

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

運用報告書（全体版）

第208期（決算日 2023年1月16日） 第210期（決算日 2023年3月15日） 第212期（決算日 2023年5月15日）
 第209期（決算日 2023年2月15日） 第211期（決算日 2023年4月17日） 第213期（決算日 2023年6月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
 「世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型」は、2023年6月15日に第213期の決算を行ないましたので、第208期から第213期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2005年9月29日から原則無期限です。	
運用方針	主として投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	投資信託証券を主要投資対象とします。
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	外貨建資産への投資は行ないません。
	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行ないません。
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	第1計算期から第3計算期までは収益分配を行ないません。第4計算期以降、毎決算時、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。	

<940607>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
 www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
 午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・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。

○最近30期の運用実績

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	投資信託証券組入比率	純資産総額
		税金	み騰騰	期中落					
	円	円	%	%	%	%	%	百万円	
184期(2021年1月15日)	9,059	10	1.8	33.3	0.2	31.3	32.4	31,348	
185期(2021年2月15日)	9,437	10	4.3	33.1	0.2	30.5	33.9	32,251	
186期(2021年3月15日)	9,629	10	2.1	32.9	0.3	30.4	34.0	32,518	
187期(2021年4月15日)	9,806	10	1.9	32.6	0.5	30.4	33.9	32,774	
188期(2021年5月17日)	9,821	10	0.3	32.1	0.5	30.8	34.3	33,128	
189期(2021年6月15日)	10,217	10	4.1	32.0	0.4	32.4	32.8	34,941	
190期(2021年7月15日)	10,196	10	△0.1	31.9	0.4	32.4	32.9	35,258	
191期(2021年8月16日)	10,206	10	0.2	32.3	0.3	32.5	32.7	35,663	
192期(2021年9月15日)	10,307	10	1.1	33.0	0.3	32.1	32.2	36,197	
193期(2021年10月15日)	10,387	10	0.9	32.6	0.5	32.1	32.6	36,461	
194期(2021年11月15日)	10,509	10	1.3	32.8	0.6	31.8	32.5	36,748	
195期(2021年12月15日)	10,365	10	△1.3	32.4	0.3	32.2	32.8	36,248	
196期(2022年1月17日)	10,348	10	△0.1	32.7	0.3	32.1	32.6	36,081	
197期(2022年2月15日)	9,963	10	△3.6	31.9	0.4	32.5	32.8	34,713	
198期(2022年3月15日)	9,866	10	△0.9	31.1	0.2	32.8	33.4	34,327	
199期(2022年4月15日)	10,503	10	6.6	31.5	0.4	31.3	34.3	36,574	
200期(2022年5月16日)	10,171	10	△3.1	31.3	0.5	33.4	32.2	35,776	
201期(2022年6月15日)	9,906	10	△2.5	31.8	0.3	33.5	31.5	35,426	
202期(2022年7月15日)	10,204	10	3.1	31.7	0.4	33.0	32.6	36,915	
203期(2022年8月15日)	10,568	10	3.7	32.5	0.3	31.7	33.1	38,365	
204期(2022年9月15日)	10,482	10	△0.7	32.2	0.3	32.3	32.8	38,197	
205期(2022年10月17日)	9,963	10	△4.9	32.4	0.3	33.4	31.5	36,483	
206期(2022年11月15日)	10,235	10	2.8	32.9	0.5	32.3	32.4	37,501	
207期(2022年12月15日)	10,208	10	△0.2	32.7	0.4	32.4	32.5	37,443	
208期(2023年1月16日)	9,753	10	△4.4	32.6	0.4	32.7	32.3	35,866	
209期(2023年2月15日)	10,085	10	3.5	33.3	0.3	32.0	31.5	37,175	
210期(2023年3月15日)	9,935	10	△1.4	33.0	0.3	33.0	32.6	36,588	
211期(2023年4月17日)	10,088	10	1.6	33.7	0.5	32.6	31.3	37,178	
212期(2023年5月15日)	10,322	10	2.4	33.7	0.5	32.2	31.9	38,149	
213期(2023年6月15日)	10,678	10	3.5	32.7	0.4	32.0	32.7	39,363	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(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」は実質比率を記載しております。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 性格の異なる複数の親投資信託の受益証券に投資するため、適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準	価 額		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率				
第208期	(期 首) 2022年12月15日	円 10,208	% —	% 32.7	% 0.4	% 32.4	% 32.5	
	12月末	9,801	△4.0	32.3	0.5	32.7	32.3	
	(期 末) 2023年1月16日	9,763	△4.4	32.6	0.4	32.7	32.3	
第209期	(期 首) 2023年1月16日	9,753	—	32.6	0.4	32.7	32.3	
	1月末	9,981	2.3	33.0	0.4	32.2	32.5	
	(期 末) 2023年2月15日	10,095	3.5	33.3	0.3	32.0	31.5	
第210期	(期 首) 2023年2月15日	10,085	—	33.3	0.3	32.0	31.5	
	2月末	10,118	0.3	33.2	0.4	32.1	32.3	
	(期 末) 2023年3月15日	9,945	△1.4	33.0	0.3	33.0	32.6	
第211期	(期 首) 2023年3月15日	9,935	—	33.0	0.3	33.0	32.6	
	3月末	10,002	0.7	33.3	0.7	32.9	31.1	
	(期 末) 2023年4月17日	10,098	1.6	33.7	0.5	32.6	31.3	
第212期	(期 首) 2023年4月17日	10,088	—	33.7	0.5	32.6	31.3	
	4月末	10,209	1.2	33.5	0.5	32.3	31.8	
	(期 末) 2023年5月15日	10,332	2.4	33.7	0.5	32.2	31.9	
第213期	(期 首) 2023年5月15日	10,322	—	33.7	0.5	32.2	31.9	
	5月末	10,411	0.9	31.6	0.5	32.6	32.2	
	(期 末) 2023年6月15日	10,688	3.5	32.7	0.4	32.0	32.7	

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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」は実質比率を記載しております。

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

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

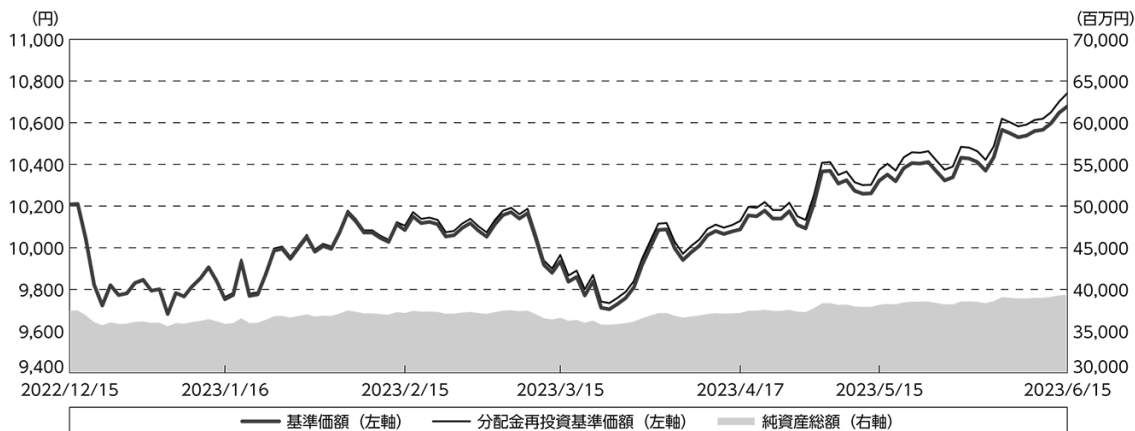
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2022年12月16日～2023年6月15日)

作成期間中の基準価額等の推移



第208期首：10,208円

第213期末：10,678円（既払分配金（税込み）：60円）

騰落率：5.2%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2022年12月15日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定していません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、国内外の不動産、債券、株式に実質的に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。また、国内外の各資産への投資にあたっては、各資産を投資対象とする6つのマザーファンドを通じて行っており、各マザーファンドの組入比率は、それぞれ、純資産総額の1/6を目途としております。当作成期間中における各マザーファンドの騰落率は以下の通りです。

投資対象資産	投資対象ファンド	作成期間中の騰落率
不動産	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	△2.1%
	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2.6%
債券	日本債券インデックスマザーファンド	1.0%
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2.7%
株式	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	17.9%
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	13.4%

当作成期間中における投資対象先6つのマザーファンドの基準価額は、国内のリートに投資するマザーファンドの基準価額は値下がりましたが、国内外の株式や海外のリート、国内外の債券に投資するマザーファンドの基準価額は値上がりとなりました。

米国の消費者物価指数（CPI）などのインフレ指標が市場予想を下回り、米国連邦準備制度理事会（FRB）の利上げペース鈍化への期待が強まったことなどが国内外の株式や海外のリートに投資するマザーファンドの基準価額の値上がり要因となりました。また、米国の市場予想を下回る全米供給管理協会（ISM）製造業景況指数などを受けて、FRBによる利上げの鈍化が見込まれたことなどが国内外の債券に投資するマザーファンドの基準価額の値上がり要因となりました。一方、日銀が金融政策決定会合において長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）における長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことなどが国内のリートに投資するマザーファンドの基準価額の値下がりに要因となりました。主要通貨に対して円安となったことは海外資産に投資するマザーファンドの値上がり要因となりました。

投資環境

（国内不動産投資信託市況）

国内不動産投資信託市場では、東証REIT指数（配当込み）は期間の初めと比べて下落しました。

都心部オフィスにおける空室率が低下したことや、日銀が指値オペを継続し国内長期金利の上昇を抑制したこと、日銀新総裁が就任会見において現行の金融緩和政策を継続する考えを示したことなどはREIT価格の支援材料となりました。しかし、都心部オフィスにおける平均賃料が下落したことや、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことを受けて国内10年国債利回りが上昇したこと、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したことなどがREIT価格の重しとなり、東証REIT指数（配当込み）は下落しました。

（海外不動産投資信託市況）

海外のREIT市場では、S&P先進国REIT指数（除く日本）は期間の初めと比べて下落しました。

期間の初めから2023年2月下旬にかけては、FRBによる金融引き締めが長期化するとの見通しが強まったことを受けて米国の長期金利が上昇したことがREIT価格の重しとなったものの、米国のインフレ鈍化への期待やFRBによる利上げ幅の縮小観測の高まり、市場予想を下回るユーロ圏のCPI速報値や天然ガス価格の下落を受けた欧州のインフレ圧力の緩和が期待されたこと、更に中国景気の回復期待などを受けて株式市場が上昇したことが支援要因となり、同指数は上昇しました。3月上旬から5月下旬にかけては、欧米の中央銀行が政策金利を引き上げたことに加えて欧米の金融政策当局者によるタカ派（金融引き締めを支持）的発言があったこと、イングランド銀行（BOE）による金融引き締めの長期化が警戒されたこと、信用格付けの引き下げを受けてスウェーデンの商業用不動産保有会社が配当金支払いの一時停止を発表したこと、一部の米国地方銀行を巡る懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったことが重しとなり、同指数は下落しました。6月上旬から期間末にかけては、米国のインフレ指標が市場予想を下回ったことを受けて、FRBが政策金利を据え置くとの観測が広がったことなどを背景に株式市場が上昇したことなどが支援要因となり、同指数は上昇しました。

（国内債券市況）

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したことや金融機関へ資金を貸し出す「共通担保資金供給オペ」の拡充を決定したこと、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化への懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、日銀新総裁が就任会見で現行の金融緩和政策を継続する考えを示したことなどが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、日銀が金融政策決定会合でイールドカーブ・コントロール政策における長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことや、日銀が金融政策決定会合で金融緩和政策の修正に動くとの観測が強まったこと、複数のFRB高官の発言などから米国の金融引き締めの長期化が意識されたことなどにより、10年国債利回りは上昇しました。

（海外債券市況）

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇しました。

期間の初めから2023年2月下旬にかけては、米国の雇用統計の内容が堅調だったことや、米国のインフレ指標が市場予想を上回ったことなどを背景にFRBによる金融引き締めが長期化するとの見通しが強まったこと、欧州中央銀行（ECB）などが利上げの継続を示したことなどをを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。3月上旬から期間末にかけては、米国や英国などの中央銀行が政策金利を引き上げたことや、FRB高官のタカ派的な発言などが利回りの上昇要因となったものの、米国の市場予想を下回るISM製造業景況指数などをを受けて、FRBによる利上げの鈍化が見込まれたこと、一部の米国地方銀行を巡る懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、ユーロ圏およびドイツの鉱工業生産や製造業購買担当者景気指数（PMI）速報値が市場予想を下回ったことを背景に景気後退が懸念されたなどをを受けて、各国の10年債利回りは総じて低下しました。

（国内株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて上昇しました。

日銀が金融政策決定会合において長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことをを受けて、国内長期金利の上昇による景気の先行き不透明感が広がったことや、欧米の金融機関の経営破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたことなどが株価の重しとなったものの、中国で新型コロナウイルスを抑え込むゼロコロナ政策が解除され、中国景気の回復が期待されたことや、米国の金融当局が預金者保護を表明したことや主要中央銀行による流動性供給などをを受けて金融システムへの警戒感が和らいだこと、日銀新総裁が就任会見にて現行の金融緩和政策を継続する考えを示したこと、円安／アメリカドル高が進行し輸出企業の業績改善が期待されたこと、米国の半導体大手が市場予想を大きく上回る売上高見通しを示し、業界の先行きへの期待が高まったことなどから、TOPIXは上昇しました。

（海外株式市況）

海外株式市場では、米国や欧州各国などの株価は、期間の初めと比べて概して上昇しました。

インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したこと、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化から金融システムに対する不安が高まったことなどが株価の重しとなったものの、米国のCPIなどのインフレ指標が市場予想を下回り、FRBの利上げペース鈍化への期待が強まったことや、米国連邦公開市場委員会（FOMC）における利上げ幅の縮小観測が強まったこと、ユーロ圏やドイツのCPIが市場予想を下回りインフレ圧力の緩和が見られたこと、交渉難航が懸念された米国政府の債務上限問題を巡る政府と野党の協議が最終的に基本合意し、米国債務上限停止法案が成立したことなどを背景に、米国や欧州各国などの株価は概して上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

主として、国内外の不動産、債券、株式に実質的に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないました。国内外の各資産を投資対象とする6つのマザーファンドへ投資を行ないました。各マザーファンドの組入比率は、それぞれ、純資産総額の1/6を目途としました。

（投資先の各マザーファンド）

各マザーファンドの運用においては、各マザーファンドがそれぞれに定めるベンチマークへの連動をめざして運用を行ないました。各マザーファンドは、ベンチマーク採用銘柄の入れ替えなどに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。各マザーファンドが定めるベンチマークは以下の通りです。

マザーファンド	ベンチマーク
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI 総合
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	東証株価指数
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	MSCI-KOKUSAI インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

分配金は、運用実績や市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項 目	第208期	第209期	第210期	第211期	第212期	第213期
	2022年12月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年2月15日	2023年2月16日～ 2023年3月15日	2023年3月16日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年5月15日	2023年5月16日～ 2023年6月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.102%	10 0.099%	10 0.101%	10 0.099%	10 0.097%	10 0.094%
当期の収益	10	10	10	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,394	2,398	2,406	2,432	2,437	2,511

（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

（当ファンド）

引き続き、主として、国内外の不動産、債券、株式に実質的に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。国内外の各資産を投資対象とする6つのマザーファンドへ投資を行ないます。各マザーファンドの組入比率は、それぞれ、純資産総額の1/6を目途とします。

（投資先の各マザーファンド）

当ファンドの投資先である各マザーファンドの運用においては、引き続き、各マザーファンドがそれぞれに定めるベンチマークへの連動をめざして運用を行なう方針です。各マザーファンドは、ベンチマーク採用銘柄の入れ替えなどに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行なう方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくごお願い申し上げます。

○ 1万口当たりの費用明細

(2022年12月16日～2023年6月15日)

項 目	第208期～第213期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 53	% 0.521	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(22)	(0.219)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(28)	(0.274)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.002)	
（ 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＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	3	0.025	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 等 ）	(1)	(0.011)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用など
（ そ の 他 ）	(0)	(0.004)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	56	0.549	
作成期間の平均基準価額は、10,087円です。			

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

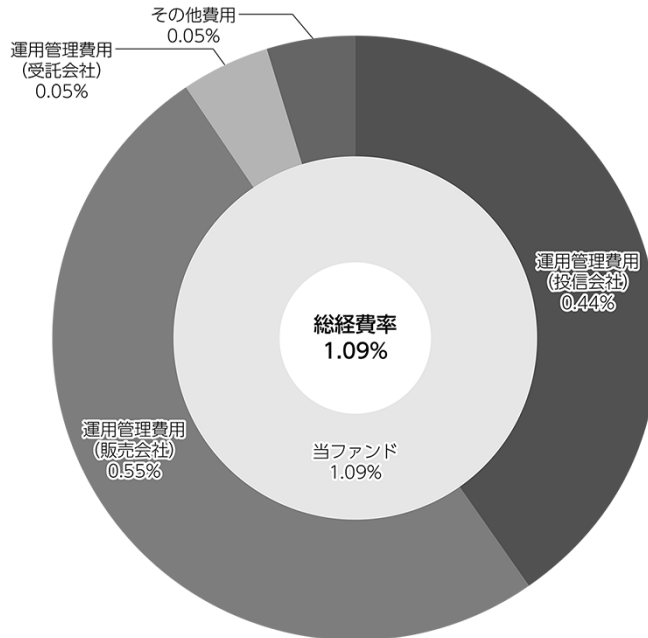
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間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

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.09%です。



(注) 当ファンドの費用は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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2022年12月16日～2023年6月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第208期～第213期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	千口 113,581	千円 282,895	千口 1,840	千円 4,607
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	167,497	457,129	30,183	84,093
日本債券インデックスマザーファンド	94,217	129,451	22,727	30,927
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	56,634	146,571	13,740	35,900
日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド	9,146	19,950	377,242	811,157
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	1,173	4,779	94,762	436,720

○株式売買比率

(2022年12月16日～2023年6月15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	第208期～第213期	
	日本株式インデックス T O P I Xマザーファンド	海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジなし） マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	4,467,264千円	21,723,365千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	45,373,380千円	254,991,054千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09	0.08

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

○利害関係人との取引状況等

(2022年12月16日～2023年6月15日)

利害関係人の発行する有価証券等

＜世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型＞

該当事項はございません。

＜日本リートインデックスJ-REITマザーファンド＞

該当事項はございません。

＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

該当事項はございません。

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

該当事項はございません。

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

該当事項はございません。

＜日本株式インデックスTOPIXマザーファンド＞

種 類	第208期～第213期		
	買 付 額	売 付 額	第213期末保有額
株式	百万円 1	百万円 4	百万円 140

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド＞

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年12月16日～2023年6月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年12月16日～2023年6月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年6月15日現在)

親投資信託残高

銘柄	第207期末	第213期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,382,153	2,493,894	6,299,578
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,143,651	2,280,965	6,527,211
日本債券インデックスマザーファンド	4,491,558	4,563,048	6,272,366
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,355,015	2,397,909	6,373,164
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,215,724	2,847,628	6,612,477
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	1,441,704	1,348,115	6,575,836

(注) 各親投資信託の2023年6月15日現在の受益権総口数は、以下の通りです。

・日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	23,882,441千口	・海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	58,234,773千口
・海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	20,078,950千口	・日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	21,889,552千口
・日本債券インデックスマザーファンド	37,056,558千口	・海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	60,758,637千口

○投資信託財産の構成

(2023年6月15日現在)

項目	第213期末	
	評価額	比率
	千円	%
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	6,299,578	15.9
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	6,527,211	16.5
日本債券インデックスマザーファンド	6,272,366	15.9
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	6,373,164	16.1
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	6,612,477	16.7
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	6,575,836	16.6
コール・ローン等、その他	850,839	2.3
投資信託財産総額	39,511,471	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（293,929,965千円）の投資信託財産総額（296,439,509千円）に対する比率は99.2%です。

(注) 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（154,729,550千円）の投資信託財産総額（154,932,152千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産（57,447,425千円）の投資信託財産総額（57,469,398千円）に対する比率は100.0%です。

