.03 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^② | |
|----------------------------------------------------------|---------------|----|-------------------|-----------------|----------------------|------------------|-----|---------------|-----------------------------|------|
| Saab AB Namn-Aktier B SK 25 | SE0000112385 | | Units | 49,960 | 58,780 | 8,820 | SEK | 575.600 | 2,539,470.39 | 0.04 |
| Safestore Holdings PLC Registered Shares LS -.01 | GB0081N7Z094 | | Units | 152,204 | 41,945 | 26,133 | GBP | 9.905 | 1,716,375.41 | 0.03 |
| Safran Actions Port. EO -.20 | FR0000073272 | | Units | 237,258 | 35,913 | 44,375 | EUR | 140.940 | 33,439,142.52 | 0.53 |
| Sage Group PLC, The Registered Shares LS-.01051948 | GB0088C3BL03 | | Units | 649,937 | 104,134 | 118,702 | GBP | 8.186 | 6,057,239.40 | 0.10 |
| Sainsbury PLC, J. Registered Shs LS -.28571428 | GB008019KW72 | | Units | 1,075,804 | 162,266 | 211,275 | GBP | 2.764 | 3,385,344.97 | 0.05 |
| Salmir ASA Navne-Aksjer NK -.25 | NO0010310956 | | Units | 49,853 | 21,688 | 6,898 | NOK | 472.500 | 1,995,729.13 | 0.03 |
| Samhallsbyggnadsbolaget I Nord AB Namn-Aktier B o.N. | SE0009554454 | | Units | 855,631 | 261,449 | 148,395 | SEK | 12.024 | 908,521.93 | 0.01 |
| Sampo OYJ Registered Shares Cl.A o.N. | FI0009003305 | | Units | 300,350 | 40,664 | 81,169 | EUR | 45.960 | 13,804,086.00 | 0.22 |
| Sandvik AB Namn-Aktier o.N. | SE0000667891 | | Units | 671,714 | 86,738 | 124,043 | SEK | 208.500 | 12,367,741.43 | 0.20 |
| Sandif S.A. Actions Port. EO 2 | FR0000120578 | | Units | 712,000 | 107,471 | 140,888 | EUR | 100.000 | 17,200,000.00 | 1.13 |
| SAP SE Inhaber-Aktien o.N. | DE0007164600 | | Units | 639,433 | 93,563 | 166,128 | EUR | 122.860 | 78,560,738.38 | 1.25 |
| Sartorius AG Vorzugsaktien o.St. o.N. | DE0007165631 | | Units | 15,573 | 2,613 | 2,847 | EUR | 351.600 | 5,475,466.80 | 0.09 |
| Sartorius Stedim Biotech S.A. Actions Port. EO -.20 | FR0013154002 | | Units | 14,516 | 1,440 | 2,520 | EUR | 242.500 | 3,520,130.00 | 0.06 |
| Schindler Holding AG Inhaber-Part.sch. SF -.10 | CH0024638196 | | Units | 24,554 | 2,592 | 4,536 | CHF | 198.700 | 4,965,198.23 | 0.08 |
| Schneider Electric SE Actions Port. EO 4 | FR0000121972 | | Units | 356,445 | 59,697 | 71,387 | EUR | 157.820 | 56,254,149.90 | 0.89 |
| Schroders PLC Registered Shares LS -.20 | GB00BP9LHF23 | | Units | 629,370 | 643,586 | 14,216 | GBP | 4.857 | 3,480,213.42 | 0.06 |
| SCOR SE Act.au Porteur EO 7,8769723 | FR0010411983 | | Units | 92,870 | 10,734 | 28,936 | EUR | 23.420 | 2,175,015.40 | 0.03 |
| Scout24 SE Namens-Aktien o.N. | DE000A12DM80 | | Units | 48,628 | 19,061 | 24,422 | EUR | 56.500 | 2,747,482.00 | 0.04 |
| SEB S.A. Actions Port. EO 1 | FR0000121709 | | Units | 19,621 | 2,235 | 3,538 | EUR | 103.800 | 2,036,659.80 | 0.03 |
| Sectra AB Namn-Aktier Ser.B o.N. | SE0018245953 | | Units | 85,482 | 87,560 | 2,078 | SEK | 161.700 | 1,220,631.67 | 0.02 |
| Securitas AB Namn-Aktier B SK 1 | SE0000163594 | | Units | 302,147 | 134,358 | 41,558 | SEK | 91.800 | 2,449,406.72 | 0.04 |
| Segro PLC Registered Shares LS -.10 | GB0085Z1N188 | | Units | 764,780 | 158,702 | 132,866 | GBP | 8.348 | 7,268,598.82 | 0.12 |
| Serco Group PLC Registered Shares LS -.02 | GB0000797394 | | Units | 744,713 | 762,812 | 18,099 | GBP | 1.521 | 1,289,584.74 | 0.02 |
| SES S.A. Bearer FDRs (rep.Shs A) o.N. | LU0088087324 | | Units | 232,248 | 27,810 | 46,702 | EUR | 5.615 | 1,304,072.52 | 0.02 |
| Severn Trent PLC Registered Shares LS -.9789 | GB0081F1H8J72 | | Units | 162,925 | 35,064 | 29,324 | GBP | 29.320 | 5,438,553.84 | 0.09 |
| SGS S.A. Namen-Aktien SF 0,04 | CH1256740924 | | Units | 93,060 | 93,060 | - | CHF | 80.560 | 7,629,550.98 | 0.12 |
| Shell PLC Reg. Shares Class EO -.07 | GB00BP6MXD84 | | Units | 4,327,581 | 649,481 | 1,264,195 | EUR | 28.690 | 121,561,750.29 | 1.93 |
| Siegfried Holding AG Nam.Akt. SF 18 | CH0014284498 | | Units | 2,600 | 288 | 504 | CHF | 686.500 | 1,816,478.92 | 0.03 |
| Siemens AG Namens-Aktien o.N. | DE0007236110 | | Units | 467,598 | 74,767 | 93,175 | EUR | 148.900 | 69,625,342.20 | 1.10 |
| Siemens Energy AG Namens-Aktien o.N. | DE000ENER6Y0 | | Units | 287,402 | 37,844 | 55,192 | EUR | 22.180 | 6,374,576.36 | 0.10 |
| Siemens Healthineers AG Namens-Aktien o.N. | DE000SHL1006 | | Units | 174,658 | 26,382 | 31,752 | EUR | 56.420 | 9,854,204.36 | 0.16 |
| SIG Group AG Namens-Aktien SF-.01 | CH0435377954 | | Units | 221,973 | 74,621 | 59,987 | CHF | 23.840 | 5,385,460.89 | 0.09 |
| Signify N.V. Registered Shares EO -.01 | NL0011821392 | | Units | 76,758 | 8,746 | 15,030 | EUR | 30.210 | 2,318,859.18 | 0.04 |
| Sika AG Namens-Aktien SF 0,01 | CH0418792922 | | Units | 91,522 | 13,953 | 21,416 | CHF | 245.400 | 22,856,858.19 | 0.36 |
| SimCorp A/S Navne-Aktier DK 1 | DK0060495240 | | Units | 24,577 | 2,880 | 4,648 | DKK | 731.500 | 2,412,052.03 | 0.04 |
| Sinch AB Namn-Aktier o.N. | SE0016101844 | | Units | 425,631 | 434,460 | 442,307 | SEK | 27.050 | 1,016,717.87 | 0.02 |
| Skandinaviska Enskilda Banken Namn-Aktier A (fria) SK 10 | SE0000148884 | | Units | 1,072,097 | 158,986 | 197,307 | SEK | 116.500 | 11,029,604.60 | 0.17 |
| Skanska AB Namn-Aktier B (fria) SK 3 | SE0000113250 | | Units | 257,609 | 44,859 | 46,668 | SEK | 167.400 | 3,808,170.84 | 0.06 |
| SKF AB Namn-Aktier B SK 0,625 | SE0000108227 | | Units | 208,834 | 24,390 | 60,089 | SEK | 185.300 | 3,417,248.52 | 0.05 |
| Smith & Nephew PLC Registered Shares DL -.20 | GB0009223206 | | Units | 537,827 | 66,844 | 102,046 | GBP | 13.145 | 8,048,870.29 | 0.13 |
| Smiths Group PLC Registered Shares LS -.375 | GB0081WY2338 | | Units | 225,986 | 24,878 | 55,592 | GBP | 16.810 | 4,324,948.95 | 0.07 |
| Smurfit Kappa Group PLC Registered Shares EO -.001 | IE00B1RR8406 | | Units | 166,239 | 29,173 | 30,188 | EUR | 33.540 | 5,575,656.06 | 0.09 |
| Snam S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0003153415 | | Units | 1,313,683 | 221,001 | 239,346 | EUR | 5.040 | 6,620,962.32 | 0.11 |
| Société Générale S.A. Actions Port. EO 1,25 | FR0000130809 | | Units | 496,556 | 81,492 | 142,694 | EUR | 22.025 | 10,936,645.90 | 0.17 |
| Sodexo S.A. Actions Port. EO 4 | FR0000121220 | | Units | 51,153 | 5,472 | 9,596 | EUR | 97.200 | 4,972,071.60 | 0.08 |
| Sofina S.A. Actions Nom. o.N. | BE0003717312 | | Units | 9,346 | 864 | 1,548 | EUR | 207.800 | 1,942,098.80 | 0.03 |
| Softcat PLC Registered Shares LS -.0005 | GB008Y2DVK82 | | Units | 81,619 | 17,108 | 16,918 | GBP | 13.370 | 1,242,379.89 | 0.02 |
| Soitec S.A. Actions au Porteur EO 2 | FR0013227113 | | Units | 16,719 | 4,772 | 3,004 | EUR | 133.700 | 2,235,330.30 | 0.04 |
| Solvay S.A. Actions au Porteur A o.N. | BE0003470755 | | Units | 44,494 | 6,678 | 8,468 | EUR | 108.850 | 4,843,171.90 | 0.08 |
| Sonova Holding AG Namens-Aktien SF 0,05 | CH0012549785 | | Units | 31,838 | 4,437 | 7,597 | CHF | 281.800 | 9,130,682.48 | 0.14 |
| Sopra Steria Group S.A. Actions Port. EO 1 | FR0000050809 | | Units | 9,347 | 864 | 1,769 | EUR | 196.000 | 1,832,012.00 | 0.03 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート期間内 | 販売/ 処分 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^① | |
|----------------------------------------------------------|--------------|----|-------------------|-----------------|----------------------|-----------|-----|---------------|-----------------------------|------|
| Spectris PLC Registered Shares LS -.05 | GB0003308607 | | Units | 68,213 | 7,643 | 19,105 | GBP | 37,590 | 2,919,249.49 | 0.05 |
| Spie S.A. Actions Nom. EO 0.47 | FR0012757854 | | Units | 98,388 | 27,045 | 17,466 | EUR | 28,280 | 2,782,412.64 | 0.04 |
| Spirax-Sarco Engineering PLC Reg. Shares LS -.26923076 | GB00BWFQGN14 | | Units | 46,496 | 6,965 | 8,112 | GBP | 110,900 | 5,870,551.14 | 0.09 |
| SSAB AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | SE0000120669 | | Units | 424,385 | 92,296 | 77,839 | SEK | 69,120 | 2,590,381.28 | 0.04 |
| SSE PLC Shs LS-.50 | GB0007908733 | | Units | 678,997 | 114,988 | 122,304 | GBP | 18,375 | 14,204,532.35 | 0.23 |
| St. James's Place PLC Registered Shares LS -.15 | GB0007669376 | | Units | 351,090 | 66,622 | 63,178 | GBP | 12,065 | 4,822,558.70 | 0.08 |
| Standard Chartered PLC Registered Shares DL -.50 | GB0004082847 | | Units | 1,523,995 | 200,146 | 370,613 | GBP | 6,284 | 10,903,136.65 | 0.17 |
| Stellantis N.V. Aandelen op naam EO -.01 | NL00150001Q9 | | Units | 1,467,000 | 292,777 | 289,618 | EUR | 15,000 | 22,005,000.00 | 0.35 |
| STMicroelectronics N.V. Aandelen aan toonder EO 1.04 | NL0000226223 | | Units | 413,039 | 61,232 | 75,222 | EUR | 38,555 | 15,924,718.65 | 0.25 |
| Stora Enso Oyj Reg. Shares Cl.R EO 1,70 | FI0009005961 | | Units | 373,362 | 47,299 | 70,996 | EUR | 11,500 | 4,293,663.00 | 0.07 |
| Storebrand ASA Navne-Aksjer NK 5 | NO0003053605 | | Units | 282,675 | 32,626 | 56,667 | NOK | 82,404 | 1,964,814.43 | 0.03 |
| Straumann Holding AG Namens-Aktien SF 0,01 | CH1175448666 | | Units | 73,178 | 11,950 | 13,152 | CHF | 133,650 | 9,953,274.29 | 0.16 |
| Subsea 7 S.A. Registered Shares DL 2 | LU0075646355 | | Units | 141,560 | 144,344 | 2,784 | NOK | 121,650 | 1,459,019.69 | 0.02 |
| Svenska Cellulosa AB Namn-Aktier B (fria) SK 10 | SE0000112724 | | Units | 334,667 | 37,076 | 64,045 | SEK | 140,450 | 4,150,826.41 | 0.07 |
| Svenska Handelsbanken AB Namn-Aktier A (fria) SK 1,433 | SE0007100599 | | Units | 986,374 | 166,521 | 175,530 | SEK | 90,620 | 7,893,427.27 | 0.13 |
| Swatch Group AG, The Inhaber-Aktien SF 2,25 | CH0012255151 | | Units | 18,390 | 2,773 | 3,072 | CHF | 304,600 | 5,700,698.88 | 0.09 |
| Sweco AB Namn-Aktier B SK 1,- | SE0014960373 | | Units | 123,147 | 14,942 | 25,589 | SEK | 137,200 | 1,492,031.13 | 0.02 |
| Swedbank AB Namn-Aktier A o.N. | SE0000242455 | | Units | 579,066 | 86,785 | 106,832 | SEK | 178,000 | 9,102,234.20 | 0.14 |
| Swedish Orphan Biovitrum AB Namn-Aktier SK 1 | SE0000872095 | | Units | 121,405 | 21,927 | 23,655 | SEK | 249,400 | 2,673,824.88 | 0.04 |
| Swiss Life Holding AG Namens-Aktien SF 0,10 | CH0014852781 | | Units | 19,226 | 2,843 | 4,287 | CHF | 586,800 | 11,481,417.69 | 0.18 |
| Swiss Prime Site AG Nam.-Aktien SF 2 | CH0008038389 | | Units | 49,795 | 8,848 | 8,664 | CHF | 80,850 | 4,097,153.49 | 0.06 |
| Swiss Re AG Namens-Aktien SF -.10 | CH0126881561 | | Units | 181,017 | 33,281 | 39,208 | CHF | 89,720 | 16,528,182.57 | 0.26 |
| Swisscom AG Namens-Aktien SF 1 | CH0008742519 | | Units | 15,908 | 2,490 | 3,024 | CHF | 613,000 | 9,924,131.96 | 0.16 |
| Sydbank AS Navne-Aktier DK 10 | DK0010311471 | | Units | 36,416 | 37,103 | 687 | DKK | 301,200 | 1,471,603.05 | 0.02 |
| Symrise AG Inhaber-Aktien o.N. | DE00059M9999 | | Units | 83,833 | 13,160 | 15,168 | EUR | 109,450 | 9,175,521.85 | 0.15 |
| Talanx AG Namens-Aktien o.N. | DE000TLX1005 | | Units | 32,289 | 32,913 | 624 | EUR | 45,560 | 1,471,086.84 | 0.02 |
| Tate & Lyle PLC Reg. Shares LS -.2916666667 | GB00BP92CJ43 | | Units | 241,267 | 289,346 | 48,079 | GBP | 8,150 | 2,238,655.52 | 0.04 |
| Taylor Wimpey PLC Registered Shares LS -.01 | GB0008782301 | | Units | 2,177,394 | 246,803 | 426,327 | GBP | 1,282 | 3,178,021.16 | 0.05 |
| Tecan Group AG Namens-Aktien SF 0,10 | CH0012100191 | | Units | 7,639 | 1,502 | 1,512 | CHF | 387,800 | 3,014,815.84 | 0.05 |
| Technip Energies N.V. Aandelen op naam EO -.01 | NL0014559478 | | Units | 87,833 | 89,513 | 1,680 | EUR | 20,130 | 1,768,078.29 | 0.03 |
| Tele2 AB Namn-Aktier B SK -.625 | SE0005190238 | | Units | 334,369 | 73,581 | 64,031 | SEK | 108,950 | 3,217,015.69 | 0.05 |
| Telecom Italia S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0003497168 | | Units | 6,851,934 | 1,429,020 | 1,123,524 | EUR | 0,267 | 1,828,781.18 | 0.03 |
| Telefonaktiebolaget L.M.Erics. Namn-Aktier B (fria) o.N. | SE0000108656 | | Units | 1,926,150 | 289,275 | 352,110 | SEK | 56,370 | 9,588,221.92 | 0.15 |
| Telefónica Deutschland Hldg AG Namens-Aktien o.N. | DE000A1J5RX9 | | Units | 539,139 | 637,840 | 98,701 | EUR | 3,065 | 1,652,461.04 | 0.03 |
| Telefónica S.A. Acciones Port. EO 1 | ES0178430E18 | | Units | 3,615,792 | 687,345 | 833,932 | EUR | 4,125 | 14,915,142.00 | 0.24 |
| Telenor ASA Navne-Aksjer NK 6 | NO0010683308 | | Units | 390,193 | 43,398 | 74,774 | NOK | 132,950 | 4,395,176.32 | 0.07 |
| Telia Company AB Namn-Aktier SK 3,20 | SE0000667925 | | Units | 1,488,436 | 166,394 | 284,782 | SEK | 28,560 | 3,753,948.46 | 0.06 |
| Temenos AG Nam.-Aktien SF 5 | CH0012453915 | | Units | 41,219 | 5,761 | 7,618 | CHF | 74,680 | 3,132,695.87 | 0.05 |
| Tenaris S.A. Actions Nom. DL 1 | LU0156801721 | | Units | 304,573 | 54,486 | 54,589 | EUR | 13,050 | 3,974,677.65 | 0.06 |
| Terna Rete Elettrica Nazio.SpA Azioni nom. EO -.22 | IT0003242622 | | Units | 896,594 | 146,050 | 163,208 | EUR | 7,860 | 7,047,228.84 | 0.11 |
| Tesco PLC Registered Shs LS-.0633333 | GB00BLGZ9862 | | Units | 4,564,161 | 490,872 | 924,161 | GBP | 2,811 | 14,606,748.04 | 0.23 |
| THALES S.A. Actions Port. (C.R.) EO 3 | FR0000121329 | | Units | 66,766 | 10,216 | 12,144 | EUR | 138,400 | 9,240,414.40 | 0.15 |
| Thule Group AB (publ) Namn-Aktier o.N. | SE0006422390 | | Units | 61,685 | 7,366 | 12,516 | SEK | 295,700 | 1,610,759.98 | 0.03 |
| thyssenkrupp AG Inhaber-Aktien o.N. | DE0007500001 | | Units | 315,098 | 112,189 | 55,418 | EUR | 6,504 | 2,049,397.39 | 0.03 |
| TietoEVRY Oyj Registered Shares o.N. | FI0009000277 | | Units | 58,498 | 59,857 | 1,359 | EUR | 28,960 | 1,694,102.08 | 0.03 |
| Tomra Systems ASA Navne-Aksjer NK -.50 | NO0012470089 | | Units | 145,072 | 170,318 | 25,246 | NOK | 163,000 | 2,003,455.45 | 0.03 |
| Topdanmark AS Navne-Aktier DK 1 | DK0060477503 | | Units | 28,317 | 28,955 | 638 | DKK | 356,400 | 1,354,030.38 | 0.02 |
| TotalEnergies SE Actions au Porteur EO 2,50 | FR0000120271 | | Units | 1,554,286 | 247,791 | 391,873 | EUR | 57,940 | 90,055,330.84 | 1.43 |
| Travis Perkins PLC Registered Shares LS -.1 | GB00B9KRKT01 | | Units | 136,082 | 16,316 | 27,687 | GBP | 9,580 | 1,484,218.80 | 0.02 |
| Trelleborg AB Namn-Aktier B (fria) SK 25 | SE0000114837 | | Units | 146,265 | 16,250 | 28,547 | SEK | 257,400 | 3,324,672.69 | 0.05 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 単位: | 2023/4/30 | 購入/ | 販売/ | | ユーロでの | 対ファンド | |
|-----------------------------------------------------------|---------------|------------|------------|-----------|-----------|-----|---------|---------------|------|
| | | 市場 | 現在 | 追加 | 処分 | 価格 | 市場価値 | 資産比率% | |
| | | 1,000単位の単位 | | レボート | 期間内 | | | | |
| Tritax Big Box REIT PLC Registered Shares LS -.01 | GB00BG49KP99 | Units | 1,129,193 | 240,265 | 223,359 | GBP | 1,551 | 1,993,938.28 | 0.03 |
| Tryg AS Navne-Aktier DK 5 | DK00060536678 | Units | 230,797 | 38,719 | 41,580 | DKK | 159,500 | 4,938,946.46 | 0.08 |
| Téléperformance SE Actions Port. EO 2,5 | FR0000051807 | Units | 36,868 | 6,877 | 8,013 | EUR | 180,800 | 6,665,734.40 | 0.11 |
| Ubisoft Entertainment S.A. Actions Port. EO 0,0775 | FR0000054470 | Units | 64,361 | 11,056 | 12,511 | EUR | 26,490 | 1,704,922.89 | 0.03 |
| UBS Group AG Namens-Aktien SF -.10 | CH0244767585 | Units | 1,903,910 | 253,969 | 571,530 | CHF | 18,065 | 35,002,644.27 | 0.56 |
| UCB S.A. Actions Nom. o.N. | BE0003739530 | Units | 79,659 | 11,749 | 14,112 | EUR | 84,420 | 6,724,812.78 | 0.11 |
| Umicore S.A. Actions Nom. o.N. | BE0974320526 | Units | 117,304 | 17,115 | 31,630 | EUR | 29,760 | 3,490,967.04 | 0.06 |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE Stapled Shares EO-.05 | FR0013326246 | Units | 66,651 | 12,284 | 21,452 | EUR | 48,540 | 3,235,239.54 | 0.05 |
| UniCredit S.p.A. Azioni nom. o.N. | IT0005239360 | Units | 1,203,027 | 178,696 | 421,380 | EUR | 17,940 | 21,582,304.38 | 0.34 |
| Unilever PLC Registered Shares LS -.031111 | GB00B10RZP78 | Units | 1,641,690 | 249,230 | 322,561 | GBP | 44,365 | 82,920,779.38 | 1.32 |
| Unite Group PLC Registered Shares LS -.25 | GB0006928617 | Units | 200,734 | 61,658 | 70,977 | GBP | 9,590 | 2,191,650.42 | 0.03 |
| United Internet AG Namens-Aktien o.N. | DE0005089031 | Units | 60,407 | 7,310 | 12,196 | EUR | 15,560 | 939,932.92 | 0.01 |
| United Utilities Group PLC Registered Shares LS -.05 | GB00B39J2M42 | Units | 436,780 | 71,781 | 79,133 | GBP | 10,820 | 5,380,488.92 | 0.09 |
| Universal Music Group N.V. Aandelen op naam ED1 | NL0015000IY2 | Units | 476,335 | 73,907 | 87,213 | EUR | 19,810 | 9,436,196.35 | 0.15 |
| UPM Kymmene Corp. Registered Shares o.N. | FI0009005987 | Units | 333,311 | 48,964 | 61,232 | EUR | 28,900 | 9,632,687.90 | 0.15 |
| Valmet Oyj Registered Shares o.N. | FI4000074984 | Units | 100,088 | 11,224 | 19,620 | EUR | 30,620 | 3,064,694.56 | 0.05 |
| Valéo S.E. Actions Port. EO 1 | FR0013176526 | Units | 140,314 | 37,513 | 33,360 | EUR | 17,665 | 2,478,646.81 | 0.04 |
| VAT Group AG Namens-Aktien SF -.10 | CH0311864901 | Units | 17,306 | 2,710 | 3,024 | CHF | 313,300 | 5,517,896.72 | 0.09 |
| Veolia Environnement S.A. Actions au Porteur EO 5 | FR0000124141 | Units | 419,090 | 77,576 | 94,953 | EUR | 28,690 | 12,023,692.10 | 0.19 |
| Verallia SA Actions Port. (Prom.) EO 3,38 | FR0013447729 | Units | 48,394 | 49,306 | 912 | EUR | 36,820 | 1,781,867.08 | 0.03 |
| Verbund AG Inhaber-Aktien A o.N. | AT0000746409 | Units | 40,168 | 12,704 | 15,643 | EUR | 80,900 | 3,249,591.20 | 0.05 |
| Vestas Wind Systems A/S Navne-Aktier DK -.20 | DK0061539921 | Units | 630,951 | 113,714 | 136,456 | DKK | 186,460 | 15,784,280.30 | 0.25 |
| Vidrala S.A. Acciones Port. EO 1,02 | ES0183746314 | Units | 15,548 | 15,836 | 288 | EUR | 95,200 | 1,480,169.60 | 0.02 |
| VINCI S.A. Actions Port. EO 2,50 | FR0000125486 | Units | 367,006 | 75,026 | 92,001 | EUR | 112,200 | 41,178,073.20 | 0.65 |
| Virgin Money UK PLC Registered Shares LS 0,10 | GB00BD6GN030 | Units | 738,266 | 89,006 | 156,429 | GBP | 1,559 | 1,310,360.27 | 0.02 |
| Viscofan S.A. Acciones Port. EO 0,70 | ES0184262212 | Units | 23,908 | 24,340 | 432 | EUR | 62,200 | 1,487,077.60 | 0.02 |
| Vistry Group PLC Registered Shares LS -.50 | GB0001859296 | Units | 200,880 | 85,940 | 28,923 | GBP | 7,825 | 1,789,586.86 | 0.03 |
| Vivendi SE Actions Port. EO 5,5 | FR0000127771 | Units | 429,460 | 47,728 | 82,911 | EUR | 9,954 | 4,274,844.84 | 0.07 |
| Vodafone Group PLC Registered Shares DL 0,2095238 | GB00BH4HKS39 | Units | 14,662,874 | 3,183,371 | 6,181,465 | GBP | 0,959 | 16,009,193.23 | 0.25 |
| voestalpine AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000937503 | Units | 74,770 | 16,598 | 13,602 | EUR | 31,380 | 2,346,282.60 | 0.04 |
| Volkswagen AG Vorzugsaktien o.St. o.N. | DE0007664039 | Units | 128,930 | 34,267 | 23,807 | EUR | 123,880 | 15,946,062.40 | 0.25 |
| Volvo (publ), AB Namn-Aktier B (fria) o.N. | SE0000115446 | Units | 992,079 | 174,336 | 210,561 | SEK | 210,800 | 18,467,869.66 | 0.29 |
| Volvo Car AB Namn-Aktier B o.N. | SE0016844831 | Units | 321,792 | 39,168 | 64,343 | SEK | 42,160 | 1,198,052.32 | 0.02 |
| Vonovia SE Namens-Aktien o.N. | DE000A1MLJ71 | Units | 443,199 | 93,548 | 101,054 | EUR | 19,625 | 8,697,780.38 | 0.14 |
| Wacker Chemie AG Inhaber-Aktien o.N. | DE000WCH8881 | Units | 12,525 | 14,373 | 1,848 | EUR | 139,950 | 1,752,873.75 | 0.03 |
| Wallenstam AB Namn-Akt. Ser.B o.N. | SE0017780133 | Units | 276,311 | 328,207 | 51,896 | SEK | 40,620 | 991,146.91 | 0.02 |
| Warehouses De Pauw N.V. Actions Nom. o.N. | BE0974349814 | Units | 97,320 | 28,944 | 16,742 | EUR | 27,120 | 2,639,318.40 | 0.04 |
| Watches Of Switzerland Grp PLC Registered Shares LS-.0125 | GB00BJDQ870 | Units | 142,581 | 17,254 | 29,588 | GBP | 8,315 | 1,349,757.19 | 0.02 |
| Weir Group PLC, The Registered Shares LS -.125 | GB0009465807 | Units | 169,651 | 32,280 | 30,783 | GBP | 18,400 | 3,553,906.39 | 0.06 |
| Wendel SE Actions Port. EO 4 | FR0000121204 | Units | 16,619 | 1,834 | 3,044 | EUR | 101,600 | 1,688,490.40 | 0.03 |
| Whitbread PLC Reg. Shares LS -.76797385 | GB00B1KJ4J08 | Units | 124,109 | 13,642 | 23,757 | GBP | 32,470 | 4,587,935.48 | 0.07 |
| Wienerberger AG Inhaber-Aktien o.N. | AT0000831706 | Units | 68,394 | 7,908 | 13,937 | EUR | 27,300 | 1,867,156.20 | 0.03 |
| Wihborgs Fastigheter AB Namn-Aktier o.N. | SE0018012635 | Units | 163,420 | 194,117 | 30,697 | SEK | 82,700 | 1,193,467.65 | 0.02 |
| Wise PLC Registered Shares LS -.01 | GB00BL9YR756 | Units | 400,416 | 181,268 | 64,068 | GBP | 5,500 | 2,507,297.39 | 0.04 |
| Wolters Kluwer N.V. Aandelen op naam EO -.12 | NL0000395903 | Units | 160,887 | 23,081 | 35,151 | EUR | 120,150 | 19,330,573.05 | 0.31 |
| Worldline S.A. Actions Port. EO -.68 | FR0011981968 | Units | 144,271 | 35,468 | 42,476 | EUR | 39,380 | 5,681,391.98 | 0.09 |
| WPP PLC Registered Shares LS -.10 | JE00B8KF9B49 | Units | 658,798 | 71,788 | 169,122 | GBP | 9,272 | 6,954,364.22 | 0.11 |
| Wärtsilä Corp. Reg. Shares o.N. | FI0009003727 | Units | 292,820 | 33,340 | 58,288 | EUR | 10,500 | 3,074,610.00 | 0.05 |
| Yara International ASA Navne-Aksjer NK 1,70 | NO0010208051 | Units | 98,126 | 17,208 | 28,989 | NOK | 428,800 | 3,564,900.06 | 0.06 |
| Zalando SE Inhaber-Aktien o.N. | DE000ZAL1111 | Units | 151,136 | 26,789 | 27,672 | EUR | 37,170 | 5,617,725.12 | 0.09 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 1,000単位の単位 | 2023/4/30 現在 | 購入/ 追加 レポート | 販売/ 処分 期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ^② |
|---------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----|-------------------|-----------------|-------------------|------------------|----------------|-----------------------|-----------------------------|
| Zurich Insurance Group AG Nam.-Aktien SF 0,10 | CH0011075394 | | Units | 93,909 | 14,372 | 17,872 | CHF 431.800 | 41,267,325.87 | 0.65 |
| Other investment securities | | | | | | | | 131,613,413.75 | 2.09 |
| Chocoladef. Lindt & Sprüngli Inhaber-Part.sch. SF 10 | CH0010570767 | | Units | 580 | 615 | 35 | CHF 11,020.000 | 6,504,681.88 | 0.10 |
| Roche Holding AG Inhaber-Genußscheine o.N. | CH0012032048 | | Units | 438,501 | 69,332 | 87,169 | CHF 280.350 | 125,108,731.87 | 1.98 |
| Derivatives | | | | | | | | 1,915,560.26 | 0.03 |
| (The amounts marked with a minus sign are sold positions.) | | | | | | | | | |
| Equity index derivatives | | | | | | | | 1,915,560.26 | 0.03 |
| Receivables/liabilities | | | | | | | | | |
| Stock index futures | | | | | | | | 1,915,560.26 | 0.03 |
| DJ Stoxx 600 Future (FXXP) Juni Z3 | | EDT | Number | 2,681 | | | EUR | 1,915,560.26 | 0.03 |
| Bank Accounts, Unsecured Money Market Instruments and Money Market Funds | | | | | | | | 29,707,174.64 | 0.47 |
| Bank accounts | | | | | | | | 29,707,174.64 | 0.47 |
| EUR balances | | | | | | | | 21,026,825.56 | 0.33 |
| Depository: State Street Bank International GmbH | | | EUR | 21,026,825.56 | | | % 100.000 | 21,026,825.56 | 0.33 |
| Balances in other EU/EEA currencies | | | | | | | | 1,264,004.56 | 0.02 |
| Depository: State Street Bank International GmbH | | | DKK | 572,122.82 | | | % 100.000 | 76,759.61 | 0.00 |
| | | | NOK | 7,108,711.60 | | | % 100.000 | 602,281.30 | 0.01 |
| | | | SEK | 6,625,150.56 | | | % 100.000 | 585,053.65 | 0.01 |
| Balances in Non-EU/EEA currencies | | | | | | | | 7,416,254.52 | 0.12 |
| Depository: State Street Bank International GmbH | | | CHF | 4,091,104.01 | | | % 100.000 | 4,163,484.90 | 0.07 |
| | | | GBP | 2,819,665.30 | | | % 100.000 | 3,210,179.35 | 0.05 |
| | | | USD | 47,019.66 | | | % 100.000 | 42,590.27 | 0.00 |
| Other assets | | | | | | | | 41,859,502.15 | 0.66 |
| Dividend claims | | | DKK | 907,968.52 | | | | 121,818.78 | 0.00 |
| | | | EUR | 10,655,476.15 | | | | 10,655,476.15 | 0.17 |
| | | | GBP | 6,468,820.78 | | | | 7,364,730.44 | 0.12 |
| | | | NOK | 7,821,682.10 | | | | 662,687.30 | 0.01 |
| | | | SEK | 12,736,869.80 | | | | 1,124,767.21 | 0.02 |
| | | | USD | 512,332.24 | | | | 464,069.01 | 0.01 |
| Withholding tax reimbursement claims | | | CHF | 7,128,814.93 | | | | 7,254,939.81 | 0.12 |
| | | | DKK | 12,205,766.81 | | | | 1,637,602.68 | 0.03 |
| | | | EUR | 3,746,816.80 | | | | 3,746,816.80 | 0.06 |
| | | | GBP | 73,291.72 | | | | 83,442.37 | 0.00 |
| | | | NOK | 36,804.88 | | | | 3,118.27 | 0.00 |
| | | | PLN | 1,091,520.00 | | | | 238,268.60 | 0.00 |
| | | | USD | 318.69 | | | | 288.67 | 0.00 |
| Receivables arising from securities transactions | | | CHF | 149,790.11 | | | | 152,440.24 | 0.00 |
| | | | EUR | 40,821.06 | | | | 40,821.06 | 0.00 |
| Receivables arising from FX spot transactions | | | EUR | 4,005,816.05 | | | | 4,005,816.05 | 0.06 |
| Initial margin | | | EUR | 4,302,000.00 | | | | 4,302,000.00 | 0.07 |
| Other receivables | | | EUR | 398.71 | | | | 398.71 | 0.00 |