(注) 外貨建資産は、当作成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。1アメリカドル=140.39円、1カナダドル=105.30円、1メキシコペソ=8.1853円、1ユーロ=152.15円、1イギリスポンド=177.72円、1スイスフラン=155.82円、1スウェーデンクローナ=13.09円、1ノルウェークローネ=13.16円、1デンマーククローネ=20.42円、1ポーランドズロチ=34.1605円、1オーストラリアドル=95.37円、1ニュージーランドドル=86.93円、1香港ドル=17.93円、1シンガポールドル=104.58円、1マレーシアリンギット=30.3592円、1韓国ウォン=0.1102円、1中国人民元=19.5933円、1イスラエルシェケル=39.1785円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第208期末	第209期末	第210期末	第211期末	第212期末	第213期末
	2023年1月16日現在	2023年2月15日現在	2023年3月15日現在	2023年4月17日現在	2023年5月15日現在	2023年6月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	35,955,940,006	37,262,413,228	36,692,421,843	37,267,025,910	38,247,160,726	39,511,471,598
コール・ローン等	649,368,861	638,543,409	600,806,881	569,729,110	586,192,083	815,533,330
日本リートインデックス-REITマザーファンド(評価額)	5,765,618,857	5,782,105,355	5,812,163,657	5,886,223,964	6,141,170,145	6,299,578,767
海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド(評価額)	5,788,850,177	6,198,107,272	5,807,725,552	5,755,147,502	6,009,512,371	6,527,211,902
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	5,994,135,382	6,039,890,198	6,129,210,453	6,097,827,778	6,151,350,583	6,272,366,499
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド(評価額)	5,779,722,291	5,917,109,957	6,023,224,001	6,079,797,431	6,193,702,825	6,373,164,916
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド(評価額)	6,047,261,090	6,348,709,888	6,209,578,965	6,477,764,003	6,722,627,859	6,612,477,036
海外株式インデックス(ヘッジなし)マザーファンド(評価額)	5,926,505,386	6,333,080,172	6,084,994,047	6,397,247,069	6,442,604,860	6,575,836,317
未収入金	4,477,962	4,866,977	24,718,287	3,289,053	—	35,302,831
(B) 負債	89,346,162	86,990,770	103,960,253	88,680,506	97,168,713	147,634,822
未払収益分配金	36,774,256	36,860,987	36,826,933	36,855,503	36,960,227	36,865,702
未払解約金	15,759,638	14,455,210	32,770,843	12,200,459	24,338,704	69,300,347
未払信託報酬	33,177,309	31,565,280	29,806,280	34,522,417	30,322,948	34,267,324
未払利息	413	366	318	141	296	1,504
その他未払費用	3,634,546	4,108,927	4,555,879	5,101,986	5,546,538	7,199,945
(C) 純資産総額(A-B)	35,866,593,844	37,175,422,458	36,588,461,590	37,178,345,404	38,149,992,013	39,363,836,776
元本	36,774,256,031	36,860,987,995	36,826,933,441	36,855,503,759	36,960,227,118	36,865,702,370
次期繰越損益金	△ 907,662,187	314,434,463	△ 238,471,851	322,841,645	1,189,764,895	2,498,134,406
(D) 受益権総口数	36,774,256,031口	36,860,987,995口	36,826,933,441口	36,855,503,759口	36,960,227,118口	36,865,702,370口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,753円	10,085円	9,935円	10,088円	10,322円	10,678円

(注) 当ファンドの第208期首元本額は36,679,093,259円、第208～213期中追加設定元本額は1,533,696,702円、第208～213期中一部解約元本額は1,347,087,591円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第208期0.9753円、第209期1.0085円、第210期0.9935円、第211期1.0088円、第212期1.0322円、第213期1.0678円です。

○損益の状況

項 目	第208期	第209期	第210期	第211期	第212期	第213期
	2022年12月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年2月15日	2023年2月16日～ 2023年3月15日	2023年3月16日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年5月15日	2023年5月16日～ 2023年6月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 19,732	△ 7,718	△ 5,006	△ 3,015	△ 18,186	△ 31,322
支払利息	△ 19,732	△ 7,718	△ 5,006	△ 3,015	△ 18,186	△ 31,322
(B) 有価証券売買損益	△1,597,603,265	1,288,483,857	△ 485,832,373	633,045,947	929,596,489	1,379,742,560
売買益	4,248,277	1,309,267,162	203,918,388	727,770,656	933,331,976	1,417,502,880
売買損	△1,601,851,542	△ 20,783,305	△ 689,750,761	△ 94,724,709	△ 3,735,487	△ 37,760,320
(C) 信託報酬等	△ 33,822,740	△ 32,179,345	△ 30,386,129	△ 35,194,015	△ 30,913,505	△ 36,048,397
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	△1,631,445,737	1,256,296,794	△ 516,223,508	597,848,917	898,664,798	1,343,662,841
(E) 前期繰越損益金	5,043,592,099	3,363,518,395	4,559,820,031	3,991,226,842	4,524,077,448	5,311,002,261
(F) 追加信託差損益金	△4,283,034,293	△4,268,519,739	△4,245,241,441	△4,229,378,611	△4,196,017,124	△4,119,664,994
(配当等相当額)	(2,407,612,042)	(2,451,467,361)	(2,476,165,840)	(2,508,367,727)	(2,574,632,829)	(2,642,288,162)
(売買損益相当額)	(△6,690,646,335)	(△6,719,987,100)	(△6,721,407,281)	(△6,737,746,338)	(△6,770,649,953)	(△6,761,953,156)
(G) 計 (D+E+F)	△ 870,887,931	351,295,450	△ 201,644,918	359,697,148	1,226,725,122	2,535,000,108
(H) 収益分配金	△ 36,774,256	△ 36,860,987	△ 36,826,933	△ 36,855,503	△ 36,960,227	△ 36,865,702
次期繰越損益金 (G+H)	△ 907,662,187	314,434,463	△ 238,471,851	322,841,645	1,189,764,895	2,498,134,406
追加信託差損益金	△4,283,034,293	△4,268,519,739	△4,245,241,441	△4,229,378,611	△4,196,017,124	△4,119,664,994
(配当等相当額)	(2,407,803,695)	(2,451,561,194)	(2,476,287,031)	(2,508,631,918)	(2,574,817,052)	(2,642,555,179)
(売買損益相当額)	(△6,690,837,988)	(△6,720,080,933)	(△6,721,528,472)	(△6,738,010,529)	(△6,770,834,176)	(△6,762,220,173)
分配準備積立金	6,398,621,002	6,390,703,514	6,385,840,030	6,457,356,475	6,433,205,474	6,617,799,400
繰越損益金	△3,023,248,896	△1,807,749,312	△2,379,070,440	△1,905,136,219	△1,047,423,455	-

(注) 損益の状況の中で (B) 有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で (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) 損益の状況の中で (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) 分配金の計算過程 (2022年12月16日～2023年6月15日) は以下の通りです。

項 目	2022年12月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年2月15日	2023年2月16日～ 2023年3月15日	2023年3月16日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年5月15日	2023年5月16日～ 2023年6月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	44,066,122円	51,614,248円	64,368,345円	133,304,946円	52,907,524円	67,809,078円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	0円	0円	0円	0円	243,165,850円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,407,803,695円	2,451,561,194円	2,476,287,031円	2,508,631,918円	2,574,817,052円	2,642,555,179円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	6,391,329,136円	6,375,950,253円	6,358,298,618円	6,360,907,032円	6,417,258,177円	6,343,690,174円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	8,843,198,953円	8,879,125,695円	8,898,953,994円	9,002,843,896円	9,044,982,753円	9,297,220,281円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,404円	2,408円	2,416円	2,442円	2,447円	2,521円
g. 分配金	36,774,256円	36,860,987円	36,826,933円	36,855,503円	36,960,227円	36,865,702円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○分配金のお知らせ

	第208期	第209期	第210期	第211期	第212期	第213期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	10円

○お知らせ

約款変更について

2022年12月16日から2023年6月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2023年6月15日）
 (2022年6月16日～2023年6月15日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2005年6月30日から原則無期限です。
運用方針	わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「東証REIT指数（配当込み）」と連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。

ファンド概要

主として、東京証券取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「東証REIT指数（配当込み）」に連動した投資成果をめざします。

不動産投資信託の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936464>

【運用報告書の表記について】

・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。

○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 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	(ベンチマーク) 期騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
14期(2019年6月17日)	22,341	15.5	3,934.65	15.8	99.4	27,572
15期(2020年6月15日)	19,644	△12.1	3,448.87	△12.3	98.6	120,656
16期(2021年6月15日)	26,874	36.8	4,720.99	36.9	99.0	81,728
17期(2022年6月15日)	24,402	△9.2	4,278.73	△9.4	96.7	58,945
18期(2023年6月15日)	25,260	3.5	4,424.14	3.4	99.0	60,326

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託 組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク) 騰落	率	
(期首) 2022年6月15日	円	%		%	%
	24,402	—	4,278.73	—	96.7
6月末	25,583	4.8	4,487.40	4.9	98.8
7月末	26,378	8.1	4,628.79	8.2	98.8
8月末	26,688	9.4	4,683.62	9.5	98.5
9月末	25,604	4.9	4,488.86	4.9	97.9
10月末	26,039	6.7	4,564.72	6.7	98.6
11月末	26,044	6.7	4,565.38	6.7	99.0
12月末	25,135	3.0	4,403.82	2.9	99.0
2023年1月末	24,347	△0.2	4,263.06	△0.4	98.8
2月末	24,725	1.3	4,331.37	1.2	98.4
3月末	24,019	△1.6	4,204.73	△1.7	98.4
4月末	25,234	3.4	4,420.34	3.3	98.8
5月末	25,397	4.1	4,448.91	4.0	97.1
(期末) 2023年6月15日	25,260	3.5	4,424.14	3.4	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2022年6月16日～2023年6月15日)

基準価額の推移

期間の初め24,402円の基準価額は、期間末に25,260円となり、騰落率は+3.5%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・都心部オフィスにおける空室率が低下したこと。
- ・日銀新総裁が就任会見において現行の金融緩和政策を継続する考えを示したこと。
- ・国内株式市場が堅調に推移し投資家のリスク回避姿勢が後退したこと。

<値下がり要因>

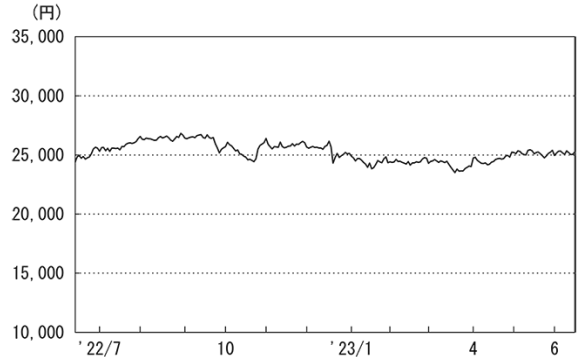
- ・都心部オフィスにおける平均賃料が下落したこと。
- ・日銀が金融政策決定会合において長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）における長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことを受けて国内10年国債利回りが上昇したこと。
- ・インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したこと。

(国内不動産投資信託市況)

国内不動産投資信託市場では、東証REIT指数（配当込み）は期間の初めと比べて上昇しました。

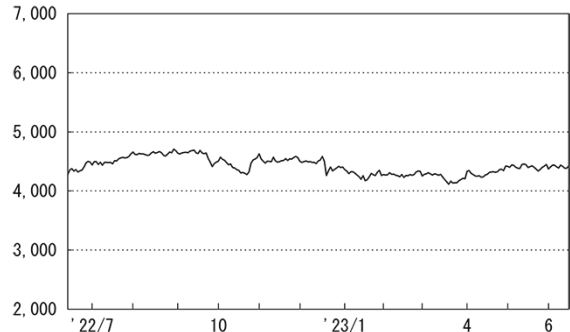
都心部オフィスにおける平均賃料が下落したことや、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容変動幅の拡大を決定したことを受けて国内10年国債利回りが上昇したこと、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの大手金融グループの経営悪化への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行が利上げを継続したことなどはREIT価格の重しとなりました。しかし、都心部オフィスにおける空室率が低下したことや、日銀が指値オペを継続し

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2022/06/15	2022/08/30	2023/03/20	2023/06/15
24,402円	26,830円	23,510円	25,260円

東証REIT指数（配当込み）の推移



国内長期金利の上昇を抑制したこと、日銀新総裁が就任会見において現行の金融緩和政策を継続する考えを示したこと、国内株式市場が堅調に推移し投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどがREIT価格の支援材料となり、東証REIT指数（配当込み）は上昇しました。

ポートフォリオ

東京証券取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざすため、組入比率を高位に維持し、「東証REIT指数」と同じような個別銘柄の時価構成比を持つポートフォリオを構築して運用を行ないました。また、不動産投資信託の新規上場など「東証REIT指数」の採用銘柄に追加・変更があった場合は、基本的に「東証REIT指数」への追加・変更タイミングに応じて対象不動産投資信託の売買を実施しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、3.5%の値上がりとなり、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の上昇率3.4%を概ね0.1%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

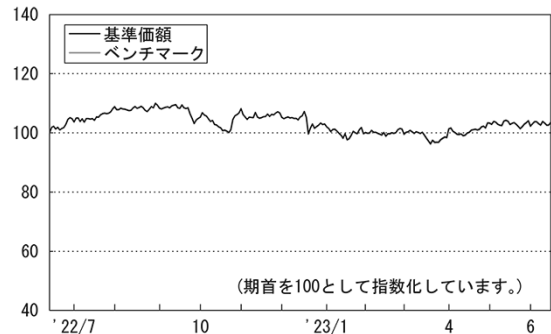
<プラス要因>

- ・信託財産留保額の計上が影響したこと。

<マイナス要因>

- ・売買委託手数料などの諸費用が発生したこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、これまでの運用方針を継続します。主として、東京証券取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の動きに連動する投資成果をめざすため、原則として「東証REIT指数」と同じような個別銘柄の時価構成比を持つポートフォリオを構築する方針です。不動産投資信託の新規上場など「東証REIT指数」の採用銘柄に追加・変更があった場合は、基本的に「東証REIT指数」への追加・変更タイミングに応じて対象不動産投資信託の売買を実施する方針です。また、不動産投資信託の組入比率は原則として高位に保ち、「東証REIT指数（配当込み）」との連動性を維持するように努めます。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2022年6月16日～2023年6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 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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、25,432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

(2022年6月16日～2023年6月15日)

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	437	50,550	389	45,065
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	692	62,770	612	56,733
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	1,184	163,381	915	131,017
	東海道リート投資法人 投資証券	765	92,991	243	28,752
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	727	451,479	662	422,345
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	2,467	375,367	2,247	345,536
	産業ファンド投資法人 投資証券	3,722	591,275	2,857	464,179
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,098	711,079	1,912	660,862
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	1,618	334,773	1,384	291,614
	アクティブィア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,082	437,457	1,011	418,308
	GLP投資法人 投資証券	7,195	1,074,719	5,841	925,369
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,053	325,852	892	284,114
国	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,872	1,199,062	2,985	940,759
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	409	279,146	336	226,093
	Oneリート投資法人 投資証券	370	91,028	333	85,046
	イオンリート投資法人 投資証券	2,434	365,875	2,373	363,617
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,977	316,343	1,788	288,979
	日本リート投資法人 投資証券	765	265,538	615	218,757
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	6,312	483,764	5,919	467,878
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	534	71,245	422	56,597
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,020	264,450	745	196,617
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	527	91,564	472	82,353
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	724	86,658	492	58,876
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	6,787	1,087,675	6,185	991,383
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	641	66,323	610	62,120
内	ラザールロジポート投資法人 投資証券	2,572	410,910	2,344	380,984
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	3,770	212,396	2,360	131,299
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	471	61,702	248	32,454
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	836	401,783	756	374,911
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	340	22,068	310	20,055
	投資法人みらい 投資証券	2,570	118,837	2,324	110,332
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	386	50,824	369	48,204
		(△ 1,301)	(△ 162,123)		
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	970	413,645	616	268,421
	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,050	196,393	745	146,068
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	346	40,775	311	37,376
	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,169	115,946	660	66,208
	アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,050	148,158	718	104,677
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,451	1,485,648	2,229	1,393,994
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,243	1,288,766	1,913	1,133,241

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 投資証券	10,593	1,085,910	9,652	1,013,483
	オリックス不動産投資法人 投資証券	4,181	754,483	3,809	702,658
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,440	534,105	1,309	500,476
	NTT都市開発リート投資法人 投資証券	2,034	283,421	1,840	262,054
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,407	277,098	1,282	251,178
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	1,766	188,872	1,351	146,228
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4,677	689,175	4,338	641,974
	森トラストリート投資法人 投資証券	2,011	225,607	1,756	204,950
		(6,365)	(162,123)		
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	9,239	452,040	8,419	397,420
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	887	451,881	706	363,673
	平和不動産リート投資法人 投資証券	1,493	224,885	1,236	186,803
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,414	437,790	1,288	402,294
	福岡リート投資法人 投資証券	1,086	179,587	990	164,865
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	959	368,856	849	414,976
	(1,489)	(-)			
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	1,720	146,897	1,568	134,258	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	423	272,087	408	267,561	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	948	138,669	864	129,289	
スターツプロシード投資法人 投資証券	441	103,202	312	75,841	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	3,249	949,750	2,936	877,571	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	7,633	563,746	6,149	442,212	
大和証券リビング投資法人 投資証券	2,903	330,381	2,456	283,682	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	1,926	243,226	1,755	226,336	
合 計	132,066	23,209,914	113,416	20,451,003	
	(6,553)	(-)			

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) () 内は分割・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。

○利害関係人との取引状況等

(2022年6月16日～2023年6月15日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2022年6月16日～2023年6月15日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2023年6月15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	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,102	1,102	1,102	135,815	0.2
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,733	1,733	1,813	159,725	0.3
S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	2,545	2,545	2,814	375,950	0.6
東海道リート投資法人 投資証券	419	419	941	114,143	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,889	1,889	1,954	1,295,502	2.1
森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,434	6,434	6,654	1,005,419	1.7
産業ファンド投資法人 投資証券	7,768	7,768	8,633	1,354,517	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,471	5,471	5,657	2,033,691	3.4
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	3,915	3,915	4,149	895,354	1.5
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,916	2,916	2,987	1,212,722	2.0
G L P 投資法人 投資証券	17,722	17,722	19,076	2,777,465	4.6
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,545	2,545	2,706	948,453	1.6
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	8,952	8,952	9,839	2,923,166	4.8
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	917	917	990	654,390	1.1
O n e リート投資法人 投資証券	950	950	987	237,373	0.4
イオンリート投資法人 投資証券	6,435	6,435	6,496	1,013,376	1.7
ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,105	5,105	5,294	825,864	1.4
日本リート投資法人 投資証券	1,688	1,688	1,838	618,487	1.0
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,609	16,609	17,002	1,356,759	2.2
トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,143	1,143	1,255	164,781	0.3
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,185	2,185	2,460	665,676	1.1
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,340	1,340	1,395	229,617	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,239	1,239	1,471	174,166	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	17,695	17,695	18,297	2,954,965	4.9
いちごホテルリート投資法人 投資証券	906	906	937	94,543	0.2
ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,699	6,699	6,927	1,118,710	1.9
スターアジア不動産投資法人 投資証券	5,655	5,655	7,065	422,487	0.7
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	641	641	864	114,480	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,155	2,155	2,235	1,148,790	1.9
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	883	883	913	59,618	0.1
投資法人みらい 投資証券	6,628	6,628	6,874	317,235	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	1,284	1,284	—	—	—
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,590	1,590	1,944	823,284	1.4
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,119	2,119	2,424	461,287	0.8
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	883	883	918	102,265	0.2
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,158	2,158	2,667	250,698	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,134	2,134	2,466	337,348	0.6
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,379	6,379	6,601	3,722,964	6.2
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,472	5,472	5,802	3,138,882	5.2
日本都市ファンド投資法人 投資証券	27,608	27,608	28,549	2,780,672	4.6
オリックス不動産投資法人 投資証券	10,902	10,902	11,274	2,034,957	3.4
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,739	3,739	3,870	1,362,240	2.3

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
N T T都市開発リート投資法人 投資証券	5,245	5,439	5,439	715,772	1.2
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,669	3,794	3,794	713,651	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3,749	4,164	4,164	455,125	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,318	12,657	12,657	1,864,376	3.1
森トラストリート投資法人 投資証券	3,911	10,531	10,531	745,594	1.2
インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,084	24,904	24,904	1,414,547	2.3
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,918	2,099	2,099	1,027,460	1.7
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,730	3,987	3,987	600,840	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,689	3,815	3,815	1,220,800	2.0
福岡リート投資法人 投資証券	2,830	2,926	2,926	478,693	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,693	3,292	3,292	1,068,254	1.8
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,484	4,636	4,636	412,604	0.7
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,157	1,172	1,172	716,092	1.2
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,472	2,556	2,556	368,319	0.6
スタートアッププロシード投資法人 投資証券	852	981	981	229,063	0.4
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,216	8,529	8,529	2,450,381	4.1
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	16,763	18,247	18,247	1,324,732	2.2
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,394	7,841	7,841	893,089	1.5
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,020	5,191	5,191	631,225	1.0
合 計	319,746	344,949	344,949	59,748,471	<99.0%>
	銘 柄 数<比 率>	61	60	<99.0%>	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 上記投資信託証券の「エスコンジャパンリート投資法人 投資証券」、「SOSiLA物流リート投資法人 投資証券」、「日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券」、「森ヒルズリート投資法人 投資証券」、「産業ファンド投資法人 投資証券」、「アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券」、「ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券」、「アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券」、「日本プロロジスリート投資法人 投資証券」、「Oneリート投資法人 投資証券」、「イオンリート投資法人 投資証券」、「ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券」、「ラサールロジポート投資法人 投資証券」、「スターアジア不動産投資法人 投資証券」、「マリモ地方創生リート投資法人 投資証券」、「三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券」、「大江戸温泉リート投資法人 投資証券」、「森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券」、「タカラレーベン不動産投資法人 投資証券」、「アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券」、「日本ビルファンド投資法人 投資証券」、「ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券」、「日本都市ファンド投資法人 投資証券」、「オリックス不動産投資法人 投資証券」、「N T T都市開発リート投資法人 投資証券」、「東急リアル・エステート投資法人 投資証券」、「ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券」、「森トラストリート投資法人 投資証券」、「インヴィンシブル投資法人 投資証券」、「フロンティア不動産投資法人 投資証券」、「平和不動産リート投資法人 投資証券」、「日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券」、「福岡リート投資法人 投資証券」、「ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券」、「大和証券オフィス投資法人 投資証券」、「スタートアッププロシード投資法人 投資証券」、「大和ハウスリート投資法人 投資証券」、「ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券」につきましては、委託会社の利害関係人等(投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等)である三井住友信託銀行株式会社が投資法人の一般事務受託会社等になっています。また、「日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券」の資産運用会社である「三井物産ロジスティクス・パートナーズ株式会社」は、委託会社の利害関係人等です。

○投資信託財産の構成

(2023年6月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	59,748,471	99.0
コール・ローン等、その他	577,617	1.0
投資信託財産総額	60,326,088	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年6月15日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	60,326,088,037
コール・ローン等	255,529,598
投資証券(評価額)	59,748,471,000
未収配当金	322,087,439
(B) 負債	471
未払利息	471
(C) 純資産総額(A-B)	60,326,087,566
元本	23,882,441,576
次期繰越損益金	36,443,645,990
(D) 受益権総口数	23,882,441,576口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,260円

(注) 当ファンドの期首元本額は24,155,988,864円、期中追加設定元本額は9,114,403,092円、期中一部解約元本額は9,387,950,380円です。

(注) 2023年6月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	19,253,210,679円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,493,894,999円
・財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	1,509,151,180円
・財産3分法(適格機関投資家専用)	473,107,791円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	152,677,611円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	399,316円

(注) 1口当たり純資産額は2,5260円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2022年6月16日から2023年6月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

○損益の状況 (2022年6月16日～2023年6月15日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	2,289,960,048
受取配当金	2,290,139,950
その他収益金	179
支払利息	△ 180,081
(B) 有価証券売買損益	△ 4,833,130
売買益	2,205,460,041
売買損	△ 2,210,293,171
(C) 保管費用等	△ 427
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,285,126,491
(E) 前期繰越損益金	34,789,149,135
(F) 追加信託差損益金	13,627,560,227
(G) 解約差損益金	△14,258,189,863
(H) 計(D+E+F+G)	36,443,645,990
次期繰越損益金(H)	36,443,645,990

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第18期（決算日 2023年6月15日）
 (2022年6月16日～2023年6月15日)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2005年6月30日から原則無期限です。
運用方針	主として日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「S & P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」と連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場されている不動産投資信託に投資を行ない、「S & P先進国REIT指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」に連動した投資成果をめざします。

不動産投資信託の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936472>

【運用報告書の表記について】

・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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国REIT指数 (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	(ベンチマーク)	騰落中率		
	円	%		%	%	百万円
14期(2019年6月17日)	21,714	9.6	206.26	9.4	99.5	25,151
15期(2020年6月15日)	18,451	△15.0	174.14	△15.6	99.1	123,251
16期(2021年6月15日)	26,113	41.5	245.18	40.8	99.4	81,352
17期(2022年6月15日)	27,245	4.3	253.60	3.4	98.2	54,462
18期(2023年6月15日)	28,616	5.0	265.31	4.6	99.6	57,457

(注)「S & P 先進国REIT指数(除く日本)」は、「スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エル エル シー (S & P 社)」が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の(ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2023年6月15日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○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REIT指数 (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		投資信託 組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク)	騰落率	
(期首) 2022年6月15日	円	%		%	%
	27,245	—	253.60	—	98.2
6月末	28,745	5.5	267.71	5.6	98.9
7月末	30,277	11.1	281.89	11.2	100.3
8月末	29,630	8.8	275.87	8.8	99.4
9月末	26,363	△3.2	244.69	△3.5	97.3
10月末	28,694	5.3	266.75	5.2	98.8
11月末	28,023	2.9	260.68	2.8	99.5
12月末	26,271	△3.6	244.10	△3.7	98.1
2023年1月末	28,030	2.9	260.70	2.8	99.5
2月末	28,347	4.0	263.23	3.8	99.0
3月末	26,388	△3.1	244.63	△3.5	99.0
4月末	27,000	△0.9	250.23	△1.3	98.8
5月末	27,411	0.6	254.00	0.2	97.0
(期末) 2023年6月15日	28,616	5.0	265.31	4.6	99.6

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2022年6月16日～2023年6月15日)

基準価額の推移

期間の初め27,245円の基準価額は、期間末に28,616円となり、騰落率は+5.0%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

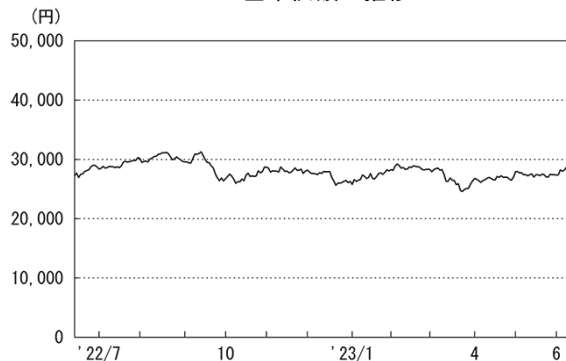
<値上がり要因>

- ・米国の主要REITの決算が概ね市場予想を上回ったこと。
- ・天然ガス価格の下落などを受けて欧州のインフレ圧力の緩和が期待されたこと。
- ・米国のインフレ指標が市場予想を下回ったことを受けて、米国連邦準備制度理事会（FRB）が政策金利を据え置くとの観測が広がったこと。
- ・主要投資対象通貨であるアメリカドル、ユーロ、イギリスポンド、オーストラリアドルなどが円に対して上昇したこと。

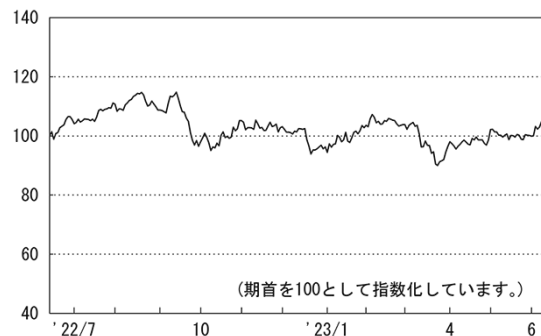
<値下がり要因>

- ・主要国の長期金利が概して上昇したこと。
- ・ウクライナ情勢の緊迫化、ロシア産ガスの供給不安などを背景とした世界景気の先行き懸念、英国新政権による経済対策の発表を受けた財政悪化懸念などを背景に、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・一部の米国地方銀行を巡る懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2022/06/15	2022/09/13	2023/03/24	2023/06/15
27,245円	31,268円	24,586円	28,616円

S&P先進国REIT指数
(除く日本、ヘッジなし・円ベース) (指数化) の推移

（海外不動産投資信託市況）

海外のREIT市場では、S & P先進国REIT指数（除く日本）は期間の初めと比べて上昇しました。

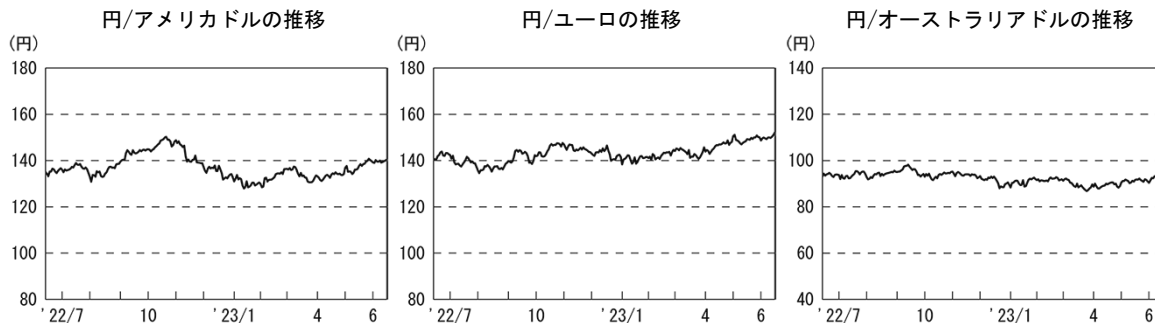
期間の初めから2022年10月前半にかけては、米国の主要REITの決算が概ね市場予想を上回ったことなどがREIT価格の支援要因となったものの、米国の市場予想を上回る消費者物価指数（CPI）などを受けて米国の長期金利が上昇したことや、FRB及び欧州中央銀行（ECB）が政策金利を引き上げたこと、ウクライナ情勢の緊迫化、ロシア産ガスの供給不安などを背景とした世界景気の先行き懸念、英国新政権による経済対策の発表を受けた財政悪化懸念、株式市場の下落を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが重しとなり、同指数は下落しました。

10月後半から2023年2月前半にかけては、FRBによる政策金利の引き上げや、景気後退懸念などがREIT価格の重しとなったものの、市場予想を下回る米国のインフレ指標や公表された米国連邦公開市場委員会（FOMC）議事要旨などから、FRBによる金融引き締めペースの鈍化が見込まれ主要国の長期金利が総じて低下したこと、天然ガス価格の下落などを受けて欧州のインフレ圧力の緩和が期待されたこと、更に中国景気の回復期待などを受けて株式市場が上昇したことなどが支援要因となり、同指数は上昇しました。

2月後半から期間末にかけては、米国のインフレ指標が市場予想を下回ったことを受けて、FRBが政策金利を据え置くとの観測が広がったことなどを背景に株式市場が上昇したことなどが支援要因となったものの、信用格付けの引き下げを受けてスウェーデンの商業用不動産保有会社が配当金支払いの一時停止を発表したこと、一部の米国地方銀行を巡る懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、一部の中央銀行が政策金利を引き上げたことなどを背景に欧米の長期金利が概して上昇したことが重しとなり、同指数は下落しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



ポートフォリオ

ポートフォリオは、リスクコントロールモデルなどを使用し、ベンチマーク採用国の時価総額ウェイトなどを考慮したうえで、米国・オーストラリア・イギリス・フランス・オランダ・カナダ・シンガポール・香港・ベルギー・ニュージーランド・ドイツ・イタリア・スペイン・アイルランド・イスラエル・韓国などのREITで構築しました。また、ベンチマーク採用銘柄の入れ替えなどに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。

（組入比率）

未収配当金などを考慮したうえで、海外REITの組入比率が高位となるように調整を行ないました。

（為替ヘッジ）

外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、外貨エクスポージャーを高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、5.0%の値上がりとなり、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」の上昇率4.6%を概ね0.4%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

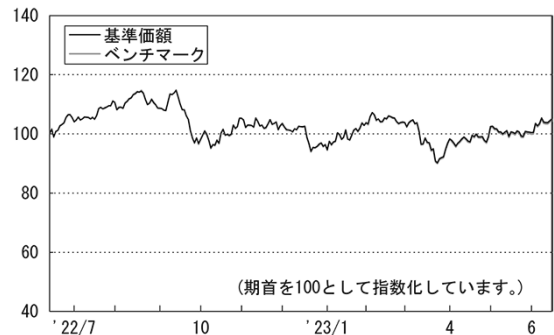
<プラス要因>

- ・組入REITの分配金の受取りが影響したこと。

<マイナス要因>

- ・REITの組入比率による要因が影響したこと。
- ・売買手数料や海外口座管理費用などのコストが発生したこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」との連動をめざし、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した海外REITポートフォリオへの投資を継続するとともに、海外REITの組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は原則として為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2022年 6 月 16 日～2023年 6 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 7 (7)	% 0.025 (0.025)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	4 (4)	0.016 (0.016)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	24 (17) (7)	0.085 (0.060) (0.025)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	35	0.126	
期中の平均基準価額は、27,931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

（2022年6月16日～2023年6月15日）

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
ACADIA REALTY TRUST	12,917	184	9,482	134
AGREE REALTY CORPORATION	12,176	855	5,491	386
ALEXANDER & BALDWIN INC	9,982	187	8,651	156
ALEXANDER'S INC	326	72	259	60
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	18,366	2,525	12,583	1,821
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,311	22	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,709	164	5,917	151
PROLOGIS INC	94,034 (51,501)	11,106 (5,597)	76,563	8,986
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	2,756	178	1,535 (43,912)	98 (2,830)
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	33,174	1,092	25,263	845
AMERICOLD REALTY TRUST INC	28,695	836	24,280	690
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	16,967	111	11,669	77
APPLE HOSPITALITY REIT INC	23,071	365	20,229	316
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	20,145	157	17,703	139
APARTMENT INCOME REIT CO	15,327	579	15,824	611
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,530	91	6,359	79
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,187	35	2,855	27
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,465	44	8,299	40
AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,760	2,629	12,791	2,366
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,394	36	2,097 (8,117)	55 (212)
BLUEROCK HOMES TRUST INC(N)	— (1,014)	— (15)	—	—
BOSTON PROPERTIES INC	15,151	1,029	13,071	967
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,239	665	26,437	557
BRANDYWINE REALTY TRUST	17,767	116	16,195	115
BRT APARTMENTS CORP	1,946	40	898	22
BROADSTONE NET LEASE INC-A	19,660	347	13,792	239
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,546	1,453	8,594	1,035
CARETRUST REIT INC	11,527	221	9,375	179
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	2,376	62	2,035	55
CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	— (3,783)	— (94)
CHATHAM LODGING TRUST	2,324	26	1,568	19
CITY OFFICE REIT INC	—	—	1,011	11
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	—	—	5,241	35
CLIPPER REALTY INC	3,658	22	1,710	11
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	12,799	324	11,141	278

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
COUSINS PROPERTIES INC	15,840	382	12,828	326
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,518	124	3,340	117
CTO REALTY GROWTH INC	2,441	40	558	11
CTO REALTY GROWTH INC(N)	—	—	—	—
	(3,370)	(—)		
SITE CENTERS CORP	16,386	208	12,951	163
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	23,075	197	20,246	170
DIGITAL REALTY TRUST INC	30,296	3,306	25,225	2,761
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	83	—	—
	(—)	(△ 1)		
DOUGLAS EMMETT INC	20,076	316	17,518	303
DUKE REALTY CORPORATION	7,294	426	15,894	888
	(△ 108,424)	(△ 5,597)		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,078	175	7,838	125
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,525	718	3,051	479
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12,433	89	15,239	107
EPR PROPERTIES	8,098	333	7,172	296
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,494	1,241	15,332	1,042
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	36,021	2,317	31,664	2,136
EQUINIX INC	10,005	6,778	7,966	5,179
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16,894	387	8,435	188
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,805	1,560	6,117	1,482
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,166	2,303	12,314	2,084
FARMLAND PARTNERS INC	8,554	115	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,664	761	5,900	584
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	13,698	687	11,302	563
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,044	239	5,396	141
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	—	—	2,515	7
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	29,971	1,496	19,302	942
GETTY REALTY CORPORATION	4,460	143	3,106	92
GLOBAL NET LEASE INC	12,370	152	10,795	128
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	3,757	68	2,122	35
GLADSTONE LAND CORP	2,186	43	1,762	40
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,845	42	3,644	28
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,364	84	5,268	86
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	59,585	1,426	49,879	1,221
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	38,188	800	30,843	657
	(47,041)	(1,174)		
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,021	53	790	21
	(△ 47,041)	(△ 1,174)		
WELLTOWER INC	51,744	3,748	33,748	2,394
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,974	22	1,966	18
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10,677	294	9,510	275
SERVICE PROPERTIES TRUST	18,926	140	17,777	119
HOST HOTELS & RESORTS INC	75,772	1,285	65,525	1,128

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
EQUITY COMMONWEALTH	12,224	296	11,572	296
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	13,573	146	19,813	248
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	23,533	420	19,564	359
CENTERSPACE	1,861	120	1,839	122
INVITATION HOMES INC	61,923	2,053	58,713	2,032
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	5,308	28	3,918	38
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,018	296	2,499	230
INDUS REALTY TRUST INC	798	51	1,077	66
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,196	196	6,891	165
IRON MOUNTAIN INC	30,680	1,577	26,341	1,334
ISTAR INC	32,863	380	5,454 (27,409)	46 (322)
JBG SMITH PROPERTIES	10,765	200	13,759	281
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	125,500 (-)	51 (△ 5)	118,100	57
KILROY REALTY CORPORATION	11,110	433	9,597	406
KIMCO REALTY CORP	64,958	1,310	55,842	1,126
KITE REALTY GROUP TRUST	22,692	454	19,449	378
LXP INDUSTRIAL TRUST	29,744	308	28,167	286
LTC PROPERTIES INC	4,730	174	3,719	139
MACERICH CO/THE	24,332	256	19,834	201
VERIS RESIDENTIAL INC	8,259	125	7,148	103
MANULIFE US REAL ESTATE INV	153,500 (-)	56 (△ 2)	97,000	43
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	62,224	723	53,883	669
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,160	1,927	10,521	1,699
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,457	397	7,411	313
NNN REIT INC	19,440	858	15,010	652
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,500	252	4,728	276
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,635	122	2,443	117
NETSTREIT CORP	11,029	209	4,817	90
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,913	121	-	-
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,359	717	22,636	661
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,397	57	1,397	33
ORION OFFICE REIT INC	5,136	43	3,711	39
PARAMOUNT GROUP INC	24,055	141	22,121	132
PARK HOTELS & RESORTS INC	24,927	320	25,246	337
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	13,725	209	11,905	187
PENN REAL ESTATE INVEST TST	- (△ 23,722)	- (-)	1,694	7
PHYSICIANS REALTY TRUST	25,166	384	18,997	292
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	12,699	400	9,966	313
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	11,818	118	10,571	114
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,709	134	4,858	102
POSTAL REALTY TRUST INC- A	2,426	36	2,355	34