(2023年4月30日現在)

| 銘柄 | ISINコード | 市場 | 単位: 2023/4/30 1,000単位の単位 | 現在 | 購入/ 追加 | 販売/ 処分 レポート期間内 | 価格 | ユーロでの 市場価値 | 対ファンド 資産比率% ²⁾ |
|-----------------------------------------------------------------|---------|-----|-----------------------------|---------------|-----------|----------------------|------------|-------------------------|------------------------------|
| Liabilities arising from loans | | | | | | | | -5,728.27 | -0.00 |
| Loans in other EU/EEA currencies | | | | | | | | -5,728.27 | -0.00 |
| Depository: State Street Bank International GmbH | | PLN | | -26,241.48 | | % | 100.000 | -5,728.27 | -0.00 |
| Other liabilities | | | | | | | | -4,463,479.45 | -0.10 |
| Management fee | | EUR | | -892,344.14 | | | | -892,344.14 | -0.01 |
| Liabilities arising from FX spot transactions | | CHF | | -3,955,775.00 | | | | -4,025,761.62 | -0.06 |
| Received variation margin | | EUR | | -1,486,600.26 | | | | -1,486,600.26 | -0.02 |
| Other liabilities | | EUR | | -58,773.43 | | | | -58,773.43 | -0.00 |
| Fund assets | | | | | | | EUR | 6,305,289,550.55 | 100.00 |
| Unit value | | | | | | | | | |
| Share class: iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE) EUR (Acc) | | | | | | | EUR | 5.10 | |
| Share class: iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE) EUR (Dist) | | | | | | | EUR | 46.41 | |
| Units in circulation | | | | | | | | | |
| Share class: iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE) EUR (Acc) | | | | | | | Units | 122,000 | |
| Share class: iShares STOXX Europe 600 UCITS ETF (DE) EUR (Dist) | | | | | | | Units | 135,845,811 | |

2) 計算中の四捨五入による誤差が生じることがあります。

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 |
|-----------------|--------|-------|--------------|-------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | 円 | 騰落率 | | 騰落率 | | | |
| 19期(2020年5月12日) | 13,524 | 0.2% | 388.75 | 0.2% | 99.6% | 0.1% | 630,705 |
| 20期(2021年5月12日) | 13,462 | △0.5% | 386.93 | △0.5% | 99.5% | 0.2% | 314,171 |
| 21期(2022年5月12日) | 13,195 | △2.0% | 379.29 | △2.0% | 99.7% | 0.1% | 666,754 |
| 22期(2023年5月12日) | 13,084 | △0.8% | 375.76 | △0.9% | 99.6% | 0.1% | 723,477 |
| 23期(2024年5月13日) | 12,543 | △4.1% | 360.26 | △4.1% | 99.4% | 0.4% | 920,650 |

(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 月 日 | 基 準 価 額 | | N O M U R A - B P I 総 合 | | 債 組 入 比 率 % | 債 先 物 比 率 % |
|---------------------|-------------|--------|-------------------------|--------|----------------|----------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2023年5月12日 | 円 13,084 | % — | 375.76 | % — | 99.6 | 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) 2024年5月13日 | 12,543 | △4.1 | 360.26 | △4.1 | 99.4 | 0.4 |

(注) 騰落率は期首比。

(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

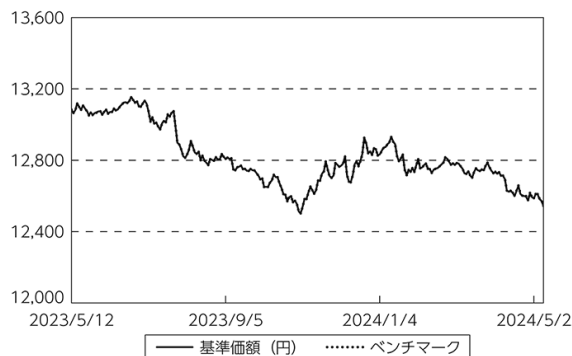
◎基準価額の動き

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

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−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っ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、乖離は $\Delta 0.0\%$ 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[※]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 (先物・オプション) | 円 0 (0) | % 0.000 (0.000) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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あります。

(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あります。

○ 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 |
|---|-------|-------------|----------------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 384,256,743 | 177,764,642 |
| | 地方債証券 | 16,956,546 | 7,211,864 (70,000) |
| 内 | 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) 金額は受渡代金。(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 | 債券先物取引 | 百万円 6,716 | 百万円 4,108 | 百万円 - | 百万円 - |

○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 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ % | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ % |
|-----|----------------|--------------------|--------------------|----------------|--------------------|--------------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 449,543 | 百万円 94,047 | 20.9 | 百万円 213,049 | 百万円 39,969 | 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 1,094 | 百万円 2,699 | 百万円 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 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MUFJ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 | | |
| | 千円 | 千円 | % | % | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 国債証券 | 807,394,000 (200,000) | 772,173,696 (200,278) | 83.9 (0.0) | — (—) | 55.3 (—) | 19.6 (0.0) | 9.0 (—) |
| 地方債証券 | 48,280,400 (48,280,400) | 48,581,318 (48,581,318) | 5.3 (5.3) | — (—) | 2.1 (2.1) | 1.9 (1.9) | 1.3 (1.3) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 34,900,958 (34,900,958) | 34,758,179 (34,758,179) | 3.8 (3.8) | — (—) | 1.9 (1.9) | 1.2 (1.2) | 0.7 (0.7) |
| 金融債券 | 2,900,000 (2,900,000) | 2,867,778 (2,867,778) | 0.3 (0.3) | — (—) | 0.0 (0.0) | 0.2 (0.2) | 0.1 (0.1) |
| 普通社債券 | 56,900,000 (56,900,000) | 56,319,048 (56,319,048) | 6.1 (6.1) | 0.0 (0.0) | 1.3 (1.3) | 3.9 (3.9) | 0.9 (0.9) |
| 合 計 | 950,375,358 (143,181,358) | 914,700,021 (142,726,602) | 99.4 (15.5) | 0.0 (0.0) | 60.7 (5.4) | 26.8 (7.2) | 11.9 (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 | 当期末 | | |
|---------------|-------|------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| | % | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | | | |
| 第449回利付国債(2年) | 0.005 | 3,720,000 | 3,714,717 |
| 第450回利付国債(2年) | 0.005 | 1,300,000 | 1,297,933 |
| 第451回利付国債(2年) | 0.005 | 5,800,000 | 5,788,690 |
| 第452回利付国債(2年) | 0.005 | 3,100,000 | 3,092,529 |
| 第453回利付国債(2年) | 0.005 | 4,600,000 | 4,586,660 |
| 第454回利付国債(2年) | 0.1 | 3,550,000 | 3,542,971 |
| 第455回利付国債(2年) | 0.005 | 1,550,000 | 1,544,001 |
| 第456回利付国債(2年) | 0.1 | 5,100,000 | 5,085,873 |
| 第457回利付国債(2年) | 0.1 | 5,710,000 | 5,691,385 |
| 第458回利付国債(2年) | 0.2 | 6,400,000 | 6,388,544 |
| 第144回利付国債(5年) | 0.1 | 6,380,000 | 6,376,491 |
| 第145回利付国債(5年) | 0.1 | 6,410,000 | 6,401,731 |
| 第146回利付国債(5年) | 0.1 | 4,450,000 | 4,438,964 |
| 第147回利付国債(5年) | 0.005 | 5,830,000 | 5,798,343 |
| 第148回利付国債(5年) | 0.005 | 8,200,000 | 8,143,502 |
| 第149回利付国債(5年) | 0.005 | 11,570,000 | 11,479,406 |
| 第150回利付国債(5年) | 0.005 | 1,630,000 | 1,615,493 |
| 第151回利付国債(5年) | 0.005 | 50,000 | 49,492 |
| 第152回利付国債(5年) | 0.1 | 5,480,000 | 5,439,009 |
| 第153回利付国債(5年) | 0.005 | 5,620,000 | 5,555,370 |
| 第154回利付国債(5年) | 0.1 | 10,230,000 | 10,130,052 |
| 第155回利付国債(5年) | 0.3 | 2,850,000 | 2,838,343 |
| 第156回利付国債(5年) | 0.2 | 8,050,000 | 7,988,498 |
| 第157回利付国債(5年) | 0.2 | 2,020,000 | 2,002,022 |
| 第158回利付国債(5年) | 0.1 | 8,740,000 | 8,629,089 |
| 第159回利付国債(5年) | 0.1 | 1,980,000 | 1,951,686 |
| 第160回利付国債(5年) | 0.2 | 2,850,000 | 2,820,730 |
| 第161回利付国債(5年) | 0.3 | 3,820,000 | 3,796,125 |
| 第162回利付国債(5年) | 0.3 | 190,000 | 188,500 |
| 第163回利付国債(5年) | 0.4 | 13,900,000 | 13,849,543 |
| 第164回利付国債(5年) | 0.2 | 1,900,000 | 1,873,077 |
| 第165回利付国債(5年) | 0.3 | 5,600,000 | 5,545,848 |
| 第166回利付国債(5年) | 0.4 | 2,100,000 | 2,089,605 |
| 第167回利付国債(5年) | 0.4 | 750,000 | 745,035 |
| 第1回利付国債(40年) | 2.4 | 2,105,000 | 2,327,393 |
| 第2回利付国債(40年) | 2.2 | 1,335,000 | 1,420,586 |
| 第3回利付国債(40年) | 2.2 | 1,668,000 | 1,770,081 |
| 第4回利付国債(40年) | 2.2 | 1,838,000 | 1,942,931 |
| 第5回利付国債(40年) | 2.0 | 1,525,000 | 1,541,531 |
| 第6回利付国債(40年) | 1.9 | 1,230,000 | 1,209,705 |
| 第7回利付国債(40年) | 1.7 | 1,540,000 | 1,441,517 |
| 第8回利付国債(40年) | 1.4 | 2,110,000 | 1,821,541 |
| 第9回利付国債(40年) | 0.4 | 3,630,000 | 2,262,288 |
| 第10回利付国債(40年) | 0.9 | 3,000,000 | 2,195,610 |

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

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 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 | 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256回神奈川県公募公債 | 0.269 | 350,000 | 334,901 | 2032/3/19 |
| 第7回大阪府公募公債(20年) | 1.84 | 220,000 | 236,277 | 2031/9/26 |
| 第11回大阪府公募公債(20年) | 1.693 | 100,000 | 106,265 | 2033/9/27 |
| 第179回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 100,000 | 99,371 | 2026/1/28 |
| 第184回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 120,000 | 118,900 | 2026/6/29 |
| 第186回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 300,000 | 297,042 | 2026/8/28 |
| 第191回大阪府公募公債(5年) | 0.001 | 160,000 | 158,072 | 2027/1/28 |
| 第400回大阪府公募公債 | 0.531 | 136,000 | 136,450 | 2025/9/29 |
| 第407回大阪府公募公債 | 0.09 | 200,000 | 198,738 | 2026/4/27 |
| 第410回大阪府公募公債 | 0.001 | 200,000 | 198,100 | 2026/7/28 |
| 第415回大阪府公募公債 | 0.142 | 100,000 | 99,215 | 2026/12/25 |
| 第417回大阪府公募公債 | 0.248 | 300,000 | 298,278 | 2027/2/26 |
| 第418回大阪府公募公債 | 0.22 | 800,000 | 794,520 | 2027/3/30 |
| 第420回大阪府公募公債 | 0.17 | 100,000 | 99,099 | 2027/5/28 |
| 第426回大阪府公募公債 | 0.172 | 100,000 | 98,855 | 2027/11/29 |
| 第435回大阪府公募公債 | 0.2 | 130,000 | 128,012 | 2028/8/30 |
| 第439回大阪府公募公債 | 0.193 | 100,000 | 98,170 | 2028/12/27 |
| 第455回大阪府公募公債 | 0.116 | 148,000 | 143,259 | 2030/4/26 |
| 第460回大阪府公募公債 | 0.115 | 194,000 | 186,911 | 2030/9/27 |
| 第464回大阪府公募公債 | 0.072 | 800,000 | 765,568 | 2031/1/28 |
| 第465回大阪府公募公債 | 0.12 | 500,000 | 479,640 | 2031/2/25 |
| 第467回大阪府公募公債 | 0.164 | 200,000 | 192,054 | 2031/4/28 |
| 第471回大阪府公募公債 | 0.083 | 97,000 | 92,170 | 2031/8/29 |
| 第483回大阪府公募公債 | 0.799 | 200,000 | 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 | 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 | 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 | 2029/4/16 |
| 第1回兵庫県公募公債(15年) | 1.66 | 400,000 | 410,728 | 2026/7/29 |
| 第2回兵庫県公募公債(20年) | 2.37 | 300,000 | 318,633 | 2027/9/17 |
| 第2回兵庫県公募公債(30年) | 2.36 | 90,000 | 99,854 | 2040/3/19 |
| 第4回兵庫県公募公債(12年) | 0.73 | 300,000 | 301,989 | 2026/8/6 |
| 第5回兵庫県公募公債(12年) | 0.687 | 400,000 | 402,628 | 2027/7/7 |
| 第5回兵庫県公募公債(15年) | 1.31 | 200,000 | 206,084 | 2028/5/26 |
| 第6回兵庫県公募公債(15年) | 1.35 | 100,000 | 103,277 | 2028/7/14 |
| 第9回兵庫県公募公債(15年) | 1.02 | 800,000 | 815,584 | 2029/7/13 |
| 第9回兵庫県公募公債(20年) | 2.25 | 200,000 | 217,260 | 2029/11/19 |
| 第27回兵庫県公募公債(20年) | 0.387 | 200,000 | 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 | 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 | 2033/6/20 |
| 令和5年度第5回兵庫県公募公債 | 0.815 | 100,000 | 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 | 2029/4/23 |
| 令和6年度第2回兵庫県公募公債 | 0.938 | 200,000 | 198,416 | 2034/4/21 |
| 第1回静岡県公募公債(15年) | 1.514 | 100,000 | 102,976 | 2027/3/19 |
| 第6回静岡県公募公債(15年) | 1.062 | 300,000 | 306,510 | 2029/6/25 |
| 第11回静岡県公募公債(20年) | 1.841 | 550,000 | 588,885 | 2030/10/18 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | % | 千円 | 千円 | |
| 地方債証券 | | | | |
| 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 |
| 地方債証券 | | % | 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 | | 2.34 | 100,000 | 106,989 | 2028/12/20 |
| 小 | 計 | | 48,280,400 | 48,581,318 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 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構債券 | 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構債券 | 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構債券 | 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構債券 | 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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(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構債券(財投機関債) | 0.491 | 300,000 | 300,570 | 2025/10/28 |
| F90回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.609 | 100,000 | 103,854 | 2028/1/28 |
| F131回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.546 | 70,000 | 73,465 | 2031/7/30 |
| F134回地方公共団体金融機構債券(財投機関債) | 1.348 | 300,000 | 308,847 | 2028/3/17 |
| F151回地方公共団体金融機構債券(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構債券 (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構債券 (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回福祉医療機構債券 (財投機関債) | 0.175 | 400,000 | 396,660 | 2026/12/18 |
| 第54回福祉医療機構債券 (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 | 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 | 2029/11/27 |
| 小 計 | | 34,900,958 | 34,758,179 | |
| 金融債券 | | | | |
| 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 | |
| 普通社債券 | | | | |
| 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 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 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回クラレ | 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 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 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回日産フィナンシャルサービス | | 0.58 | 300,000 | 295,812 | 2026/9/18 |
| 第56回日産フィナンシャルサービス | | 0.52 | 500,000 | 494,500 | 2026/6/19 |
| 第57回日産フィナンシャルサービス | | 0.834 | 400,000 | 392,188 | 2028/6/20 |
| 第58回日産フィ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 | 当 期 末 | | | |
|---------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 第34回東京センチュリー | 0.22 | 300,000 | 292,461 | 2028/7/21 |
| 第102回トヨタファイナンス | 0.414 | 700,000 | 697,053 | 2027/4/9 |
| 第103回トヨタファイナンス | 0.617 | 300,000 | 298,035 | 2029/4/11 |
| 第22回ポケットカード | 0.3 | 100,000 | 99,378 | 2025/10/29 |
| 第23回ポケットカード | 0.2 | 200,000 | 196,568 | 2026/12/3 |
| 第24回ポケットカード | 0.898 | 300,000 | 297,621 | 2028/11/22 |
| 第42回リコーリース | 0.39 | 400,000 | 395,680 | 2027/6/1 |
| 第209回オリックス | 0.39 | 500,000 | 494,230 | 2027/9/1 |
| 第220回オリックス | 0.723 | 400,000 | 397,224 | 2028/11/29 |
| 第222回オリックス | 0.677 | 500,000 | 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 | 2026/2/2 |
| 第2回三菱HCキャピタル | 0.19 | 500,000 | 492,170 | 2027/3/1 |
| 第40回大和証券グループ本社 | 0.575 | 500,000 | 497,560 | 2026/11/27 |
| 第3回野村ホールディングス | 0.28 | 200,000 | 197,100 | 2026/9/4 |
| 第24回野村ホールディングス | 2.329 | 100,000 | 101,798 | 2025/6/24 |
| 第27回野村ホールディングス | 2.107 | 100,000 | 101,823 | 2025/9/24 |
| 第83回三井不動産(グリーン) | 0.81 | 200,000 | 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 | 2028/5/2 |
| 第143回三菱地所 | 0.9 | 100,000 | 96,989 | 2033/5/2 |
| 第111回住友不動産(グリーン) | 0.52 | 100,000 | 99,058 | 2028/4/28 |
| 第76回東京急行電鉄 | 1.563 | 200,000 | 205,544 | 2027/6/7 |
| 第36回京王電鉄 | 0.325 | 200,000 | 197,786 | 2027/9/17 |
| 第53回東日本旅客鉄道 | 2.35 | 300,000 | 319,356 | 2028/4/21 |
| 第71回東日本旅客鉄道 | 1.905 | 400,000 | 425,184 | 2030/9/27 |
| 第100回東日本旅客鉄道 | 1.981 | 200,000 | 201,118 | 2044/1/29 |
| 第163回東日本旅客鉄道 | 0.05 | 600,000 | 594,402 | 2026/4/15 |
| 第73回西日本旅客鉄道 | 0.05 | 400,000 | 396,228 | 2026/4/22 |
| 第42回東海旅客鉄道 | 2.312 | 100,000 | 107,276 | 2029/4/24 |
| 第53回東海旅客鉄道 | 1.797 | 100,000 | 105,609 | 2030/10/25 |
| 第28回東京地下鉄 | 0.25 | 300,000 | 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 | 2028/9/13 |
| 第58回阪急阪神ホールディングス | 0.09 | 200,000 | 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 | 2028/7/13 |
| 第71回名古屋鉄道 | 0.35 | 400,000 | 396,928 | 2027/3/12 |
| 第14回日本通運 | 0.28 | 200,000 | 197,534 | 2027/6/16 |
| 第1回横浜高速鉄道 | 0.62 | 300,000 | 299,658 | 2026/2/25 |
| 第20回三菱倉庫 | 0.759 | 100,000 | 98,764 | 2031/3/14 |
| 第31回KDDI(サステナビリティ) | 0.43 | 200,000 | 197,854 | 2027/10/27 |
| 第9回ソフトバンク | 0.48 | 600,000 | 585,972 | 2027/12/3 |
| 第13回ソフトバンク | 0.52 | 500,000 | 465,070 | 2031/6/3 |
| 第16回ソフトバンク | 0.52 | 500,000 | 462,275 | 2031/10/10 |
| 第21回ソフトバンク | 0.82 | 700,000 | 688,877 | 2028/7/12 |
| 第22回ソフトバンク | 1.0 | 300,000 | 292,674 | 2030/7/12 |
| 第49回電源開発 | 0.4 | 500,000 | 495,245 | 2027/5/20 |
| 第50回電源開発 | 0.415 | 200,000 | 198,084 | 2027/7/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 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 J E R A | 0.64 | 200,000 | 198,280 | 2028/4/25 |
| 第17回 J E R A | 0.9 | 400,000 | 396,076 | 2030/4/25 |
| 第21回 J E R A | 0.689 | 200,000 | 197,888 | 2028/11/24 |
| 第22回 J E R A | 0.5 | 1,000,000 | 993,540 | 2027/2/25 |
| 第23回 J E R A | 1.192 | 100,000 | 97,962 | 2034/2/24 |
| 第25回 J E R A | 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回ファーストリテイリング | 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回サントアンデル銀行 (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 | |
|-----|--------|----------|--------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 債券先物取引 | 10年国債標準物 | 百万円 3,311 | 百万円 — |

○投資信託財産の構成

(2024年5月13日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 914,700,021 | % 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 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 929,887,560,233 |
| コール・ローン等 | 13,449,202,663 |
| 公社債(評価額) | 914,700,021,042 |
| 未収利息 | 1,536,128,641 |
| 前払費用 | 140,463,382 |
| 差入委託証拠金 | 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 |

<注記事項>

- 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。

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 J 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 J 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 J 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 J 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 J ライフセレクトファンド(安定成長型) | 12,165,840,984円 |
| 三菱UFJ J 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 J 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 J ライフセレクトファンド(安定型) | 7,900,455,072円 |
| 三菱UFJ J DC年金バランス(株式40) | 7,530,798,013円 |
| 三菱UFJ J DC年金バランス(株式15) | 7,397,848,968円 |
| 三菱UFJ J 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 J 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 J 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 |

○損益の状況 (2023年5月13日~2024年5月13日)

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

| | |
|------------------------------------------|----------------|
| 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 バランスファンドVA 40型 (適格機関投資家限定) | 4,588,038,506円 |
| 三菱UFJ バランスファンド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 ウェルス・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 ウェルス・インサイト・ファンド (保守型) | 2,499,242,039円 |
| 三菱UFJ バランスファンド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) | 2,272,420,672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 バランスファンド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 バランスファンド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UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 56,719,654円 |
| 三菱UFJ バランスVA60D (適格機関投資家限定) | 47,853,897円 |
| 三菱UFJ バランスVA60G (適格機関投資家限定) | 30,896,965円 |
| 三菱UFJ バランスファンド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UFJ 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UFJ 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UFJ 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UFJ 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UFJ バランスファンド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UFJ バランスファンド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)

米国国債7-10年ラダーマザーファンド

《第16期》決算日2024年3月18日

[計算期間：2023年9月20日～2024年3月18日]

「米国国債7-10年ラダーマザーファンド」は、3月18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 | 主として米国の国債に投資を行います。 原則として、残存期間が7年程度から10年程度までの米国国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用をめざします。 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 | 米国の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 円 | 価額 | | 債 組 入 比 率 % | 債 先 物 比 率 % | 純 資 産 額 百万円 |
|-----------------|---------|-----------------------|-------------|----------------------------|----------------------------|-------------------------|
| | | 期 騰 落 率 % | 中 率 % | | | |
| 12期(2022年3月17日) | 11,753 | | 1.5 | 98.5 | — | 24,819 |
| 13期(2022年9月20日) | 12,956 | | 10.2 | 98.8 | — | 26,518 |
| 14期(2023年3月17日) | 12,194 | △ | 5.9 | 97.8 | — | 27,000 |
| 15期(2023年9月19日) | 13,016 | | 6.7 | 97.9 | — | 33,813 |
| 16期(2024年3月18日) | 13,443 | | 3.3 | 93.8 | — | 31,723 |

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

(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 月 日 | 基 準 価 額 騰 落 率 | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 券 率 |
|-------------------------|------------------|-----------|-----------|-----------|
| | | | | |
| (期 首) 2023年 9 月 19 日 | 円 13,016 | — | — | % 97.9 |
| 9 月 末 | 12,950 | △0.5 | — | 96.8 |
| 10 月 末 | 12,732 | △2.2 | — | 97.6 |
| 11 月 末 | 13,125 | 0.8 | — | 97.6 |
| 12 月 末 | 13,100 | 0.6 | — | 97.4 |
| 2024年 1 月 末 | 13,491 | 3.6 | — | 97.0 |
| 2 月 末 | 13,576 | 4.3 | — | 96.8 |
| (期 末) 2024年 3 月 18 日 | 13,443 | 3.3 | — | 93.8 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

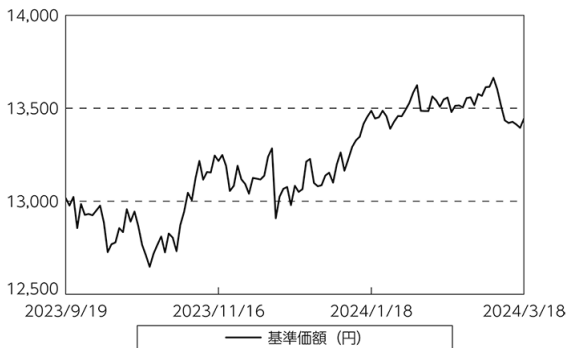
○運用経過

●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3.3%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

債券利子収入を享受したことや、米ドルが対円で上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎債券市況

- ・米国長期金利は概ね横ばいとなりました。
- ・米国長期金利は、期間の初めから2023年10月頃にかけて国債増発による需給悪化懸念により上昇した後、12月頃にかけてはインフレの鈍化を背景に今後の利下げ期待が拡大したことなどを背景に、金利低下する場面もありましたが、その後、期間の終わりにかけては、米連邦準備制度理事会（FRB）高官が早期の利下げをけん制したことや雇用統計などの堅調な内容の経済指標などを受けて、上昇しました。結果、期間を通じてみると、米国長期金利は概ね横ばいとなりました。

◎為替市況

- ・米ドルは対円で上昇しました。
- ・米ドルは、米国の堅調な経済指標などを背景に、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

- ・残存期間が7年程度から10年程度までの米国国債を主要投資対象とし、これらの債券の各残存期間ごとの投資金額が同額程度になるような運用を行いました。

○今後の運用方針

- ・米国国債を主要投資対象とし、原則として、残存期間が7年程度から10年程度までの米国国債に投資し、各残存期間ごとの投資金額が同程度になるような運用を目指します。

○1万口当たりの費用明細

(2023年9月20日～2024年3月18日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (1) | (0.006) | 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 の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 1 | 0.006 | |
| 期中の平均基準価額は、13,196円です。 | | | |

(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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年9月20日～2024年3月18日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|------|------|-------------------|-------------------|
| 外 国 | アメリカ | 国債証券 | 千アメリカドル 52,305 | 千アメリカドル 78,823 |

(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9月20日～2024年3月18日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|--------|--------------|--------------------|---------------|--------------|--------------------|---------------|
| | | | $\frac{B}{A}$ | | | $\frac{D}{C}$ |
| 為替直物取引 | 百万円 4,563 | 百万円 2,701 | % 59.2 | 百万円 7,681 | 百万円 5,814 | % 75.7 |

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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年3月18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 |
| | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 220,980 | 199,289 | 29,757,845 | 93.8 | — | 93.8 | — | — |
| 合 計 | 220,980 | 199,289 | 29,757,845 | 93.8 | — | 93.8 | — | — |

(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) 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 | | | | | |
|------|---------------------|---------|---------|--------|------------|------------|
| | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | | |
| 国債証券 | 1.25 T-NOTE 310815 | 1.25 | 20,590 | 16,622 | 2,481,997 | 2031/8/15 |
| | 1.375 T-NOTE 311115 | 1.375 | 20,620 | 16,694 | 2,492,829 | 2031/11/15 |
| | 1.625 T-NOTE 310515 | 1.625 | 19,960 | 16,680 | 2,490,694 | 2031/5/15 |
| | 1.875 T-NOTE 320215 | 1.875 | 19,820 | 16,594 | 2,477,906 | 2032/2/15 |
| | 2.75 T-NOTE 320815 | 2.75 | 18,580 | 16,525 | 2,467,613 | 2032/8/15 |
| | 2.875 T-NOTE 320515 | 2.875 | 18,490 | 16,651 | 2,486,451 | 2032/5/15 |
| | 3.375 T-NOTE 330515 | 3.375 | 17,930 | 16,649 | 2,486,078 | 2033/5/15 |
| | 3.5 T-NOTE 330215 | 3.5 | 17,620 | 16,546 | 2,470,742 | 2033/2/15 |
| | 3.875 T-NOTE 330815 | 3.875 | 16,970 | 16,380 | 2,445,865 | 2033/8/15 |
| | 4 T-NOTE 340215 | 4.0 | 17,100 | 16,671 | 2,489,338 | 2034/2/15 |
| | 4.125 T-NOTE 321115 | 4.125 | 16,890 | 16,639 | 2,484,677 | 2032/11/15 |
| | 4.5 T-NOTE 331115 | 4.5 | 16,410 | 16,633 | 2,483,650 | 2033/11/15 |
| 合 計 | | | | | 29,757,845 | |

(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3月18日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 29,757,845 | % 93.8 |
| コール・ローン等、その他 | 1,965,517 | 6.2 |
| 投資信託財産総額 | 31,723,362 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(30,638,718千円)の投資信託財産総額(31,723,362千円)に対する比率は96.6%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=149.32円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年3月18日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 32,651,699,461 |
| コール・ローン等 | 1,763,632,215 |
| 公社債(評価額) | 29,757,845,931 |
| 未収入金 | 928,336,866 |
| 未収利息 | 192,832,323 |
| 前払費用 | 9,052,126 |
| (B) 負債 | 928,359,931 |
| 未払金 | 928,359,880 |
| 未払利息 | 51 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 31,723,339,530 |
| 元本 | 23,597,925,100 |
| 次期繰越損益金 | 8,125,414,430 |
| (D) 受益権総口数 | 23,597,925,100口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,443円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 25,978,225,329円
 期中追加設定元本額 3,698,597,546円
 期中一部解約元本額 6,078,897,775円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,443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)

| | |
|----------------------------------------------------|-----------------|
| MUKAM 米回国債7-10年ラダーファンド(為替ヘッジ70)(適格機関投資家限定) | 5,923,028,842円 |
| MUKAM 米回国債7-10年ラダーファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定) | 4,493,258,774円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 3,637,028,214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) | 3,008,839,524円 |
| MUKAM 日米コアバランス 2021-07(適格機関投資家限定) | 2,807,568,389円 |
| MUKAM 米回国債7-10年ラダーファンド(為替ヘッジ可変型)2016-03(適格機関投資家限定) | 2,139,968,457円 |
| 日米コアバランス(FOF s用)(適格機関投資家限定) | 1,052,752,322円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 534,651,720円 |
| MUKAM 米回国債7-10年ラダーファンド(為替ヘッジなし)(適格機関投資家限定) | 828,858円 |
| 合計 | 23,597,925,100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)
- ②新NISA(成長投資枠)の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2023年12月29日)

○損益の状況 (2023年9月20日~2024年3月18日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 456,761,048 |
| 受取利息 | 456,781,263 |
| 支払利息 | △ 20,215 |
| (B) 有価証券売買損益 | 580,992,949 |
| 売買益 | 694,063,801 |
| 売買損 | △ 113,070,852 |
| (C) 保管費用等 | △ 1,889,614 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,035,864,383 |
| (E) 前期繰越損益金 | 7,835,138,942 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,211,119,126 |
| (G) 解約差損益金 | △1,956,708,021 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 8,125,414,430 |
| 次期繰越損益金(H) | 8,125,414,430 |

- (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) (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。

米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド

《第3期》決算日2024年5月20日

[計算期間：2023年5月23日～2024年5月20日]

「米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド」は、5月20日に第3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3期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針 | 主として新興国の米ドル建ての公社債に投資を行います。 公社債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公社債の実質投資比率が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を行いません。 |
| 主要運用対象 | 新興国の米ドル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。 |

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース) | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|---------------------|-------------|--------|-------------------------------------------------|--------|--------|--------|------------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | | |
| (設定日) 2021年5月25日 | 円 10,000 | % — | (円換算ベース) 10,000.00 | % — | % — | % — | 百万円 499 |
| 1期(2022年5月20日) | 9,140 | △ 8.6 | 9,003.55 | △10.0 | 98.2 | — | 2,002 |
| 2期(2023年5月22日) | 9,725 | 6.4 | 9,576.38 | 6.4 | 97.6 | — | 9,407 |
| 3期(2024年5月20日) | 12,274 | 26.2 | 12,214.57 | 27.5 | 97.5 | — | 19,807 |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円換算ベース) の情報は信頼性があると信じるに足る情報源から得られたものですが、J. P. モルガンはその完全性または正確性を保証するものではありません。同指数は使用許諾を得て使用しています。J. P. モルガンによる書面による事前の承諾なく同指数を複製、使用、頒布することは禁じられています。Copyright © 2019 J. P. Morgan Chase & Co. 無断複製・転載を禁じます。

(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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | J Pモルガン・エマージング・ マーケット・ボンド・ インデックス・プラス (円換算ベース) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|----------------------|------------|--------|---------------------------------------------------------|--------|-----------------------|-----------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2023年 5月22日 | 円 9,725 | % — | 円 9,576.38 | % — | % 97.6 | % — |
| 5月末 | 9,890 | 1.7 | 9,757.50 | 1.9 | 97.4 | — |
| 6月末 | 10,444 | 7.4 | 10,329.85 | 7.9 | 97.2 | — |
| 7月末 | 10,328 | 6.2 | 10,231.19 | 6.8 | 97.3 | — |
| 8月末 | 10,571 | 8.7 | 10,474.08 | 9.4 | 97.2 | — |
| 9月末 | 10,373 | 6.7 | 10,282.57 | 7.4 | 97.2 | — |
| 10月末 | 10,241 | 5.3 | 10,136.90 | 5.9 | 98.1 | — |
| 11月末 | 10,778 | 10.8 | 10,676.05 | 11.5 | 97.8 | — |
| 12月末 | 10,928 | 12.4 | 10,824.71 | 13.0 | 97.0 | — |
| 2024年 1月末 | 11,166 | 14.8 | 11,071.07 | 15.6 | 97.5 | — |
| 2月末 | 11,513 | 18.4 | 11,459.16 | 19.7 | 97.4 | — |
| 3月末 | 11,866 | 22.0 | 11,814.13 | 23.4 | 98.1 | — |
| 4月末 | 12,114 | 24.6 | 12,055.87 | 25.9 | 97.9 | — |
| (期 末) 2024年 5月20日 | 12,274 | 26.2 | 12,214.57 | 27.5 | 97.5 | — |

(注) 騰落率は期首比。

(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

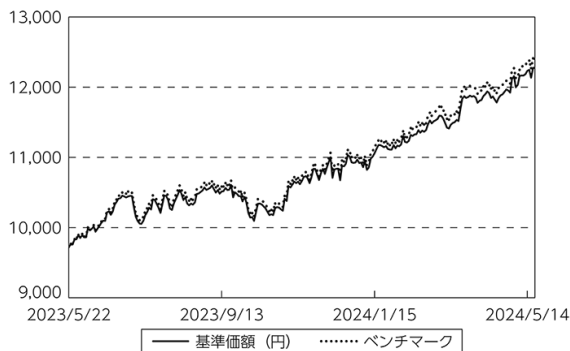
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ26.2%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(27.5%)を1.3%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

◎ 債券市況

- ・ 新興国の米ドル建て債券市況は上昇しました。
- ・ 新興国の米ドル建て債券市況は、米国の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、米国の利上げの打ち止め観測などから市場参加者のリスク回避姿勢が後退したことで上昇しました。

◎ 為替市況

- ・ 期間の初めに比べて米ドル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

- ・ 新興国の米ドル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・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・

プラス（円換算ベース）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27.5%の上昇になったため、カイ離は△1.3%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)

- ・ 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。

○ 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23日～2024年5月20日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 | % | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用) | 4 | 0.033 | |
| (そ の 他) | (4) | (0.033) | |
| 合 計 | (0) | (0.000) | |
| 期中の平均基準価額は、10,851円です。 | | | |

(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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年5月23日～2024年5月20日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|------|------|--------------------|--------------------|
| 外 国 | アメリカ | 国債証券 | 千アメリカドル 158,076 | 千アメリカドル 105,715 |

(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23日～2024年5月20日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|------|--------------------|---------------|-------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | % | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | % |
| 為替直物取引 | 百万円 18,626 | 百万円 16,292 | 87.5 | 百万円 11,565 | 百万円 11,565 | 100.0 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2024年5月20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 |
| | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 148,710 | 123,885 | 19,314,910 | 97.5 | 35.7 | 80.2 | 11.3 | 6.1 |
| 合 計 | 148,710 | 123,885 | 19,314,910 | 97.5 | 35.7 | 80.2 | 11.3 | 6.1 |

(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) 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 | 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|--------|---------|---------|---------|------------|
| | | | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | 0.55 CHINA GOVT I 251021 | 0.55 | 1,000 | 938 | 146,340 | 2025/10/21 |
| | 1.2 CHINA GOVT IN 301021 | 1.2 | 1,000 | 823 | 128,351 | 2030/10/21 |
| | 1.25 CHINA GOVT I 261026 | 1.25 | 600 | 551 | 86,030 | 2026/10/26 |
| | 1.625 ABU DHABI G 280602 | 1.625 | 600 | 529 | 82,612 | 2028/6/2 |
| | 1.7 ABU DHABI GOV 310302 | 1.7 | 400 | 329 | 51,330 | 2031/3/2 |
| | 1.875 ABU DHABI G 310915 | 1.875 | 600 | 493 | 76,865 | 2031/9/15 |
| | 1.95 CHINA GOVT I 241203 | 1.95 | 600 | 589 | 91,927 | 2024/12/3 |
| | 10.875 EGYPT TASK 260228 | 10.875 | 600 | 631 | 98,448 | 2026/2/28 |
| | 2.125 CHINA GOVT 291203 | 2.125 | 1,000 | 890 | 138,846 | 2029/12/3 |
| | 2.125 HUNGARY 310922 | 2.125 | 1,000 | 793 | 123,651 | 2031/9/22 |
| | 2.25 KSA SUKUK LT 310517 | 2.25 | 400 | 338 | 52,718 | 2031/5/17 |
| | 2.25 SAUDI INTERN 330202 | 2.25 | 600 | 482 | 75,153 | 2033/2/2 |
| | 2.252 PANAMA 320929 | 2.252 | 1,200 | 864 | 134,718 | 2032/9/29 |
| | 2.5 ABU DHABI GOV 250416 | 2.5 | 800 | 780 | 121,623 | 2025/4/16 |
| | 2.5 ABU DHABI GOV 290930 | 2.5 | 1,200 | 1,071 | 167,084 | 2029/9/30 |
| | 2.55 CHILE 320127 | 2.55 | 600 | 503 | 78,545 | 2032/1/27 |
| | 2.55 CHILE 330727 | 2.55 | 800 | 648 | 101,096 | 2033/7/27 |
| | 2.65 PHILIPPINE 451210 | 2.65 | 600 | 392 | 61,121 | 2045/12/10 |
| | 2.659 MEXICO 310524 | 2.659 | 1,000 | 829 | 129,401 | 2031/5/24 |
| | 2.7 ABU DHABI GOV 700902 | 2.7 | 600 | 343 | 53,489 | 2070/9/2 |
| | 2.75 CHILE 270131 | 2.75 | 600 | 563 | 87,780 | 2027/1/31 |
| | 2.78 PERU 601201 | 2.78 | 890 | 499 | 77,934 | 2060/12/1 |
| | 2.783 PERU 310123 | 2.783 | 1,580 | 1,341 | 209,173 | 2031/1/23 |
| | 2.875 BRAZIL 250606 | 2.875 | 1,000 | 971 | 151,404 | 2025/6/6 |
| | 2.9 SAUDI INTERNA 251022 | 2.9 | 600 | 581 | 90,661 | 2025/10/22 |
| | 2.969 KSA SUKUK L 291029 | 2.969 | 600 | 544 | 84,894 | 2029/10/29 |
| | 3 COLOMBIA 300130 | 3.0 | 800 | 657 | 102,468 | 2030/1/30 |
| | 3 PERU 340115 | 3.0 | 960 | 777 | 121,179 | 2034/1/15 |
| | 3.05 INDONESIA 510312 | 3.05 | 800 | 550 | 85,820 | 2051/3/12 |
| | 3.1 CHILE 410507 | 3.1 | 1,000 | 734 | 114,539 | 2041/5/7 |
| | 3.1 CHILE 610122 | 3.1 | 800 | 497 | 77,492 | 2061/1/22 |
| | 3.125 ABU DHABI G 300416 | 3.125 | 1,000 | 913 | 142,468 | 2030/4/16 |
| | 3.125 ABU DHABI G 490930 | 3.125 | 1,200 | 834 | 130,131 | 2049/9/30 |
| | 3.125 COLOMBIA 310415 | 3.125 | 1,000 | 792 | 123,555 | 2031/4/15 |
| | 3.125 HUNGARY 510921 | 3.125 | 800 | 508 | 79,290 | 2051/9/21 |
| | 3.16 PANAMA 300123 | 3.16 | 600 | 504 | 78,646 | 2030/1/23 |
| | 3.2 PHILIPPINE 460706 | 3.2 | 1,000 | 712 | 111,024 | 2046/7/6 |
| | 3.25 COLOMBIA 320422 | 3.25 | 1,000 | 773 | 120,594 | 2032/4/22 |
| | 3.25 MEXICO 300416 | 3.25 | 600 | 530 | 82,749 | 2030/4/16 |
| | 3.25 SAUDI INTERN 301022 | 3.25 | 400 | 361 | 56,345 | 2030/10/22 |
| | 3.25 UAE INT'L GO 611019 | 3.25 | 600 | 403 | 62,913 | 2061/10/19 |
| | 3.4 QATAR 250416 | 3.4 | 1,000 | 983 | 153,358 | 2025/4/16 |
| | 3.45 SAUDI INTERN 610202 | 3.45 | 600 | 392 | 61,178 | 2061/2/2 |
| | 3.5 CHILE 340131 | 3.5 | 600 | 523 | 81,626 | 2034/1/31 |

米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| アメリカ | 国債証券 | | | | | |
| | 3.5 CHILE 500125 | 3.5 | 800 | 578 | 90,124 | 2050/1/25 |
| | 3.5 CHILE 530415 | 3.5 | 600 | 428 | 66,740 | 2053/4/15 |
| | 3.5 MEXICO 340212 | 3.5 | 800 | 657 | 102,581 | 2034/2/12 |
| | 3.55 PERU 510310 | 3.55 | 750 | 529 | 82,549 | 2051/3/10 |
| | 3.75 BRAZIL 310912 | 3.75 | 600 | 516 | 80,560 | 2031/9/12 |
| | 3.75 MEXICO 710419 | 3.75 | 800 | 495 | 77,255 | 2071/4/19 |
| | 3.75 QATAR 300416 | 3.75 | 1,400 | 1,327 | 207,029 | 2030/4/16 |
| | 3.75 SAUDI INTERN 550121 | 3.75 | 600 | 428 | 66,821 | 2055/1/21 |
| | 3.771 MEXICO 610524 | 3.771 | 800 | 506 | 78,924 | 2061/5/24 |
| | 3.85 INDONESIA 301015 | 3.85 | 800 | 741 | 115,575 | 2030/10/15 |
| | 3.87 PANAMA 600723 | 3.87 | 1,400 | 810 | 126,429 | 2060/7/23 |
| | 3.875 ABU DHABI G 500416 | 3.875 | 1,200 | 951 | 148,325 | 2050/4/16 |
| | 3.875 BRAZIL 300612 | 3.875 | 1,200 | 1,067 | 166,372 | 2030/6/12 |
| | 4 ROMANIA 510214 | 4.0 | 890 | 627 | 97,836 | 2051/2/14 |
| | 4.05 UAE INT'L GO 320707 | 4.05 | 400 | 380 | 59,341 | 2032/7/7 |
| | 4.125 COLOMBIA 510515 | 4.125 | 800 | 483 | 75,451 | 2051/5/15 |
| | 4.2 INDONESIA 501015 | 4.2 | 800 | 664 | 103,616 | 2050/10/15 |
| | 4.25 TURKEY 250313 | 4.25 | 400 | 395 | 61,609 | 2025/3/13 |
| | 4.274 KSA SUKUK L 290522 | 4.274 | 800 | 778 | 121,327 | 2029/5/22 |
| | 4.28 MEXICO 410814 | 4.28 | 600 | 473 | 73,892 | 2041/8/14 |
| | 4.34 CHILE 420307 | 4.34 | 1,000 | 866 | 135,031 | 2042/3/7 |
| | 4.4 MEXICO 520212 | 4.4 | 600 | 447 | 69,785 | 2052/2/12 |
| | 4.4 PERUSAHAAN PE 270606 | 4.4 | 800 | 783 | 122,169 | 2027/6/6 |
| | 4.4 QATAR 500416 | 4.4 | 2,200 | 1,912 | 298,240 | 2050/4/16 |
| | 4.5 DOMINICAN 300130 | 4.5 | 900 | 825 | 128,732 | 2030/1/30 |
| | 4.5 MEXICO 500131 | 4.5 | 600 | 462 | 72,042 | 2050/1/31 |
| | 4.5 PANAMA 560401 | 4.5 | 1,200 | 781 | 121,893 | 2056/4/1 |
| | 4.5 PANAMA 630119 | 4.5 | 600 | 387 | 60,429 | 2063/1/19 |
| | 4.5 SAUDI INTERNA 600422 | 4.5 | 800 | 648 | 101,143 | 2060/4/22 |
| | 4.511 KSA SUKUK L 330522 | 4.511 | 800 | 774 | 120,724 | 2033/5/22 |
| | 4.625 POLAND 290318 | 4.625 | 850 | 837 | 130,591 | 2029/3/18 |
| | 4.7 PERUSAHAAN PE 320606 | 4.7 | 800 | 778 | 121,350 | 2032/6/6 |
| | 4.75 BRAZIL 500114 | 4.75 | 1,600 | 1,163 | 181,336 | 2050/1/14 |
| | 4.75 MEXICO 320427 | 4.75 | 800 | 747 | 116,564 | 2032/4/27 |
| | 4.75 SAUDI INTERN 280118 | 4.75 | 800 | 795 | 123,957 | 2028/1/18 |
| | 4.75 SAUDI INTERN 300116 | 4.75 | 800 | 789 | 123,133 | 2030/1/16 |
| | 4.75 TURKEY 260126 | 4.75 | 600 | 588 | 91,725 | 2026/1/26 |
| | 4.85 CHILE 290122 | 4.85 | 600 | 592 | 92,417 | 2029/1/22 |
| | 4.85 SOUTH AFRICA 290930 | 4.85 | 1,000 | 911 | 142,105 | 2029/9/30 |
| | 4.875 ABU DHABI G 290430 | 4.875 | 200 | 200 | 31,233 | 2029/4/30 |
| | 4.875 DOMINICAN 320923 | 4.875 | 1,350 | 1,215 | 189,507 | 2032/9/23 |
| | 4.875 MEXICO 330519 | 4.875 | 600 | 559 | 87,225 | 2033/5/19 |
| | 4.875 OMAN SOVERE 300615 | 4.875 | 800 | 779 | 121,540 | 2030/6/15 |
| | 4.875 POLAND 331004 | 4.875 | 1,100 | 1,072 | 167,210 | 2033/10/4 |
| | 4.875 SAUDI INTER 330718 | 4.875 | 800 | 785 | 122,444 | 2033/7/18 |

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|--------------------------|-------|---------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| アメリカ | 国債証券 | | | | | |
| | 4.917 UAE INT'L G 330925 | 4.917 | 400 | 403 | 62,963 | 2033/9/25 |
| | 4.95 CHILE 360105 | 4.95 | 600 | 576 | 89,943 | 2036/1/5 |
| | 5 ABU DHABI GOVT 340430 | 5.0 | 600 | 607 | 94,684 | 2034/4/30 |
| | 5 MEXICO 510427 | 5.0 | 600 | 493 | 76,879 | 2051/4/27 |
| | 5 SAUDI INTERNATI 340116 | 5.0 | 1,000 | 987 | 153,950 | 2034/1/16 |
| | 5 SAUDI INTERNATI 530118 | 5.0 | 800 | 710 | 110,846 | 2053/1/18 |
| | 5.125 HAZINE MUST 260622 | 5.125 | 800 | 782 | 122,048 | 2026/6/22 |
| | 5.125 POLAND 340918 | 5.125 | 1,210 | 1,191 | 185,783 | 2034/9/18 |
| | 5.25 HUNGARY 290616 | 5.25 | 800 | 786 | 122,687 | 2029/6/16 |
| | 5.25 TURKEY 300313 | 5.25 | 600 | 548 | 85,549 | 2030/3/13 |
| | 5.268 KSA SUKUK L 281025 | 5.268 | 600 | 609 | 95,002 | 2028/10/25 |
| | 5.3 DOMINICAN 410121 | 5.3 | 600 | 513 | 80,136 | 2041/1/21 |
| | 5.5 ABU DHABI GOV 540430 | 5.5 | 400 | 403 | 62,959 | 2054/4/30 |
| | 5.5 DOMINICAN 290222 | 5.5 | 900 | 874 | 136,277 | 2029/2/22 |
| | 5.5 HUNGARY 360326 | 5.5 | 1,200 | 1,162 | 181,291 | 2036/3/26 |
| | 5.5 POLAND 271116 | 5.5 | 650 | 661 | 103,092 | 2027/11/16 |
| | 5.5 POLAND 530404 | 5.5 | 1,100 | 1,081 | 168,606 | 2053/4/4 |
| | 5.5 POLAND 540318 | 5.5 | 1,600 | 1,558 | 242,963 | 2054/3/18 |
| | 5.5 SAUDI INTERNA 321025 | 5.5 | 600 | 617 | 96,265 | 2032/10/25 |
| | 5.75 POLAND 321116 | 5.75 | 650 | 675 | 105,257 | 2032/11/16 |
| | 5.75 SAUDI INTERN 540116 | 5.75 | 1,200 | 1,177 | 183,584 | 2054/1/16 |
| | 5.75 SOUTH AFRICA 490930 | 5.75 | 1,200 | 899 | 140,190 | 2049/9/30 |
| | 5.75 URUGUAY 341028 | 5.75 | 950 | 987 | 153,947 | 2034/10/28 |
| | 5.875 ARAB REPUBL 310216 | 5.875 | 800 | 651 | 101,556 | 2031/2/16 |
| | 5.875 DOMINICAN 600130 | 5.875 | 1,350 | 1,154 | 180,051 | 2060/1/30 |
| | 5.875 ROMANIA 290130 | 5.875 | 950 | 947 | 147,781 | 2029/1/30 |
| | 5.875 TURKEY 310626 | 5.875 | 400 | 369 | 57,616 | 2031/6/26 |
| | 5.95 TURKEY 310115 | 5.95 | 600 | 558 | 87,049 | 2031/1/15 |
| | 6 BRAZIL 331020 | 6.0 | 800 | 776 | 121,036 | 2033/10/20 |
| | 6 DOMINICAN 330222 | 6.0 | 750 | 729 | 113,777 | 2033/2/22 |
| | 6 MEXICO 360507 | 6.0 | 1,200 | 1,184 | 184,741 | 2036/5/7 |
| | 6 OMAN GOV INTERN 290801 | 6.0 | 1,000 | 1,017 | 158,586 | 2029/8/1 |
| | 6.125 BRAZIL 340315 | 6.125 | 1,000 | 972 | 151,637 | 2034/3/15 |
| | 6.125 HUNGARY 280522 | 6.125 | 1,000 | 1,021 | 159,207 | 2028/5/22 |
| | 6.25 BRAZIL 310318 | 6.25 | 800 | 800 | 124,784 | 2031/3/18 |
| | 6.25 HUNGARY 320922 | 6.25 | 800 | 829 | 129,272 | 2032/9/22 |
| | 6.25 OMAN GOV INT 310125 | 6.25 | 600 | 620 | 96,740 | 2031/1/25 |
| | 6.338 MEXICO 530504 | 6.338 | 800 | 769 | 119,964 | 2053/5/4 |
| | 6.35 MEXICO 350209 | 6.35 | 600 | 609 | 95,024 | 2035/2/9 |
| | 6.375 ROMANIA 340130 | 6.375 | 800 | 810 | 126,299 | 2034/1/30 |
| | 6.375 TURKEY 251014 | 6.375 | 600 | 603 | 94,119 | 2025/10/14 |
| | 6.4 DOMINICAN 490605 | 6.4 | 750 | 708 | 110,418 | 2049/6/5 |
| | 6.4 MEXICO 540507 | 6.4 | 800 | 777 | 121,268 | 2054/5/7 |
| | 6.4 PANAMA 350214 | 6.4 | 1,000 | 952 | 148,501 | 2035/2/14 |
| | 6.5 TURKEY 330920 | 6.5 | 400 | 376 | 58,710 | 2033/9/20 |

米ドル建て新興国債券インデックスマザーファンド

| 銘柄 | 銘柄 | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|------|--------|---------|---------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千アメリカドル | 千アメリカドル | 千円 | |
| アメリカ | 国債証券 | 6.625 | 700 | 719 | 112,153 | 2028/2/17 |
| | | 6.876 | 400 | 106 | 16,681 | 2031/5/21 |
| | | 7.125 | 1,000 | 976 | 152,298 | 2054/5/13 |
| | | 7.125 | 770 | 816 | 127,357 | 2033/1/17 |
| | | 7.25 | 800 | 816 | 127,374 | 2027/2/24 |
| | | 7.253 | 800 | 213 | 33,208 | 2035/3/15 |
| | | 7.3 | 800 | 713 | 111,163 | 2052/4/20 |
| | | 7.375 | 800 | 675 | 105,241 | 2033/9/28 |
| | | 7.5 | 600 | 433 | 67,550 | 2061/2/16 |
| | | 7.5 | 1,000 | 1,005 | 156,805 | 2034/2/2 |
| | | 7.625 | 800 | 696 | 108,623 | 2032/5/29 |
| | | 7.625 | 800 | 806 | 125,663 | 2034/5/15 |
| | | 8.0 | 600 | 625 | 97,529 | 2033/4/20 |
| | | 8.0 | 800 | 826 | 128,888 | 2035/11/14 |
| | | 8.5091 | 600 | 638 | 99,523 | 2029/1/14 |
| | | 8.6 | 600 | 638 | 99,534 | 2027/9/24 |
| | | 8.75 | 800 | 852 | 132,971 | 2053/11/14 |
| | | 8.875 | 800 | 659 | 102,884 | 2050/5/29 |
| | | 9.125 | 800 | 873 | 136,146 | 2030/7/13 |
| | | 9.375 | 600 | 656 | 102,294 | 2029/3/14 |
| | | 9.375 | 800 | 896 | 139,795 | 2033/1/19 |
| | | 9.758 | 600 | 632 | 98,678 | 2025/11/13 |
| | | 9.875 | 1,000 | 1,104 | 172,174 | 2028/1/15 |
| | | 0.75 | 4,350 | 2,546 | 397,097 | 2030/7/9 |
| | | 3.625 | 4,940 | 2,266 | 353,326 | 2035/7/9 |
| | | 4.25 | 2,610 | 1,298 | 202,490 | 2038/1/9 |
| | | 3.5 | 2,740 | 1,174 | 183,080 | 2041/7/9 |
| | | 6.0 | 1,500 | 1,017 | 158,648 | 2030/7/31 |
| | | 3.5 | 3,320 | 1,727 | 269,274 | 2035/7/31 |
| | | 2.5 | 1,250 | 589 | 91,891 | 2040/7/31 |
| 合 | 計 | | | | 19,314,910 | |