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	—	—	—	—
PRIME US REIT	49,700 (—)	32 (△ 4)	(16,624)	(413)
PS BUSINESS PARKS INC	305	57	247 (6,248)	45 (1,162)
PUBLIC STORAGE	16,609	4,942	12,732	3,829
RPT REALTY	13,491	124	12,367	112
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	13,445	193	10,282	153
REALTY INCOME CORP	71,450	4,568	43,721	2,785
REGENCY CENTERS CORP	16,171	985	14,077	840
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	24,049	1,362	12,573	726
RLJ LODGING TRUST	17,834	200	16,643	188
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,759	496	4,902	412
SABRA HEALTH CARE REIT INC	23,617	303	20,182	267
SAUL CENTERS INC	1,626	68	1,568	65
SAFEHOLD INC	3,257	102	1,001	36
SAFEHOLD INC(N)	— (6,257)	— (230)	—	—
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	17,998	32	19,000	30
SIMON PROPERTY GROUP INC	34,467	3,763	30,487	3,214
SL GREEN REALTY CORP	6,858	243	5,973	233
LIFE STORAGE INC	9,083	1,043	6,990	820
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15,868	630	10,196	411
STAG INDUSTRIAL INC	18,492	601	15,180	485
STORE CAPITAL CORP	18,819	579	12,270 (82,135)	368 (2,142)
STAR HOLDINGS(N)	— (4,193)	— (92)	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,069	97	11,962	87
SUN COMMUNITIES INC	13,343	1,914	9,192	1,338
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	21,112	214	21,050	219
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	11,914	208	10,359	168
TERRENO REALTY CORP	8,570	514	8,292	486
CUBESMART	23,667	1,033	18,897	819
UDR INC	33,169	1,376	25,752	1,093
UMH PROPERTIES INC	6,588	106	3,723	63
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	699	35	493	23
URBAN EDGE PROPERTIES	13,818	201	9,594	138
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	2,623	48	2,401	43
VENTAS INC	42,137	1,951	36,313	1,668
VICI PROPERTIES INC	140,789	4,431	77,326	2,507
VORNADO REALTY TRUST	15,744	342	13,298	313
ELME COMMUNITIES	10,586	195	8,196	148
WHITESTONE REIT	4,901	47	4,399	44

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ		千アメリカドル		千アメリカドル
	WP CAREY INC	24,349	1,918	15,195	1,189
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	13,465	191	11,730	168
	小計	2,899,613 (△ 65,811)	109,475 (324)	2,247,585 (188,228)	86,568 (7,177)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	7,888	213	6,963	195
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,147	72	8,268	77
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,864	35	1,572	19
	BOARDWALK EQUITIES INC	2,430	131	2,105	109
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	117	—	—
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	15,092	53	11,859	43
	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	8,252	376	7,549	335
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8,789	237	7,596	204
	CHOICE PROPERTIES REIT	18,663	263	15,545	213
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,052	64	2,958	45
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,465	70	4,082	64
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	11,698	148	9,705	117
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	—	—	831	14
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	5,120	14	6,398	19
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	11,263	179	10,762	166
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,605	279	3,344	246
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	10,097	122	10,854	129
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,261	69	4,799	63
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	4,702	16	3,035	13
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,034	87	5,120	88
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,483	22	2,467	36
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,619	27	1,892	31
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	3,697	34	3,011	29
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	14,577	156	9,983	108
	PLAZA RETAIL REIT	—	—	16,858	68
	PRIMARIS REIT	3,318	47	1,843	25
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	9,850	61	2,670	15
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,358	319	14,301	289
SLATE GROCERY REIT	7,394	107	6,198	87	
SLATE OFFICE REIT	11,342	51	10,066	44	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	7,672	151	8,150 (27,125)	158 (478)	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,035	37	4,593	28	
小計	225,037	3,572	205,377 (27,125)	3,095 (478)	
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ	
ドイツ					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	83 (—)	0.901 (△ 19)	1,916	14	

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
ドイツ				
HAMBORNER REIT AG	8,970	67	8,099	61
小 計	(9,053)	(△ 19)	10,015	76
イタリア				
COIMA RES SPA	1,724	17	7,611	75
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,283	7	—	—
小 計	4,007	24	7,611	75
フランス				
ALTAREA	699	91	418	53
CARMILA	11,151	157	(5,872)	(21)
COVIVIO	5,000	279	4,548	248
GECINA SA	5,664	547	4,932	460
ICADE	3,991	167	3,761	153
	(—)	(△ 8)		
KLEPIERRE	20,540	443	17,638	363
MERCIALYS	9,452	80	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10,026	518	12,036	618
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,546	69	1,088	47
小 計	(68,069)	(△ 2,356)	(50,293)	(2,028)
オランダ				
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,031	132	4,915	105
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV(N)	—	—	—	—
	(163)	(—)		
NSI NV	1,051	31	693	22
VASTNED RETAIL	3,177	65	2,714	51
WERELDHAVE NV	3,762	52	2,864	38
小 計	(14,021)	(281)	11,186	218
	(163)	(—)		
スペイン				
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	33,129	194	19,827	117
	(—)	(△ 14)		
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	13,104	63	14,235	68
	(—)	(△ 9)		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	35,680	312	31,088	272
小 計	(81,913)	(△ 570)	65,150	458
	(—)	(△ 23)		
ベルギー				
AEDIFICA	5,309	438	3,660	301
BEFIMMO S. C. A.	796	37	8,632	410
CARE PROPERTY INVEST	1,865	26	1,101	18
	(2,849)	(44)	(—)	(10)

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
ベルギー				
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	—	—	—	—
	(8,548)	(10)	(8,548)	(10)
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS(N)	—	—	—	—
	(8,548)	(10)	(8,548)	(10)
COFINIMMO	3,231	285	2,456	223
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,653	32	323	7
MONTEA	1,827	144	659	50
RETAIL ESTATES	1,609	100	1,412	83
WAREHOUSES DE PAUV SCA	19,783	545	13,000	363
XIOR STUDENT HOUSING NV	3,582	111	2,737	92
小 計	39,655	1,722	33,980	1,551
	(19,945)	(65)	(17,096)	(31)
アイルランド				
HIBERNIA REIT PLC	—	—	—	—
			(205,453)	(328)
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	40,201	45	39,973	47
小 計	40,201	45	39,973	47
			(205,453)	(328)
シンガポール				
CROMWELL REIT EUR	30,100	52	6,900	10
	(—)	(△ 1)		
小 計	30,100	52	6,900	10
	(—)	(△ 1)		
ユ ー ロ 計	287,019	5,121	225,108	4,467
	(20,108)	(11)	(222,549)	(380)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
AEW UK REIT PLC	10,356	9	9,924	9
ASSURA PLC	317,175	176	273,522	156
BIG YELLOW GROUP PLC	17,386	206	14,386	168
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	107,674	100	87,725	83
BRITISH LAND COMPANY PLC	98,063	400	84,757	347
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	407,720	509	88,636	107
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	63,021	41	48,822	35
CLS HOLDINGS PLC	65,076	95	—	—
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	53,657	50	44,787	39
DERWENT LONDON PLC	11,756	286	10,378	249
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	118,793	81	41,988	26
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	62,492	55	57,057	50
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	28,221	147	25,281	127
HAMMERSON PLC	514,029	123	332,688	82
HOME REIT PLC	125,823	124	43,035	44
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,124	63	45,911	50
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	54,194	27	61,967	33
PICTON PROPERTY INCOME LTD	66,930	54	60,678	51

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外	イギリス					
		口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	79,822	507	69,736	441
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	105,823	205	93,795	182
		LXI REIT PLC	472,059	628	200,626	264
		NEWRIVER REIT PLC	23,606	19	11,371	8
		PRS REIT PLC/THE	49,491	41	37,348	34
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	151,861	174	129,464	153
		REGIONAL REIT LTD	39,419	23	26,350	16
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	24,263	235	19,281	188
		SEGRE PLC	127,305	1,069	109,147	923
		SHAFTESBURY PLC	21,319	88	109,326	455
		ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	39,074	27	16,767	11
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	210,760	231	114,466	116
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	204,810	310	177,541	272
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	14,306	9	8,056	6
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	93,143	56	71,265	43
		UNITE GROUP PLC	41,731	401	35,876	347
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	177,608	283	30,569	40
		WAREHOUSE REIT PLC	157,973	220	24,304	25
	WORKSPACE GROUP PLC	12,440	62	11,126	58	
	小 計	4,229,303	7,151	2,627,956	5,254	
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	
		ABACUS PROPERTY GROUP	30,914	83	21,733	58
		ARENA REIT	32,546	130	29,806	116
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	31,359	104	30,671	101
		BWP TRUST	55,763	217	53,945	205
		VICINITY CENTRES	404,815	794	355,834	657
		CENTURIA OFFICE REIT	26,572	41	21,822	35
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	51,068	161	48,640	149
		CENTURIA CAPITAL GROUP	87,839	159	70,073	125
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	75,292	331	53,656	229
		CHARTER HALL GROUP	51,539	635	44,889	546
		CROMWELL PROPERTY GROUP	114,544	78	111,113	78
		DEXUS/AU	116,089	957	101,411	838
		GDI PROPERTY GROUP	52,698	40	48,651	38
		GOODMAN GROUP	181,122	3,398	154,790	2,816
		GPT GROUP	198,931	871	171,946	713
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	28,977	96	19,537	66
		HEALTHCO REIT	22,537	35	22,007	36
		HEALTHCO REIT(N)	—	—	(—)	(0.532)
	HEALTHCO REIT-RIGHTS	(46,577)	(63)	—	—	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	37,397	126	30,282	96	
	HMC CAPITAL LTD	8,124	35	2,447	11	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	204,055	256	146,897	180
	DEXUS INDUSTRIA REIT	23,613	69	27,525	79
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	50,640	209	47,674	193
	IRONGATE GROUP	15,830	29	192,272	363
	CHARTER HALL RETAIL REIT	68,883	269	62,259	238
	MIRVAC GROUP	410,028	896	357,155	751
	NATIONAL STORAGE REIT	156,105	384	102,101	236
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	23,158	17	14,377	11
	RURAL FUNDS GROUP	49,776	119	41,193	99
	SCENTRE GROUP	553,210	1,574	480,440	1,314
	REGION RE LTD	131,248	345	103,674	263
	STOCKLAND	247,051	950	214,377	781
	WAYPOINT REIT	66,389	171	82,817	206
小 計	3,608,112 (93,154)	13,592 (63)	3,266,014 (46,577)	11,641 (1)	
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	
GOODMAN PROPERTY TRUST	177,583	370	164,698	343	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	106,907	263	86,557	217	
STRIDE PROPERTY GROUP	374,809	620	50,025	71	
小 計	659,299	1,255	301,280	631	
香港		千香港ドル		千香港ドル	
CHAMPION REIT	172,400	529	154,400	482	
FORTUNE REIT	188,200	1,158	147,300	918	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	183,000	400	201,000	523	
LINK REIT	239,800	13,053	200,800	11,466 (950)	
LINK REIT(N)	— (124,980)	— (6,475)	—	—	
LINK REIT-RTS	— (124,980)	— (950)	— (124,980)	— (950)	
LINK REIT-RTS(N)	— (124,980)	— (950)	— (124,980)	— (950)	
PROSPERITY REIT	233,000	516	218,000	489	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71,000	226	65,000	224	
小 計	1,087,400 (374,940)	15,884 (8,376)	986,500 (249,960)	14,105 (2,852)	
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル	
AIMS APAC REIT-RIGHTS(N)	— (5,992)	— (0.192)	—	—	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	348,900 (—)	970 (△ 27)	299,800 (—)	830 (12)	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	316,900 (—)	328 (△ 12)	199,100	211	
CAPITALAND CHINA TRUST	129,600 (—)	141 (△ 18)	107,200	115	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール		口 千シンガポールドル		口 千シンガポールドル
	ESR-LOGOS REIT	751,500 (-)	269 (△ 5)	520,500 (-)	192 (0.612)
	ESR-LOGOS REIT(N)	- (113,601)	- (37)	-	-
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	523,900 (-)	1,047 (△ 2)	468,800	947
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	93,400 (-)	115 (△ 1)	70,100	86
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	259,000 (-)	173 (△ 7)	85,500	49
	EC WORLD REIT	20,300	11	56,500	29
	ESR-LOGOS REIT-RIGHTS	- (113,601)	- (0.612)	- (113,601)	- (0.612)
	ESR-LOGOS REIT-RIGHTS(N)	- (113,601)	- (0.612)	- (113,601)	- (0.612)
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	140,100	86	102,400	62
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	62,800 (-)	16 (△ 5)	49,800	13
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	115,400	248	99,500	217
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	326,000 (-)	407 (△ 15)	297,600	381
	IREIT GLOBAL	-	-	169,833 (-)	88 (2)
	KEPPEL REIT	265,900 (-)	249 (△ 1)	228,500	226
	KEPPEL DC REIT	135,200 (-)	259 (△ 9)	117,400	219
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	247,500	180	170,500	126
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	246,100 (-)	423 (△ 4)	181,100	313
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	115,000 (-)	148 (△ 6)	91,800 (-)	118 (0.192)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	338,700 (-)	560 (△ 39)	295,700	487
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	209,600 (-)	494 (△ 0.573)	165,700	399
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	323,400 (-)	111 (△ 2)	258,900	88	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	49,800 (-)	205 (△ 4)	43,300	184	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	2,400	1	-	-	
PARAGON REIT	168,600	157	104,500	97	
STARHILL GLOBAL REIT	111,800	61	95,800	55	

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
シンガポール		口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	SUNTEC REIT	233,800 (-)	336 (△ 5)	173,900	259
小計		5,535,600 (346,795)	7,008 (△ 131)	4,453,733 (227,202)	5,804 (16)
韓国			千韓国ウォン		千韓国ウォン
	D&D PLATFORM REIT CO LTD	12,836	46,200	10,181	42,146
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	50,972	-	-
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	19,355	86,161	9,936	46,130
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	208	1,030	-	-
	JR REIT XXVII	20,456	91,897	6,616	28,918
	JR GLOBAL REIT-RTS	-	-	-	-
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,305	24,023	7,615	41,510
	LOTTE REIT CO LTD	4,615	23,214	5,550	27,940
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	63,388	-	-
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,414	92,627	3,029 (-)	23,761 (1,307)
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	46,951	-	-
	SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS	-	-	3,664	482
	SHINHAN ALPHA REIT CO-RIGHTS(N)	- (3,664)	- (1,307)	-	-
	SK REITS CO LTD	14,050 (-)	72,274 (0)	10,004 (-)	57,651 (53)
	SK REITS CO LTD(N)	- (4,577)	- (23,213)	-	-
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	-	-	- (4,577)	- (53)
	SK REITS CO LTD-RIGHTS(N)	- (4,577)	- (53)	-	-
小計		119,722 (12,818)	598,742 (24,574)	56,595 (11,747)	268,542 (2,131)
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
	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	231,039	456	-	-
	REIT 1 LTD	11,962	204	11,983	203
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	10,531	88	7,327	66
小計		253,532	749	19,310	269

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は分割・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。

○利害関係人との取引状況等

(2022年6月16日～2023年6月15日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2022年6月16日～2023年6月15日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2023年6月15日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	27,062	30,497	434	61,011	0.1
AGREE REALTY CORPORATION	21,854	28,539	1,877	263,513	0.5
ALEXANDER & BALDWIN INC	22,028	23,359	436	61,324	0.1
ALEXANDER'S INC	655	722	133	18,716	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	44,779	50,562	6,164	865,436	1.5
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,963	4,274	68	9,552	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,111	16,903	329	46,250	0.1
PROLOGIS INC	227,419	296,391	36,239	5,087,695	8.9
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	42,691	—	—	—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	90,627	98,538	3,432	481,829	0.8
AMERICOLD REALTY TRUST INC	82,172	86,587	2,756	386,923	0.7
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	37,153	42,451	299	42,075	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	65,347	68,189	1,035	145,318	0.3
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	46,127	48,569	407	57,208	0.1
APARTMENT INCOME REIT CO	48,369	47,872	1,766	247,995	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	20,024	21,195	253	35,617	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,202	12,534	51	7,214	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,955	19,121	77	10,898	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,975	44,944	8,546	1,199,850	2.1
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	8,820	—	—	—	—
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	1,014	16	2,280	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	43,737	45,817	2,484	348,820	0.6
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	91,258	96,060	2,071	290,755	0.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	52,850	54,422	240	33,770	0.1
BRT APARTMENTS CORP	3,122	4,170	81	11,509	0.0
BROADSTONE NET LEASE INC-A	49,769	55,637	907	127,473	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	31,409	35,361	3,951	554,813	1.0
CARETRUST REIT INC	29,943	32,095	637	89,530	0.2
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,667	8,008	185	26,003	0.0
CEDAR REALTY TRUST INC	3,783	—	—	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	14,649	15,405	144	20,329	0.0
CITY OFFICE REIT INC	12,836	11,825	64	9,097	0.0
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,241	—	—	—	—

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)	口	口	千アメリカドル	千円	%
CLIPPER REALTY INC	3,403	5,351	29	4,116	0.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	34,653	36,311	868	121,987	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	45,588	48,600	1,058	148,535	0.3
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,412	7,590	262	36,815	0.1
CTO REALTY GROWTH INC	1,685	6,938	116	16,314	0.0
SITE CENTERS CORP	54,796	58,231	768	107,828	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	63,962	66,791	544	76,420	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	87,285	92,356	9,742	1,367,768	2.4
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	—	99,300	47	6,691	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	54,054	56,612	707	99,346	0.2
DUKE REALTY CORPORATION	117,024	—	—	—	—
EASTERLY GOVERNMENT PROPTI	26,758	29,998	434	60,981	0.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	12,509	13,983	2,431	341,358	0.6
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	500,700	68	9,630	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	44,630	41,824	291	40,925	0.1
EPR PROPERTIES	23,143	24,069	1,100	154,456	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53,083	56,245	3,804	534,101	0.9
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	105,078	109,435	7,263	1,019,680	1.8
EQUINIX INC	27,681	29,720	23,056	3,236,857	5.6
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	37,103	45,562	1,123	157,672	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,075	20,763	4,845	680,312	1.2
EXTRA SPACE STORAGE INC	41,147	42,999	6,162	865,169	1.5
FARMLAND PARTNERS INC	7,648	16,202	201	28,250	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,738	23,502	2,216	311,170	0.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	40,022	42,418	2,218	311,449	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	23,602	27,250	718	100,843	0.2
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	28,941	26,426	37	5,231	0.0
GAMING AND LEISURE PROPTIE	72,071	82,740	4,147	582,303	1.0
GETTY REALTY CORPORATION	12,422	13,776	482	67,729	0.1
GLOBAL NET LEASE INC	32,073	33,648	359	50,450	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	10,617	12,252	158	22,274	0.0
GLADSTONE LAND CORP	9,764	10,188	175	24,601	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,148	19,349	182	25,642	0.0
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,407	15,503	121	17,063	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	166,155	175,861	3,640	511,064	0.9
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	68,126	122,512	2,396	336,421	0.6
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	45,810	—	—	—	—
WELLTOWER INC	133,746	151,742	12,373	1,737,051	3.0
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,016	11,024	66	9,332	0.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	32,471	33,638	756	106,160	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	52,050	53,199	471	66,171	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	219,255	229,502	4,007	562,557	1.0
EQUITY COMMONWEALTH	34,809	35,461	755	106,039	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	46,970	40,730	195	27,446	0.0
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,500	71,469	1,323	185,821	0.3