(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20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 19,314,910 | % 97.5 |
| コール・ローン等、その他 | 492,903 | 2.5 |
| 投資信託財産総額 | 19,807,813 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (19,796,327千円) の投資信託財産総額 (19,807,813千円) 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=155.91円 | 1 ユーロ=169.57円 | | |
|------------------|---------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 20,312,789,765 |
| コール・ローン等 | 237,852,103 |
| 公社債(評価額) | 19,314,910,463 |
| 未収入金 | 504,996,740 |
| 未収利息 | 219,687,321 |
| 前払費用 | 35,343,138 |
| (B) 負債 | 504,997,970 |
| 未払金 | 504,976,460 |
| 未払解約金 | 21,510 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 19,807,791,795 |
| 元本 | 16,138,228,539 |
| 次期繰越損益金 | 3,669,563,256 |
| (D) 受益権総口数 | 16,138,228,539口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,274円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 9,673,820,355円
期中追加設定元本額 17,041,453,231円
期中一部解約元本額 10,577,045,047円
また、1口当たり純資産額は、期末1.2274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)

| | |
|------------------------------------------------|-----------------|
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 14,391,538,578円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 894,949,814円 |
| 米ドル建て新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家限定) | 497,861,896円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 345,076,572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 | 8,139,750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 | 661,929円 |
| 合計 | 16,138,228,539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)
- ②新NISA(成長投資枠)の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年12月29日)

○損益の状況 (2023年5月23日～2024年5月20日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 994,057,844 |
| 受取利息 | 994,065,131 |
| その他収益金 | 48,317 |
| 支払利息 | △ 55,604 |
| (B) 有価証券売買損益 | 2,843,116,212 |
| 売買益 | 3,385,920,307 |
| 売買損 | △ 542,804,095 |
| (C) 保管費用等 | △ 5,801,862 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 3,831,372,194 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 266,313,480 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,130,954,713 |
| (G) 解約差損益金 | △ 1,026,450,171 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 3,669,563,256 |
| 次期繰越損益金(H) | 3,669,563,256 |

- (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) (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。

iシェアーズ・コア・ユーロ国債 UCITS ETF

(iShares Core € Govt Bond UCITS ETF)

損益計算書、資産変動計算書、投資明細表は、入手可能なANNUAL REPORTから抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

1. 損益計算書

| | iShares Core € Govt Bond UCITS ETF |
|-----------------------------|---------------------------------------|
| | EUR' 000 |
| (2023年6月30日に終了する会計年度) | |
| 運用収益 | 43,777 |
| 金融商品の純(損失)/収益 | (232,927) |
| 投資収益総額/(損失) | (189,150) |
| 運用費用 | (3,597) |
| 金融資産のマイナス金利 | — |
| 運用収益/(費用) | (192,747) |
| 費用: | |
| 銀行金利 | (80) |
| 償還可能投資者への分配 | (19,045) |
| 費用合計 | (19,125) |
| 税引前純利益(損失) | (211,872) |
| 課税 | (2) |
| 課税後の純(損失)/利益 | (211,874) |
| 償還可能投資者に帰属する純資産の増(減) | (211,874) |

損益計算書に掲載された以外に会計年度に生じる認識された損益はありません。

2. 資産変動計算書

| (2023年6月30日に終了する会計年度) | iShares Core € Govt Bond UCITS ETF EUR' 000 |
|-----------------------|---------------------------------------------------|
| 会計年度期初の純資産 | 3,859,437 |
| 償還可能投資者に帰属する純資産の増(減) | (211,874) |
| 取引： | |
| 償還可能証券の発行 | 2,098,652 |
| 償還可能証券の償還 | (1,580,992) |
| 取引による純資産の増(減) | 517,660 |
| 会計年度末の純資産 | 4,165,223 |

3. 投資明細表

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Transferable Securities Admitted to an Official Stock Exchange Listing or traded on a Regulated Market (30 June 2022: 99.01%) | | | | |
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) | | | | |
| Austria (30 June 2022: 3.51%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 7,268,000 | Republic of Austria Government Bond 0.000% 15/07/2024 | 7,022 | 0.17 |
| EUR | 5,550,000 | Republic of Austria Government Bond 0.000% 20/04/2025 | 5,237 | 0.13 |
| EUR | 4,644,000 | Republic of Austria Government Bond 0.000% 20/10/2028 | 3,978 | 0.09 |
| EUR | 7,711,000 | Republic of Austria Government Bond 0.000% 20/02/2030 | 6,356 | 0.15 |
| EUR | 8,250,000 | Republic of Austria Government Bond 0.000% 20/02/2031 | 6,590 | 0.16 |
| EUR | 3,047,000 | Republic of Austria Government Bond 0.000% 20/10/2040 | 1,812 | 0.04 |
| EUR | 3,349,000 | Republic of Austria Government Bond 0.250% 20/10/2036 | 2,334 | 0.06 |
| EUR | 9,477,000 | Republic of Austria Government Bond 0.500% 20/04/2027 | 8,637 | 0.21 |
| EUR | 9,975,000 | Republic of Austria Government Bond 0.500% 20/02/2029 | 8,721 | 0.21 |
| EUR | 2,042,000 | Republic of Austria Government Bond 0.700% 20/04/2071 | 933 | 0.02 |
| EUR | 9,673,000 | Republic of Austria Government Bond 0.750% 20/10/2026 | 8,989 | 0.22 |
| EUR | 6,591,000 | Republic of Austria Government Bond 0.750% 20/02/2028 | 5,962 | 0.14 |
| EUR | 6,811,000 | Republic of Austria Government Bond 0.750% 20/03/2051 | 3,958 | 0.09 |
| EUR | 2,833,000 | Republic of Austria Government Bond 0.850% 30/06/2120 | 1,181 | 0.03 |
| EUR | 7,992,000 | Republic of Austria Government Bond 0.900% 20/02/2032 | 6,742 | 0.16 |
| EUR | 8,566,000 | Republic of Austria Government Bond 1.200% 20/10/2025 | 8,203 | 0.20 |
| EUR | 5,916,000 | Republic of Austria Government Bond 1.500% 20/02/2047 | 4,370 | 0.10 |
| EUR | 1,148,000 | Republic of Austria Government Bond 1.500% 02/11/2086 | 697 | 0.02 |
| EUR | 7,643,000 | Republic of Austria Government Bond 1.650% 21/10/2024 | 7,482 | 0.18 |
| EUR | 2,015,000 | Republic of Austria Government Bond 1.850% 23/05/2049 | 1,588 | 0.04 |
| EUR | 3,344,000 | Republic of Austria Government Bond 2.000% 15/07/2026 | 3,239 | 0.08 |
| EUR | 3,815,000 | Republic of Austria Government Bond 2.100% 20/09/2117 | 2,822 | 0.07 |
| EUR | 5,748,000 | Republic of Austria Government Bond 2.400% 23/05/2034 | 5,415 | 0.13 |
| EUR | 2,140,000 | Republic of Austria Government Bond 2.900% 23/05/2029 | 2,135 | 0.05 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|---------------------------------------------|------------|--------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Austria (30 June 2022: 3.51%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 5,570,000 | Republic of Austria Government Bond 2.900% 20/02/2033 | 5,510 | 0.13 |
| EUR | 5,627,000 | Republic of Austria Government Bond 3.150% 20/06/2044 | 5,714 | 0.14 |
| EUR | 1,087,000 | Republic of Austria Government Bond 3.150% 20/10/2053 | 1,101 | 0.03 |
| EUR | 2,692,000 | Republic of Austria Government Bond 3.800% 26/01/2062 | 3,148 | 0.07 |
| EUR | 10,157,000 | Republic of Austria Government Bond 4.150% 15/03/2037* | 11,336 | 0.27 |
| EUR | 5,612,000 | Republic of Austria Government Bond 4.850% 15/03/2026 | 5,861 | 0.14 |
| EUR | 3,703,000 | Republic of Austria Government Bond 6.250% 15/07/2027 | 4,153 | 0.10 |
| Total Austria | | | 151,226 | 3.63 |
| Belgium (30 June 2022: 5.36%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 4,776,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.000% 22/10/2027 | 4,215 | 0.10 |
| EUR | 8,105,500 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.000% 22/10/2031 | 6,368 | 0.15 |
| EUR | 7,989,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.100% 22/06/2030 | 6,606 | 0.16 |
| EUR | 9,235,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.350% 22/06/2032 | 7,337 | 0.18 |
| EUR | 5,228,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.400% 22/06/2040 | 3,277 | 0.08 |
| EUR | 8,931,608 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.500% 22/10/2024* | 8,603 | 0.21 |
| EUR | 3,477,060 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.650% 22/06/2071* | 1,450 | 0.03 |
| EUR | 15,465,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.800% 22/06/2025 | 14,762 | 0.35 |
| EUR | 8,028,367 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.800% 22/06/2027* | 7,382 | 0.18 |
| EUR | 10,898,740 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.800% 22/06/2028 | 9,863 | 0.24 |
| EUR | 12,782,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 0.900% 22/06/2029 | 11,426 | 0.27 |
| EUR | 6,640,400 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.000% 22/06/2026 | 6,260 | 0.15 |
| EUR | 13,203,968 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.000% 22/06/2031 | 11,417 | 0.27 |
| EUR | 5,839,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.250% 22/04/2033 | 5,004 | 0.12 |
| EUR | 6,097,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.400% 22/06/2053 | 3,893 | 0.09 |
| EUR | 4,263,232 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.450% 22/06/2037 | 3,437 | 0.08 |
| EUR | 6,904,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.600% 22/06/2047 | 4,946 | 0.12 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|---------------------------------------------|------------|-------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| Belgium (30 June 2022: 5.36%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 8,594,500 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.700% 22/06/2050 | 6,114 | 0.15 |
| EUR | 5,030,200 | Kingdom of Belgium Government Bond 1.900% 22/06/2038 | 4,235 | 0.10 |
| EUR | 4,918,800 | Kingdom of Belgium Government Bond 2.150% 22/06/2066 | 3,698 | 0.09 |
| EUR | 4,536,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 2.250% 22/06/2057 | 3,571 | 0.09 |
| EUR | 2,702,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 2.750% 22/04/2039 | 2,527 | 0.06 |
| EUR | 1,584,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 2.750% 22/04/2039 | 1,481 | 0.04 |
| EUR | 8,079,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 3.000% 22/06/2033 | 8,041 | 0.19 |
| EUR | 6,448,479 | Kingdom of Belgium Government Bond 3.000% 22/06/2034 ⁴ | 6,397 | 0.15 |
| EUR | 3,441,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 3.300% 22/06/2054 | 3,374 | 0.08 |
| EUR | 2,450,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 3.450% 22/06/2043 | 2,476 | 0.06 |
| EUR | 5,927,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 3.750% 22/06/2045 ⁵ | 6,314 | 0.15 |
| EUR | 5,274,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 4.000% 28/03/2032 | 5,680 | 0.14 |
| EUR | 9,380,500 | Kingdom of Belgium Government Bond 4.250% 28/03/2041 ¹ | 10,576 | 0.25 |
| EUR | 9,498,500 | Kingdom of Belgium Government Bond 4.500% 28/03/2026 | 9,840 | 0.24 |
| EUR | 12,224,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 5.000% 28/03/2035 | 14,429 | 0.35 |
| EUR | 13,821,000 | Kingdom of Belgium Government Bond 5.500% 28/03/2028 | 15,396 | 0.37 |
| Total Belgium | | | 220,395 | 5.29 |
| Croatia (30 June 2022: 0.00%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 3,860,000 | Croatia Government International Bond 1.125% 19/06/2029 | 3,384 | 0.08 |
| EUR | 2,190,000 | Croatia Government International Bond 1.125% 04/03/2033 ³ | 1,728 | 0.04 |
| EUR | 2,440,000 | Croatia Government International Bond 1.500% 17/06/2031 ¹ | 2,088 | 0.05 |
| EUR | 4,260,000 | Croatia Government International Bond 3.000% 20/03/2027 ⁷ | 4,212 | 0.10 |
| Total Croatia | | | 11,412 | 0.27 |
| Cyprus (30 June 2022: 0.18%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 530,000 | Cyprus Government International Bond 0.625% 21/01/2030 | 444 | 0.01 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------|-----------|------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Cyprus (30 June 2022: 0.18%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 640,000 | Cyprus Government International Bond 1.250% 21/01/2040 ⁴ | 430 | 0.01 |
| EUR | 390,000 | Cyprus Government International Bond 2.250% 16/04/2050 ¹ | 289 | 0.01 |
| EUR | 950,000 | Cyprus Government International Bond 2.375% 25/09/2028 ⁸ | 900 | 0.02 |
| EUR | 3,281,000 | Cyprus Government International Bond 2.750% 27/06/2024 | 3,266 | 0.08 |
| EUR | 256,000 | Cyprus Government International Bond 2.750% 26/02/2034 | 231 | 0.00 |
| EUR | 812,000 | Cyprus Government International Bond 2.750% 03/05/2049 | 675 | 0.02 |
| Total Cyprus | | | 6,235 | 0.15 |
| Estonia (30 June 2022: 0.01%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 18,000 | Estonia Government International Bond 0.125% 10/06/2030 | 14 | 0.00 |
| Total Estonia | | | 14 | 0.00 |
| Finland (30 June 2022: 1.47%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 5,526,000 | Finland Government Bond 0.000% 15/09/2024 ⁴ | 5,305 | 0.13 |
| EUR | 1,460,000 | Finland Government Bond 0.000% 15/09/2026 | 1,327 | 0.03 |
| EUR | 4,834,000 | Finland Government Bond 0.000% 15/09/2030 | 3,933 | 0.09 |
| EUR | 3,525,000 | Finland Government Bond 0.125% 15/09/2031 | 2,812 | 0.07 |
| EUR | 2,254,000 | Finland Government Bond 0.125% 15/04/2036 | 1,555 | 0.04 |
| EUR | 3,292,000 | Finland Government Bond 0.125% 15/04/2052 ² | 1,551 | 0.04 |
| EUR | 2,376,000 | Finland Government Bond 0.250% 15/09/2040 | 1,487 | 0.04 |
| EUR | 3,576,000 | Finland Government Bond 0.500% 15/04/2026 ⁶ | 3,335 | 0.08 |
| EUR | 4,287,000 | Finland Government Bond 0.500% 15/09/2027 ⁷ | 3,875 | 0.09 |
| EUR | 4,055,000 | Finland Government Bond 0.500% 15/09/2028 | 3,588 | 0.09 |
| EUR | 3,741,000 | Finland Government Bond 0.500% 15/09/2029 | 3,240 | 0.08 |
| EUR | 2,763,000 | Finland Government Bond 0.500% 15/04/2043 | 1,726 | 0.04 |
| EUR | 3,000,000 | Finland Government Bond 0.750% 15/04/2031 | 2,555 | 0.06 |
| EUR | 3,459,000 | Finland Government Bond 0.875% 15/09/2025 | 3,291 | 0.08 |
| EUR | 3,626,000 | Finland Government Bond 1.125% 15/04/2034 ¹ | 3,007 | 0.07 |
| EUR | 2,330,000 | Finland Government Bond 1.375% 15/04/2027 | 2,193 | 0.05 |
| EUR | 3,181,000 | Finland Government Bond 1.375% 15/04/2047 | 2,342 | 0.06 |
| EUR | 3,346,000 | Finland Government Bond 1.500% 15/09/2032 | 2,959 | 0.07 |
| EUR | 3,202,000 | Finland Government Bond 2.625% 04/07/2042 | 3,014 | 0.07 |
| EUR | 3,003,000 | Finland Government Bond 2.750% 04/07/2028 ⁸ | 2,983 | 0.07 |
| EUR | 3,128,000 | Finland Government Bond 2.750% 15/04/2038 | 2,991 | 0.07 |
| EUR | 1,808,000 | Finland Government Bond 3.000% 15/09/2033 | 1,809 | 0.04 |
| EUR | 3,088,000 | Finland Government Bond 4.000% 04/07/2025 | 3,129 | 0.08 |
| Total Finland | | | 64,007 | 1.54 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------|------------|--------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| France (30 June 2022: 24.07%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 16,873,000 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/02/2025 ⁵ | 15,979 | 0.38 |
| EUR | 28,743,100 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/03/2025 ⁵ | 27,163 | 0.65 |
| EUR | 29,145,000 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/02/2026 ⁶ | 26,863 | 0.65 |
| EUR | 24,747,000 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/02/2027 ⁷ | 22,234 | 0.53 |
| EUR | 30,470,000 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/11/2029 | 25,488 | 0.61 |
| EUR | 34,574,000 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/11/2030 ⁰ | 28,103 | 0.68 |
| EUR | 33,563,000 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/11/2031 ¹ | 26,508 | 0.64 |
| EUR | 21,822,800 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25/05/2032 | 16,968 | 0.41 |
| EUR | 23,894,000 | French Republic Government Bond OAT 0.250% 25/11/2026 | 21,787 | 0.52 |
| EUR | 33,078,000 | French Republic Government Bond OAT 0.500% 25/05/2025 ⁵ | 31,399 | 0.75 |
| EUR | 33,515,600 | French Republic Government Bond OAT 0.500% 25/05/2026 ⁶ | 31,153 | 0.75 |
| EUR | 38,326,000 | French Republic Government Bond OAT 0.500% 25/05/2029 ⁹ | 33,499 | 0.80 |
| EUR | 13,963,000 | French Republic Government Bond OAT 0.500% 25/05/2040 | 9,121 | 0.22 |
| EUR | 11,728,000 | French Republic Government Bond OAT 0.500% 25/06/2044 | 6,951 | 0.17 |
| EUR | 7,142,000 | French Republic Government Bond OAT 0.500% 25/05/2072 ² | 2,814 | 0.07 |
| EUR | 28,732,000 | French Republic Government Bond OAT 0.750% 25/02/2028 | 26,058 | 0.63 |
| EUR | 34,662,000 | French Republic Government Bond OAT 0.750% 25/05/2028 | 31,311 | 0.75 |
| EUR | 35,774,000 | French Republic Government Bond OAT 0.750% 25/11/2028 ⁸ | 32,049 | 0.77 |
| EUR | 23,326,000 | French Republic Government Bond OAT 0.750% 25/05/2052 | 12,721 | 0.31 |
| EUR | 17,815,000 | French Republic Government Bond OAT 0.750% 25/05/2053 | 9,492 | 0.23 |
| EUR | 23,291,000 | French Republic Government Bond OAT 1.000% 25/11/2025 ⁵ | 22,147 | 0.53 |
| EUR | 35,569,000 | French Republic Government Bond OAT 1.000% 25/05/2027 ⁷ | 33,024 | 0.79 |
| EUR | 26,515,000 | French Republic Government Bond OAT 1.250% 25/05/2034 ⁴ | 22,274 | 0.54 |
| EUR | 28,543,000 | French Republic Government Bond OAT 1.250% 25/05/2036 ⁶ | 23,067 | 0.55 |
| EUR | 8,026,000 | French Republic Government Bond OAT 1.250% 25/05/2038 | 6,232 | 0.15 |
| EUR | 43,239,000 | French Republic Government Bond OAT 1.500% 25/05/2031 ¹ | 39,276 | 0.94 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|---------------------------------------------|------------|--------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| France (30 June 2022: 24.07%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 17,283,000 | French Republic Government Bond OAT 1.500% 25/05/2050 | 12,016 | 0.29 |
| EUR | 19,177,000 | French Republic Government Bond OAT 1.750% 25/11/2024 | 18,756 | 0.45 |
| EUR | 20,755,000 | French Republic Government Bond OAT 1.750% 25/06/2039 | 17,233 | 0.41 |
| EUR | 11,226,000 | French Republic Government Bond OAT 1.750% 25/05/2066 | 7,687 | 0.18 |
| EUR | 28,354,000 | French Republic Government Bond OAT 2.000% 25/11/2032 ² | 26,285 | 0.63 |
| EUR | 19,404,500 | French Republic Government Bond OAT 2.000% 25/05/2048 | 15,349 | 0.37 |
| EUR | 3,363,000 | French Republic Government Bond OAT 2.250% 25/05/2024 ⁴ | 3,326 | 0.08 |
| EUR | 9,331,000 | French Republic Government Bond OAT 2.500% 24/09/2026 | 9,164 | 0.22 |
| EUR | 34,747,000 | French Republic Government Bond OAT 2.500% 25/05/2030 | 34,068 | 0.82 |
| EUR | 3,023,000 | French Republic Government Bond OAT 2.500% 25/05/2043 | 2,691 | 0.07 |
| EUR | 31,279,500 | French Republic Government Bond OAT 2.750% 25/10/2027 | 31,058 | 0.75 |
| EUR | 4,317,000 | French Republic Government Bond OAT 2.750% 25/02/2029 | 4,283 | 0.10 |
| EUR | 12,580,000 | French Republic Government Bond OAT 3.000% 25/05/2033 ³ | 12,649 | 0.30 |
| EUR | 6,832,000 | French Republic Government Bond OAT 3.000% 25/05/2054 | 6,460 | 0.16 |
| EUR | 20,786,000 | French Republic Government Bond OAT 3.250% 25/05/2045 | 20,858 | 0.50 |
| EUR | 28,396,000 | French Republic Government Bond OAT 3.500% 25/04/2026 | 28,691 | 0.69 |
| EUR | 16,321,300 | French Republic Government Bond OAT 4.000% 25/10/2038 | 18,007 | 0.43 |
| EUR | 12,502,500 | French Republic Government Bond OAT 4.000% 25/04/2055 | 14,313 | 0.34 |
| EUR | 11,146,100 | French Republic Government Bond OAT 4.000% 25/04/2060 | 12,947 | 0.31 |
| EUR | 25,296,000 | French Republic Government Bond OAT 4.500% 25/04/2041 | 29,748 | 0.71 |
| EUR | 17,453,500 | French Republic Government Bond OAT 4.750% 25/04/2035 ⁵ | 20,375 | 0.49 |
| EUR | 21,247,000 | French Republic Government Bond OAT 5.500% 25/04/2029 | 24,180 | 0.58 |
| EUR | 20,960,000 | French Republic Government Bond OAT 5.750% 25/10/2032 | 25,775 | 0.62 |
| EUR | 15,371,000 | French Republic Government Bond OAT 6.000% 25/10/2025 | 16,318 | 0.39 |
| Total France | | | 995,918 | 23.91 |
| Germany (30 June 2022: 17.88%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 12,971,000 | Bundesobligation 0.000% 18/10/2024 ⁴ | 12,428 | 0.30 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|----------------------------------------------|------------|-------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| Germany (30 June 2022: 17.88%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 14,836,000 | Bundesobligation 0.000% 11/04/2025 ^a | 14,032 | 0.34 |
| EUR | 25,445,000 | Bundesobligation 0.000% 10/10/2025 ^a | 23,755 | 0.57 |
| EUR | 4,263,000 | Bundesobligation 0.000% 10/10/2025 | 3,986 | 0.10 |
| EUR | 17,181,000 | Bundesobligation 0.000% 10/04/2026 ^a | 15,864 | 0.38 |
| EUR | 14,577,000 | Bundesobligation 0.000% 09/10/2026 ^a | 13,313 | 0.32 |
| EUR | 13,698,000 | Bundesobligation 0.000% 16/04/2027 ^a | 12,381 | 0.30 |
| EUR | 15,278,000 | Bundesobligation 1.300% 15/10/2027 ^a | 14,461 | 0.35 |
| EUR | 5,210,000 | Bundesobligation 1.300% 15/10/2027 | 4,943 | 0.12 |
| EUR | 14,680,000 | Bundesobligation 2.200% 13/04/2028 ^b | 14,426 | 0.35 |
| EUR | 21,590,500 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2026 ^a | 19,805 | 0.48 |
| EUR | 12,395,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/11/2027 ^a | 11,078 | 0.27 |
| EUR | 17,368,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/11/2028 ^a | 15,218 | 0.37 |
| EUR | 20,674,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2029 ^a | 17,832 | 0.43 |
| EUR | 17,116,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/02/2030 ^a | 14,612 | 0.35 |
| EUR | 17,082,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2030 ^a | 14,437 | 0.35 |
| EUR | 6,297,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2030 | 5,330 | 0.13 |
| EUR | 15,909,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/02/2031 ^a | 13,299 | 0.32 |
| EUR | 18,882,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2031 ^a | 15,626 | 0.37 |
| EUR | 6,460,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2031 ^a | 5,352 | 0.13 |
| EUR | 24,608,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/02/2032 ^a | 20,135 | 0.48 |
| EUR | 14,662,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/05/2035 ^a | 11,029 | 0.26 |
| EUR | 14,025,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/05/2036 ^a | 10,272 | 0.25 |
| EUR | 20,495,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2050 ^a | 11,033 | 0.26 |
| EUR | 5,794,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2050 | 3,136 | 0.08 |
| EUR | 14,511,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15/08/2052 | 7,451 | 0.18 |
| EUR | 14,493,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15/02/2027 ^a | 13,276 | 0.32 |
| EUR | 24,604,500 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15/08/2028 ^a | 21,956 | 0.53 |
| EUR | 16,290,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.250% 15/02/2029 ^a | 14,412 | 0.35 |
| EUR | 18,432,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15/02/2025 ^a | 17,653 | 0.42 |
| EUR | 18,200,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15/02/2026 ^a | 17,090 | 0.41 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|----------------------------------------------|------------|-------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Germany (30 June 2022: 17.88%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 19,513,400 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15/08/2027 ^a | 17,911 | 0.43 |
| EUR | 16,943,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.500% 15/02/2028 ^a | 15,437 | 0.37 |
| EUR | 12,095,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.000% 15/08/2024 ^a | 11,787 | 0.28 |
| EUR | 18,180,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.000% 15/08/2025 | 17,405 | 0.42 |
| EUR | 10,828,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.000% 15/05/2038 | 8,842 | 0.21 |
| EUR | 22,015,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.250% 15/08/2048 ^a | 17,500 | 0.42 |
| EUR | 16,047,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.700% 15/08/2032 ^a | 15,180 | 0.36 |
| EUR | 12,421,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.800% 15/08/2053 ^a | 10,857 | 0.26 |
| EUR | 2,740,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 1.800% 15/08/2053 | 2,395 | 0.06 |
| EUR | 15,530,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.100% 15/11/2029 | 15,192 | 0.36 |
| EUR | 20,897,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.300% 15/02/2033 ^a | 20,728 | 0.50 |
| EUR | 4,078,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.300% 15/02/2033 | 4,049 | 0.10 |
| EUR | 17,720,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.500% 04/07/2044 ^a | 17,892 | 0.43 |
| EUR | 21,960,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.500% 15/08/2046 | 22,386 | 0.54 |
| EUR | 11,391,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3.250% 04/07/2042 ^a | 12,698 | 0.30 |
| EUR | 16,753,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.000% 04/01/2037 ^a | 19,666 | 0.47 |
| EUR | 12,840,500 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.250% 04/07/2039 ^a | 15,780 | 0.38 |
| EUR | 7,667,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.750% 04/07/2028 | 8,459 | 0.20 |
| EUR | 14,447,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.750% 04/07/2034 | 17,678 | 0.42 |
| EUR | 11,900,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.750% 04/07/2040 ^a | 15,585 | 0.37 |
| EUR | 13,602,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 5.500% 04/01/2031 ^a | 16,446 | 0.39 |
| EUR | 10,457,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 5.625% 04/01/2028 | 11,796 | 0.28 |
| EUR | 6,644,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 6.250% 04/01/2030 | 8,150 | 0.20 |
| EUR | 7,689,000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 6.500% 04/07/2027 ^a | 8,790 | 0.21 |
| EUR | 875,000 | Bundesschatzanweisungen 0.200% 14/06/2024 ^a | 850 | 0.02 |
| EUR | 10,992,000 | Bundesschatzanweisungen 0.400% 13/09/2024 | 10,615 | 0.25 |
| EUR | 10,572,000 | Bundesschatzanweisungen 2.200% 12/12/2024 ^a | 10,406 | 0.25 |
| EUR | 8,578,000 | Bundesschatzanweisungen 2.500% 13/03/2025 ^a | 8,472 | 0.20 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|----------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| Germany (30 June 2022: 17.88%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 7,112,000 | Bundesschatzanweisungen 2.800% 12/06/2025* | 7,060 | 0.17 |
| Total Germany | | | 779,633 | 18.72 |
| Ireland (30 June 2022: 1.82%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 5,702,000 | Ireland Government Bond 0.000% 18/10/2031 | 4,540 | 0.11 |
| EUR | 5,693,000 | Ireland Government Bond 0.200% 15/05/2027 | 5,122 | 0.12 |
| EUR | 4,458,000 | Ireland Government Bond 0.180% 18/10/2030 | 3,705 | 0.09 |
| EUR | 2,645,000 | Ireland Government Bond 0.350% 18/10/2032 | 2,120 | 0.05 |
| EUR | 4,295,000 | Ireland Government Bond 0.400% 15/05/2035 | 3,218 | 0.08 |
| EUR | 3,908,950 | Ireland Government Bond 0.550% 22/04/2041 | 2,549 | 0.06 |
| EUR | 4,711,690 | Ireland Government Bond 0.900% 15/05/2028* | 4,303 | 0.11 |
| EUR | 5,257,000 | Ireland Government Bond 1.000% 15/05/2026 | 4,972 | 0.12 |
| EUR | 6,533,250 | Ireland Government Bond 1.100% 15/05/2029 | 5,929 | 0.14 |
| EUR | 2,218,500 | Ireland Government Bond 1.300% 15/05/2033* | 1,923 | 0.05 |
| EUR | 3,839,000 | Ireland Government Bond 1.350% 15/05/2031 | 3,466 | 0.08 |
| EUR | 4,740,000 | Ireland Government Bond 1.500% 15/05/2050 | 3,337 | 0.08 |
| EUR | 4,011,500 | Ireland Government Bond 1.700% 15/05/2037 | 3,388 | 0.08 |
| EUR | 6,515,000 | Ireland Government Bond 2.000% 18/02/2045 | 5,318 | 0.13 |
| EUR | 5,644,000 | Ireland Government Bond 2.400% 15/05/2030 | 5,516 | 0.13 |
| EUR | 2,227,000 | Ireland Government Bond 3.000% 18/10/2043 | 2,192 | 0.05 |
| EUR | 7,640,000 | Ireland Government Bond 5.400% 13/03/2025 | 7,919 | 0.19 |
| Total Ireland | | | 69,517 | 1.67 |
| Italy (30 June 2022: 21.87%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 10,259,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 15/08/2024* | 9,840 | 0.24 |
| EUR | 8,485,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 15/12/2024* | 8,039 | 0.19 |
| EUR | 12,218,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01/04/2026 | 11,030 | 0.27 |
| EUR | 10,696,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01/08/2026 | 9,544 | 0.23 |
| EUR | 12,182,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.2500% 15/03/2028 | 10,387 | 0.25 |
| EUR | 13,199,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.350% 01/02/2025 | 12,512 | 0.30 |
| EUR | 14,778,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.450% 15/02/2029 | 12,333 | 0.30 |
| EUR | 10,486,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.500% 01/02/2026 | 9,654 | 0.23 |
| EUR | 8,207,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.500% 15/07/2028 | 7,010 | 0.17 |
| EUR | 11,338,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.600% 01/08/2031* | 8,806 | 0.21 |
| EUR | 13,576,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.850% 15/01/2027 | 12,309 | 0.30 |
| EUR | 14,271,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.900% 01/04/2031 | 11,497 | 0.28 |
| EUR | 11,735,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 15/09/2027 | 10,496 | 0.25 |
| EUR | 9,738,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01/08/2030 | 8,024 | 0.19 |
| EUR | 11,624,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01/12/2031 | 9,218 | 0.22 |
| EUR | 11,227,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01/06/2032* | 8,767 | 0.21 |
| EUR | 9,574,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.950% 01/03/2037 | 6,455 | 0.16 |
| EUR | 8,463,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.100% 01/04/2027 | 7,700 | 0.19 |
| EUR | 8,317,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.200% 15/08/2025 | 7,882 | 0.19 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Italy (30 June 2022: 21.87%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 12,313,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.250% 01/12/2026 | 11,357 | 0.27 |
| EUR | 14,674,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 01/04/2030 | 12,562 | 0.30 |
| EUR | 10,864,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.450% 15/11/2024 | 10,532 | 0.25 |
| EUR | 10,516,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.450% 15/05/2025* | 10,085 | 0.24 |
| EUR | 7,105,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.450% 01/03/2036* | 5,261 | 0.13 |
| EUR | 13,021,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.500% 01/06/2025 | 12,475 | 0.30 |
| EUR | 7,846,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.500% 30/04/2045 | 4,858 | 0.12 |
| EUR | 20,585,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.600% 01/06/2026 | 19,383 | 0.47 |
| EUR | 13,098,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.650% 01/12/2030 | 11,269 | 0.27 |
| EUR | 15,488,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.650% 01/03/2032* | 12,994 | 0.31 |
| EUR | 9,359,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.700% 01/09/2051* | 5,614 | 0.14 |
| EUR | 8,005,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.750% 01/07/2024 | 7,844 | 0.19 |
| EUR | 10,012,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.800% 01/03/2041 | 7,043 | 0.17 |
| EUR | 10,556,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.850% 01/07/2025 | 10,170 | 0.24 |
| EUR | 9,944,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.000% 01/12/2025 | 9,548 | 0.23 |
| EUR | 14,176,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.000% 01/02/2028 | 13,173 | 0.32 |
| EUR | 12,627,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.050% 01/08/2027 | 11,848 | 0.28 |
| EUR | 9,811,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.100% 15/07/2026 | 9,357 | 0.22 |
| EUR | 5,337,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.150% 01/09/2052 | 3,499 | 0.08 |
| EUR | 3,594,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.150% 01/03/2072* | 2,135 | 0.05 |
| EUR | 11,642,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.200% 01/06/2027 | 11,200 | 0.26 |
| EUR | 9,400,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.250% 01/09/2036 | 7,638 | 0.18 |
| EUR | 15,629,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.450% 01/09/2033* | 13,641 | 0.33 |
| EUR | 11,287,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.450% 01/09/2050* | 8,085 | 0.19 |
| EUR | 15,346,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.500% 01/12/2024* | 15,084 | 0.36 |
| EUR | 10,457,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.500% 15/11/2025* | 10,169 | 0.24 |
| EUR | 10,426,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.500% 01/12/2032* | 9,274 | 0.22 |
| EUR | 11,436,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.650% 01/12/2027 | 10,947 | 0.26 |
| EUR | 11,146,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.700% 01/03/2047* | 8,667 | 0.21 |
| EUR | 13,458,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.800% 01/12/2028 | 12,870 | 0.31 |
| EUR | 10,067,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.800% 15/06/2029 | 9,549 | 0.23 |
| EUR | 6,274,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.800% 01/03/2067 | 4,494 | 0.11 |
| EUR | 8,436,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2.950% 01/09/2038 | 7,278 | 0.18 |
| EUR | 21,334,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.000% 01/08/2029 | 20,477 | 0.49 |
| EUR | 8,134,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.100% 01/03/2040 | 7,038 | 0.17 |
| EUR | 6,142,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.250% 01/03/2038 | 5,501 | 0.13 |
| EUR | 10,719,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.250% 01/09/2046* | 9,184 | 0.22 |
| EUR | 9,448,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.350% 01/03/2035* | 8,778 | 0.21 |
| EUR | 11,680,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.400% 28/03/2025 | 11,591 | 0.28 |
| EUR | 10,417,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.400% 01/04/2028 | 10,274 | 0.25 |
| EUR | 11,895,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.450% 01/03/2048 | 10,467 | 0.25 |
| EUR | 9,748,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.500% 15/01/2026 | 9,682 | 0.23 |
| EUR | 17,309,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.500% 01/03/2030 | 17,042 | 0.41 |
| EUR | 6,012,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.700% 15/06/2030 | 5,958 | 0.14 |
| EUR | 11,360,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.750% 01/09/2024 | 11,353 | 0.27 |
| EUR | 7,250,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.800% 15/04/2026 | 7,254 | 0.17 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------|------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| Italy (30 June 2022: 21.87%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 3,530,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.800% 01/08/2028 | 3,538 | 0.09 |
| EUR | 11,818,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.850% 15/12/2029 | 11,845 | 0.28 |
| EUR | 8,914,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3.850% 01/09/2049* | 8,325 | 0.20 |
| EUR | 6,300,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.000% 30/10/2031 | 6,353 | 0.15 |
| EUR | 6,802,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.000% 30/04/2035* | 6,730 | 0.16 |
| EUR | 18,189,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.000% 01/02/2037* | 17,939 | 0.43 |
| EUR | 6,760,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.350% 01/11/2033 | 6,943 | 0.17 |
| EUR | 11,244,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.400% 01/05/2033 | 11,633 | 0.28 |
| EUR | 5,212,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.450% 01/09/2043 | 5,299 | 0.13 |
| EUR | 13,774,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.500% 01/03/2026 | 14,028 | 0.34 |
| EUR | 3,070,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.500% 01/10/2053 | 3,126 | 0.08 |
| EUR | 14,540,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.750% 01/09/2028 | 15,245 | 0.37 |
| EUR | 13,066,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.750% 01/09/2044 | 13,862 | 0.33 |
| EUR | 14,909,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.000% 01/03/2025 | 15,184 | 0.36 |
| EUR | 14,936,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.000% 01/08/2034* | 16,144 | 0.39 |
| EUR | 17,589,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.000% 01/08/2039 | 19,123 | 0.46 |
| EUR | 12,996,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.000% 01/09/2040 | 14,180 | 0.34 |
| EUR | 17,338,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.250% 01/11/2029 | 18,830 | 0.45 |
| EUR | 14,132,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5.750% 01/02/2033 | 16,102 | 0.39 |
| EUR | 18,791,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.000% 01/05/2031 | 21,559 | 0.52 |
| EUR | 15,111,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6.500% 01/11/2027 | 16,813 | 0.40 |
| EUR | 7,600,000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 7.250% 01/11/2026 | 8,432 | 0.20 |
| Total Italy | | | 907,058 | 21.78 |
| Latvia (30 June 2022: 0.10%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 2,360,000 | Latvia Government International Bond 0.000% 24/01/2029 | 1,915 | 0.05 |
| EUR | 400,000 | Latvia Government International Bond 1.375% 23/09/2025 | 379 | 0.01 |
| EUR | 205,000 | Latvia Government International Bond 1.375% 16/05/2036 | 153 | 0.00 |
| EUR | 720,000 | Latvia Government International Bond 1.875% 19/02/2049 | 498 | 0.01 |
| EUR | 400,000 | Latvia Government International Bond 2.250% 15/02/2047 | 303 | 0.01 |
| EUR | 500,000 | Latvia Government International Bond 2.875% 30/04/2024 | 497 | 0.01 |
| Total Latvia | | | 3,745 | 0.09 |
| Lithuania (30 June 2022: 0.12%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 1,409,000 | Lithuania Government International Bond 0.500% 19/06/2029 | 1,173 | 0.03 |
| EUR | 1,250,000 | Lithuania Government International Bond 0.500% 28/07/2050 | 564 | 0.01 |
| EUR | 405,000 | Lithuania Government International Bond 0.750% 06/05/2030 | 334 | 0.01 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|-----------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Lithuania (30 June 2022: 0.12%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 336,000 | Lithuania Government International Bond 0.750% 15/07/2051 | 166 | 0.00 |
| EUR | 500,000 | Lithuania Government International Bond 0.950% 26/05/2027* | 453 | 0.01 |
| EUR | 110,000 | Lithuania Government International Bond 1.250% 22/10/2025 | 104 | 0.00 |
| EUR | 306,000 | Lithuania Government International Bond 1.625% 19/06/2049 | 197 | 0.01 |
| EUR | 500,000 | Lithuania Government International Bond 2.100% 26/05/2047 | 383 | 0.01 |
| EUR | 260,000 | Lithuania Government International Bond 2.125% 29/10/2026* | 248 | 0.01 |
| EUR | 632,000 | Lithuania Government International Bond 2.125% 22/10/2035* | 533 | 0.01 |
| EUR | 1,990,000 | Lithuania Government International Bond 3.875% 14/06/2033 | 1,998 | 0.05 |
| Total Lithuania | | | 6,153 | 0.15 |
| Luxembourg (30 June 2022: 0.16%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 1,230,000 | Luxembourg Government Bond 0.000% 13/11/2026* | 1,102 | 0.03 |
| EUR | 1,000,000 | Luxembourg Government Bond 0.000% 28/04/2030 | 817 | 0.02 |
| EUR | 780,000 | Luxembourg Government Bond 0.625% 01/02/2027* | 710 | 0.02 |
| EUR | 212,000 | Luxembourg Government Bond 2.125% 10/07/2023 | 212 | 0.01 |
| EUR | 2,109,000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg 0.000% 24/03/2031 | 1,679 | 0.04 |
| EUR | 1,360,000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg 0.000% 14/09/2032 | 1,040 | 0.02 |
| EUR | 637,000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg 1.750% 25/05/2042 | 516 | 0.01 |
| EUR | 1,310,000 | State of the Grand-Duchy of Luxembourg 3.250% 02/03/2043 | 1,343 | 0.03 |
| Total Luxembourg | | | 7,419 | 0.18 |
| Netherlands (30 June 2022: 4.71%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 9,297,000 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/01/2026 | 8,611 | 0.21 |
| EUR | 8,600,000 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/01/2027 | 7,774 | 0.19 |
| EUR | 7,073,000 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/01/2029 | 6,082 | 0.15 |
| EUR | 6,468,000 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/07/2030* | 5,369 | 0.13 |
| EUR | 12,010,000 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/07/2031 | 9,715 | 0.23 |
| EUR | 6,223,000 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/01/2038 | 4,182 | 0.10 |
| EUR | 11,311,010 | Netherlands Government Bond 0.000% 15/01/2052 | 5,517 | 0.13 |
| EUR | 11,979,600 | Netherlands Government Bond 0.250% 15/07/2025* | 11,304 | 0.27 |
| EUR | 7,879,000 | Netherlands Government Bond 0.250% 15/07/2029 | 6,813 | 0.16 |
| EUR | 12,952,200 | Netherlands Government Bond 0.500% 15/07/2026* | 12,032 | 0.29 |
| EUR | 7,913,000 | Netherlands Government Bond 0.500% 15/07/2032 | 6,540 | 0.16 |
| EUR | 10,420,000 | Netherlands Government Bond 0.500% 15/01/2040* | 7,343 | 0.18 |
| EUR | 9,812,000 | Netherlands Government Bond 0.750% 15/07/2027* | 9,043 | 0.22 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|-------------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| Netherlands (30 June 2022: 4.71%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 12,091,292 | Netherlands Government Bond 0.750% 15/07/2028 [*] | 10,956 | 0.26 |
| EUR | 8,275,000 | Netherlands Government Bond 2.000% 15/07/2024 [*] | 8,157 | 0.20 |
| EUR | 4,643,000 | Netherlands Government Bond 2.000% 15/01/2054 | 4,034 | 0.10 |
| EUR | 2,706,000 | Netherlands Government Bond 2.500% 15/01/2030 | 2,665 | 0.06 |
| EUR | 9,671,000 | Netherlands Government Bond 2.500% 15/01/2033 [*] | 9,520 | 0.23 |
| EUR | 3,520,000 | Netherlands Government Bond 2.500% 15/07/2033 | 3,447 | 0.08 |
| EUR | 12,375,000 | Netherlands Government Bond 2.750% 15/01/2047 [*] | 12,622 | 0.30 |
| EUR | 11,799,000 | Netherlands Government Bond 3.750% 15/01/2042 | 13,537 | 0.32 |
| EUR | 11,131,500 | Netherlands Government Bond 4.000% 15/01/2037 [*] | 12,653 | 0.30 |
| EUR | 7,658,000 | Netherlands Government Bond 5.500% 15/01/2028 | 8,520 | 0.20 |
| Total Netherlands | | | 186,436 | 4.47 |
| Portugal (30 June 2022: 2.26%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 3,828,498 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.300% 17/10/2031 | 3,071 | 0.08 |
| EUR | 6,841,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.475% 18/10/2030 | 5,723 | 0.14 |
| EUR | 2,326,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.700% 15/10/2027 [*] | 2,119 | 0.05 |
| EUR | 3,299,390 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 0.900% 12/10/2035 | 2,484 | 0.06 |
| EUR | 2,200,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.000% 12/04/2052 | 1,214 | 0.03 |
| EUR | 2,228,050 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.150% 11/04/2042 | 1,521 | 0.04 |
| EUR | 5,804,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.650% 16/07/2032 [*] | 5,142 | 0.12 |
| EUR | 7,082,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 1.950% 15/06/2029 | 6,694 | 0.16 |
| EUR | 10,506,800 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.125% 17/10/2028 | 10,090 | 0.24 |
| EUR | 5,551,500 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.250% 18/04/2034 [*] | 5,050 | 0.12 |
| EUR | 8,213,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.875% 15/10/2025 | 8,193 | 0.20 |
| EUR | 9,207,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 2.875% 21/07/2026 | 9,190 | 0.22 |
| EUR | 1,794,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3.500% 18/06/2038 [*] | 1,796 | 0.04 |
| EUR | 5,504,178 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 3.875% 15/02/2030 [*] | 5,797 | 0.14 |
| EUR | 6,363,182 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.100% 15/04/2037 | 6,806 | 0.16 |
| EUR | 3,995,000 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.100% 15/02/2045 [*] | 4,357 | 0.11 |
| EUR | 4,136,330 | Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4.125% 14/04/2027 | 4,311 | 0.10 |
| Total Portugal | | | 83,558 | 2.01 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|---------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Slovakia (30 June 2022: 0.67%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 474,000 | Slovakia Government Bond 0.000% 17/06/2024 [*] | 459 | 0.01 |
| EUR | 2,677,000 | Slovakia Government Bond 0.250% 14/05/2025 [*] | 2,520 | 0.06 |
| EUR | 1,155,000 | Slovakia Government Bond 0.375% 21/04/2036 [*] | 752 | 0.02 |
| EUR | 2,305,000 | Slovakia Government Bond 0.625% 22/05/2026 [*] | 2,130 | 0.05 |
| EUR | 1,968,000 | Slovakia Government Bond 0.750% 09/04/2030 [*] | 1,646 | 0.04 |
| EUR | 902,000 | Slovakia Government Bond 1.000% 12/06/2028 [*] | 805 | 0.02 |
| EUR | 1,620,000 | Slovakia Government Bond 1.000% 12/06/2028 | 1,445 | 0.04 |
| EUR | 1,610,000 | Slovakia Government Bond 1.000% 09/10/2030 | 1,351 | 0.03 |
| EUR | 1,781,000 | Slovakia Government Bond 1.000% 14/05/2032 [*] | 1,444 | 0.04 |
| EUR | 866,000 | Slovakia Government Bond 1.000% 13/10/2051 | 457 | 0.01 |
| EUR | 2,549,395 | Slovakia Government Bond 1.375% 21/01/2027 [*] | 2,380 | 0.06 |
| EUR | 2,548,000 | Slovakia Government Bond 1.625% 21/01/2031 [*] | 2,237 | 0.05 |
| EUR | 1,599,000 | Slovakia Government Bond 1.875% 09/03/2037 | 1,277 | 0.03 |
| EUR | 1,803,000 | Slovakia Government Bond 2.000% 17/10/2047 | 1,290 | 0.03 |
| EUR | 173,000 | Slovakia Government Bond 2.250% 12/06/2068 | 122 | 0.00 |
| EUR | 1,395,000 | Slovakia Government Bond 3.375% 15/11/2024 | 1,392 | 0.03 |
| EUR | 968,000 | Slovakia Government Bond 3.625% 16/01/2029 [*] | 988 | 0.02 |
| EUR | 2,030,000 | Slovakia Government Bond 3.750% 23/02/2035 | 2,011 | 0.05 |
| EUR | 572,000 | Slovakia Government Bond 3.875% 08/02/2033 [*] | 582 | 0.01 |
| EUR | 2,750,000 | Slovakia Government Bond 4.000% 19/10/2032 [*] | 2,827 | 0.07 |
| EUR | 554,000 | Slovakia Government Bond 4.000% 23/02/2043 | 564 | 0.01 |
| EUR | 1,875,000 | Slovakia Government Bond 4.350% 14/10/2025 [*] | 1,907 | 0.05 |
| Total Slovakia | | | 30,576 | 0.73 |
| Slovenia (30 June 2022: 0.45%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 582,000 | Slovenia Government Bond 0.000% 12/02/2031 | 456 | 0.01 |
| EUR | 839,000 | Slovenia Government Bond 0.275% 14/01/2030 [*] | 693 | 0.02 |
| EUR | 1,123,000 | Slovenia Government Bond 0.488% 20/10/2050 | 544 | 0.01 |
| EUR | 252,000 | Slovenia Government Bond 0.688% 03/03/2081 | 115 | 0.00 |
| EUR | 684,000 | Slovenia Government Bond 0.875% 15/07/2030 [*] | 583 | 0.01 |
| EUR | 363,000 | Slovenia Government Bond 1.000% 06/03/2028 | 327 | 0.01 |
| EUR | 1,904,000 | Slovenia Government Bond 1.187% 14/03/2029 [*] | 1,696 | 0.04 |
| EUR | 2,235,000 | Slovenia Government Bond 1.250% 22/03/2027 | 2,075 | 0.05 |
| EUR | 1,320,000 | Slovenia Government Bond 1.500% 25/03/2035 [*] | 1,066 | 0.03 |
| EUR | 2,330,000 | Slovenia Government Bond 1.750% 03/11/2040 [*] | 1,773 | 0.04 |
| EUR | 3,412,000 | Slovenia Government Bond 2.125% 28/07/2025 | 3,362 | 0.08 |
| EUR | 4,907,000 | Slovenia Government Bond 2.250% 03/03/2032 [*] | 4,547 | 0.11 |
| EUR | 1,169,000 | Slovenia Government Bond 3.125% 07/08/2045 | 1,088 | 0.03 |
| EUR | 528,000 | Slovenia Government Bond 3.625% 11/03/2033 [*] | 546 | 0.01 |
| EUR | 264,000 | Slovenia Government Bond 5.125% 30/03/2026 | 277 | 0.01 |
| Total Slovenia | | | 19,148 | 0.46 |
| Spain (30 June 2022: 14.37%) | | | | |
| Government Bonds | | | | |
| EUR | 14,473,000 | Spain Government Bond 0.000% 31/01/2025 | 13,711 | 0.33 |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Bonds (30 June 2022: 99.01%) (cont) | | | | |
| Spain (30 June 2022: 14.37%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 15,424,000 | Spain Government Bond 0.000% 31/05/2025 | 14,447 | 0.35 |
| EUR | 11,089,000 | Spain Government Bond 0.000% 31/01/2026 | 10,184 | 0.24 |
| EUR | 20,607,000 | Spain Government Bond 0.000% 31/01/2027 | 18,345 | 0.44 |
| EUR | 19,884,000 | Spain Government Bond 0.000% 31/01/2028 | 17,179 | 0.41 |
| EUR | 13,761,000 | Spain Government Bond 0.100% 30/04/2031 | 10,794 | 0.26 |
| EUR | 6,982,000 | Spain Government Bond 0.250% 30/07/2024 | 6,734 | 0.16 |
| EUR | 16,294,000 | Spain Government Bond 0.500% 30/04/2030 | 13,613 | 0.33 |
| EUR | 13,272,000 | Spain Government Bond 0.500% 31/10/2031 | 10,614 | 0.25 |
| EUR | 12,995,000 | Spain Government Bond 0.600% 31/10/2029 | 11,078 | 0.27 |
| EUR | 13,744,000 | Spain Government Bond 0.700% 30/04/2032 | 11,040 | 0.26 |
| EUR | 13,502,000 | Spain Government Bond 0.800% 30/07/2027 | 12,253 | 0.29 |
| EUR | 9,187,000 | Spain Government Bond 0.800% 30/07/2029 | 7,961 | 0.19 |
| EUR | 9,038,000 | Spain Government Bond 0.850% 30/07/2037 | 6,315 | 0.15 |
| EUR | 5,654,000 | Spain Government Bond 1.000% 30/07/2042 | 3,566 | 0.09 |
| EUR | 13,050,000 | Spain Government Bond 1.000% 31/10/2050 | 6,996 | 0.17 |
| EUR | 11,661,000 | Spain Government Bond 1.200% 31/10/2040 | 7,968 | 0.19 |
| EUR | 15,476,000 | Spain Government Bond 1.250% 31/10/2030 | 13,479 | 0.32 |
| EUR | 13,860,000 | Spain Government Bond 1.300% 31/10/2026 | 13,010 | 0.31 |
| EUR | 15,951,000 | Spain Government Bond 1.400% 30/04/2028 | 14,667 | 0.35 |
| EUR | 14,097,000 | Spain Government Bond 1.400% 30/07/2028 | 12,912 | 0.31 |
| EUR | 15,175,000 | Spain Government Bond 1.450% 31/10/2027 | 14,084 | 0.34 |
| EUR | 11,993,000 | Spain Government Bond 1.450% 30/04/2029 | 10,888 | 0.26 |
| EUR | 4,042,000 | Spain Government Bond 1.450% 31/10/2071 | 1,962 | 0.05 |
| EUR | 12,674,000 | Spain Government Bond 1.500% 30/04/2027 ^a | 11,881 | 0.29 |
| EUR | 14,268,000 | Spain Government Bond 1.600% 30/04/2025 ^a | 13,811 | 0.33 |
| EUR | 13,366,000 | Spain Government Bond 1.850% 30/07/2035 | 11,228 | 0.27 |