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)	口	口	千アメリカドル	千円	%
CENTERSPACE	4,743	4,765	296	41,622	0.1
INVITATION HOMES INC	183,337	186,547	6,350	891,484	1.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	20,854	22,244	57	8,025	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,365	8,884	645	90,623	0.2
INDUS REALTY TRUST INC	2,000	1,721	115	16,173	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,348	21,653	508	71,406	0.1
IRON MOUNTAIN INC	88,982	93,321	5,293	743,107	1.3
JBG SMITH PROPERTIES	35,265	32,271	493	69,226	0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	258,400	265,800	82	11,567	0.0
KILROY REALTY CORPORATION	32,306	33,819	1,032	144,951	0.3
KIMCO REALTY CORP	189,196	198,312	3,827	537,331	0.9
KITE REALTY GROUP TRUST	66,924	70,167	1,476	207,259	0.4
LXP INDUSTRIAL TRUST	87,019	88,596	910	127,862	0.2
LTC PROPERTIES INC	12,150	13,161	448	62,913	0.1
MACERICH CO/THE	65,245	69,743	782	109,857	0.2
VERIS RESIDENTIAL INC	24,488	25,599	434	61,023	0.1
MANULIFE US REAL ESTATE INV	545,747	602,247	101	14,288	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	183,924	192,265	1,745	245,088	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,446	37,085	5,688	798,656	1.4
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,027	27,073	951	133,559	0.2
NNN REIT INC	53,954	58,384	2,485	349,008	0.6
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,153	13,925	749	105,253	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,935	7,127	322	45,235	0.1
NETSTREIT CORP	11,500	17,712	324	45,504	0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	—	9,913	115	16,199	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	73,658	75,381	2,351	330,181	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,324	5,324	111	15,651	0.0
ORION OFFICE REIT INC	17,913	19,338	124	17,483	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	50,203	52,137	239	33,596	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	72,352	72,033	965	135,611	0.2
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,272	42,092	573	80,484	0.1
PENN REAL ESTATE INVEST TST	25,416	—	—	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	67,514	73,683	1,066	149,682	0.3
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	35,024	37,757	1,269	178,209	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	38,325	39,572	271	38,166	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,741	12,592	286	40,199	0.1
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,657	5,728	85	11,941	0.0
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	16,624	—	—	—	—
PRIME US REIT	195,200	184,200	40	5,689	0.0
PS BUSINESS PARKS INC	6,190	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	46,887	50,764	14,423	2,024,854	3.5
RPT REALTY	26,147	27,271	281	39,587	0.1
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	36,566	39,729	534	75,018	0.1
REALTY INCOME CORP	173,794	201,523	12,329	1,730,893	3.0
REGENCY CENTERS CORP	47,350	49,444	3,008	422,317	0.7

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)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	49,122	60,598	3,219	451,995	0.8	
RLJ LODGING TRUST	50,781	51,972	536	75,371	0.1	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,827	17,684	1,658	232,798	0.4	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70,747	74,182	879	123,514	0.2	
SAUL CENTERS INC	4,075	4,133	151	21,329	0.0	
SAFEHOLD INC	4,389	12,902	306	43,072	0.1	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	78,919	77,917	237	33,363	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	101,024	105,004	11,644	1,634,833	2.8	
SL GREEN REALTY CORP	19,825	20,710	539	75,739	0.1	
LIFE STORAGE INC	25,178	27,271	3,489	489,942	0.9	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	39,164	44,836	1,788	251,088	0.4	
STAG INDUSTRIAL INC	54,220	57,532	2,108	296,019	0.5	
STORE CAPITAL CORP	75,586	—	—	—	—	
STAR HOLDINGS	—	4,193	59	8,364	0.0	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,165	34,272	225	31,659	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	35,647	39,798	5,324	747,461	1.3	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,028	67,090	680	95,600	0.2	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	31,991	33,546	722	101,396	0.2	
TERRENO REALTY CORP	23,077	23,355	1,362	191,351	0.3	
CUBESMART	67,331	72,101	3,153	442,747	0.8	
UDR INC	92,013	99,430	4,286	601,771	1.0	
UMH PROPERTIES INC	14,190	17,055	276	38,788	0.1	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,004	4,210	205	28,825	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	33,294	37,518	560	78,691	0.1	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	9,386	9,608	200	28,164	0.0	
VENTAS INC	122,670	128,494	5,951	835,579	1.5	
VICI PROPERTIES INC	258,715	322,178	10,432	1,464,565	2.5	
VORNADO REALTY TRUST	49,139	51,585	788	110,658	0.2	
ELME COMMUNITIES	26,049	28,439	447	62,882	0.1	
WHITESTONE REIT	14,650	15,152	145	20,399	0.0	
WP CAREY INC	58,591	67,745	4,736	664,989	1.2	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,678	36,413	451	63,337	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	8,282,667	8,680,656	316,603	44,447,973	
	銘柄 数 < 比 率 >	151	145	—	< 77.4% >	
(カナダ)			千カナダドル			
ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,428	20,353	463	48,778	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,931	18,810	135	14,260	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,633	6,925	80	8,502	0.0	
BOARDWALK EQUITIES INC	6,814	7,139	428	45,111	0.1	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	—	5,270	87	9,234	0.0	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	8,798	12,031	38	4,034	0.0	
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	26,332	27,035	1,350	142,168	0.2	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,885	23,078	579	61,044	0.1	
CHOICE PROPERTIES REIT	49,128	52,246	698	73,500	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,376	17,470	253	26,710	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		
(カナダ)	口	口	千カナダドル	千円	%	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,271	16,654	248	26,217	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	38,115	40,108	557	58,747	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,681	6,850	101	10,646	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	14,405	13,127	36	3,884	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,251	34,752	526	55,439	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,790	10,051	807	84,987	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	42,477	41,720	430	45,336	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,457	21,919	279	29,404	0.1	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	6,035	7,702	24	2,603	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,216	18,130	322	34,000	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	6,740	5,756	87	9,218	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	6,174	5,901	97	10,265	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,165	9,851	84	8,848	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	33,599	38,193	294	30,967	0.1	
PLAZA RETAIL REIT	16,858	—	—	—	—	
PRIMARIS REIT	14,543	16,018	204	21,555	0.0	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	—	7,180	38	4,029	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,331	47,388	942	99,250	0.2	
SLATE GROCERY REIT	8,330	9,526	124	13,090	0.0	
SLATE OFFICE REIT	10,768	12,044	24	2,536	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	27,603	—	—	—	—	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,341	12,783	32	3,378	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	573,475	566,010	9,380	987,755	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	30	—	< 1.7% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,601	2,768	14	2,185	0.0	
HAMBORNER REIT AG	23,113	23,984	166	25,361	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	27,714	26,752	181	27,547	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.0% >	
(ユーロ…イタリア)						
COIMA RES SPA	5,887	—	—	—	—	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,183	15,466	39	5,988	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	19,070	15,466	39	5,988	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)						
ALTAREA	1,241	1,522	156	23,851	0.0	
CARMILA	13,401	18,680	273	41,552	0.1	
COVIVIO	14,509	14,961	691	105,256	0.2	
GECINA SA	16,755	17,487	1,713	260,743	0.5	
ICADE	10,106	10,336	414	63,093	0.1	
KLEPIERRE	59,627	62,529	1,395	212,252	0.4	
MERCIALYS	15,186	24,638	199	30,345	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,781	—	—	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	34,229	1,604	244,096	0.4	
小 計	口 数 ・ 金 額	166,606	184,382	6,448	981,192	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 1.7% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,230	13,509	302	46,081	0.1	
NSI NV	5,190	5,548	112	17,093	0.0	
VASTNED RETAIL	5,393	5,856	118	17,998	0.0	
WERELDHAVE NV	12,186	13,084	183	27,969	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	34,999	37,997	717	109,143	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.2% >	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	84,235	97,537	554	84,441	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	20,809	19,678	104	15,868	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	103,192	107,784	850	129,472	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	208,236	224,999	1,510	229,782	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.4% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AEDIFICA	11,194	12,843	850	129,456	0.2	
BEFIMMO S. C. A.	7,836	—	—	—	—	
CARE PROPERTY INVEST	8,630	12,243	163	24,812	0.0	
COFINIMMO	9,132	9,907	747	113,804	0.2	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,178	8,508	133	20,323	0.0	
MONTEA	3,114	4,282	330	50,296	0.1	
RETAIL ESTATES	3,406	3,603	230	35,139	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	42,976	49,759	1,312	199,718	0.3	
XIOR STUDENT HOUSING NV	6,582	7,427	219	33,448	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	100,048	108,572	3,989	606,999	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 1.1% >	
(ユーロ…アイルランド)						
HIBERNIA REIT PLC	205,453	—	—	—	—	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	148,551	148,779	150	22,953	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	354,004	148,779	150	22,953	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…シンガポール)						
CROMWELL REIT EUR	96,360	119,560	188	28,741	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	96,360	119,560	188	28,741	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1,007,037	866,507	13,226	2,012,349	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	28	—	< 3.5% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
AEW UK REIT PLC	45,281	45,713	46	8,286	0.0	
ASSURA PLC	915,575	959,228	446	79,304	0.1	
BIG YELLOW GROUP PLC	52,973	55,973	626	111,412	0.2	
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	243,750	263,699	203	36,226	0.1	
BRITISH LAND COMPANY PLC	287,748	301,054	1,007	179,075	0.3	

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)	口	口	千イギリスポンド	千円	%
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	261,269	580,353	681	121,189	0.2
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	191,789	205,988	164	29,176	0.1
CLS HOLDINGS PLC	—	65,076	89	15,844	0.0
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	136,467	145,337	131	23,401	0.0
DERWENT LONDON PLC	34,787	36,165	763	135,743	0.2
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	—	76,805	47	8,462	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	183,125	188,560	163	29,120	0.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	78,708	81,648	376	66,951	0.1
HAMMERSON PLC	1,102,741	1,284,082	339	60,292	0.1
HOME REIT PLC	173,650	256,438	97	17,340	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	124,452	138,665	128	22,918	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	189,603	181,830	82	14,622	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	172,503	178,755	136	24,207	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	230,971	241,057	1,431	254,387	0.4
INTU PROPERTIES PLC	758,746	758,746	0	0	0.0
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	300,725	312,753	556	98,936	0.2
LXI REIT PLC	279,315	550,748	544	96,753	0.2
NEWRIVER REIT PLC	92,155	104,390	93	16,530	0.0
PRS REIT PLC/THE	171,020	183,163	149	26,562	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	412,004	434,401	431	76,661	0.1
REGIONAL REIT LTD	134,627	147,696	73	13,006	0.0
SAFESTORE HOLDINGS PLC	64,388	69,370	633	112,620	0.2
SEGRE PLC	370,209	388,367	2,933	521,381	0.9
SHAFTESBURY PLC	88,007	—	—	—	—
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	114,313	136,620	69	12,334	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	306,595	402,889	318	56,636	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	572,503	599,772	825	146,776	0.3
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	116,006	122,256	63	11,363	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	256,093	277,971	150	26,725	0.0
UNITE GROUP PLC	122,333	128,188	1,140	202,755	0.4
URBAN LOGISTICS REIT PLC	—	147,039	191	33,971	0.1
WAREHOUSE REIT PLC	—	133,669	119	21,237	0.0
WORKSPACE GROUP PLC	42,629	43,943	226	40,336	0.1
小 計	口 数・金 額	口 数	15,488	2,752,555	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	—	< 4.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
ABACUS PROPERTY GROUP	125,543	134,724	347	33,149	0.1
ARENA REIT	108,807	111,547	412	39,361	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	105,456	106,144	308	29,457	0.1
BWP TRUST	157,486	159,304	576	54,998	0.1
VICINITY CENTRES	1,199,217	1,248,198	2,321	221,415	0.4
CENTURIA OFFICE REIT	140,685	145,435	202	19,348	0.0
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	172,965	175,393	534	51,018	0.1
CENTURIA CAPITAL GROUP	201,674	219,440	352	33,589	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	190,151	211,787	859	82,004	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	千円	%	
CHARTER HALL GROUP	145,135	151,785	1,651	157,496	0.3	
CROMWELL PROPERTY GROUP	459,623	463,054	243	23,184	0.0	
DEXUS/AU	333,022	347,700	2,736	260,970	0.5	
GDI PROPERTY GROUP	177,407	181,454	124	11,854	0.0	
GOODMAN GROUP	523,297	549,629	10,822	1,032,112	1.8	
GPT GROUP	591,734	618,719	2,487	237,209	0.4	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	89,476	98,916	284	27,168	0.0	
HEALTHCO REIT	87,968	135,075	189	18,099	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	58,540	65,655	215	20,537	0.0	
HMC CAPITAL LTD	57,590	63,267	287	27,453	0.0	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	448,637	505,795	574	54,749	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	74,408	70,496	190	18,152	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	117,583	120,549	480	45,872	0.1	
IRONGATE GROUP	176,442	—	—	—	—	
CHARTER HALL RETAIL REIT	163,244	169,868	616	58,807	0.1	
MIRVAC GROUP	1,220,812	1,273,685	2,776	264,807	0.5	
NATIONAL STORAGE REIT	335,840	389,844	959	91,461	0.2	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	123,766	132,547	86	8,279	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	116,819	125,402	213	20,391	0.0	
SCENTRE GROUP	1,601,114	1,673,884	4,335	413,463	0.7	
REGION RE LTD	346,561	374,135	886	84,564	0.1	
STOCKLAND	736,255	768,929	3,129	298,464	0.5	
WAYPOINT REIT	236,646	220,218	596	56,915	0.1	
小計	口 数 ・ 金 額	10,623,903	11,012,578	39,806	3,796,359	
	銘柄 数 < 比 率 >	32	31	—	< 6.6% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
GOODMAN PROPERTY TRUST	415,171	428,056	924	80,375	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209,606	229,956	531	46,177	0.1	
STRIDE PROPERTY GROUP	—	324,784	435	37,832	0.1	
小計	口 数 ・ 金 額	624,777	982,796	1,891	164,385	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.3% >	
(香港)			千香港ドル			
CHAMPION REIT	599,000	617,000	1,684	30,201	0.1	
FORTUNE REIT	444,000	484,900	2,720	48,774	0.1	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	751,110	733,110	1,246	22,345	0.0	
LINK REIT	648,900	812,880	38,002	681,378	1.2	
PROSPERITY REIT	396,000	411,000	706	12,675	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	325,000	331,000	936	16,795	0.0	
小計	口 数 ・ 金 額	3,164,010	3,389,890	45,296	812,171	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.4% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
AIMS APAC REIT-RIGHTS	—	5,992	0	0	0.0	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,036,032	1,085,132	2,897	302,999	0.5	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	596,692	714,492	757	79,204	0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST	352,185	374,585	378	39,565	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		
(シンガポール)	口	口	千シンガポールドル	千円	%	
ESR-LOGOS REIT	1,593,718	1,938,319	610	63,853	0.1	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,565,592	1,620,692	3,192	333,899	0.6	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	243,800	267,100	323	33,799	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	173,500	101	10,614	0.0	
EC WORLD REIT	113,900	77,700	25	2,681	0.0	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	318,000	355,700	213	22,319	0.0	
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	415,740	428,740	111	11,657	0.0	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	331,105	347,005	756	79,111	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	899,960	928,360	1,151	120,388	0.2	
IREIT GLOBAL	169,833	—	—	—	—	
KEPPEL REIT	611,600	649,000	577	60,406	0.1	
KEPPEL DC REIT	413,477	431,277	875	91,558	0.2	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	525,552	602,552	403	42,219	0.1	
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	677,831	742,831	1,233	128,957	0.2	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	148,025	171,225	202	21,129	0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	995,387	1,038,387	1,723	180,266	0.3	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	602,508	646,408	1,441	150,751	0.3	
OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I	744,035	808,535	258	27,058	0.0	
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	119,300	125,800	465	48,677	0.1	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	167,000	169,400	116	12,135	0.0	
PARAGON REIT	296,100	360,200	338	35,409	0.1	
STARHILL GLOBAL REIT	451,500	467,500	238	24,934	0.0	
SUNTEC REIT	670,100	730,000	927	96,956	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,058,972	15,260,432	19,320	2,020,558	
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	26	—	< 3.5% >	
(韓国)			千韓国ウォン			
D&D PLATFORM REIT CO LTD	20,244	22,899	76,597	8,441	0.0	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	—	8,770	46,919	5,170	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,652	55,071	225,515	24,851	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,383	11,591	56,332	6,207	0.0	
JR REIT XXVII	37,368	51,208	234,788	25,873	0.0	
JR GLOBAL REIT-RTS(N)	7,170	—	—	—	—	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	16,937	13,627	75,902	8,364	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	40,192	39,257	155,261	17,109	0.0	
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	8,226	36,400	4,011	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	—	12,699	47,176	5,198	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,263	23,648	147,563	16,261	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	—	9,014	33,081	3,645	0.0	
SK REITS CO LTD	20,771	29,394	151,085	16,649	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	221,206	285,404	1,286,624	141,785	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	12	—	< 0.2% >	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	—	231,039	400	15,686	0.0	
REIT 1 LTD	60,581	60,560	981	38,460	0.1	

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		口	口	千イスラエルシケル	千円	%
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		68,110	71,314	568	22,287	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	128,691	362,913	1,950	76,434	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	3	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	47,311,798	51,635,593	—	57,212,329	
	銘 柄 数 < 比 率 >	323	321	—	<99.6%>	

(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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2023年6月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 57,212,329	% 99.6
コール・ローン等、その他	257,069	0.4
投資信託財産総額	57,469,398	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（57,447,425千円）の投資信託財産総額（57,469,398千円）に対する比率は100.0%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。1アメリカドル=140.39円、1カナダドル=105.30円、1ユーロ=152.15円、1イギリスポンド=177.72円、1オーストラリアドル=95.37円、1ニュージーランドドル=86.93円、1香港ドル=17.93円、1シンガポールドル=104.58円、1韓国ウォン=0.1102円、1イスラエルシケル=39.1785円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年6月15日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	57,469,398,474
コール・ローン等	102,955,605
投資証券(評価額)	57,212,329,686
未収入金	2,106,554
未収配当金	152,006,629
(B) 負債	11,569,720
未払解約金	11,569,680
未払利息	40
(C) 純資産総額(A-B)	57,457,828,754
元本	20,078,950,947
次期繰越損益金	37,378,877,807
(D) 受益権総口数	20,078,950,947口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,616円

(注) 当ファンドの期首元本額は19,989,699,038円、期中追加設定元本額は6,239,159,688円、期中一部解約元本額は6,149,907,779円です。

(注) 2023年6月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け) 17,560,828,477円
- ・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型 2,280,965,859円
- ・海外先進国REITインデックスファンド(適格機関投資家向け) 225,612,076円
- ・インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け) 7,247,382円
- ・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス) 4,297,153円

(注) 1口当たり純資産額は2,8616円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2022年6月16日から2023年6月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

○損益の状況（2022年6月16日～2023年6月15日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,248,744,871
受取配当金	2,248,862,617
その他収益金	3,728
支払利息	△ 121,474
(B) 有価証券売買損益	749,228,015
売買益	5,915,582,121
売買損	△ 5,166,354,106
(C) 保管費用等	△ 47,444,223
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,950,528,663
(E) 前期繰越損益金	34,473,173,432
(F) 追加信託差損益金	10,998,830,027
(G) 解約差損益金	△11,043,654,315
(H) 計(D+E+F+G)	37,378,877,807
次期繰越損益金(H)	37,378,877,807

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2022年10月26日）
（2021年10月27日～2022年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行ないません。

ファンド概要

主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・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。

○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	純資産額
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	率		
20期(2018年10月26日)	13,870	0.2	546.64	0.2	99.6	38,466	
21期(2019年10月28日)	14,315	3.2	564.07	3.2	99.4	41,390	
22期(2020年10月26日)	14,128	△1.3	556.49	△1.3	99.4	43,807	
23期(2021年10月26日)	14,100	△0.2	555.54	△0.2	99.6	48,618	
24期(2022年10月26日)	13,539	△4.0	532.71	△4.1	99.8	47,577	

(注) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合			債組入比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	率	
(期首) 2021年10月26日	14,100	—	555.54	—	99.6	
10月末	14,120	0.1	556.34	0.1	99.7	
11月末	14,154	0.4	557.68	0.4	99.6	
12月末	14,123	0.2	556.51	0.2	99.8	
2022年1月末	14,026	△0.5	552.50	△0.5	99.8	
2月末	13,957	△1.0	549.73	△1.0	99.7	
3月末	13,918	△1.3	548.16	△1.3	99.9	
4月末	13,885	△1.5	546.84	△1.6	99.8	
5月末	13,866	△1.7	546.00	△1.7	99.7	
6月末	13,742	△2.5	541.03	△2.6	99.8	
7月末	13,835	△1.9	544.59	△2.0	99.7	
8月末	13,804	△2.1	543.32	△2.2	99.7	
9月末	13,661	△3.1	537.46	△3.3	99.8	
(期末) 2022年10月26日	13,539	△4.0	532.71	△4.1	99.8	

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2021年10月27日～2022年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め14,100円の基準価額は、期間末に13,539円となり、騰落率は△4.0%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・南アフリカで確認された新型コロナウイルスの新たな変異株の感染拡大に対する懸念や、ロシア軍のウクライナ侵攻を受けた地政学的リスクへの警戒感などから、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したこと。

<値下がり要因>

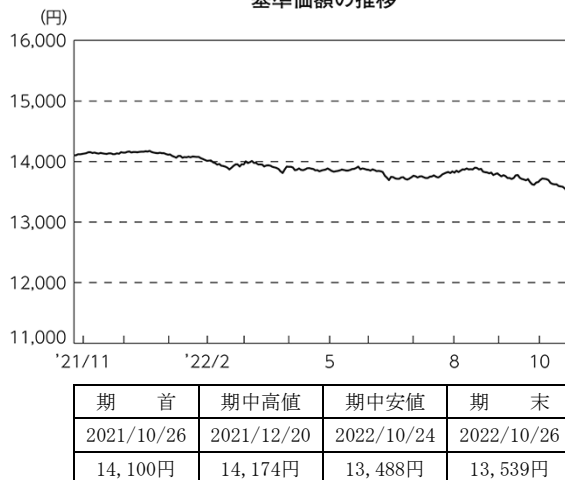
- ・ウクライナ情勢を巡り供給混乱を受けた世界的なインフレ高進が懸念され金利先高観が強まったこと。
- ・中国の上海市がロックダウン（都市封鎖）を解除する方針を示し、経済正常化への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退したこと。
- ・欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたこと。

(国内債券市況)

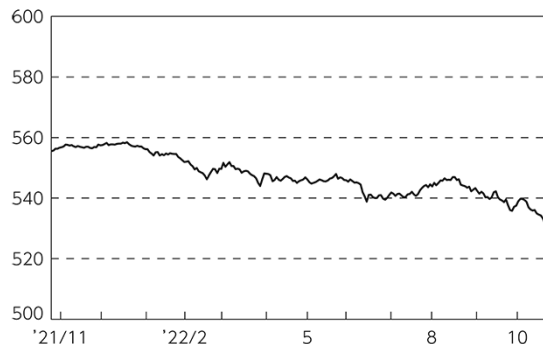
国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新たな変異株が確認され投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、ロシア軍のウクライナ侵攻を受けた地政学的リスクへの警戒感が高まったこと、日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したことなどから利回りが低下（債券価格は上昇）する局面があったものの、ウクライナ情勢を巡り、世界的なインフレ高進が懸念され金利先高観が強まったことや、中国の上海市がロックダウンを解除する方針を示し、経済正常化への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退したこと、欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

基準価額の推移



NOMURA - BPI総合の推移



ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルを利用して国債、政府保証債、地方債、金融債、電力債、事業債などによりポートフォリオを構築し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。また、「NOMURA-BPI総合」採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しを行ない、債券組入比率を高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、4.0%の値下がりとなり、ベンチマークである「NOMURA-BPI総合」の下落率4.1%を概ね0.1%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・金利効果。
- ・債券種別効果。
- ・売買要因。

<マイナス要因>

- ・個別銘柄効果。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度や残存期間別構成比率などを「NOMURA-BPI総合」と同程度に保つことで連動性を高めるよう努めます。また、ベンチマークの採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行ない、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	7,662,675	2,290,132
	地方債証券	703,018	1,915,396 (10,000)
内	特殊債券	1,113,373	2,845,698
	社債券(投資法人債券を含む)	—	1,009,130

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	39,154,000 (16,129,000)	39,782,689 (16,207,969)	83.6 (34.1)	— (—)	62.0 (22.4)	18.9 (10.0)	2.7 (1.7)
地方債証券	3,530,000 (3,530,000)	3,556,850 (3,556,850)	7.5 (7.5)	— (—)	0.2 (0.2)	5.8 (5.8)	1.5 (1.5)
特殊債券 (除く金融債)	3,300,000 (3,300,000)	3,329,171 (3,329,171)	7.0 (7.0)	— (—)	1.1 (1.1)	4.2 (4.2)	1.7 (1.7)
金融債券	200,000 (200,000)	199,448 (199,448)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	600,000 (600,000)	603,631 (603,631)	1.3 (1.3)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.8 (0.8)
合 計	46,784,000 (23,759,000)	47,471,790 (23,897,070)	99.8 (50.2)	— (—)	63.3 (23.6)	29.5 (20.6)	7.0 (6.0)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利率	当 期 末			銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日			額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円		%	千円	千円		
国債証券					国債証券				
第153回利付国債 (5年)	0.005	300,000	299,025	2027/6/20	第366回利付国債 (10年)	0.2	400,000	400,000	2032/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	70,000	84,619	2048/3/20	第367回利付国債 (10年)	0.2	350,000	348,512	2032/6/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	125,000	145,111	2049/3/20	第1回利付国債 (30年)	2.8	50,000	58,866	2029/9/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	85,000	98,855	2050/3/20	第3回利付国債 (30年)	2.3	70,000	80,649	2030/5/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	95,000	110,441	2051/3/20	第5回利付国債 (30年)	2.2	80,000	92,842	2031/5/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	75,000	83,847	2052/3/20	第6回利付国債 (30年)	2.4	50,000	59,345	2031/11/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	110,000	119,810	2053/3/20	第8回利付国債 (30年)	1.8	80,000	91,107	2032/11/22
第7回利付国債 (40年)	1.7	80,000	83,236	2054/3/20	第14回利付国債 (30年)	2.4	108,000	130,120	2034/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	95,000	91,531	2055/3/20	第15回利付国債 (30年)	2.5	147,000	178,962	2034/6/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	130,000	91,278	2056/3/20	第16回利付国債 (30年)	2.5	35,000	42,645	2034/9/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	125,000	103,520	2057/3/20	第17回利付国債 (30年)	2.4	50,000	60,429	2034/12/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	140,000	111,539	2058/3/20	第18回利付国債 (30年)	2.3	110,000	131,649	2035/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	175,000	124,153	2059/3/20	第19回利付国債 (30年)	2.3	40,000	47,936	2035/6/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	180,000	126,707	2060/3/20	第20回利付国債 (30年)	2.5	40,000	48,952	2035/9/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	150,000	112,666	2061/3/20	第21回利付国債 (30年)	2.3	70,000	84,040	2035/12/20
第15回利付国債 (40年)	1.0	140,000	115,112	2062/3/20	第22回利付国債 (30年)	2.5	70,000	85,850	2036/3/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	210,000	211,934	2024/3/20	第23回利付国債 (30年)	2.5	55,000	67,499	2036/6/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	120,000	121,274	2024/6/20	第24回利付国債 (30年)	2.5	68,000	83,503	2036/9/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	490,000	494,929	2024/9/20	第25回利付国債 (30年)	2.3	60,000	72,126	2036/12/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	180,000	182,030	2024/12/20	第26回利付国債 (30年)	2.4	170,000	206,575	2037/3/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	230,000	231,605	2024/12/20	第27回利付国債 (30年)	2.5	89,000	109,358	2037/9/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	390,000	393,970	2025/3/20	第28回利付国債 (30年)	2.5	144,000	176,945	2038/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	570,000	576,338	2025/6/20	第29回利付国債 (30年)	2.4	176,000	213,609	2038/9/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	620,000	627,551	2025/9/20	第30回利付国債 (30年)	2.3	147,000	176,023	2039/3/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	700,000	706,944	2025/12/20	第31回利付国債 (30年)	2.2	120,000	141,634	2039/9/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	530,000	531,976	2026/3/20	第32回利付国債 (30年)	2.3	160,000	191,243	2040/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	545,000	546,885	2026/6/20	第33回利付国債 (30年)	2.0	135,000	154,672	2040/9/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	500,000	501,460	2026/9/20	第34回利付国債 (30年)	2.2	180,000	212,076	2041/3/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	610,000	611,384	2026/12/20	第35回利付国債 (30年)	2.0	128,000	146,712	2041/9/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	690,000	691,207	2027/3/20	第36回利付国債 (30年)	2.0	135,000	154,668	2042/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	580,000	580,800	2027/6/20	第37回利付国債 (30年)	1.9	161,000	181,434	2042/9/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	500,000	500,240	2027/9/20	第38回利付国債 (30年)	1.8	135,000	149,494	2043/3/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	640,000	639,667	2027/12/20	第39回利付国債 (30年)	1.9	115,000	129,281	2043/6/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	640,000	638,969	2028/3/20	第40回利付国債 (30年)	1.8	130,000	143,631	2043/9/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	535,000	533,646	2028/6/20	第41回利付国債 (30年)	1.7	160,000	173,640	2043/12/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	590,000	587,929	2028/9/20	第42回利付国債 (30年)	1.7	135,000	146,365	2044/3/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	400,000	398,172	2028/12/20	第43回利付国債 (30年)	1.7	155,000	167,883	2044/6/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	325,000	323,251	2029/3/20	第44回利付国債 (30年)	1.7	150,000	162,301	2044/9/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	350,000	347,816	2029/6/20	第45回利付国債 (30年)	1.5	120,000	124,986	2044/12/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	350,000	347,378	2029/9/20	第46回利付国債 (30年)	1.5	120,000	124,812	2045/3/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	560,000	555,072	2029/12/20	第47回利付国債 (30年)	1.6	125,000	132,255	2045/6/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	600,000	593,460	2030/3/20	第48回利付国債 (30年)	1.4	85,000	86,422	2045/9/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	420,000	414,493	2030/6/20	第49回利付国債 (30年)	1.4	140,000	142,111	2045/12/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	580,000	571,485	2030/9/20	第50回利付国債 (30年)	0.8	95,000	84,805	2046/3/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	270,000	265,809	2030/12/20	第51回利付国債 (30年)	0.3	90,000	70,962	2046/6/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	400,000	393,448	2031/3/20	第52回利付国債 (30年)	0.5	130,000	107,318	2046/9/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	300,000	294,816	2031/6/20	第53回利付国債 (30年)	0.6	105,000	88,482	2046/12/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	300,000	294,543	2031/9/20	第54回利付国債 (30年)	0.8	110,000	96,852	2047/3/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	300,000	295,050	2031/12/20	第55回利付国債 (30年)	0.8	110,000	96,578	2047/6/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第56回利付国債 (30年)	0.8	90,000	78,721	2047/9/20	第105回利付国債 (20年)	2.1	77,000	85,778	2028/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	100,000	87,138	2047/12/20	第106回利付国債 (20年)	2.2	2,000	2,239	2028/9/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	100,000	86,808	2048/3/20	第107回利付国債 (20年)	2.1	130,000	145,308	2028/12/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	170,000	143,481	2048/6/20	第108回利付国債 (20年)	1.9	134,000	148,149	2028/12/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	120,000	105,976	2048/9/20	第109回利付国債 (20年)	1.9	27,000	29,945	2029/3/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	100,000	83,639	2048/12/20	第110回利付国債 (20年)	2.1	98,000	109,929	2029/3/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	120,000	94,712	2049/3/20	第111回利付国債 (20年)	2.2	25,000	28,307	2029/6/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	90,000	68,795	2049/6/20	第112回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,058	2029/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	100,000	76,215	2049/9/20	第113回利付国債 (20年)	2.1	290,000	327,494	2029/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	110,000	83,826	2049/12/20	第114回利付国債 (20年)	2.1	52,000	58,920	2029/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	180,000	136,902	2050/3/20	第115回利付国債 (20年)	2.2	125,000	142,517	2029/12/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	110,000	87,820	2050/6/20	第116回利付国債 (20年)	2.2	135,000	154,280	2030/3/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	140,000	111,595	2050/9/20	第117回利付国債 (20年)	2.1	343,000	389,493	2030/3/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	110,000	89,999	2050/12/20	第118回利付国債 (20年)	2.0	10,000	11,304	2030/6/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	110,000	89,794	2051/3/20	第119回利付国債 (20年)	1.8	30,000	33,463	2030/6/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	120,000	97,729	2051/6/20	第120回利付国債 (20年)	1.6	170,000	187,078	2030/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	160,000	130,128	2051/9/20	第121回利付国債 (20年)	1.9	22,000	24,763	2030/9/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	120,000	97,562	2051/12/20	第122回利付国債 (20年)	1.8	17,000	19,004	2030/9/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	130,000	114,519	2052/3/20	第123回利付国債 (20年)	2.1	195,000	223,360	2030/12/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	90,000	85,428	2052/6/20	第124回利付国債 (20年)	2.0	90,000	102,372	2030/12/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	100,000	102,286	2023/12/20	第125回利付国債 (20年)	2.2	50,000	57,873	2031/3/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	34,000	34,738	2023/12/20	第126回利付国債 (20年)	2.0	105,000	119,811	2031/3/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	34,000	34,929	2024/3/20	第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	56,643	2031/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	78,000	80,460	2024/3/20	第128回利付国債 (20年)	1.9	65,000	73,858	2031/6/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	104,000	108,189	2024/6/20	第129回利付国債 (20年)	1.8	85,000	95,866	2031/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	112,000	116,531	2024/9/20	第130回利付国債 (20年)	1.8	150,000	169,647	2031/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	113,000	117,916	2024/12/20	第131回利付国債 (20年)	1.7	92,000	103,252	2031/9/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	118,000	123,387	2024/12/20	第132回利付国債 (20年)	1.7	135,000	151,895	2031/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	10,000	10,509	2025/3/20	第133回利付国債 (20年)	1.8	30,000	34,021	2031/12/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	21,000	21,968	2025/3/20	第134回利付国債 (20年)	1.8	120,000	136,321	2032/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	40,000	41,940	2025/3/20	第135回利付国債 (20年)	1.7	30,000	33,806	2032/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	160,000	168,579	2025/6/20	第136回利付国債 (20年)	1.6	220,000	245,905	2032/3/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	60,000	63,688	2025/9/20	第137回利付国債 (20年)	1.7	200,000	225,720	2032/6/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	130,000	139,755	2026/3/20	第138回利付国債 (20年)	1.5	120,000	133,188	2032/6/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	300,000	325,101	2026/6/20	第139回利付国債 (20年)	1.6	230,000	257,427	2032/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	16,000	17,355	2026/9/20	第140回利付国債 (20年)	1.7	358,000	404,235	2032/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	250,000	272,150	2026/9/20	第141回利付国債 (20年)	1.7	195,000	220,149	2032/12/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	60,000	65,104	2026/12/20	第142回利付国債 (20年)	1.8	125,000	142,343	2032/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	60,000	65,101	2027/3/20	第143回利付国債 (20年)	1.6	94,000	105,151	2033/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	50,000	54,470	2027/3/20	第144回利付国債 (20年)	1.5	370,000	410,204	2033/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	82,000	90,468	2027/6/20	第145回利付国債 (20年)	1.7	315,000	355,543	2033/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	248,000	271,314	2027/6/20	第146回利付国債 (20年)	1.7	135,000	152,373	2033/9/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	45,000	49,642	2027/9/20	第147回利付国債 (20年)	1.6	98,000	109,498	2033/12/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	94,000	103,239	2027/9/20	第148回利付国債 (20年)	1.5	90,000	99,487	2034/3/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	117,000	128,950	2027/12/20	第149回利付国債 (20年)	1.5	115,000	127,026	2034/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	30,000	33,335	2028/3/20	第150回利付国債 (20年)	1.4	140,000	152,947	2034/9/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	66,000	74,045	2028/3/20	第151回利付国債 (20年)	1.2	140,000	149,510	2034/12/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	81,000	91,255	2028/6/20	第152回利付国債 (20年)	1.2	300,000	319,842	2035/3/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	11,000	12,331	2028/6/20	第153回利付国債 (20年)	1.3	270,000	290,846	2035/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	33,000	36,623	2028/6/20	第154回利付国債 (20年)	1.2	160,000	170,168	2035/9/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
第155回利付国債 (20年)	1.0	270,000	280,087	2035/12/20	第147回共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	101,232	2025/6/25
第156回利付国債 (20年)	0.4	160,000	153,369	2036/3/20	第165回共同発行市場公募地方債	0.145	200,000	199,916	2026/12/25
第157回利付国債 (20年)	0.2	150,000	139,354	2036/6/20	平成28年度第1回長崎県公募公債	0.105	100,000	99,863	2026/9/30
第158回利付国債 (20年)	0.5	170,000	164,031	2036/9/20	平成27年度第1回佐賀県公募公債	0.476	100,000	101,190	2025/11/28
第159回利付国債 (20年)	0.6	150,000	146,187	2036/12/20	平成29年度第1回滋賀県公募公債	0.19	100,000	99,849	2027/11/30
第160回利付国債 (20年)	0.7	140,000	137,837	2037/3/20	平成27年度第2回熊本県公募公債 (10年)	0.476	100,000	101,160	2025/10/30
第161回利付国債 (20年)	0.6	120,000	116,091	2037/6/20	第2回名古屋市定時償還公募公債 (10年)	0.275	30,000	30,073	2025/7/17
第162回利付国債 (20年)	0.6	150,000	144,562	2037/9/20	平成27年度第5回札幌市公募公債 (10年)	0.47	100,000	101,086	2025/9/19
第163回利付国債 (20年)	0.6	165,000	158,400	2037/12/20	令和元年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,830	2024/10/31
第164回利付国債 (20年)	0.5	255,000	240,232	2038/3/20	令和2年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,776	2025/10/30
第165回利付国債 (20年)	0.5	170,000	159,470	2038/6/20	小 計		3,530,000	3,556,850	
第166回利付国債 (20年)	0.7	150,000	144,520	2038/9/20	特殊債券 (除く金融債)				
第167回利付国債 (20年)	0.5	160,000	148,772	2038/12/20	第28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	109,308	2027/2/26
第168回利付国債 (20年)	0.4	100,000	91,035	2039/3/20	第43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	110,517	2027/10/29
第169回利付国債 (20年)	0.3	160,000	142,491	2039/6/20	第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,000	2024/6/28
第170回利付国債 (20年)	0.3	140,000	124,040	2039/9/20	第28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	100,967	2025/10/31
第171回利付国債 (20年)	0.3	170,000	149,946	2039/12/20	第270回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	99,805	2026/4/30
第172回利付国債 (20年)	0.4	230,000	205,590	2040/3/20	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.09	200,000	199,170	2027/9/30
第173回利付国債 (20年)	0.4	150,000	133,495	2040/6/20	第350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	99,547	2028/6/30
第174回利付国債 (20年)	0.4	200,000	177,340	2040/9/20	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.693	100,000	100,804	2023/12/18
第175回利付国債 (20年)	0.5	140,000	125,958	2040/12/20	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.01	200,000	199,264	2026/9/14
第176回利付国債 (20年)	0.5	160,000	143,446	2041/3/20	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	99,432	2027/1/29
第177回利付国債 (20年)	0.4	150,000	131,614	2041/6/20	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.414	200,000	201,672	2025/2/17
第178回利付国債 (20年)	0.5	120,000	106,976	2041/9/20	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.386	100,000	100,968	2025/10/15
第179回利付国債 (20年)	0.5	190,000	168,896	2041/12/20	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.11	200,000	199,622	2027/5/21
第180回利付国債 (20年)	0.8	190,000	178,182	2042/3/20	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	100,000	99,906	2027/6/14
第181回利付国債 (20年)	0.9	190,000	181,081	2042/6/20	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	200,000	199,948	2028/2/15
小 計		39,154,000	39,782,689		第52回政府保証日本政策金融公庫債券	0.13	100,000	99,459	2028/7/19
地方債証券					第5回政府保証新聞関西国際空港債	0.145	100,000	100,002	2027/3/30
第4回東京都公募公債 (東京グリーンボンド (5年))	0.02	100,000	99,786	2025/9/19	第13回新聞関西国際空港株式会社社債 (一般担保)	0.506	200,000	201,310	2024/12/20
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	104,588	2025/3/19	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	100,000	100,837	2024/3/19
第32回東京都公募公債 (5年)	0.02	300,000	299,451	2025/6/20	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.665	200,000	201,604	2024/3/19
第726回東京都公募公債	0.73	100,000	100,805	2023/12/20	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	100,698	2024/6/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	100,856	2024/3/19	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.5	100,000	100,728	2024/9/20
第739回東京都公募公債	0.29	100,000	100,429	2024/12/20	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	100,752	2024/12/20
第744回東京都公募公債	0.577	100,000	101,303	2025/6/20	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	0.674	100,000	100,936	2024/6/20
令和2年度第2回北海道公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,808	2025/5/29	第29回国際協力機構債券	0.583	100,000	101,225	2025/6/20
令和3年度第6回北海道公募公債 (5年)	0.005	100,000	99,514	2026/7/30	第37回国際協力機構債券	0.1	100,000	99,690	2026/9/18
第214回神奈川県公募公債	0.563	100,000	101,266	2025/6/20	小 計		3,300,000	3,329,171	
平成25年度第10回静岡県公募公債	0.669	100,000	100,869	2024/3/26	金融債券				
平成27年度第10回静岡県公募公債	0.461	200,000	202,120	2025/9/19	第357回信金中金債 (5年)	0.02	100,000	99,778	2024/8/27
平成26年度第3回埼玉県公募公債	0.67	100,000	100,943	2024/5/20	第363回信金中金債 (5年)	0.01	100,000	99,670	2025/2/27
平成22年度第1回福岡県公募公債 (15年)	1.67	100,000	104,823	2025/11/21	小 計		200,000	199,448	
平成26年度第2回新潟県公募公債	0.429	100,000	100,812	2025/2/27	普通社債券 (含む投資法人債券)				
第10回群馬県公募公債 (10年)	0.67	100,000	100,696	2023/11/24	第13回成田国際空港株式会社社債 (一般担保)	0.739	100,000	100,823	2024/2/20
平成26年度第1回岐阜県公募公債 (10年)	0.554	100,000	100,901	2024/9/30	第35回日本高速道路株式会社社債 (一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重量的債引付受委託)	0.524	100,000	100,780	2024/12/20
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	100,943	2024/4/25	第11回株式会社セブン銀行担保社債 (社債買取定額付特別付)	0.536	100,000	100,639	2024/12/20
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	100,872	2024/11/25	第8回日本政策投資株式会社社債担保社債 (社債買取定額付特別付)	0.757	100,000	100,727	2024/1/30
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	201,152	2025/1/24					
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	100,938	2025/3/25					