| 通貨 | 保有 | 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|--------------------------------------------|------------|------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Spain (30 June 2022: 14.37%) (cont) | | | | |
| Government Bonds (cont) | | | | |
| EUR | 8,071,000 | Spain Government Bond 1.900% 31/10/2052 | 5,347 | 0.13 |
| EUR | 10,980,000 | Spain Government Bond 1.950% 30/04/2026 | 10,575 | 0.25 |
| EUR | 16,584,000 | Spain Government Bond 1.950% 30/07/2030 | 15,250 | 0.37 |
| EUR | 14,890,000 | Spain Government Bond 2.150% 31/10/2025 | 14,504 | 0.35 |
| EUR | 11,573,000 | Spain Government Bond 2.350% 30/07/2033 ^a | 10,561 | 0.25 |
| EUR | 14,290,000 | Spain Government Bond 2.550% 31/10/2032 | 13,393 | 0.32 |
| EUR | 13,328,000 | Spain Government Bond 2.700% 31/10/2048 | 10,992 | 0.26 |
| EUR | 16,719,000 | Spain Government Bond 2.750% 31/10/2024 ^a | 16,572 | 0.40 |
| EUR | 7,878,000 | Spain Government Bond 2.800% 31/05/2026 | 7,750 | 0.19 |
| EUR | 10,622,000 | Spain Government Bond 2.900% 31/10/2046 | 9,201 | 0.22 |
| EUR | 13,581,000 | Spain Government Bond 3.150% 30/04/2033 | 13,316 | 0.32 |
| EUR | 6,070,000 | Spain Government Bond 3.450% 30/07/2043 | 5,770 | 0.14 |
| EUR | 8,780,000 | Spain Government Bond 3.450% 30/07/2066 | 8,007 | 0.19 |
| EUR | 7,070,000 | Spain Government Bond 3.550% 31/10/2033 | 7,132 | 0.17 |
| EUR | 2,530,000 | Spain Government Bond 3.900% 30/07/2039 | 2,587 | 0.06 |
| EUR | 13,233,000 | Spain Government Bond 4.200% 31/01/2037 | 14,112 | 0.34 |
| EUR | 13,393,000 | Spain Government Bond 4.650% 30/07/2025 | 13,719 | 0.33 |
| EUR | 13,143,000 | Spain Government Bond 4.700% 30/07/2041 ^a | 14,851 | 0.36 |
| EUR | 15,462,000 | Spain Government Bond 4.900% 30/07/2040 | 17,813 | 0.43 |
| EUR | 10,254,000 | Spain Government Bond 5.150% 31/10/2028 | 11,199 | 0.27 |
| EUR | 9,686,000 | Spain Government Bond 5.150% 31/10/2044 | 11,617 | 0.28 |
| EUR | 17,698,000 | Spain Government Bond 5.750% 30/07/2032 ^a | 21,079 | 0.51 |
| EUR | 17,473,000 | Spain Government Bond 5.900% 30/07/2026 | 18,760 | 0.45 |
| EUR | 18,881,000 | Spain Government Bond 6.000% 31/01/2029 | 21,513 | 0.52 |
| Total Spain | | | 596,340 | 14.32 |
| Total bonds | | | 4,138,790 | 99.37 |

| 通貨 | 買い金額 | 通貨 | 売り金額 | 原資産 エクスポージャー (ユーロ) | 満期日 | 未実現 利益/(損失) 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|---------------------------------------------------------------------|------------|-----|-------------|--------------------------|------------|---------------------------------|-----------------|
| Financial derivative instruments (30 June 2022: 0.03%) | | | | | | | |
| Forward currency contracts^a (30 June 2022: 0.03%) | | | | | | | |
| CHF | 99,659,169 | EUR | 102,459,485 | 102,459,485 | 05/07/2023 | (351) | (0.01) |
| EUR | 424,699 | CHF | 412,213 | 424,699 | 05/07/2023 | 2 | 0.00 |
| EUR | 420,517 | CHF | 410,875 | 420,517 | 05/07/2023 | - | 0.00 |
| Total unrealised gains on forward currency contracts | | | | | | 2 | 0.00 |
| Total unrealised losses on forward currency contracts | | | | | | (351) | (0.01) |
| Net unrealised losses on forward currency contracts | | | | | | (349) | (0.01) |
| Total financial derivative instruments | | | | | | (349) | (0.01) |

(2023年6月30日現在)

| 通貨 保有 銘柄 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Total value of investments | 4,138,441 | 99.36 |
| Cash equivalents (30 June 2022: 0.27%) | | |
| UCITS collective investment schemes - Money Market Funds (30 June 2022: 0.27%) | | |
| EUR 195,541 BlackRock ICS Euro Liquid Environmentally Aware Fund [†] | 19,517 | 0.47 |
| Bank overdraft[‡] | (1,151) | (0.03) |
| Other net assets | 8,416 | 0.20 |
| Net asset value attributable to redeemable shareholders at the end of the financial year | 4,165,223 | 100.00 |

[†]Substantially all cash positions are held with State Street Bank and Trust Company.

[‡]These securities are partially or fully transferred as securities lent.

[‡]The counterparty for forward currency contracts is State Street Bank and Trust Company. All forwards relate to the CHF Hedged (Acc) Class.

[‡]Investment in related party.

Fixed income securities are primarily classified by country/geographic region of issuer for government type fixed income securities.

Underlying exposure has been calculated according to the guidelines issued by ESMA and represents the market value of an equivalent position in the assets underlying each financial derivative instrument.

| 全負債の総流動資産総額の概要 | 公正価値 単位 (EUR' 000) | 対 純資産 比率% |
|------------------------------------------------------------------------|--------------------------|-----------------|
| Transferable securities admitted to an official stock exchange listing | 4,138,790 | 97.72 |
| Over-the-counter financial derivative instruments | 2 | 0.00 |
| UCITS collective investment schemes - Money Market Funds | 19,517 | 0.46 |
| Other assets | 76,936 | 1.82 |
| Total current assets | 4,235,245 | 100.00 |

米国投資適格債券マザーファンド

《第9期》決算日2024年4月15日

[計算期間：2023年10月17日～2024年4月15日]

「米国投資適格債券マザーファンド」は、4月15日に第9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9期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|-------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針 | 米ドル建て投資適格債券指数への運動をめざす上場投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建て投資適格債券に投資を行います。 上場投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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 | 上場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 | 期 騰 落 中 率 | | 投 資 信 託 証券 組 入 比 率 | 純 総 資 産 額 |
|-----------------|---------|-----------|------|--------------------|--------------|
| | | 円 | % | | |
| 5期(2022年4月15日) | 11,015 | | △2.8 | 98.1 | 百万円 4,387 |
| 6期(2022年10月17日) | 11,445 | | 3.9 | 96.3 | 5,804 |
| 7期(2023年4月17日) | 11,427 | | △0.2 | 96.8 | 4,945 |
| 8期(2023年10月16日) | 12,097 | | 5.9 | 98.4 | 16,495 |
| 9期(2024年4月15日) | 13,234 | | 9.4 | 96.6 | 28,877 |

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 | 月 | 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 投 資 信 託 組 入 比 | 託 券 率 |
|---|-------------|---|---------|-------|------|---------------|-------|
| | | | | | | | |
| | (期 首) | | 円 | | % | | % |
| | 2023年10月16日 | | 12,097 | | — | | 98.4 |
| | 10月末 | | 11,850 | △ | 2.0 | | 96.9 |
| | 11月末 | | 12,558 | | 3.8 | | 97.0 |
| | 12月末 | | 12,660 | | 4.7 | | 96.5 |
| | 2024年1月末 | | 13,037 | | 7.8 | | 96.7 |
| | 2月末 | | 13,078 | | 8.1 | | 96.7 |
| | 3月末 | | 13,353 | | 10.4 | | 96.6 |
| | (期 末) | | | | | | |
| | 2024年4月15日 | | 13,234 | | 9.4 | | 96.6 |

(注) 騰落率は期首比。

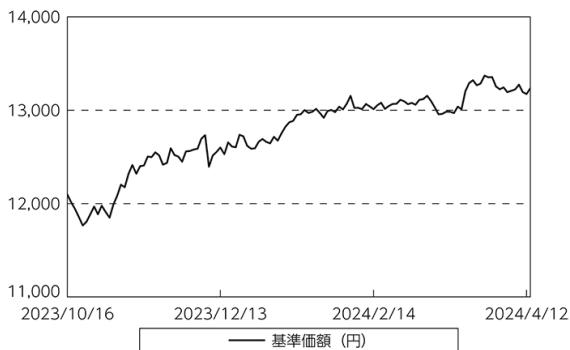
○運用経過

●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9.4%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の変動要因

(上昇要因)

米ドル建て投資適格債券が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎米ドル建て投資適格債券市況

・米ドル建て投資適格債券市況は、米連邦公開市場委員会（FOMC）の金利据え置き決定や利下げ期待の高まりなどによる米金利低下を背景に、上昇しました。

◎為替市況

・為替市況は、期間の初めに比べ2.6%の円安・米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

・米ドル建て投資適格債券指数への連動をめざす上場投資信託証券の組入れを高位に保ちました。

○今後の運用方針

・米ドル建て投資適格債券指数への連動をめざす上場投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建て投資適格債券に投資を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年10月17日～2024年4月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) | 円 1 (1) | % 0.007 (0.007) | (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 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 (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 1 (1) (0) | 0.004 (0.004) (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 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 2 | 0.011 | |
| 期中の平均基準価額は、12,768円です。 | | | |

(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) 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。

○ 売買及び取引の状況

(2023年10月17日～2024年4月15日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------------------------------|-----|---------|-----|---------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 | アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| | ISHARES IBOXX INVESTMENT GRA | 841 | 89,813 | 197 | 21,465 |

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2023年10月17日～2024年4月15日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|------------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 13,033 | 百万円 12,152 | % 93.2 | 百万円 3,229 | 百万円 3,229 | % 100.0 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2024年4月15日現在)

外国投資信託証券

| 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) ISHARES IBOX INVESTMENT GRA | 千口 1,070 | 千口 1,714 | 千アメリカドル 181,836 | 千円 27,904,609 | % 96.6 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | - | < 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) 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。

○投資信託財産の構成

(2024年4月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 27,904,609 | % 96.6 |
| コール・ローン等、その他 | 973,122 | 3.4 |
| 投資信託財産総額 | 28,877,731 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(28,591,189千円)の投資信託財産総額(28,877,731千円)に対する比率は99.0%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=153.46円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年4月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 28,877,731,944 |
| コール・ローン等 | 879,281,846 |
| 投資証券(評価額) | 27,904,609,343 |
| 未収配当金 | 93,840,250 |
| 未収利息 | 505 |
| (B) 負債 | 0 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 28,877,731,944 |
| 元本 | 21,821,177,142 |
| 次期繰越損益金 | 7,056,554,802 |
| (D) 受益権総口数 | 21,821,177,142口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,234円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 13,636,104,069円
 期中追加設定元本額 10,828,215,014円
 期中一部解約元本額 2,643,141,941円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3234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)

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 17,457,095,942円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 2,195,974,644円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 859,438,484円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定) | 276,698,315円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定) | 274,816,412円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定) | 273,441,087円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定) | 241,983,142円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定) | 241,729,116円 |
| 合計 | 21,821,177,142円 |

[お知らせ]

新NISA(成長投資枠)の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2023年12月29日)

○損益の状況 (2023年10月17日~2024年4月15日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 533,903,019 |
| 受取配当金 | 520,786,253 |
| 受取利息 | 13,127,074 |
| 支払利息 | △ 10,308 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,573,869,134 |
| 売買益 | 1,596,870,062 |
| 売買損 | △ 23,000,928 |
| (C) 保管費用等 | △ 999,230 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,106,772,923 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,859,189,731 |
| (F) 追加信託差損益金 | 2,875,774,986 |
| (G) 解約差損益金 | △ 785,182,838 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 7,056,554,802 |
| 次期繰越損益金(H) | 7,056,554,802 |

- (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) (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。

米国ハイイールド債券マザーファンド

《第9期》決算日2024年4月15日

[計算期間：2023年10月17日～2024年4月15日]

「米国ハイイールド債券マザーファンド」は、4月15日に第9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9期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|-------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運 用 方 針 | 米ドル建てハイイールド債券指数への運動をめざす上場投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建てハイイールド債券に投資を行います。 上場投資信託証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。 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 | 上場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 | | 投 資 信 託 証券 組 入 比 率 | 純 総 資 産 額 |
|-----------------|--------|-------|------|--------------------|-----------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 | | |
| 5期(2022年4月15日) | 円 | | % | % | 百万円 |
| | 11,723 | | 3.9 | 97.3 | 2,646 |
| 6期(2022年10月17日) | 12,431 | | 6.0 | 96.9 | 5,482 |
| 7期(2023年4月17日) | 12,153 | △ | 2.2 | 96.5 | 9,371 |
| 8期(2023年10月16日) | 13,498 | | 11.1 | 100.1 | 7,145 |
| 9期(2024年4月15日) | 15,039 | | 11.4 | 97.8 | 15,122 |

(注) 当ファンドの値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 | 月 | 日 | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | | 投 資 組 入 比 | 信 託 券 率 |
|---|-------------|---|---------|-------|------|-----------|---------|
| | | | | 騰 | 落 | | |
| | (期 首) | | 円 | | % | | % |
| | 2023年10月16日 | | 13,498 | | — | | 100.1 |
| | 10月末 | | 13,411 | △ | 0.6 | | 97.0 |
| | 11月末 | | 13,865 | | 2.7 | | 96.4 |
| | 12月末 | | 13,820 | | 2.4 | | 96.6 |
| | 2024年1月末 | | 14,384 | | 6.6 | | 97.0 |
| | 2月末 | | 14,664 | | 8.6 | | 101.8 |
| | 3月末 | | 15,038 | | 11.4 | | 96.3 |
| | (期 末) | | | | | | |
| | 2024年4月15日 | | 15,039 | | 11.4 | | 97.8 |

(注) 騰落率は期首比。

○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11.4%の上昇となりました。

基準価額等の推移



●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

米ドル建てハイイールド債券が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

●投資環境について

◎米ドル建てハイイールド債券市況

・米ドル建てハイイールド債券市況は、米連邦公開市場委員会（FOMC）の金利据え置き決定や利下げ期待の高まりなどによる米金利低下を背景に、上昇しました。

◎為替市況

・為替市況は、期間の初めに比べ2.6%の円安・米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

・米ドル建てハイイールド債券指数への連動をめざす上場投資信託証券の組入れを高位に保ちました。

○今後の運用方針

・米ドル建てハイイールド債券指数への連動をめざす上場投資信託証券への投資を通じて、主として米ドル建てハイイールド債券に投資を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年10月17日～2024年4月15日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) | 円 2 (2) | % 0.011 (0.011) | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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 (投 資 信 託 証 券) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 1 (1) (0) | 0.005 (0.005) (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 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合 計 | 3 | 0.016 | |
| 期中の平均基準価額は、14,231円です。 | | | |

(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) 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。

○ 売買及び取引の状況

(2023年10月17日～2024年4月15日)

投資信託証券

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|------------------------------|-----|---------|-----|---------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 千口 | 千アメリカドル | 千口 | 千アメリカドル |
| | SPDR BLOOMBERG HIGH YIELD BO | 674 | 63,908 | 179 | 16,652 |

(注) 金額は受渡代金。

○利害関係人との取引状況等

(2023年10月17日～2024年4月15日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 為替直物取引 | 9,517 | 2,087 | 21.9 | 2,474 | 2,474 | 100.0 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2024年4月15日現在)

外国投資信託証券

| 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) SPDR BLOOMBERG HIGH YIELD BO | 千口 536 | 千口 1,031 | 千アメリカドル 96,362 | 千円 14,787,778 | % 97.8 |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | - | < 97.8% > |

(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< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

○投資信託財産の構成

(2024年4月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 14,787,778 | % 96.5 |
| コール・ローン等、その他 | 528,519 | 3.5 |
| 投資信託財産総額 | 15,316,297 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産(14,972,218千円)の投資信託財産総額(15,316,297千円)に対する比率は97.8%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=153.46円 | | |
|------------------|--|--|

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年4月15日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 15,439,046,356 |
| コール・ローン等 | 528,518,630 |
| 投資証券(評価額) | 14,787,778,421 |
| 未収入金 | 122,749,040 |
| 未収利息 | 265 |
| (B) 負債 | 316,370,739 |
| 未払金 | 316,370,739 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 15,122,675,617 |
| 元本 | 10,055,402,720 |
| 次期繰越損益金 | 5,067,272,897 |
| (D) 受益権総口数 | 10,055,402,720口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 15,039円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 5,293,604,352円
 期中追加設定元本額 6,609,103,682円
 期中一部解約元本額 1,847,305,314円
 また、1口当たり純資産額は、期末15,039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)

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 8,207,792,966円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 1,149,179,961円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 394,045,058円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12(適格機関投資家限定) | 64,146,991円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07(適格機関投資家限定) | 63,702,997円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10(適格機関投資家限定) | 63,391,843円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06(適格機関投資家限定) | 57,043,944円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03(適格機関投資家限定) | 56,098,960円 |
| 合計 | 10,055,402,720円 |

【お知らせ】

新NISA(成長投資枠)の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。

(2023年12月29日)

○損益の状況 (2023年10月17日~2024年4月15日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 280,843,796 |
| 受取配当金 | 276,618,116 |
| 受取利息 | 4,229,969 |
| 支払利息 | △ 4,289 |
| (B) 有価証券売買損益 | 447,088,543 |
| 売買益 | 512,957,891 |
| 売買損 | △ 65,869,348 |
| (C) 保管費用等 | △ 407,906 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 727,524,433 |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,851,732,977 |
| (F) 追加信託差損益金 | 3,195,336,318 |
| (G) 解約差損益金 | △ 707,320,831 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 5,067,272,897 |
| 次期繰越損益金(H) | 5,067,272,897 |

- (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) (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15期》決算日2024年1月26日

[計算期間：2023年1月27日～2024年1月26日]

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月26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 | 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。 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 (配当込み) | | 投資信託証券 組入比率 | 不動産 投信指 先物比 率 | 純総 資産 額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------|-------|----------------|------------------------|---------------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2020年1月27日) | 36,432 | 23.6 | 4,533.90 | 23.5 | 98.4 | 1.6 | 35,177 |
| 12期(2021年1月26日) | 31,049 | △14.8 | 3,872.69 | △14.6 | 98.0 | 2.0 | 42,741 |
| 13期(2022年1月26日) | 34,244 | 10.3 | 4,269.20 | 10.2 | 98.9 | 1.2 | 62,254 |
| 14期(2023年1月26日) | 34,199 | △0.1 | 4,262.37 | △0.2 | 98.1 | 1.9 | 77,896 |
| 15期(2024年1月26日) | 35,281 | 3.2 | 4,390.19 | 3.0 | 98.4 | 1.8 | 102,201 |

(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指数の指数値及び東証REIT指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証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J P X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 月 日 | 基 準 価 額 | | 東 証 R E I T 指 数 | | 投 資 信 託 組 入 比 率 | 不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率 |
|--------------------|---------|-------|-----------------|-------|-----------------|-----------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (配 当 込 み) | 騰 落 率 | | |
| (期首) 2023年1月26日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 34,199 | — | 4,262.37 | — | 98.1 | 1.9 |
| 1月末 | 34,206 | 0.0 | 4,263.06 | 0.0 | 98.2 | 1.9 |
| 2月末 | 34,744 | 1.6 | 4,331.37 | 1.6 | 98.1 | 1.8 |
| 3月末 | 33,734 | △1.4 | 4,204.73 | △1.4 | 98.2 | 1.8 |
| 4月末 | 35,464 | 3.7 | 4,420.34 | 3.7 | 98.1 | 1.8 |
| 5月末 | 35,695 | 4.4 | 4,448.91 | 4.4 | 98.0 | 2.1 |
| 6月末 | 35,474 | 3.7 | 4,421.28 | 3.7 | 98.0 | 2.2 |
| 7月末 | 35,894 | 5.0 | 4,472.88 | 4.9 | 98.2 | 1.9 |
| 8月末 | 36,429 | 6.5 | 4,539.20 | 6.5 | 98.1 | 1.9 |
| 9月末 | 35,860 | 4.9 | 4,468.30 | 4.8 | 98.2 | 1.8 |
| 10月末 | 35,119 | 2.7 | 4,372.14 | 2.6 | 97.9 | 2.1 |
| 11月末 | 35,802 | 4.7 | 4,455.46 | 4.5 | 98.2 | 1.9 |
| 12月末 | 35,217 | 3.0 | 4,382.85 | 2.8 | 98.0 | 2.0 |
| (期末) 2024年1月26日 | 35,281 | 3.2 | 4,390.19 | 3.0 | 98.4 | 1.8 |

(注) 騰落率は期首比。

(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

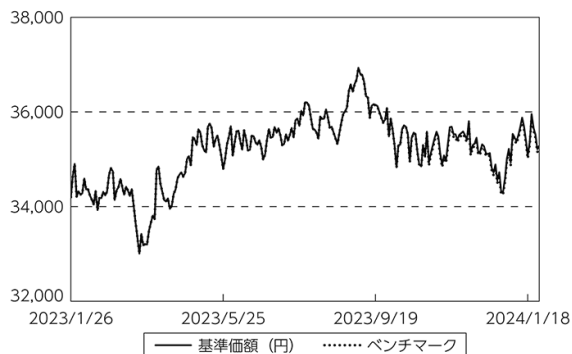
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ3.2%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(3.0%)を0.2%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**◎ 国内REIT市況**

- ・ 国内REIT市況は上昇しました。
- ・ 日銀による金融緩和政策維持観測等により国内REIT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3.0%の上昇となったため、乖離は0.2%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：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1月27日～2024年1月26日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|-------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (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 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 |
| (投 資 信 託 証 券) | 0 | 0.001 | |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | (0) | (0.000) | |
| 期中の平均基準価額は、35,190円です。 | | | |

(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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年1月27日～2024年1月26日)

投資信託証券

| 銘 | 柄 | 買 | | 付 | | 売 | | 付 | |
|---------------------|-------------------------|----------|-------------|---------------|-------|-------|---------|---------|---|
| | | 口 | 数 | 金 | 額 | 口 | 数 | 金 | 額 |
| | | 千口 | | 千円 | | 千口 | | 千円 | |
| 国 | エスコンジャパンリート投資法人 | 0.589 | | 68,569 | | 0.119 | | 13,762 | |
| | サンケイリアルエステート投資法人 | 0.932 | | 83,311 | | 0.191 | | 16,804 | |
| | S O S i L A物流リート投資法人 | 1 | | 186,581 | | 0.301 | | 38,817 | |
| | 東海道リート投資法人 | 0.537 | | 65,461 | | 0.243 | | 29,300 | |
| | | (0.251) | | (29,166) | | | | | |
| | 日本アコモデーションファンド投資法人 | 1 | | 630,616 | | 0.208 | | 132,188 | |
| | 森ヒルズリート投資法人 | 3 | | 497,680 | | 0.705 | | 103,786 | |
| | 産業ファンド投資法人 | 4 | | 676,435 | | 0.916 | | 135,377 | |
| | アドバンス・レジデンス投資法人 | 3 | | 1,046,782 | | 1 | | 345,474 | |
| | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 1 | | 350,106 | | 0.378 | | 80,870 | |
| | | (△ 6) | | (△ 1,349,790) | | | | | |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 1 | | 612,503 | | 0.344 | | 137,962 | |
| | GLP投資法人 | 10 | | 1,546,030 | | 1 | | 281,494 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 1 | | 525,560 | | 0.29 | | 96,363 | |
| | | (0.029) | | (8,340) | | | | | |
| | 日本プロロジスリート投資法人 | 5 | | 1,508,958 | | 1 | | 294,956 | |
| | | (0.189) | | (54,838) | | | | | |
| | 星野リゾート・リート投資法人 | 0.608 | | 391,007 | | 0.11 | | 72,461 | |
| | Oneリート投資法人 | 0.51 | | 128,143 | | 0.106 | | 26,221 | |
| | イオンリート投資法人 | 4 | | 650,382 | | 0.71 | | 106,378 | |
| | | (0.104) | | (15,031) | | | | | |
| | ヒューリックリート投資法人 | 2 | | 425,166 | | 0.561 | | 87,682 | |
| | 日本リート投資法人 | 0.949 | | 321,358 | | 0.198 | | 66,625 | |
| | 積水ハウス・リート投資法人 | 8 | | 692,841 | | 1 | | 142,408 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 0.621 | | 83,336 | | 0.218 | | 29,469 | |
| | ケネディクス商業リート投資法人 | 0.954 | | 253,932 | | 0.219 | | 57,051 | |
| | | (△ 3) | | (△ 989,706) | | | | | |
| | ヘルスケア&メディカル投資法人 | 0.717 | | 110,408 | | 0.147 | | 23,041 | |
| | サムティ・レジデンシャル投資法人 | 0.88 | | 100,089 | | 0.157 | | 17,959 | |
| | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 9 | | 1,530,870 | | 1 | | 315,011 | |
| | いちごホテルリート投資法人 | 0.482 | | 52,569 | | 0.099 | | 10,584 | |
| | ラサールロジポート投資法人 | 4 | | 627,569 | | 0.754 | | 116,743 | |
| | スターアジア不動産投資法人 | 6 | | 365,519 | | 0.805 | | 46,339 | |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 0.458 | | 58,148 | | 0.091 | | 11,666 | | |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 1 | | 650,570 | | 0.244 | | 118,613 | | |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 0.454 | | 29,667 | | 0.164 | | 10,699 | | |
| 投資法人みらい | 5 | | 229,880 | | 0.75 | | 34,306 | | |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 0.051 | | 6,687 | | 0.008 | | 1,018 | | |
| | (△ 1) | | (△ 232,898) | | | | | | |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 1 | | 402,226 | | 0.207 | | 83,044 | | |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | 1 | | 271,474 | | 0.253 | | 44,483 | | |
| ザイマックス・リート投資法人 | 0.472 | | 54,226 | | 0.097 | | 10,998 | | |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 1 | | 145,391 | | 0.288 | | 27,255 | | |
| | (0.132) | | (11,671) | | | | | | |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 1 | | 170,147 | | 0.26 | | 34,500 | | |
| 日本ビルファンド投資法人 | 3 | | 1,997,039 | | 0.706 | | 408,635 | | |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 3 | | 1,792,468 | | 0.614 | | 339,815 | | |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|-----------------------|-------------------|------------|--------------|-----------|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | 日本都市ファンド投資法人 | 14 | 1,398,722 | 5 | 491,289 |
| | オリックス不動産投資法人 | 5 | 1,019,803 | 1 | 212,016 |
| | 日本プライムリアルティ投資法人 | 1 | 708,969 | 0.413 | 146,007 |
| | NTT都市開発リート投資法人 | 2 | 391,162 | 0.566 | 75,005 |
| | | (0.33) | (40,363) | | |
| | 東急リアル・エステート投資法人 | 1 | 359,947 | 0.405 | 74,661 |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 2 | 241,403 | 0.445 | 48,930 |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 6 | 973,391 | 1 | 200,621 |
| | 森トラストリート投資法人 | 5 | 432,593 | 1 | 79,933 |
| | | (8) | (232,898) | | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 17 | 986,476 | 2 | 153,901 |
| | フロンティア不動産投資法人 | 1 | 506,668 | 0.222 | 105,083 |
| | 平和不動産リート投資法人 | 2 | 372,058 | 0.424 | 62,970 |
| | | (0.078) | (11,562) | | |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 1 | 568,114 | 0.676 | 205,002 |
| | 福岡リート投資法人 | 1 | 247,739 | 0.312 | 50,969 |
| | KDX不動産投資法人 | 3 | 751,127 | 0.566 | 138,622 |
| | | (20) | (2,339,497) | | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 2 | 208,245 | 0.492 | 43,719 |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 0.602 | 381,449 | 0.123 | 76,957 |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 1 | 223,008 | 0.278 | 39,735 |
| | スタートアップリート投資法人 | 0.504 | 110,784 | 0.103 | 23,098 |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 4 | 1,199,463 | 0.909 | 252,008 |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 10 | 784,729 | 1 | 144,243 |
| | 大和証券リビング投資法人 | 4 | 538,694 | 0.839 | 93,451 |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 2 | 326,373 | 0.941 | 121,138 |
| | 東海道リート投資法人(新) | 0.075 | 9,115 | — | — |
| | (△0.251) | (△ 29,166) | | | |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新) | — | — | — | — | |
| | (△0.029) | (△ 8,340) | | | |
| 日本プロロジスリート投資法人(新) | 0.189 | 54,838 | — | — | |
| | (△0.189) | (△ 54,838) | | | |
| イオンリート投資法人(新) | — | — | — | — | |
| | (△0.104) | (△ 15,031) | | | |
| タカラレーベン不動産投資法人(新) | 0.132 | 11,671 | — | — | |
| | (△0.132) | (△ 11,671) | | | |
| NTT都市開発リート(新) | 0.33 | 40,363 | — | — | |
| | (△0.33) | (△ 40,363) | | | |
| 平和不動産リート投資法人(新) | 0.078 | 11,562 | — | — | |
| | (△0.078) | (△ 11,562) | | | |
| 合 計 | 195 | 32,198,207 | 40 | 6,789,546 | |
| | (17) | (—) | | | |

(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 8,850 | 百万円 8,555 | 百万円 — | 百万円 — |

○利害関係人との取引状況等

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-------------|--------|----------------|---------------|-------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 32,198 | 19,004 | 59.0 | 6,789 | 4,118 | 60.7 |
| 不動産投信指数先物取引 | 8,850 | 6,671 | 75.4 | 8,555 | 8,178 | 95.6 |

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 | 百万円 1,619 |

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) | 607千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 283千円 |
| (B) / (A) | 46.6% |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当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MUFG証券です。

○組入資産の明細

(2024年1月26日現在)

国内投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|-----|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| エスコンジャパンリート投資法人 | 1 | 1 | 242,200 | 0.2 |
| サンケイリアルエステート投資法人 | 2 | 3 | 288,032 | 0.3 |
| S O S i L A 物流リート投資法人 | 3 | 4 | 583,313 | 0.6 |
| 東海道リート投資法人 | 0.902 | 1 | 185,939 | 0.2 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 2 | 3 | 2,047,136 | 2.0 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 8 | 11 | 1,609,966 | 1.6 |
| 産業ファンド投資法人 | 11 | 14 | 2,060,603 | 2.0 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 7 | 9 | 3,166,677 | 3.1 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | 5 | — | — | — |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 3 | 5 | 2,092,444 | 2.0 |
| GLP投資法人 | 24 | 32 | 4,354,403 | 4.3 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | 3 | 4 | 1,515,220 | 1.5 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 12 | 16 | 4,588,188 | 4.5 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 1 | 1 | 948,073 | 0.9 |
| One リート投資法人 | 1 | 1 | 463,352 | 0.5 |
| イオンリート投資法人 | 8 | 11 | 1,703,246 | 1.7 |
| ヒューリックリート投資法人 | 6 | 9 | 1,427,749 | 1.4 |
| 日本リート投資法人 | 2 | 3 | 1,086,281 | 1.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 22 | 29 | 2,300,128 | 2.3 |
| トーセイ・リート投資法人 | 1 | 2 | 288,035 | 0.3 |
| ケネディクス商業リート投資法人 | 3 | — | — | — |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 | 1 | 2 | 331,752 | 0.3 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 | 1 | 2 | 294,661 | 0.3 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 24 | 31 | 5,073,659 | 5.0 |
| いちごホテルリート投資法人 | 1 | 1 | 194,123 | 0.2 |
| ラサールロジポート投資法人 | 9 | 12 | 1,873,489 | 1.8 |
| スターアジア不動産投資法人 | 9 | 15 | 892,663 | 0.9 |
| マリモ地方創生リート投資法人 | 1 | 1 | 186,822 | 0.2 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 2 | 4 | 1,877,928 | 1.8 |
| 大江戸温泉リート投資法人 | 1 | 1 | 112,570 | 0.1 |
| 投資法人みらい | 9 | 13 | 605,535 | 0.6 |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人 | 1 | — | — | — |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 2 | 3 | 1,269,359 | 1.2 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | 2 | 4 | 645,232 | 0.6 |
| ザイマックス・リート投資法人 | 1 | 1 | 190,156 | 0.2 |
| タカラレーベン不動産投資法人 | 3 | 4 | 485,415 | 0.5 |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | 3 | 4 | 549,935 | 0.5 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 8 | 11 | 6,756,750 | 6.6 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 7 | 10 | 5,669,056 | 5.5 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 37 | 46 | 4,678,674 | 4.6 |
| オリックス不動産投資法人 | 14 | 19 | 3,316,530 | 3.2 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 5 | 6 | 2,364,160 | 2.3 |
| NTT都市開発リート投資法人 | 7 | 9 | 1,248,601 | 1.2 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 4 | 6 | 1,154,610 | 1.1 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 5 | 7 | 790,560 | 0.8 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 16 | 21 | 3,295,944 | 3.2 |

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------------|---------|-------|-------------|-----|
| | | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| 森トラストリート投資法人 | | 5 | 18 | 1,403,986 | 1.4 |
| インヴィンシブル投資法人 | | 32 | 47 | 2,875,271 | 2.8 |
| フロンティア不動産投資法人 | | 2 | 3 | 1,555,740 | 1.5 |
| 平和不動産リート投資法人 | | 5 | 7 | 1,008,244 | 1.0 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | | 5 | 6 | 1,768,242 | 1.7 |
| 福岡リート投資法人 | | 3 | 5 | 874,960 | 0.9 |
| KDX不動産投資法人 | | 4 | 28 | 4,534,819 | 4.4 |
| いちごオフィスリート投資法人 | | 6 | 7 | 660,773 | 0.6 |
| 大和証券オフィス投資法人 | | 1 | 2 | 1,242,300 | 1.2 |
| 阪急阪神リート投資法人 | | 3 | 4 | 675,964 | 0.7 |
| スターツプロシード投資法人 | | 1 | 1 | 344,253 | 0.3 |
| 大和ハウスリート投資法人 | | 11 | 14 | 3,742,110 | 3.7 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | | 23 | 32 | 2,480,792 | 2.4 |
| 大和証券リビング投資法人 | | 10 | 14 | 1,532,105 | 1.5 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | | 6 | 8 | 1,028,743 | 1.0 |
| 東海道リート投資法人(新) | | 0.251 | 0.075 | 9,387 | 0.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新) | | 0.029 | — | — | — |
| イオンリート投資法人(新) | | 0.104 | — | — | — |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 443 | 616 | 100,546,877 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 64 | 59 | < 98.4% > | |

(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、森ヒ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、アドバンス・ロジスティクス投資法人、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、N T T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、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、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MUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2023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 | |
|-----|-------------|----------|--------------|----------|
| | | | 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 1,792 | 百万円 - |

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2024年1月26日現在)

| 区 分 | 当 期 末 | |
|-----------------|-------|-------------|
| | 数 | 量 |
| 貸付有価証券<投資証券>総口数 | | 口 56,735 |