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第1回KDDI株式会社無担保社債(社債同等有利順位特付)	0.803	100,000	100,748	2023/12/20	第1回KDDI株式会社無担保社債(社債同等有利順位特付)	0.13	100,000	99,914	2024/4/26
					小 計		600,000	603,631	
					合 計		46,784,000	47,471,790	

○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 47,471,790	% 99.7
コール・ローン等、その他	120,490	0.3
投資信託財産総額	47,592,280	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	47,592,280,774	
コール・ローン等	38,142,474	
公社債(評価額)	47,471,790,020	
未収利息	81,611,164	
前払費用	737,116	
(B) 負債	14,845,618	
未払解約金	14,845,556	
未払利息	62	
(C) 純資産総額(A-B)	47,577,435,156	
元本	35,139,813,158	
次期繰越損益金	12,437,621,998	
(D) 受益権総口数	35,139,813,158口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,539円	

(注) 当ファンドの期首元本額は34,479,945,047円、期中追加設定元本額は4,247,701,412円、期中一部解約元本額は3,587,833,301円です。

(注) 2022年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,161,581,877円
・DCインデックスバランス(株式20)	4,815,944,655円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,488,925,161円
・DCインデックスバランス(株式40)	4,446,314,480円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,381,046,243円
・DCインデックスバランス(株式60)	3,280,760,207円
・インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,209,280,459円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,615,057,133円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,480,910,178円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,423,718,543円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	807,219,661円
・DCインデックスバランス(株式80)	537,618,854円
・日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	372,392,108円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	119,043,599円

(注) 1口当たり純資産額は1.3539円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○損益の状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	403,967,654	
受取利息	403,990,521	
支払利息	△ 22,867	
(B) 有価証券売買損益	△ 2,364,035,883	
売買益	1,877,927	
売買損	△ 2,365,913,810	
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,960,068,229	
(D) 前期繰越損益金	14,138,082,141	
(E) 追加信託差損益金	1,646,564,078	
(F) 解約差損益金	△ 1,386,955,992	
(G) 計(C+D+E+F)	12,437,621,998	
次期繰越損益金(G)	12,437,621,998	

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

〇お知らせ

約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2022年10月26日）
（2021年10月27日～2022年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として世界各国の債券に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	期騰	期中率	期騰	期中率		
	円	%		%	%	百万円
20期(2018年10月26日)	22,220	△3.6	221.52	△3.5	98.9	147,033
21期(2019年10月28日)	23,455	5.6	233.74	5.5	99.1	154,835
22期(2020年10月26日)	24,530	4.6	244.04	4.4	99.2	152,834
23期(2021年10月26日)	25,816	5.2	257.16	5.4	99.3	159,216
24期(2022年10月26日)	26,448	2.4	263.52	2.5	99.2	152,274

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、設定時を100として2022年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率
	騰	落率	騰	落率	
(期首) 2021年10月26日	円	%		%	%
	25,816	—	257.16	—	99.3
10月末	25,986	0.7	258.63	0.6	99.1
11月末	25,697	△0.5	255.53	△0.6	99.4
12月末	25,857	0.2	257.38	0.1	99.2
2022年1月末	25,414	△1.6	253.15	△1.6	99.3
2月末	24,955	△3.3	248.98	△3.2	98.7
3月末	25,783	△0.1	256.63	△0.2	99.2
4月末	25,841	0.1	256.99	△0.1	99.2
5月末	25,680	△0.5	255.99	△0.5	99.2
6月末	26,298	1.9	262.17	1.9	99.2
7月末	26,479	2.6	263.24	2.4	99.2
8月末	26,164	1.3	259.90	1.1	99.2
9月末	25,932	0.4	257.23	0.0	99.2
(期末) 2022年10月26日	26,448	2.4	263.52	2.5	99.2

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2021年10月27日～2022年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め25,816円の基準価額は、期間末に26,448円となり、騰落率は+2.4%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

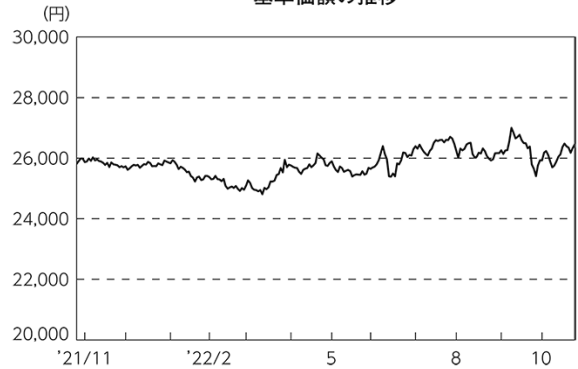
<値上がり要因>

- ・欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や、南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大が警戒されたこと。
- ・米国やユーロ圏の市場予想を下回る景況感に関する指標などを背景に、景気後退の可能性が懸念されたこと。
- ・円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高、円安／イギリスポンド高となったこと。

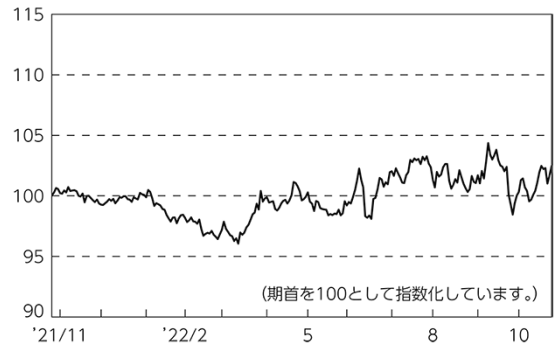
<値下がり要因>

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）や欧州中央銀行（ECB）など主要国の中央銀行が政策金利を引き上げたこと。
- ・米国の消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回り、FRBによる金融引き締め長期化観測が強まったこと。
- ・原油や天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を受けて、インフレの高進が懸念されたこと（期間の初め～2022年6月前半）。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2021/10/26	2022/09/08	2022/03/11	2022/10/26
25,816円	27,001円	24,809円	26,448円

FTSE世界国債インデックス
（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移

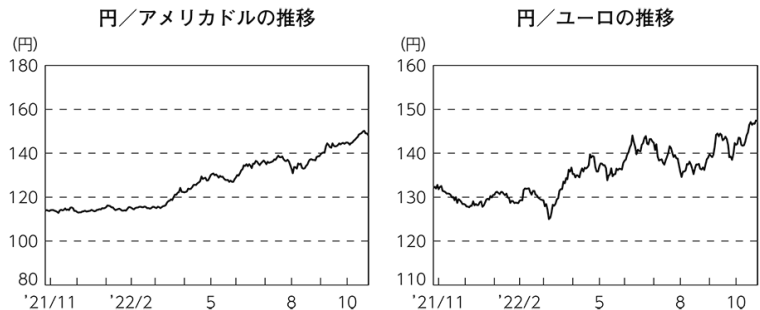
（海外債券市況）

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など、各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2022年6月前半にかけては、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大に対する警戒感、ロシアによる軍事侵攻などウクライナ情勢の緊迫化などが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、FRBやカナダの中央銀行など主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、ECBが政策金利の引き上げ開始や大幅な利上げの可能性を示唆したこと、原油や天然ガスなどのエネルギー価格の上昇を受けてインフレの高進が懸念されたことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。6月後半から7月下旬にかけては、FRBやECBによる政策金利の引き上げなどが利回りの上昇要因となったものの、米国や欧州の中央銀行による金融引き締め加速や米国やユーロ圏の市場予想を下回る景況感に関する指標などを背景に景気後退の可能性が懸念されたことなどをを受けて、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。8月上旬から期間末にかけては、ECBやオーストラリア準備銀行（RBA）など主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、タカ派（金融引き締めの政策を支持）的とみなされた複数のFRB高官の発言や、市場予想を上回る米国のCPIを受けてFRBによる金融引き締めの長期化観測が強まったことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマークが採用している国の債券の中からポートフォリオを構築し、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、債券の組入比率を高位に維持してベンチマークとの連動性を保つように努めました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、2.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」の上昇率2.5%と概ね同水準となりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・投資銘柄の選択による効果が寄与したこと。
- ・投資国の選択による効果が寄与したこと。

<マイナス要因>

- ・投資通貨の選択が影響したこと。
- ・外国口座の管理費用を支払ったこと。

○今後の運用方針

引き続き、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (保 管 費 用)	円 4 (4)	% 0.016 (0.016)	(a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
合 計	4	0.016	
期中の平均基準価額は、25,840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

（2021年10月27日～2022年10月26日）

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 137,462	千アメリカドル 157,414
	カナダ	国債証券	千カナダドル 9,698	千カナダドル 11,367
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 14,522	千メキシコペソ 24,181
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	8,969	18,332
	イタリア	国債証券	6,886	19,720
	フランス	国債証券	6,660	18,769
	オランダ	国債証券	1,967	4,306
	スペイン	国債証券	3,530	10,897
	ベルギー	国債証券	1,382	3,434
	オーストリア	国債証券	1,611	3,233
	フィンランド	国債証券	676	1,447
	アイルランド	国債証券	434	2,019
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 4,248	千イギリスポンド 11,665
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ -	千スウェーデンクローナ 3,928
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 1,887	千ノルウェークローネ 7,697
デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ -	千デンマーククローネ 10,311	
ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 2,026	千ポーランドズロチ 5,556	
オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 1,788	千オーストラリアドル 7,608	
シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,275	千シンガポールドル 1,776	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリングット 2,974	千マレーシアリングット 4,829	
中国	国債証券	千中国人民元 250,700	千中国人民元 12,105	
イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 410	千イスラエルシェケル 5,204	

(注) 金額は受け渡し代金。(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

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカドル 604,930	千アメリカドル 526,775	千円 78,083,916	% 51.3	% —	% 22.0	% 18.3	% 11.0
カナダ	千カナダドル 31,629	千カナダドル 28,322	3,078,358	2.0	—	1.0	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 186,410	千メキシコペソ 168,383	1,255,043	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	67,990	65,229	9,612,257	6.3	—	3.6	1.6	1.1
イタリア	84,609	78,381	11,550,345	7.6	—	4.2	2.3	1.1
フランス	94,514	89,124	13,133,319	8.6	—	5.3	2.5	0.8
オランダ	17,059	15,938	2,348,760	1.5	—	1.0	0.4	0.2
スペイン	55,048	52,288	7,705,219	5.1	—	3.0	1.5	0.5
ベルギー	20,988	19,676	2,899,471	1.9	—	1.3	0.4	0.2
オーストリア	13,888	12,528	1,846,243	1.2	—	0.6	0.4	0.2
フィンランド	6,007	5,174	762,453	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	7,443	6,647	979,637	0.6	—	0.4	0.2	0.0
イギリス	千イギリスポンド 44,120	千イギリスポンド 39,111	6,630,252	4.4	—	3.3	0.7	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 29,735	千スウェーデンクローナ 28,947	390,499	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 23,840	千ノルウェークローネ 21,793	309,464	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 26,860	千デンマーククローネ 27,436	543,525	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 25,905	千ポーランドズロチ 20,749	641,714	0.4	—	0.1	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 27,115	千オーストラリアドル 23,957	2,264,192	1.5	—	1.0	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 7,059	千シンガポールドル 6,626	692,485	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 25,825	千マレーシアリンギット 24,852	778,544	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中国	千中国人民幣 235,000	千中国人民幣 240,422	4,901,467	3.2	—	1.4	1.1	0.7
イスラエル	千イスラエルシェケル 14,025	千イスラエルシェケル 13,640	574,169	0.4	—	0.2	0.2	0.1
合 計	—	—	150,981,343	99.2	—	50.4	31.5	17.2

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	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					
US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,429	360,051	2023/9/30
US TREASURY N/B	2.875	660	650	96,471	2023/9/30
US TREASURY N/B	0.25	3,500	3,363	498,521	2023/9/30
US TREASURY N/B	0.125	1,400	1,341	198,873	2023/10/15
US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,651	244,827	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.875	900	885	131,245	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,926	582,040	2023/11/15
US TREASURY N/B	0.25	7,000	6,692	991,981	2023/11/15
US TREASURY N/B	2.125	2,680	2,611	387,030	2023/11/30
US TREASURY N/B	2.875	1,810	1,778	263,637	2023/11/30
US TREASURY N/B	0.5	4,000	3,828	567,466	2023/11/30
US TREASURY N/B	0.125	3,000	2,854	423,185	2023/12/15
US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,947	288,689	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.625	2,470	2,415	358,040	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,942	288,006	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.5	2,520	2,455	363,989	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.75	3,300	3,222	477,675	2024/2/15
US TREASURY N/B	0.125	5,000	4,719	699,634	2024/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,452	215,275	2024/2/29
US TREASURY N/B	2.375	1,630	1,583	234,743	2024/2/29
US TREASURY N/B	0.25	5,000	4,710	698,244	2024/3/15
US TREASURY N/B	2.125	3,860	3,729	552,834	2024/3/31
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,923	285,169	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.25	3,000	2,897	429,455	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.5	3,380	3,273	485,164	2024/5/15
US TREASURY N/B	0.25	2,830	2,646	392,338	2024/5/15
US TREASURY N/B	2.0	3,870	3,716	550,928	2024/5/31
US TREASURY N/B	0.25	4,700	4,381	649,437	2024/6/15
US TREASURY N/B	2.0	2,300	2,204	326,825	2024/6/30
US TREASURY N/B	1.75	2,660	2,539	376,471	2024/6/30
US TREASURY N/B	2.125	2,490	2,387	353,882	2024/7/31
US TREASURY N/B	1.75	4,640	4,420	655,251	2024/7/31
US TREASURY N/B	2.375	4,620	4,445	658,927	2024/8/15
US TREASURY N/B	0.375	5,000	4,640	687,908	2024/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,420	1,353	200,603	2024/8/31
US TREASURY N/B	1.25	2,300	2,167	321,232	2024/8/31
US TREASURY N/B	0.375	6,000	5,554	823,301	2024/9/15
US TREASURY N/B	2.125	2,015	1,927	285,744	2024/9/30
US TREASURY N/B	1.5	2,200	2,079	308,310	2024/9/30
US TREASURY N/B	2.25	1,090	1,043	154,703	2024/10/31
US TREASURY N/B	1.5	2,140	2,018	299,133	2024/10/31
US TREASURY N/B	2.25	4,650	4,448	659,356	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.125	1,400	1,334	197,794	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.5	3,470	3,264	483,878	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.0	1,800	1,674	248,168	2024/12/15
US TREASURY N/B	2.25	1,900	1,812	268,721	2024/12/31
US TREASURY N/B	1.75	1,300	1,228	182,059	2024/12/31
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,436	212,904	2025/1/31
US TREASURY N/B	1.375	3,510	3,279	486,153	2025/1/31