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 100,546,877 | % 89.4 |
| コール・ローン等、その他 | 11,886,516 | 10.6 |
| 投資信託財産総額 | 112,433,393 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 112,431,510,257 |
| コール・ローン等 | 11,019,994,112 |
| 投資証券(評価額) | 100,546,877,425 |
| 未収配当金 | 749,152,064 |
| その他未収収益 | 231,550 |
| 差入委託証拠金 | 115,255,106 |
| (B) 負債 | 10,230,265,380 |
| 未払金 | 586,860,686 |
| 未払解約金 | 67,188,016 |
| 未払利息 | △ 106,197 |
| 受入担保金 | 9,576,322,875 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 102,201,244,877 |
| 元本 | 28,967,583,332 |
| 次期繰越損益金 | 73,233,661,545 |
| (D) 受益権総口数 | 28,967,583,332口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 35,281円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 22,777,413,306円
 期中追加設定元本額 9,412,859,047円
 期中一部解約元本額 3,222,689,021円
 また、1口当たり純資産額は、期末3.5281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)

| | |
|-----------------------------------------|----------------|
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 8,498,954,748円 |
| eMAXIS Slim 国内リートインデックス | 4,416,581,169円 |
| つみたて8資産均等バランス | 4,160,894,592円 |
| eMAXIS 国内リートインデックス | 4,005,255,931円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 1,695,074,917円 |
| オルタナティブ資産セレクトション(ラップ向け) | 1,157,018,741円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 865,517,622円 |
| 三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド | 698,361,080円 |
| ラップ向けインデックスf 国内リート | 513,469,091円 |
| 三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 438,307,742円 |
| 日本リートインデックスファンドS | 397,889,264円 |
| MUKAM 3資産インカムバランスファンド(適格機関投資家販売制限付) | 377,898,956円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 201,173,222円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 171,204,247円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 150,884,725円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 105,723,123円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 104,487,466円 |
| J-REITインデックスファンド(ラップ向け) | 84,480,105円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 70,532,341円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 45,142,333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) | 43,683,780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) | 42,265,508円 |

○損益の状況 (2023年1月27日~2024年1月26日)

| 項目 | 当期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 3,788,505,135 |
| 受取配当金 | 3,738,881,398 |
| 受取利息 | 95,723 |
| その他収益金 | 50,559,197 |
| 支払利息 | △ 1,031,183 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 1,274,717,794 |
| 売買益 | 1,900,893,387 |
| 売買損 | △ 3,175,611,181 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 37,767,440 |
| 取引益 | 131,205,530 |
| 取引損 | △ 93,438,090 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,551,554,781 |
| (E) 前期繰越損益金 | 55,119,541,415 |
| (F) 追加信託差損益金 | 23,685,554,148 |
| (G) 解約差損益金 | △ 8,122,988,799 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 73,233,661,545 |
| 次期繰越損益金(H) | 73,233,661,545 |

(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。

| | |
|------------------------------------------|-----------------|
| 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) | 41,745,917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) | 41,380,171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) | 41,189,187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) | 41,025,580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) | 40,524,225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) | 40,129,598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) | 36,872,615円 |
| 三菱UFJ 国内リートインデックスファンド | 36,663,864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) | 36,383,347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) | 36,375,423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) | 36,352,853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) | 36,247,289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) | 36,183,882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) | 36,150,033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) | 36,098,235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) | 35,735,992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) | 35,712,758円 |
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 27,504,631円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) | 22,277,579円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 13,433,589円 |
| アクティブアロケーションファンド (ラップ向け) | 4,977,713円 |
| ラップ向けアクティブアロケーションファンド | 3,885,032円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 2,964,387円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 1,427,207円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 759,099円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 538,674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) | 243,749円 |
| 合計 | 28,967,583,332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)

MUAM G-REITマザーファンド

【第18期】決算日2024年1月5日

〔計算期間：2023年1月6日～2024年1月5日〕

「MUAM G-REITマザーファンド」は、1月5日に第18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18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、不動産投資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 (除く日本、配当込み、円換算ベース) | | 投資信託証券組入比率 | 不動産指数先物投信物比率 | 純総資産額 |
|----------------|--------|-------|------------------------------------------|-------|------------|--------------|---------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 14期(2020年1月6日) | 18,377 | 22.4 | 47,161.24 | 22.2 | 99.0 | — | 30,217 |
| 15期(2021年1月5日) | 15,806 | △14.0 | 40,236.52 | △14.7 | 99.0 | — | 40,409 |
| 16期(2022年1月5日) | 24,645 | 55.9 | 62,554.10 | 55.5 | 99.3 | — | 78,315 |
| 17期(2023年1月5日) | 21,519 | △12.7 | 54,258.04 | △13.3 | 95.3 | 5.3 | 87,184 |
| 18期(2024年1月5日) | 25,604 | 19.0 | 64,147.13 | 18.2 | 98.2 | 2.0 | 116,457 |

(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数です。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 (「SPDJ」) 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 SPDJ に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱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、SPDJ、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、これら関係者のいずれも、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) 「不動産投資指数先物比率」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 月 日 | 基 準 価 額 | | S & P 先 進 国 R E I T イ ン デ ッ ク ス (除く日本、配当込 み、円換算ベース) | 投 資 信 託 不 動 産 組 入 比 率 先 物 指 数 率 |
|--------------------|---------|-------|--------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 |
| (期 首) 2023年1月5日 | 円 | % | | % |
| | 21,519 | — | 54,258.04 | 95.3 |
| 1月末 | 22,702 | 5.5 | 57,299.84 | 97.3 |
| 2月末 | 22,938 | 6.6 | 57,855.97 | 97.3 |
| 3月末 | 21,356 | △ 0.8 | 53,766.84 | 96.2 |
| 4月末 | 21,857 | 1.6 | 54,997.08 | 98.2 |
| 5月末 | 22,180 | 3.1 | 55,825.75 | 97.6 |
| 6月末 | 23,807 | 10.6 | 59,850.31 | 97.5 |
| 7月末 | 23,931 | 11.2 | 60,158.04 | 97.1 |
| 8月末 | 24,290 | 12.9 | 61,059.23 | 97.2 |
| 9月末 | 22,919 | 6.5 | 57,524.16 | 96.4 |
| 10月末 | 21,595 | 0.4 | 54,188.45 | 97.9 |
| 11月末 | 23,854 | 10.9 | 59,805.74 | 97.9 |
| 12月末 | 25,781 | 19.8 | 64,636.41 | 98.1 |
| (期 末) 2024年1月5日 | 25,604 | 19.0 | 64,147.13 | 98.2 |

(注) 騰落率は期首比。

(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19.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(18.2%)を0.8%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。
- ・ 主要国の長期金利の上昇などを受けて外国REIT市況は下落する場面がみられたものの、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上昇して期間を終えました。

◎ 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9.7%の円安・米ドル高、13.1%の円安・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18.2%の上昇になったため、カイ離は0.8%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)

- ・ 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1月6日～2024年1月5日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (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 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) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.001) | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.005) | |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 | 2 | 0.008 | (b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (2) | (0.008) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 14 | 0.059 | (c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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 信託事務の処理等に要するその他諸費用（合併にかかる現地徴収税等） |
| (保 管 費 用) | (4) | (0.016) | |
| (そ の 他) | (10) | (0.043) | |
| 合 計 | 18 | 0.074 | |
| 期中の平均基準価額は、23,039円です。 | | | |

(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) 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。

○売買及び取引の状況

(2023年1月6日～2024年1月5日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|---|------|------------------|-----------------------|------------------|------------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 | アメリカ | 百株 — (77) | 千アメリカドル — (141) | 百株 — (77) | 千アメリカドル — (141) |
| | イギリス | 607 | 千イギリスポンド 169 | — (607) | 千イギリスポンド — (169) |

(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す。

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 | 16 | 199 | — | — |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 70 | 1,445 | 18 | 360 |
| MACERICH CO/THE | 27 | 267 | 10 | 165 |
| ACADIA REALTY TRUST | 6 | 86 | — | — |
| AGREE REALTY CORP | 14 | 922 | — | — |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 22 | 2,615 | 5 | 714 |
| PROLOGIS INC | 106 | 12,213 | 25 | 3,306 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 15 | 69 | — | — |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 13 | 1,377 | 4 | 447 |
| NNN REIT INC | 22 | 917 | 5 | 241 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 11 | 258 | — | — |
| COUSINS PROPERTIES INC | 15 | 332 | — | — |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 21 | 161 | — | — |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 42 | 4,612 | 8 | 1,102 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 6 | 1,045 | 0.732 | 126 |
| EPR PROPERTIES | 10 | 424 | 1 | 70 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 27 | 1,823 | 5 | 401 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 7 | 1,529 | 1 | 463 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 19 | 2,587 | 5 | 879 |
| | (43) | (4,800) | | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 8 | 846 | 2 | 260 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 17 | 827 | 4 | 217 |
| GETTY REALTY CORP | 6 | 203 | — | — |
| WELLTOWER INC | 103 | 8,151 | 14 | 1,316 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 11 | 271 | — | — |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 30 | 239 | 7 | 72 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 13 | 268 | 5 | 103 |
| KILROY REALTY CORP | 14 | 455 | 2 | 105 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 25 | 533 | 9 | 218 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 39 | 386 | — | — |
| LTC PROPERTIES INC | 4 | 144 | — | — |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 7 | 124 | — | — |
| BOSTON PROPERTIES INC | 17 | 1,004 | 4 | 330 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 69 | 553 | — | — |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 13 | 1,964 | 3 | 462 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 4 | 249 | 2 | 129 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 34 | 1,043 | 7 | 245 |
| RPT REALTY | 13 | 142 | 15 | 190 |
| | (△ 42) | (△ 435) | | |
| REALTY INCOME CORP | 126 | 7,315 | 15 | 871 |
| REGENCY CENTERS CORP | 19 | 1,131 | 5 | 373 |
| | (6) | (342) | | |
| SAUL CENTERS INC | 1 | 73 | — | — |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 65 | 110 | 28 | 65 |

| 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 |
| SL GREEN REALTY CORP | 7 | 199 | 2 | 132 |
| LIFE STORAGE INC | 5 (△ 48) | 725 (△ 4,800) | — | — |
| SUN COMMUNITIES INC | 14 | 1,849 | 3 | 488 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 23 | 218 | 14 | 149 |
| TANGER INC | 10 | 222 | — | — |
| CUBESMART | 27 | 1,118 | 7 | 326 |
| UDR INC | 36 | 1,396 | 13 | 513 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1 | 71 | — | — |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 3 (△ 17) | 73 (△ 342) | — | — |
| VENTAS INC | 48 | 2,112 | 11 | 567 |
| ELME COMMUNITIES | 8 | 147 | — | — |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST-A | 15 | 110 | 7 (20) | 72 (161) |
| UMH PROPERTIES INC | 8 | 121 | — | — |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 5 | 73 | — | — |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 30 | 54 | — | — |
| CENTERSPACE | 1 | 72 | — | — |
| DOUGLAS EMMETT INC | 20 | 249 | 12 | 189 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 9 | 117 | — | — |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 10 | 73 | — | — |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 22 | 124 | 10 | 71 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 3 | 72 | — | — |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 12 | 87 | — | — |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 4 | 20 | — | — |
| RLJ LODGING TRUST | 14 | 143 | — | — |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 11 | 146 | — | — |
| STAG INDUSTRIAL INC | 20 | 698 | 5 | 192 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 30 | 387 | 10 | 152 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 46 | 833 | 6 | 95 |
| WP CAREY INC | 28 | 1,973 | 4 | 316 |
| WHITESTONE REIT | 8 | 71 | — | — |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 9 | 791 | 1 | 129 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 7 | 75 | — | — |
| TERRENO REALTY CORP | 17 | 1,026 | — | — |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 14 | 551 | 2 | 121 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 6 | 74 | — | — |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 37 | 1,991 | 6 | 365 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 26 | 370 | — | — |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 42 | 1,371 | 10 | 376 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 9 | 23 | — | — |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 10 | 73 | — | — |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 35 | 740 | 6 | 151 |
| CARETRUST REIT INC | 23 | 486 | — | — |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 32 | 1,557 | 4 | 228 |

外

国

| 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 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 29 | 442 | 8 | 139 |
| IRON MOUNTAIN INC | 35 | 1,902 | 8 | 576 |
| STORE CAPITAL CORP | 6 | 200 | — | — |
| | | | (136) | (4,389) |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 10 | 159 | — | — |
| EQUINIX INC | 11 | 8,052 | 2 | 2,011 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 30 | 137 | 14 | 75 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 11 | 137 | — | — |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 7 | 88 | — | — |
| UNITI GROUP INC | 146 | 758 | — | — |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 6 | 256 | 4 | 180 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 1 | 75 | — | — |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 26 | 407 | 4 | 74 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 12 | 132 | — | — |
| | (50) | (461) | | |
| CITY OFFICE REIT INC | 7 | 26 | — | — |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 12 | 311 | — | — |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 3 | 126 | — | — |
| FARMLAND PARTNERS INC | 6 | 74 | — | — |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 188 | 47 | — | — |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 26 | 309 | 14 | 217 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 42 | 2,498 | 10 | 609 |
| INVITATION HOMES INC | 67 | 2,089 | 21 | 742 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 6 | 90 | 5 | 89 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 5 | 103 | — | — |
| CLIPPER REALTY INC | 8 | 40 | — | — |
| GLADSTONE LAND CORP | 4 | 72 | — | — |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 7 | 72 | — | — |
| VICI PROPERTIES INC | 148 | 4,551 | 23 | 737 |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC | 40 | 1,162 | 19 | 595 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 8 | 20 | — | — |
| BRT APARTMENTS CORP | 3 | 73 | — | — |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 3 | 249 | — | — |
| SAFEHOLD INC | — | — | — | — |
| | (△ 12) | (△ 388) | | |
| NECESSITY RETAIL REIT INC/TH | 12 | 73 | — | — |
| | (△ 74) | (△ 461) | | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 22 | 530 | — | — |
| PRIME US REIT | — | — | — | — |
| | (—) | (△ 5) | | |
| NETSTREIT CORP | 13 | 243 | — | — |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 93 | 17 | — | — |
| | (—) | (△ 8) | | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 25 | 410 | — | — |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 12 | 438 | 5 | 175 |
| CTO REALTY GROWTH INC | 2 | 40 | — | — |

| 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 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 4 | 76 | — | — |
| INDUS REALTY TRUST INC | — | — | — | — |
| | | | (2) | (159) |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 3 | 40 | — | — |
| ORION OFFICE REIT INC | 11 | 73 | — | — |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 246 | 137 | — | — |
| | (—) | (△ 3) | | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 12 | 405 | — | — |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 3 | 72 | — | — |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 6 | 151 | — | — |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC | — | — | 1 | 19 |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | — | — | — | — |
| | (0.184) | (1) | | |
| STAR HOLDINGS | — | — | 7 | 109 |
| | (7) | (141) | | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 21 | 417 | — | — |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | — | — | — | — |
| | (8) | (—) | | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 86 | 1,360 | 30 | 556 |
| SAFEHOLD INC | 18 | 221 | — | — |
| | (12) | (388) | (42) | (141) |
| PUBLIC STORAGE | 18 | 5,090 | 4 | 1,312 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 38 | 4,181 | 10 | 1,457 |
| VORNADO REALTY TRUST | 17 | 324 | 4 | 139 |
| KIMCO REALTY CORP | 75 | 1,399 | 21 | 461 |
| | (25) | (435) | | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 17 | 2,954 | 4 | 770 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 18 | 124 | 9 | 70 |
| 小 計 | 3,606 | 125,090 | 606 | 29,008 |
| | (△ 41) | (126) | (202) | (4,852) |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3 | 172 | — | — |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 7 | 194 | — | — |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 8 | 366 | — | — |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 8 | 99 | — | — |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 18 | 350 | 18 | 340 |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 4 | 94 | — | — |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10 | 79 | — | — |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 5 | 75 | — | — |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 11 | 101 | — | — |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3 | 271 | 1 | 108 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 7 | 98 | — | — |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 16 | 209 | — | — |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 12 | 189 | — | — |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 6 | 103 | — | — |
| SLATE GROCERY REIT-CL U | 5 | 73 | — | — |

| 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 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 9 | 168 | 5 | 101 |
| SLATE OFFICE REIT | — | — | 13 | 21 |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | — | — | — | — |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | — | — | — | — |
| | (△ 24) | (—) | — | — |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 11 | 159 | — | — |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | — | — | 7 | 78 |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 34 | 100 | — | — |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES | — | — | 16 | 40 |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTM | — | — | 7 | 24 |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 11 | 94 | 9 | 72 |
| PRIMARIS REIT | 5 | 71 | — | — |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | 5 | 90 | — | — |
| 小 計 | 207 | 3,168 | 79 | 787 |
| | (△ 24) | (—) | (46) | (1,060) |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| ドイツ | | | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | — | — | 5 | 24 |
| | (—) | (11) | — | — |
| HAMBORNER REIT AG | 6 | 37 | — | — |
| 小 計 | 6 | 37 | 5 | 24 |
| | (—) | (11) | — | — |
| フランス | | | | |
| GECINA SA | 5 | 533 | 1 | 187 |
| KLEPIERRE | 23 | 521 | 3 | 85 |
| | (—) | (△ 93) | — | — |
| COVIVIO | 8 | 378 | 3 | 160 |
| MERCIALYS | 16 | 148 | — | — |
| ICADE | 1 | 82 | — | — |
| | (—) | (△ 30) | — | — |
| ALTAREA | 0.605 | 70 | — | — |
| | | | (—) | (0.43696) |
| CARMILA | 3 | 45 | — | — |
| | (—) | (△ 37) | — | — |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 7 | 358 | 7 | 447 |
| | (58) | (3,042) | — | — |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 5 | 261 | — | — |
| | | | (58) | (3,042) |
| 小 計 | 72 | 2,399 | 16 | 881 |
| | (58) | (2,881) | (58) | (3,042) |
| オランダ | | | | |
| NSI NV | 3 | 55 | — | — |
| VASTNED RETAIL NV | 3 | 66 | 6 | 133 |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 3 | 63 | — | — |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|----------------------------|-------------------------------|----------|--------|----------|------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 国 | ユーロ | | 千口 | | 千ユーロ |
| | オランダ | | | | |
| | WERELDHAVE NV | 5 | 73 | — | — |
| | 小計 | 15 | 258 | 6 | 133 |
| | スペイン | | | | |
| | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | — | — | — | — |
| | | (—) | (△ 14) | | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 44 | 348 | 13 | 138 |
| | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 23 | 137 | — | — |
| | | (—) | (△ 9) | | |
| | 小計 | 68 | 485 | 13 | 138 |
| | | (—) | (△ 23) | | |
| | ベルギー | | | | |
| | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSE | 6 | 122 | — | — |
| | RETAIL ESTATES | 1 | 67 | — | — |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 23 | 617 | — | — |
| | AEDIFICA | 8 | 550 | — | — |
| | AEDIFICA SA-RIGHTS | — | — | 22 | 9 |
| | | (22) | (—) | | |
| | MONTEA NV | 3 | 248 | — | — |
| | CARE PROPERTY INVEST | 12 | 152 | 9 | 127 |
| | CARE PROPERTY INVEST NV-RTS | — | — | 12 | 9 |
| | | (12) | (—) | | |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 4 | 139 | — | — |
| | COFINIMMO | 6 | 488 | — | — |
| | 小計 | 67 | 2,387 | 43 | 146 |
| | | (34) | (—) | | |
| | ガンジー | | | | |
| | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 19 | 758 | — | — |
| | 小計 | 19 | 758 | — | — |
| | シンガポール | | | | |
| | CROMWELL REIT EUR | 83 | 119 | 47 | 63 |
| | | (—) | (△ 16) | | |
| 小計 | 83 | 119 | 47 | 63 | |
| | (—) | (△ 16) | | | |
| ユーロ計 | 331 | 6,445 | 134 | 1,386 | |
| | (93) | (2,853) | (58) | (3,042) | |
| イギリス | | 千イギリスポンド | | 千イギリスポンド | |
| BRITISH LAND CO PLC | 117 | 407 | 49 | 186 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 33 | 153 | — | — | |
| HAMMERSON PLC | 310 | 83 | — | — | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 88 | 531 | 20 | 142 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 71 | 71 | — | — | |
| SEGRO PLC | 159 | 1,174 | 44 | 370 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 19 | 88 | 12 | 65 | |
| SHAFTESBURY PLC | — | — | — | — | |
| | (△ 141) | (△ 527) | | | |

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | | |
|---|-----------------------------|------------------------------|-----------------|--------|------------|-----|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 | |
| 外 | イギリス | | 千口 | | 千口 | |
| | | | 千イギリスポンド | | 千イギリスポンド | |
| | | BIG YELLOW GROUP PLC | 33 | 368 | 5 | 55 |
| | | DERWENT LONDON PLC | 11 | 251 | 4 | 102 |
| | | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 124 | 218 | — | — |
| | | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 39 | 329 | 19 | 162 |
| | | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 240 | 336 | 65 | 107 |
| | | ASSURA PLC | 290 | 138 | — | — |
| | | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 66 | 60 | — | — |
| | | REGIONAL REIT LTD | 138 | 37 | 233 | 71 |
| | | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | — | — | 336 | 267 |
| | | UNITE GROUP PLC/THE | 64 | 591 | 26 | 253 |
| | | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 61 | 58 | — | — |
| | | LXI REIT PLC | 162 | 177 | — | — |
| | | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 170 | 114 | 86 | 57 |
| | | AEW UK REIT PLC | 120 | 115 | 57 | 59 |
| | | SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 281 | 315 | 93 | 123 |
| | | | (475) | (527) | | |
| | | BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 93 | 62 | 94 | 63 |
| | | CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 143 | 117 | 71 | 58 |
| | | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 151 | 124 | — | — |
| | | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 134 | 76 | 113 | 56 |
| | | PRS REIT PLC/THE | 52 | 45 | — | — |
| | | WAREHOUSE REIT PLC | 63 | 69 | — | — |
| | | EDISTON PROPERTY INVESTMENT | — | — | 100 | 68 |
| | | URBAN LOGISTICS REIT PLC | 42 | 58 | — | — |
| | HELICAL PLC | — | — | — | — | |
| | | (60) | (169) | | | |
| | LIFE SCIENCE REIT PLC | 209 | 147 | — | — | |
| | TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 371 | 291 | — | — | |
| | 小 計 | 3,867 (394) | 6,617 (169) | 1,434 | 2,273 | |
| 国 | 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 | 449 | 838 | 162 | 314 |
| | | ABACUS GROUP | 61 | 161 | — | — |
| | | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 50 | 199 | — | — |
| | | CHARTER HALL GROUP | 56 | 587 | 19 | 243 |
| | | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 31 | 96 | — | — |
| | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 169 | 96 | — | — |
| | | REGION RE LTD | 123 | 270 | — | — |
| | | NATIONAL STORAGE REIT | 207 | 501 | — | — |
| | | GDI PROPERTY GROUP | 142 | 75 | 250 | 154 |
| | | DEXUS INDUSTRIA REIT | 33 | 85 | 23 | 65 |
| | | SCENTRE GROUP | 669 | 1,780 | 235 | 665 |
| | | ARENA REIT | 27 | 102 | — | — |
| | | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 31 | 112 | — | — |
| | | WAYPOINT REIT | 46 | 122 | — | — |
| | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 75 | 294 | — | — | |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|------------------------------|--------|-------------|-------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千口 | 千オーストラリアドル | 千口 | 千オーストラリアドル |
| RURAL FUNDS GROUP | 48 | 97 | — | — |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 104 | 313 | 37 | 115 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 144 | 230 | — | — |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 258 | 320 | — | — |
| DEXUS/AU | 133 | 977 | 40 | 307 |
| HEALTHCO REIT | 199 | 281 | — | — |
| HMC CAPITAL LTD | 52 | 235 | — | — |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE | — | — | 140 | 97 |
| ABACUS STORAGE KING | 91 | 109 | — | — |
| | (258) | (—) | | |
| GPT GROUP | 222 | 913 | 74 | 326 |
| MIRVAC GROUP | 483 | 1,034 | 83 | 175 |
| STOCKLAND | 292 | 1,128 | 96 | 408 |
| BWP TRUST | 58 | 220 | — | — |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 63 | 220 | — | — |
| GOODMAN GROUP | 200 | 3,966 | 44 | 1,058 |
| 小 計 | 4,529 | 15,377 | 1,208 | 3,933 |
| | (258) | (—) | | |
| 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 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 51 | 122 | 276 | 558 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 170 | 154 | — | — |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 168 | 358 | 84 | 181 |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 253 | 322 | 95 | 119 |
| STRIDE PROPERTY GROUP | — | — | 293 | 367 |
| 小 計 | 643 | 957 | 749 | 1,226 |
| 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| LINK REIT | 520 | 24,640 | 73 | 2,984 |
| LINK REIT-RIGHTS | — | — | 216 | 896 |
| | (216) | (—) | | |
| CHAMPION REIT | 203 | 569 | — | — |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 331 | 636 | — | — |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 198 | 571 | — | — |
| FORTUNE REIT | 109 | 708 | — | — |
| 小 計 | 1,361 | 27,125 | 290 | 3,880 |
| | (216) | (—) | | |
| 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 | 299 | 375 | 133 | 162 |
| | (—) | (△ 9) | | |
| KEPPEL REIT | 279 | 229 | — | — |
| | (—) | (△ 5) | | |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 297 | 314 | — | — |
| | (—) | (△ 22) | (—) | (1) |
| ESR-LOGOS REIT | 1,300 | 403 | 314 | 97 |
| | (—) | (△ 13) | | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 143 | 162 | 96 | 102 |
| | (—) | (△ 2) | | |

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------------|-------|------------|-------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千口 | 千シンガポールドル | 千口 | 千シンガポールドル |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 126 | 278 | — | — |
| STARHILL GLOBAL REIT | 608 | 305 | 587 | 290 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 405 | 682 | 102 | 169 |
| | (—) | (△ 77) | | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 112 | 127 | — | — |
| | (—) | (△ 33) | | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 246 | 65 | 758 | 170 |
| | (—) | (△ 7) | | |
| AIMS APAC REIT | 167 | 223 | — | — |
| | (—) | (△ 9) | | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 56 | 213 | — | — |
| | (—) | (△ 7) | | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 235 | 536 | — | — |
| | (—) | (△ 4) | | |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 317 | 502 | 65 | 99 |
| | (—) | (△ 11) | | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 282 | 173 | 154 | 96 |
| | (—) | (△ 2) | | |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | — | — | 1,306 | 274 |
| | (—) | (△ 3) | | |
| PARAGON REIT | 120 | 108 | — | — |
| KEPPEL DC REIT | 179 | 339 | 78 | 141 |
| | (—) | (△ 16) | | |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL | 355 | 426 | — | — |
| | (—) | (△ 17) | | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT | — | — | — | — |
| | (—) | (△0.50412) | | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 126 | 85 | — | — |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | — | — | 246 | 135 |
| | (—) | (△ 12) | | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 627 | 1,205 | 202 | 390 |
| | (—) | (△ 9) | | |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 473 | 1,319 | 75 | 219 |
| | (—) | (△ 39) | | |
| 小 計 | 6,759 | 8,078 | 4,120 | 2,351 |
| | (—) | (△ 306) | (—) | (1) |
| 韓国 | | 千韓国ウォン | | 千韓国ウォン |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 15 | 98,675 | — | — |
| | | | (—) | (652) |
| SHINHAN ALPHA REIT CO-RTS | — | — | 5 | 833 |
| | (5) | (652) | | |
| LOTTE REIT CO LTD | 23 | 89,771 | — | — |
| MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 24 | 100,956 | 61 | 243,870 |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 22 | 89,421 | — | — |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 19 | 93,129 | 49 | 215,207 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|---------------------------|------------------------------|------------|---------|------------|--------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外 国 | 韓国 | 千口 | 千韓国ウォン | 千口 | 千韓国ウォン |
| | IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS | — | — | 13 | 1,531 |
| | | (13) | (—) | | |
| | JR REIT XXVII | 23 | 102,685 | — | — |
| | D&D PLATFORM REIT CO LTD | 21 | 70,004 | — | — |
| | SK REITS CO LTD | 27 | 123,072 | — | — |
| | SK REITS CO LTD-RIGHTS | — | — | — | — |
| | | (13) | (—) | (13) | (363) |
| | SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT | — | — | 18 | 57,853 |
| | E KOCREF CR-REIT CO LTD | — | — | 12 | 62,821 |
| 小計 | 176 | 767,715 | 161 | 582,119 | |
| | (32) | (652) | (13) | (1,016) | |
| 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 | |
| REIT 1 LTD | 19 | 299 | — | — | |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 101 | 170 | — | — | |
| 小計 | 121 | 470 | — | — | |

(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 | 不動産投信指数先物取引 | 百万円 36,524 | 百万円 38,784 | 百万円 — | 百万円 — |

(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1月6日～2024年1月5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 | 31,045千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | —千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | — |

(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1月6日～2024年1月5日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|----------|--------------------|---------------|----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 為替直物取引 | 百万円 21,762 | 百万円 491 | % 2.3 | 百万円 11,838 | 百万円 626 | % 5.3 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年1月5日現在)

外国投資信託証券

| 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 | % |
| SITE CENTERS CORP | 91 | 107 | 1,436 | 208,289 | 0.2 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 265 | 316 | 6,227 | 903,117 | 0.8 |
| MACERICH CO/THE | 105 | 121 | 1,821 | 264,200 | 0.2 |
| ACADIA REALTY TRUST | 48 | 54 | 920 | 133,422 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 43 | 58 | 3,691 | 535,309 | 0.5 |
| ALEXANDER'S INC | 1 | 1 | 244 | 35,422 | 0.0 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 73 | 90 | 11,381 | 1,650,553 | 1.4 |
| PROLOGIS INC | 456 | 537 | 70,028 | 10,155,461 | 8.7 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 15 | 15 | 28 | 4,164 | 0.0 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 81 | 96 | 513 | 74,447 | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 52 | 61 | 6,028 | 874,199 | 0.8 |
| NNN REIT INC | 88 | 105 | 4,512 | 654,391 | 0.6 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 56 | 67 | 1,705 | 247,319 | 0.2 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 75 | 90 | 2,171 | 314,956 | 0.3 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 105 | 126 | 1,178 | 170,856 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 142 | 176 | 23,203 | 3,364,980 | 2.9 |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 21 | 27 | 4,887 | 708,832 | 0.6 |
| EPR PROPERTIES | 36 | 45 | 2,148 | 311,529 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 85 | 108 | 7,536 | 1,092,919 | 0.9 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 32 | 37 | 9,087 | 1,317,854 | 1.1 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 66 | 122 | 19,264 | 2,793,762 | 2.4 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 35 | 42 | 4,303 | 624,050 | 0.5 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 64 | 77 | 4,041 | 586,046 | 0.5 |
| GETTY REALTY CORP | 21 | 27 | 795 | 115,378 | 0.1 |
| WELLTOWER INC | 233 | 322 | 28,562 | 4,142,089 | 3.6 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 51 | 63 | 1,448 | 210,089 | 0.2 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 77 | 100 | 838 | 121,661 | 0.1 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 54 | 63 | 1,228 | 178,164 | 0.2 |
| KILROY REALTY CORP | 51 | 62 | 2,465 | 357,580 | 0.3 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 109 | 125 | 2,789 | 404,569 | 0.3 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 134 | 174 | 1,676 | 243,071 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 20 | 24 | 783 | 113,649 | 0.1 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 39 | 47 | 718 | 104,192 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 70 | 83 | 5,764 | 835,908 | 0.7 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 295 | 365 | 1,825 | 264,732 | 0.2 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 57 | 67 | 8,932 | 1,295,323 | 1.1 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 22 | 24 | 1,326 | 192,379 | 0.2 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 115 | 141 | 4,329 | 627,929 | 0.5 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 9 | 9 | 203 | 29,561 | 0.0 |
| RPT REALTY | 43 | — | — | — | — |

| 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 | % |
| REALTY INCOME CORP | 310 | 421 | 24,291 | 3,522,723 | 3.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | 75 | 95 | 6,238 | 904,668 | 0.8 |
| SAUL CENTERS INC | 6 | 8 | 320 | 46,484 | 0.0 |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 94 | 131 | 440 | 63,863 | 0.1 |
| SL GREEN REALTY CORP | 31 | 36 | 1,620 | 235,005 | 0.2 |
| LIFE STORAGE INC | 42 | — | — | — | — |
| SUN COMMUNITIES INC | 61 | 72 | 9,571 | 1,388,079 | 1.2 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 104 | 113 | 1,233 | 178,827 | 0.2 |
| TANGER INC | 51 | 62 | 1,696 | 246,011 | 0.2 |
| CUBESMART | 110 | 130 | 5,950 | 862,934 | 0.7 |
| UDR INC | 151 | 174 | 6,622 | 960,352 | 0.8 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 5 | 7 | 317 | 46,046 | 0.0 |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 14 | — | — | — | — |
| VENTAS INC | 196 | 233 | 11,509 | 1,669,107 | 1.4 |
| ELME COMMUNITIES | 42 | 51 | 731 | 106,084 | 0.1 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST-A | 12 | — | — | — | — |
| UMH PROPERTIES INC | 27 | 35 | 523 | 75,877 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 18 | 24 | 321 | 46,581 | 0.0 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 34 | 64 | 171 | 24,884 | 0.0 |
| CENTERSPACE | 7 | 8 | 493 | 71,618 | 0.1 |
| DOUGLAS EMMETT INC | 87 | 95 | 1,359 | 197,167 | 0.2 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 64 | 74 | 1,165 | 169,048 | 0.1 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 63 | 73 | 516 | 74,893 | 0.1 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 65 | 78 | 753 | 109,254 | 0.1 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 26 | 29 | 670 | 97,261 | 0.1 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 49 | 61 | 407 | 59,107 | 0.1 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRU | 25 | 30 | 204 | 29,716 | 0.0 |
| RLJ LODGING TRUST | 80 | 95 | 1,106 | 160,498 | 0.1 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 61 | 72 | 995 | 144,349 | 0.1 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 88 | 104 | 4,030 | 584,502 | 0.5 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 112 | 131 | 1,847 | 267,958 | 0.2 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 187 | 227 | 3,865 | 560,566 | 0.5 |
| WP CAREY INC | 102 | 126 | 8,208 | 1,190,384 | 1.0 |
| WHITESTONE REIT | 19 | 27 | 330 | 47,978 | 0.0 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 27 | 35 | 3,921 | 568,697 | 0.5 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 22 | 29 | 321 | 46,672 | 0.0 |
| TERRENO REALTY CORP | 32 | 49 | 3,092 | 448,493 | 0.4 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 69 | 81 | 3,566 | 517,185 | 0.4 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 31 | 38 | 465 | 67,567 | 0.1 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 91 | 122 | 6,742 | 977,784 | 0.8 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 114 | 140 | 1,824 | 264,598 | 0.2 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 152 | 184 | 6,584 | 954,916 | 0.8 |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 25 | 34 | 86 | 12,544 | 0.0 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 68 | 78 | 770 | 111,765 | 0.1 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 147 | 176 | 4,018 | 582,746 | 0.5 |

| 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 | % | |
| CARETRUST REIT INC | 48 | 71 | 1,569 | 227,556 | 0.2 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 127 | 155 | 7,523 | 1,091,130 | 0.9 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 109 | 130 | 1,950 | 282,858 | 0.2 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 142 | 169 | 11,284 | 1,636,528 | 1.4 | |
| STORE CAPITAL CORP | 130 | — | — | — | — | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 58 | 69 | 1,258 | 182,532 | 0.2 | |
| EQUINIX INC | 45 | 54 | 43,380 | 6,291,051 | 5.4 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 86 | 102 | 511 | 74,180 | 0.1 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 45 | 57 | 771 | 111,940 | 0.1 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 56 | 64 | 848 | 123,048 | 0.1 | |
| UNITI GROUP INC | — | 146 | 872 | 126,532 | 0.1 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 42 | 44 | 1,786 | 259,073 | 0.2 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL | 11 | 13 | 445 | 64,604 | 0.1 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 105 | 127 | 2,148 | 311,639 | 0.3 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 52 | 115 | 1,127 | 163,475 | 0.1 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 18 | 25 | 157 | 22,910 | 0.0 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 40 | 52 | 1,309 | 189,967 | 0.2 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 11 | 14 | 386 | 56,055 | 0.0 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 22 | 29 | 348 | 50,611 | 0.0 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INV | 822 | 1,011 | 78 | 11,436 | 0.0 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 111 | 123 | 1,944 | 282,003 | 0.2 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 168 | 200 | 12,187 | 1,767,384 | 1.5 | |
| INVITATION HOMES INC | 287 | 333 | 11,340 | 1,644,528 | 1.4 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 49 | 51 | 853 | 123,719 | 0.1 | |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 36 | 42 | 778 | 112,961 | 0.1 | |
| CLIPPER REALTY INC | 2 | 11 | 60 | 8,744 | 0.0 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 14 | 18 | 262 | 38,026 | 0.0 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 28 | 36 | 388 | 56,381 | 0.0 | |
| VICI PROPERTIES INC | 476 | 601 | 19,198 | 2,784,199 | 2.4 | |
| AMERICOLD REALTY TRUST INC | 132 | 153 | 4,536 | 657,827 | 0.6 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 28 | 36 | 167 | 24,312 | 0.0 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 4 | 8 | 151 | 21,961 | 0.0 | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 13 | 17 | 1,635 | 237,230 | 0.2 | |
| SAFEHOLD INC | 12 | — | — | — | — | |
| NECESSITY RETAIL REIT INC/TH | 62 | — | — | — | — | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 70 | 92 | 2,362 | 342,566 | 0.3 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 20 | 20 | 486 | 70,571 | 0.1 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 202 | 202 | — | — | — | |
| PRIME US REIT | 348 | 348 | 76 | 11,115 | 0.0 | |
| NETSTREIT CORP | 25 | 39 | 708 | 102,799 | 0.1 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 384 | 477 | 162 | 23,553 | 0.0 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 85 | 111 | 1,869 | 271,157 | 0.2 | |
| APARTMENT INCOME REIT CO | 75 | 83 | 2,875 | 416,968 | 0.4 | |
| CTO REALTY GROWTH INC | 9 | 12 | 205 | 29,842 | 0.0 | |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 4 | 8 | 149 | 21,632 | 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 | % | |
| INDUS REALTY TRUST INC | 2 | — | — | — | — | |
| POSTAL REALTY TRUST INC- A | 8 | 11 | 167 | 24,306 | 0.0 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 25 | 36 | 203 | 29,545 | 0.0 | |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 177 | 423 | 281 | 40,793 | 0.0 | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY IN | 57 | 69 | 2,508 | 363,778 | 0.3 | |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES | 12 | 15 | 389 | 56,552 | 0.0 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 33 | 39 | 1,012 | 146,871 | 0.1 | |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC | 1 | — | — | — | — | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES | 16 | 16 | 120 | 17,485 | 0.0 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | — | 21 | 380 | 55,123 | 0.0 | |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | — | 8 | 150 | 21,755 | 0.0 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 351 | 408 | 8,041 | 1,166,112 | 1.0 | |
| SAFEHOLD INC | 38 | 27 | 637 | 92,522 | 0.1 | |
| PUBLIC STORAGE | 78 | 92 | 27,619 | 4,005,388 | 3.4 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 161 | 189 | 26,600 | 3,857,556 | 3.3 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 80 | 93 | 2,596 | 376,493 | 0.3 | |
| KIMCO REALTY CORP | 304 | 384 | 7,996 | 1,159,634 | 1.0 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 69 | 82 | 15,146 | 2,196,551 | 1.9 | |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 76 | 84 | 656 | 95,216 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 12,803 146 | 15,558 140 | 613,636 — | 88,989,500 <76.4%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 10 | 13 | 925 | 100,514 | 0.1 | |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 34 | 41 | 1,051 | 114,243 | 0.1 | |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 40 | 48 | 2,323 | 252,390 | 0.2 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 12 | 12 | 130 | 14,174 | 0.0 | |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 66 | 74 | 737 | 80,103 | 0.1 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 75 | 76 | 1,432 | 155,640 | 0.1 | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 31 | 36 | 727 | 78,995 | 0.1 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 26 | 36 | 250 | 27,203 | 0.0 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 25 | 30 | 418 | 45,416 | 0.0 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 55 | 66 | 347 | 37,708 | 0.0 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 15 | 18 | 1,386 | 150,652 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 34 | 41 | 536 | 58,299 | 0.1 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 63 | 79 | 1,088 | 118,256 | 0.1 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | 10 | 10 | 158 | 17,269 | 0.0 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 79 | 92 | 1,299 | 141,161 | 0.1 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 23 | 29 | 435 | 47,329 | 0.0 | |
| SLATE GROCERY REIT-CL U | 14 | 20 | 243 | 26,441 | 0.0 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 30 | 34 | 615 | 66,822 | 0.1 | |
| SLATE OFFICE REIT | 13 | — | — | — | — | |
| SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI | 46 | — | — | — | — | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E | 29 | 5 | 52 | 5,730 | 0.0 | |
| MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 12 | 12 | 195 | 21,244 | 0.0 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 53 | 64 | 988 | 107,411 | 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 | | |
| (カナダ) | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % | |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | 7 | — | — | — | — | |
| BTB REAL ESTATE INVESTMENT T | 17 | 52 | 155 | 16,848 | 0.0 | |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES | 16 | — | — | — | — | |
| INOVALIS REAL ESTATE INVESTM | 7 | — | — | — | — | |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 13 | 14 | 120 | 13,089 | 0.0 | |
| PRIMARIS REIT | 25 | 31 | 431 | 46,823 | 0.0 | |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT T | 13 | 13 | 63 | 6,849 | 0.0 | |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT T | 8 | 13 | 206 | 22,466 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 913 | 969 | 16,322 | 1,773,087 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | 26 | — | < 1.5% > | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 5 | — | — | — | — | |
| HAMBORNER REIT AG | 37 | 43 | 298 | 47,334 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 43 | 43 | 298 | 47,334 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 22 | 22 | 52 | 8,290 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 22 | 22 | 52 | 8,290 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| GECINA SA | 27 | 30 | 3,363 | 534,155 | 0.5 | |
| KLEPIERRE | 96 | 116 | 2,883 | 457,954 | 0.4 | |
| COVIVIO | 22 | 27 | 1,316 | 209,068 | 0.2 | |
| MERCIALYS | 37 | 54 | 549 | 87,307 | 0.1 | |
| ICADE | 16 | 18 | 643 | 102,262 | 0.1 | |
| ALTAREA | 2 | 2 | 223 | 35,520 | 0.0 | |
| CARMILA | 28 | 31 | 503 | 79,994 | 0.1 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | — | 58 | 3,901 | 619,544 | 0.5 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 53 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 284 | 340 | 13,385 | 2,125,807 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | < 1.8% > | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| NSI NV | 9 | 12 | 245 | 38,944 | 0.0 | |
| VASTNED RETAIL NV | 9 | 6 | 127 | 20,283 | 0.0 | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 21 | 24 | 557 | 88,515 | 0.1 | |
| WERELDHAVE NV | 18 | 24 | 352 | 55,980 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 59 | 67 | 1,282 | 203,723 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | < 0.2% > | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | 32 | 32 | 205 | 32,561 | 0.0 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 163 | 194 | 1,919 | 304,905 | 0.3 | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI | 146 | 170 | 1,099 | 174,582 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 343 | 397 | 3,224 | 512,050 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.4% > | |

| 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 | % | |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSE | 11 | 17 | 370 | 58,778 | 0.1 | |
| RETAIL ESTATES | 5 | 6 | 440 | 69,919 | 0.1 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 77 | 100 | 2,778 | 441,233 | 0.4 | |
| AEDIFICA | 19 | 28 | 1,790 | 284,411 | 0.2 | |
| MONTEA NV | 5 | 9 | 782 | 124,209 | 0.1 | |
| CARE PROPERTY INVEST | 12 | 16 | 221 | 35,252 | 0.0 | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 12 | 16 | 497 | 79,073 | 0.1 | |
| COFINIMMO | 14 | 21 | 1,492 | 237,036 | 0.2 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 159 | 217 | 8,374 | 1,329,913 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | < 1.1% > | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 229 | 229 | 247 | 39,311 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 229 | 229 | 247 | 39,311 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…ガーンジー) | | | | | | |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | — | 19 | 819 | 130,155 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | — | 19 | 819 | 130,155 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | — | 1 | — | < 0.1% > | |
| (ユーロ…シンガポール) | | | | | | |
| CROMWELL REIT EUR | 163 | 199 | 281 | 44,672 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 163 | 199 | 281 | 44,672 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,304 | 1,537 | 27,965 | 4,441,258 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 28 | 28 | — | < 3.8% > | |
| (イギリス) | | | 千イギリスポンド | | | |
| BRITISH LAND CO PLC | 465 | 533 | 2,111 | 388,646 | 0.3 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 122 | 155 | 657 | 121,015 | 0.1 | |
| HAMMERSON PLC | 2,022 | 2,333 | 652 | 120,152 | 0.1 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 372 | 440 | 3,070 | 565,139 | 0.5 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 671 | 742 | 765 | 140,903 | 0.1 | |
| SEGRO PLC | 596 | 711 | 6,144 | 1,130,957 | 1.0 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 65 | 72 | 392 | 72,162 | 0.1 | |
| SHAFTESBURY PLC | 141 | — | — | — | — | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 84 | 112 | 1,313 | 241,785 | 0.2 | |
| DERWENT LONDON PLC | 55 | 63 | 1,464 | 269,644 | 0.2 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 499 | 623 | 1,156 | 212,808 | 0.2 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 101 | 121 | 1,034 | 190,339 | 0.2 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 908 | 1,083 | 1,783 | 328,260 | 0.3 | |
| ASSURA PLC | 1,479 | 1,769 | 847 | 155,981 | 0.1 | |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 308 | 308 | 136 | 25,166 | 0.0 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 306 | 372 | 354 | 65,264 | 0.1 | |
| REGIONAL REIT LTD | 221 | 125 | 42 | 7,747 | 0.0 | |
| NEWRIVER REIT PLC | 188 | 188 | 158 | 29,187 | 0.0 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 336 | — | — | — | — | |
| UNITE GROUP PLC/THE | 193 | 231 | 2,392 | 440,330 | 0.4 | |

| 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 | % | |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 184 | 246 | 222 | 40,944 | 0.0 | |
| LXI REIT PLC | 827 | 989 | 1,024 | 188,479 | 0.2 | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 464 | 464 | 294 | 54,287 | 0.0 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING | 175 | 175 | 110 | 20,423 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 276 | 360 | 253 | 46,716 | 0.0 | |
| AEW UK REIT PLC | 55 | 118 | 116 | 21,473 | 0.0 | |
| SHAFESBURY CAPITAL PLC | 441 | 1,105 | 1,515 | 279,008 | 0.2 | |
| BALANCED COMM PROPERTY TRUST | 418 | 417 | 300 | 55,392 | 0.0 | |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE | 219 | 291 | 252 | 46,557 | 0.0 | |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 603 | 754 | 649 | 119,498 | 0.1 | |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 168 | 189 | 100 | 18,434 | 0.0 | |
| HOME REIT PLC | 398 | 398 | 151 | 27,929 | 0.0 | |
| PRS REIT PLC/THE | 258 | 310 | 269 | 49,515 | 0.0 | |
| WAREHOUSE REIT PLC | 197 | 260 | 228 | 42,095 | 0.0 | |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT | 100 | — | — | — | — | |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 217 | 260 | 322 | 59,362 | 0.1 | |
| CLS HOLDINGS PLC | 90 | 90 | 90 | 16,664 | 0.0 | |
| HELICAL PLC | — | 60 | 130 | 24,090 | 0.0 | |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | — | 209 | 132 | 24,412 | 0.0 | |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | — | 371 | 324 | 59,726 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 14,239 | 17,066 | 30,970 | 5,700,507 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 37 | 37 | — | < 4.9% > | |
| (オーストラリア) | | | | 千オーストラリアドル | | |
| VICINITY CENTRES | 1,933 | 2,220 | 4,418 | 429,946 | 0.4 | |
| ABACUS GROUP | 196 | 258 | 288 | 28,027 | 0.0 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 185 | 236 | 1,036 | 100,828 | 0.1 | |
| CHARTER HALL GROUP | 233 | 270 | 3,088 | 300,576 | 0.3 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 163 | 195 | 571 | 55,650 | 0.0 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 651 | 821 | 340 | 33,169 | 0.0 | |
| REGION RE LTD | 579 | 703 | 1,532 | 149,171 | 0.1 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 156 | 156 | 372 | 36,286 | 0.0 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 536 | 744 | 1,659 | 161,506 | 0.1 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 256 | 148 | 96 | 9,408 | 0.0 | |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 105 | 114 | 316 | 30,780 | 0.0 | |
| SCENTRE GROUP | 2,556 | 2,989 | 8,788 | 855,256 | 0.7 | |
| ARENA REIT | 166 | 193 | 696 | 67,727 | 0.1 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS | 84 | 115 | 322 | 31,365 | 0.0 | |
| WAYPOINT REIT | 338 | 384 | 915 | 89,039 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 323 | 398 | 1,439 | 140,106 | 0.1 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 223 | 223 | 296 | 28,863 | 0.0 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 179 | 228 | 461 | 44,883 | 0.0 | |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 259 | 327 | 1,043 | 101,509 | 0.1 | |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 358 | 502 | 829 | 80,750 | 0.1 | |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 786 | 1,044 | 1,258 | 122,511 | 0.1 | |
| DEXUS/AU | 530 | 623 | 4,674 | 454,845 | 0.4 | |

| 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 | 千口 | 千オーストラリアドル | 千円 | % | |
| HEALTHCO REIT | 103 | 303 | 418 | 40,757 | 0.0 | |
| HMC CAPITAL LTD | 99 | 151 | 862 | 83,948 | 0.1 | |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE | 140 | — | — | — | — | |
| ABACUS STORAGE KING | — | 349 | 381 | 37,087 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 944 | 1,092 | 4,885 | 475,417 | 0.4 | |
| MIRVAC GROUP | 1,946 | 2,346 | 4,763 | 463,558 | 0.4 | |
| STOCKLAND | 1,176 | 1,373 | 5,934 | 577,476 | 0.5 | |
| BWP TRUST | 227 | 286 | 979 | 95,351 | 0.1 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 256 | 320 | 1,119 | 108,935 | 0.1 | |
| GOODMAN GROUP | 848 | 1,004 | 24,128 | 2,347,898 | 2.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 16,552 | 20,131 | 77,922 | 7,582,644 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 31 | 31 | — | <6.5%> | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR | 224 | — | — | — | — | |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | 706 | 876 | 762 | 68,986 | 0.1 | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 512 | 596 | 1,347 | 121,851 | 0.1 | |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 672 | 831 | 1,055 | 95,463 | 0.1 | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 451 | 451 | 510 | 46,147 | 0.0 | |
| STRIDE PROPERTY GROUP | 293 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2,860 | 2,755 | 3,675 | 332,448 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 4 | — | <0.3%> | |
| (香港) | | | 千香港ドル | | | |
| LINK REIT | 1,040 | 1,487 | 63,813 | 1,185,021 | 1.0 | |
| CHAMPION REIT | 926 | 1,129 | 2,619 | 48,640 | 0.0 | |
| PROSPERITY REIT | 760 | 760 | 1,056 | 19,617 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 973 | 1,304 | 1,577 | 29,300 | 0.0 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 437 | 635 | 1,365 | 25,352 | 0.0 | |
| FORTUNE REIT | 746 | 855 | 4,146 | 77,005 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 4,882 | 6,170 | 74,579 | 1,384,937 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 6 | 6 | — | <1.2%> | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | | |
| SUNTEC REIT | 1,101 | 1,267 | 1,559 | 170,134 | 0.1 | |
| KEPPEL REIT | 988 | 1,267 | 1,172 | 127,956 | 0.1 | |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 1,083 | 1,381 | 1,346 | 146,935 | 0.1 | |
| ESR-LOGOS REIT | 2,797 | 3,783 | 1,229 | 134,184 | 0.1 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 380 | 427 | 470 | 51,337 | 0.0 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 527 | 653 | 1,464 | 159,831 | 0.1 | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 683 | 704 | 366 | 39,963 | 0.0 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 1,592 | 1,896 | 3,166 | 345,508 | 0.3 | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 591 | 703 | 647 | 70,664 | 0.1 | |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 512 | — | — | — | — | |
| AIMS APAC REIT | 243 | 411 | 542 | 59,199 | 0.1 | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 177 | 234 | 861 | 93,965 | 0.1 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 981 | 1,217 | 3,043 | 332,052 | 0.3 | |
| MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST | 1,141 | 1,393 | 2,117 | 231,079 | 0.2 | |

| 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 | |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポールドル | 千円 | % |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 549 | 677 | 450 | 49,140 | 0.0 |
| QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 1,306 | — | — | — | — |
| PARAGON REIT | 599 | 719 | 626 | 68,324 | 0.1 |
| KEPPEL DC REIT | 657 | 758 | 1,440 | 157,196 | 0.1 |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCI | 1,413 | 1,768 | 2,016 | 220,053 | 0.2 |
| EC WORLD REIT | 199 | 199 | 55 | 6,092 | 0.0 |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 272 | 272 | 186 | 20,368 | 0.0 |
| LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 880 | 1,007 | 639 | 69,776 | 0.1 |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | 246 | — | — | — | — |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMER | 2,484 | 2,909 | 5,818 | 634,888 | 0.5 |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 1,653 | 2,052 | 6,032 | 658,307 | 0.6 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 23,066 | 25,705 | 35,254 | 3,846,962 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 25 | 22 | — | < 3.3% > |
| (韓国) | | | 千韓国ウォン | | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 28 | 44 | 291,261 | 32,213 | 0.0 |
| LOTTE REIT CO LTD | 57 | 80 | 254,311 | 28,126 | 0.0 |
| MIRAE ASIA PAC REAL EST-1 | 36 | — | — | — | — |
| ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 74 | 96 | 352,364 | 38,971 | 0.0 |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 30 | — | — | — | — |
| JR REIT XXVII | 64 | 87 | 365,086 | 40,378 | 0.0 |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | 18 | 18 | 95,468 | 10,558 | 0.0 |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | 21 | 42 | 137,172 | 15,171 | 0.0 |
| SK REITS CO LTD | 35 | 62 | 248,522 | 27,486 | 0.0 |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | 32 | 32 | 110,008 | 12,166 | 0.0 |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT | 18 | — | — | — | — |
| E KOCREF CR-REIT CO LTD | 12 | — | — | — | — |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 429 | 463 | 1,854,195 | 205,073 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 12 | 8 | — | < 0.2% > |
| (イスラエル) | | | 千イスラエルシェケル | | |
| REIT 1 LTD | 90 | 109 | 1,944 | 77,006 | 0.1 |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 113 | 113 | 981 | 38,881 | 0.0 |
| MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 305 | 406 | 730 | 28,947 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 508 | 629 | 3,657 | 144,835 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.1% > |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 77,560 | 90,988 | — | 114,401,255 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 325 | 305 | — | < 98.2% > |

(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 | |
|-----|-------------|------------|--------------|----------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国 | 不動産投信指数先物取引 | DJREIT2403 | 百万円 2,279 | 百万円 - |

(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1月5日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 投資証券 | 千円 114,401,255 | % 98.0 |
| コール・ローン等、その他 | 2,348,445 | 2.0 |
| 投資信託財産総額 | 116,749,700 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産（116,465,577千円）の投資信託財産総額（116,749,700千円）に対する比率は99.8%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=145.02円 | 1 カナダドル=108.63円 | 1 ユーロ=158.81円 | 1 イギリスポンド=184.06円 |
| 1 オーストラリアドル=97.31円 | 1 ニュージーランドドル=90.45円 | 1 香港ドル=18.57円 | 1 シンガポールドル=109.12円 |
| 100韓国ウォン=11.06円 | 1 イスラエルシェケル=39.6025円 | | |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月5日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 117,039,401,538 |
| コール・ローン等 | 912,696,203 |
| 投資証券(評価額) | 114,401,255,608 |
| 未収入金 | 290,073,979 |
| 未収配当金 | 474,174,156 |
| 差入委託証拠金 | 961,201,592 |
| (B) 負債 | 581,907,638 |
| 未払金 | 312,596,566 |
| 未払解約金 | 269,311,013 |
| 未払利息 | 59 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 116,457,493,900 |
| 元本 | 45,483,654,763 |
| 次期繰越損益金 | 70,973,839,137 |
| (D) 受益権総口数 | 45,483,654,763口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 25,604円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 40,515,017,562円
 期中追加設定元本額 10,954,954,792円
 期中一部解約元本額 5,986,317,591円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.5604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)

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| eMAXIS Slim バランス(8資産均等型) | 11,589,964,172円 |
| eMAXIS Slim 先進国リートインデックス | 10,007,487,864円 |
| eMAXIS 先進国リートインデックス | 5,993,296,223円 |
| つみたて8資産均等バランス | 5,653,815,055円 |
| 三菱UFJ <DC>先進国REITインデックスファンド | 3,277,288,724円 |
| eMAXIS バランス(8資産均等型) | 2,342,855,681円 |
| オルタナティブ資産セレクション(ラップ向け) | 1,567,691,742円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート | 872,874,739円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型) | 777,967,410円 |
| 海外リートインデックスファンドS | 718,073,904円 |
| 三菱UFJ ブライムバランス(8資産)(確定拠出年金) | 597,167,019円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー) | 416,597,800円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード) | 340,589,407円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型) | 300,321,949円 |
| eMAXIS バランス(波乗り型) | 210,585,598円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー) | 134,919,872円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(2ヵ月分配型) | 106,730,421円 |
| 三菱UFJ 先進国リートインデックスファンド | 97,044,067円 |
| 三菱UFJ 6資産バランスファンド(成長型) | 93,127,745円 |
| eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー) | 92,580,986円 |
| MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型) | 64,670,216円 |

○損益の状況 (2023年1月6日~2024年1月5日)

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 4,276,769,053 |
| 受取配当金 | 4,166,855,325 |
| 受取利息 | 107,934,343 |
| その他収益金 | 2,043,783 |
| 支払利息 | △ 64,398 |
| (B) 有価証券売買損益 | 15,121,913,208 |
| 売買益 | 19,312,572,076 |
| 売買損 | △ 4,190,658,868 |
| (C) 先物取引等取引損益 | △ 307,082,062 |
| 取引益 | 761,589,526 |
| 取引損 | △ 1,068,671,588 |
| (D) 保管費用等 | △ 62,772,041 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 19,028,828,158 |
| (F) 前期繰越損益金 | 46,669,776,550 |
| (G) 追加信託差損益金 | 13,560,108,908 |
| (H) 解約差損益金 | △ 8,284,874,479 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 70,973,839,137 |
| 次期繰越損益金(I) | 70,973,839,137 |

(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) (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。

| | |
|-------------------------------|-----------------|
| eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー) | 56,346,040円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド (バランス型) | 54,285,579円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型) | 34,400,995円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド (分配型) | 29,997,986円 |
| 三菱UFJ 資産設計ファンド (株式重視型) | 24,888,416円 |
| 世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定) | 17,980,892円 |
| 三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型) | 3,944,730円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1980s | 3,074,028円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1970s | 1,591,598円 |
| eMAXIS マイマネージャー 1990s | 1,039,197円 |
| ラップ向けインデックスf 先進国リート (為替ヘッジあり) | 303,033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) | 151,675円 |
| 合計 | 45,483,654,763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)