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					
US TREASURY N/B	2.0	4,530	4,285	635,206	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.75	2,060	1,981	293,759	2025/2/28
US TREASURY N/B	1.125	1,540	1,426	211,438	2025/2/28
US TREASURY N/B	2.625	2,010	1,926	285,593	2025/3/31
US TREASURY N/B	0.5	3,470	3,160	468,467	2025/3/31
US TREASURY N/B	2.625	2,600	2,488	368,822	2025/4/15
US TREASURY N/B	2.875	2,200	2,116	313,749	2025/4/30
US TREASURY N/B	0.375	2,150	1,943	288,069	2025/4/30
US TREASURY N/B	2.125	3,800	3,585	531,501	2025/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,420	1,364	202,264	2025/5/31
US TREASURY N/B	0.25	3,820	3,428	508,165	2025/5/31
US TREASURY N/B	2.875	5,000	4,803	712,083	2025/6/15
US TREASURY N/B	2.75	1,370	1,311	194,468	2025/6/30
US TREASURY N/B	3.0	5,000	4,813	713,458	2025/7/15
US TREASURY N/B	2.875	1,440	1,381	204,738	2025/7/31
US TREASURY N/B	0.25	3,000	2,674	396,468	2025/7/31
US TREASURY N/B	2.0	4,730	4,423	655,746	2025/8/15
US TREASURY N/B	2.75	3,000	2,862	424,331	2025/8/31
US TREASURY N/B	3.0	4,200	4,033	597,882	2025/9/30
US TREASURY N/B	0.25	320	283	42,038	2025/9/30
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,342	199,042	2025/10/31
US TREASURY N/B	0.25	1,800	1,588	235,463	2025/10/31
US TREASURY N/B	2.25	3,440	3,223	477,882	2025/11/15
US TREASURY N/B	2.875	1,320	1,259	186,721	2025/11/30
US TREASURY N/B	0.375	3,420	3,020	447,677	2025/11/30
US TREASURY N/B	2.625	2,000	1,892	280,571	2025/12/31
US TREASURY N/B	2.625	1,850	1,748	259,175	2026/1/31
US TREASURY N/B	0.375	3,000	2,632	390,145	2026/1/31
US TREASURY N/B	6.0	1,800	1,885	279,414	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	3,310	3,025	448,438	2026/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,790	1,682	249,442	2026/2/28
US TREASURY N/B	0.5	3,650	3,205	475,205	2026/2/28
US TREASURY N/B	2.25	2,070	1,928	285,896	2026/3/31
US TREASURY N/B	0.75	2,400	2,121	314,437	2026/3/31
US TREASURY N/B	2.375	320	299	44,341	2026/4/30
US TREASURY N/B	0.75	2,740	2,415	357,999	2026/4/30
US TREASURY N/B	1.625	4,840	4,400	652,331	2026/5/15
US TREASURY N/B	2.125	2,740	2,534	375,657	2026/5/31
US TREASURY N/B	0.75	2,800	2,461	364,882	2026/5/31
US TREASURY N/B	1.875	2,000	1,830	271,376	2026/6/30
US TREASURY N/B	1.875	960	877	130,049	2026/7/31
US TREASURY N/B	0.625	3,260	2,837	420,598	2026/7/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,597	533,211	2026/8/15
US TREASURY N/B	0.75	3,000	2,617	387,957	2026/8/31
US TREASURY N/B	1.625	1,620	1,461	216,686	2026/9/30
US TREASURY N/B	0.875	3,000	2,624	389,025	2026/9/30
US TREASURY N/B	1.625	2,450	2,205	326,861	2026/10/31
US TREASURY N/B	1.125	4,950	4,364	646,879	2026/10/31
US TREASURY N/B	2.0	3,040	2,774	411,251	2026/11/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
(アメリカ) 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	1.625	2,870	2,580	382,462	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.25	2,210	1,955	289,838	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,804	267,474	2026/12/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,562	528,115	2027/1/31
US TREASURY N/B	2.25	2,060	1,892	280,484	2027/2/15
US TREASURY N/B	1.125	1,530	1,388	198,451	2027/2/28
US TREASURY N/B	0.625	3,310	2,822	418,367	2027/3/31
US TREASURY N/B	0.5	2,450	2,071	307,057	2027/4/30
US TREASURY N/B	2.375	3,530	3,248	481,473	2027/5/15
US TREASURY N/B	0.5	1,600	1,348	199,943	2027/5/31
US TREASURY N/B	0.5	3,100	2,607	386,439	2027/6/30
US TREASURY N/B	3.25	5,000	4,782	708,869	2027/6/30
US TREASURY N/B	0.375	7,000	5,838	865,431	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.75	930	868	128,807	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.25	2,960	2,700	400,240	2027/8/15
US TREASURY N/B	0.5	2,100	1,756	260,383	2027/8/31
US TREASURY N/B	0.375	4,090	3,387	502,154	2027/9/30
US TREASURY N/B	0.5	3,860	3,208	475,525	2027/10/31
US TREASURY N/B	6.125	1,400	1,513	224,391	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	3,020	2,743	406,666	2027/11/15
US TREASURY N/B	0.625	220	183	27,215	2027/11/30
US TREASURY N/B	0.625	3,960	3,295	488,486	2027/12/31
US TREASURY N/B	0.75	2,850	2,379	352,717	2028/1/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,710	549,979	2028/2/15
US TREASURY N/B	1.125	3,830	3,257	482,873	2028/2/29
US TREASURY N/B	1.25	960	820	121,556	2028/3/31
US TREASURY N/B	1.25	3,370	2,872	425,717	2028/4/30
US TREASURY N/B	2.875	2,440	2,270	336,547	2028/5/15
US TREASURY N/B	1.25	4,300	3,657	542,154	2028/5/31
US TREASURY N/B	1.25	3,300	2,801	415,211	2028/6/30
US TREASURY N/B	1.0	2,920	2,435	361,025	2028/7/31
US TREASURY N/B	2.875	4,200	3,899	578,062	2028/8/15
US TREASURY N/B	1.125	3,900	3,269	484,698	2028/8/31
US TREASURY N/B	1.25	4,000	3,372	499,859	2028/9/30
US TREASURY N/B	1.375	4,000	3,391	502,684	2028/10/31
US TREASURY N/B	5.25	1,070	1,124	166,647	2028/11/15
US TREASURY N/B	3.125	4,510	4,236	627,962	2028/11/15
US TREASURY N/B	1.5	6,000	5,118	758,648	2028/11/30
US TREASURY N/B	1.375	870	736	109,142	2028/12/31
US TREASURY N/B	2.625	4,370	3,977	589,567	2029/2/15
US TREASURY N/B	2.375	4,630	4,145	614,443	2029/3/31
US TREASURY N/B	2.375	4,180	3,737	553,962	2029/5/15
US TREASURY N/B	3.25	2,650	2,500	370,621	2029/6/30
US TREASURY N/B	1.625	3,470	2,954	437,887	2029/8/15
US TREASURY N/B	1.75	1,390	1,191	176,670	2029/11/15
US TREASURY N/B	1.5	4,340	3,627	537,673	2030/2/15
US TREASURY N/B	6.25	1,060	1,200	177,939	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	4,590	3,558	527,477	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	5,090	3,918	580,898	2030/8/15
US TREASURY N/B	0.875	6,110	4,788	709,830	2030/11/15
US TREASURY N/B	5.375	560	607	90,092	2031/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
(アメリカ) 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	1.125	4,400	3,506	519,756	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.625	7,480	6,159	912,951	2031/5/15
US TREASURY N/B	1.25	7,600	6,012	891,205	2031/8/15
US TREASURY N/B	1.375	6,830	5,426	804,431	2031/11/15
US TREASURY N/B	1.875	6,500	5,382	797,894	2032/2/15
US TREASURY N/B	2.875	4,600	4,152	615,589	2032/5/15
US TREASURY N/B	2.75	3,200	2,852	422,751	2032/8/15
US TREASURY N/B	4.5	800	828	122,880	2036/2/15
US TREASURY N/B	5.0	750	811	120,313	2037/5/15
US TREASURY N/B	4.375	670	677	100,489	2038/2/15
US TREASURY N/B	4.5	720	737	109,389	2038/5/15
US TREASURY N/B	3.5	800	722	107,154	2039/2/15
US TREASURY N/B	4.25	1,450	1,436	212,868	2039/5/15
US TREASURY N/B	4.5	1,420	1,449	214,840	2039/8/15
US TREASURY N/B	4.375	750	751	111,465	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.625	680	702	104,160	2040/2/15
US TREASURY N/B	4.375	1,590	1,589	235,671	2040/5/15
US TREASURY N/B	1.125	3,700	2,187	324,228	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	1,440	1,344	199,293	2040/8/15
US TREASURY N/B	1.125	3,000	1,759	260,786	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.25	1,010	990	146,767	2040/11/15
US TREASURY N/B	1.375	3,100	1,897	281,200	2040/11/15
US TREASURY N/B	4.75	1,500	1,569	232,619	2041/2/15
US TREASURY N/B	1.875	4,200	2,814	417,180	2041/2/15
US TREASURY N/B	4.375	870	865	128,287	2041/5/15
US TREASURY N/B	2.25	4,900	3,505	519,564	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	960	873	129,477	2041/8/15
US TREASURY N/B	1.75	3,190	2,064	306,025	2041/8/15
US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,029	300,808	2041/11/15
US TREASURY N/B	3.125	500	411	61,055	2042/2/15
US TREASURY N/B	2.75	800	613	90,874	2042/8/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,528	226,502	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	1,765	1,433	212,499	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	2,050	1,591	235,927	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	1,950	1,715	254,249	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	2,090	1,870	277,259	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	1,080	945	140,089	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	2,200	1,843	273,292	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.125	2,150	1,724	255,640	2044/8/15
US TREASURY N/B	3.0	2,300	1,801	267,109	2044/11/15
US TREASURY N/B	2.5	2,820	2,009	297,929	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,093	162,158	2045/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,390	1,060	157,185	2045/8/15
US TREASURY N/B	3.0	1,190	928	137,607	2045/11/15
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,061	157,361	2046/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,059	156,983	2046/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,150	1,438	213,201	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	1,540	1,171	173,680	2046/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,556	230,769	2047/2/15
US TREASURY N/B	3.0	1,780	1,385	205,441	2047/5/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,483	219,971	2047/8/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千アメリカドル	外貨建金額 千アメリカドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ) 国債証券					
US TREASURY N/B	2.75	1,740	1,291	191,475	2047/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,750	2,148	318,415	2048/2/15
US TREASURY N/B	3.125	2,400	1,925	285,477	2048/5/15
US TREASURY N/B	3.0	4,100	3,216	476,817	2048/8/15
US TREASURY N/B	3.375	2,950	2,491	369,329	2048/11/15
US TREASURY N/B	3.0	3,300	2,602	385,824	2049/2/15
US TREASURY N/B	2.875	3,000	2,307	342,098	2049/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,950	1,979	293,437	2049/8/15
US TREASURY N/B	2.375	3,100	2,138	316,992	2049/11/15
US TREASURY N/B	2.0	3,700	2,320	343,895	2050/2/15
US TREASURY N/B	1.25	2,450	1,241	183,993	2050/5/15
US TREASURY N/B	1.375	2,570	1,347	199,716	2050/8/15
US TREASURY N/B	1.625	3,000	1,688	250,224	2050/11/15
US TREASURY N/B	1.875	4,750	2,857	423,555	2051/2/15
US TREASURY N/B	2.375	4,100	2,792	413,977	2051/5/15
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,238	183,608	2051/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,400	838	124,221	2051/11/15
小 計				78,083,916	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	500	481	52,310	2023/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	590	564	61,400	2024/2/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	790	770	83,699	2024/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	1,450	1,372	149,145	2024/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,010	984	106,998	2024/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	650	634	68,973	2024/8/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	795	758	82,437	2024/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	800	750	81,577	2024/10/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	610	571	62,128	2025/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	520	489	53,154	2025/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	950	909	98,833	2025/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,925	1,743	189,522	2025/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	995	882	95,912	2026/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	770	711	77,285	2026/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,090	981	106,662	2026/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	420	378	41,152	2027/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	850	756	82,189	2027/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	420	403	43,805	2027/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	707	652	70,879	2028/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	540	609	66,287	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	364	337	36,651	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	2,198	1,869	203,175	2030/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,405	1,108	120,469	2030/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,676	1,425	154,950	2031/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,950	1,646	178,976	2031/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	790	694	75,463	2032/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	710	845	91,883	2033/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	340	390	42,401	2037/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	600	623	67,820	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	730	709	77,063	2045/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	750	637	69,276	2048/12/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千カナダドル	外貨建金額 千カナダドル	邦貨換算金額 千円	
(カナダ) 国債証券					
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	2,403	1,704	185,233	2051/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	996	652	70,898	2053/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	335	273	29,736	2064/12/1
小 計				3,078,358	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	12,100	11,767	87,707	2023/12/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	18,900	18,155	135,324	2024/9/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	16,700	16,606	123,773	2024/12/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	24,250	21,347	159,114	2026/3/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5	3,950	3,332	24,841	2027/3/4
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,600	18,803	140,155	2027/6/3
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	17,670	16,499	122,977	2029/5/31
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	21,200	18,603	138,657	2031/5/29
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,300	4,496	33,516	2034/11/23
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	3,900	3,909	29,141	2036/11/20
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	12,970	11,421	85,131	2038/11/18
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	13,200	10,638	79,293	2042/11/13
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	13,570	11,097	82,716	2047/11/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,100	1,702	12,693	2053/7/31
小 計				1,255,043	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BUNDES OBLIGATION	—	1,105	1,085	159,903	2023/10/13
BUNDES OBLIGATION	—	1,300	1,265	186,421	2024/4/5
BUNDES OBLIGATION	—	1,360	1,309	192,943	2024/10/18
BUNDES OBLIGATION	—	1,300	1,240	182,780	2025/4/11
BUNDES OBLIGATION	—	1,045	987	145,556	2025/10/10
BUNDES OBLIGATION	—	1,600	1,498	220,788	2026/4/10
BUNDES OBLIGATION	—	1,250	1,142	168,421	2027/4/16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	790	830	122,318	2024/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,230	1,228	180,987	2024/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,575	1,566	230,795	2024/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	1,790	1,762	259,720	2024/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	870	842	124,141	2025/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	1,740	1,696	250,032	2025/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,820	1,738	256,170	2026/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,900	1,766	260,300	2026/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,795	2,600	383,242	2027/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	910	1,086	160,143	2027/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,580	1,475	217,407	2027/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,150	1,040	153,345	2027/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	1,150	1,347	198,575	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,770	1,638	241,418	2028/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	970	1,106	163,039	2028/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,670	1,510	222,656	2028/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,080	957	141,165	2028/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,875	1,681	247,773	2029/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,830	1,595	235,072	2029/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	660	842	124,157	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,410	1,216	179,191	2030/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	外 貨 建 金 額 千ユーロ	評 価 額 邦貨換算金額 千円	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,920	1,638	241,403	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	420	358	52,835	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,110	1,392	205,210	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	2,120	1,788	263,560	2031/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,065	887	130,853	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	333	49,176	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,238	1,017	149,936	2032/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7	100	95	14,126	2032/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,475	1,856	273,639	2034/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,200	902	133,059	2035/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	734	108,219	2036/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,790	2,147	316,499	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,235	1,546	227,882	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,355	1,814	267,346	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	955	1,089	160,499	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,635	1,688	248,801	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	2,197	2,298	338,740	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	2,040	1,662	244,977	2048/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,330	733	108,120	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	640	354	52,190	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	750	397	58,644	2052/8/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	900	881	129,856	2023/12/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	830	809	119,278	2024/3/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	0.2	760	739	108,926	2024/6/14
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	920	920	135,627	2023/10/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,160	1,140	168,103	2023/10/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	9.0	860	915	134,900	2023/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,110	1,075	158,557	2024/1/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	250	242	35,686	2024/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,650	1,690	249,172	2024/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,360	1,309	192,909	2024/4/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,075	1,060	156,339	2024/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.75	1,180	1,161	171,137	2024/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	200	190	28,070	2024/8/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,250	1,272	187,447	2024/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,260	1,227	180,813	2024/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,080	1,072	158,021	2024/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	650	612	90,208	2024/12/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,485	1,401	206,594	2025/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,540	1,610	237,377	2025/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	855	821	121,065	2025/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,300	1,250	184,200	2025/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	967	142,538	2025/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,100	1,079	159,071	2025/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,085	1,048	154,448	2025/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	850	777	114,534	2026/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,330	1,384	203,955	2026/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,220	1,089	160,497	2026/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.6	1,330	1,254	184,827	2026/6/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	外 貨 建 金 額 千ユーロ	評 価 額 邦貨換算金額 千円	
(ユーロ…イタリア) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.1	1,220	1,168	172,213	2026/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	600	529	77,956	2026/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	7.25	720	828	122,071	2026/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,080	993	146,364	2026/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.85	1,180	1,062	156,571	2027/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.1	410	369	54,504	2027/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.2	1,160	1,097	161,771	2027/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.05	995	931	137,241	2027/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,275	1,127	166,149	2027/9/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.5	1,560	1,774	261,471	2027/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,530	1,410	207,834	2028/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.25	1,230	1,023	150,858	2028/3/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	1,330	1,110	163,576	2028/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,330	1,400	206,445	2028/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,415	1,344	198,082	2028/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.45	1,125	914	134,690	2029/2/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.0	1,655	1,572	231,734	2029/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,750	1,908	281,281	2029/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.5	1,465	1,430	210,752	2030/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.35	975	813	119,858	2030/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,167	930	137,058	2030/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,367	1,142	168,381	2030/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.9	1,375	1,064	156,817	2031/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.0	1,515	1,730	254,954	2031/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.6	1,245	923	136,087	2031/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,010	764	112,696	2031/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,610	1,300	191,616	2032/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	950	707	104,310	2032/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,475	1,650	243,213	2033/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,140	952	140,300	2033/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,580	1,673	246,665	2034/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.35	980	882	130,043	2035/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	644	94,988	2036/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.25	965	760	112,028	2036/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	2,005	1,940	285,882	2037/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	400	259	38,192	2037/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.95	1,200	1,001	147,633	2038/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,500	1,602	236,202	2039/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.1	610	513	75,618	2040/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,070	1,143	168,440	2040/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.8	830	560	82,576	2041/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,165	1,220	179,876	2044/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	440	264	38,918	2045/4/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.25	1,120	943	139,096	2046/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.7	970	740	109,081	2047/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.45	1,135	985	145,157	2048/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.85	850	782	115,350	2049/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	870	609	89,816	2050/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.7	850	501	73,865	2051/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.15	280	180	26,610	2052/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	630	441	65,099	2067/3/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BONI POLIENALI DEL TES	2.15	300	177	26,226	2072/3/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	4.25	2,620	2,676	394,436	2023/10/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,140	1,110	163,596	2024/2/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,390	2,323	342,462	2024/3/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,439	2,445	360,371	2024/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,758	2,736	403,218	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	135	128	18,907	2025/2/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,785	2,643	389,519	2025/3/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,610	2,500	368,512	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	2,090	2,317	341,538	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,070	1,997	294,345	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,673	246,536	2026/2/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	2,730	2,847	419,574	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,450	2,304	339,631	2026/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.25	3,010	2,775	409,044	2026/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,390	1,260	185,683	2027/2/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,275	2,147	316,523	2027/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	3,350	3,414	503,232	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,715	3,402	501,451	2028/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,030	2,754	405,891	2028/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	1,975	2,331	343,613	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,990	2,651	390,794	2029/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,580	2,177	320,897	2029/11/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	2,965	2,985	440,009	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	3,049	2,499	368,296	2030/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	3,290	3,048	449,274	2031/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,605	2,069	304,976	2031/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,178	1,698	250,269	2032/5/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	2,085	2,636	388,449	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	400	375	55,334	2032/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,425	2,044	301,242	2034/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	1,735	2,057	303,174	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,555	2,072	305,355	2036/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,590	1,776	261,756	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,060	1,733	255,417	2039/6/25
FRANCE (GOVT OF)	4.5	2,780	3,309	487,709	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	960	583	86,029	2044/6/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	1,730	1,779	262,278	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,830	1,490	219,605	2048/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	1,960	1,410	207,902	2050/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,500	852	125,597	2052/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	775	431	63,627	2053/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,300	1,547	228,054	2055/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,070	1,287	189,736	2060/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	825	595	87,744	2066/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	515	215	31,692	2072/5/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	880	859	126,683	2024/1/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	989	989	145,859	2024/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,035	986	145,380	2025/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	250	233	34,427	2026/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,140	1,075	158,501	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	898	820	120,968	2027/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	925	866	127,662	2027/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	775	898	132,454	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	961	884	130,405	2028/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	535	463	68,321	2029/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	645	563	83,106	2029/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	725	608	89,684	2030/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	690	564	83,224	2031/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	570	474	69,867	2032/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	855	854	125,968	2033/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	1,025	1,180	173,966	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	325	218	32,199	2038/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	888	626	92,363	2040/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	1,017	1,181	174,075	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,154	1,194	176,056	2047/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	777	390	57,581	2052/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	995	1,017	149,956	2023/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	1,105	1,140	168,119	2024/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,250	1,279	188,555	2024/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	966	142,368	2024/5/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	1,100	1,064	156,822	2024/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,520	1,536	226,431	2024/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,350	1,283	189,150	2025/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	1,350	1,327	195,619	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,490	1,584	233,445	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	1,455	1,448	213,493	2025/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,315	1,215	179,156	2026/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,055	1,038	153,035	2026/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	1,360	1,530	225,499	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,720	1,644	242,311	2026/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	225	201	29,679	2027/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,475	1,407	207,340	2027/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	1,315	1,208	178,027	2027/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,400	1,320	194,577	2027/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,010	875	128,975	2028/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,270	1,183	174,371	2028/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,275	1,183	174,372	2028/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,095	1,235	182,013	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	1,545	1,836	270,575	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,445	1,328	195,839	2029/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	1,140	977	144,072	2029/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,400	1,174	173,135	2030/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,330	1,238	182,494	2030/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	1,530	1,342	197,836	2030/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1	1,155	902	133,047	2031/4/30

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,045	833	122,848	2031/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7	1,340	1,071	157,830	2032/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	1,450	1,774	261,479	2032/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.55	645	606	89,372	2032/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,235	1,135	167,265	2033/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,195	1,005	148,175	2035/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	1,250	1,356	199,902	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.85	670	462	68,168	2037/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,045	1,239	182,602	2040/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	1,000	683	100,693	2040/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,300	1,510	222,543	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	300	193	28,474	2042/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	930	1,152	169,799	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,060	946	139,511	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	985	837	123,458	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	1,170	638	94,037	2050/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9	560	378	55,709	2052/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	848	798	117,732	2066/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	345	171	25,288	2071/10/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	0.2	495	486	71,709	2023/10/22
BELGIUM KINGDOM	2.6	845	852	125,687	2024/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.5	670	650	95,816	2024/10/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	1,265	1,224	180,375	2025/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.5	670	721	106,338	2026/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.0	977	937	138,149	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	830	775	114,331	2027/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	495	440	64,909	2027/10/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	1,070	1,242	183,028	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.8	965	884	130,369	2028/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.9	1,060	958	141,234	2029/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.1	800	666	98,273	2030/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	878	129,420	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	640	505	74,539	2031/10/22
BELGIUM KINGDOM	4.0	600	663	97,831	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.35	330	263	38,769	2032/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.25	695	602	88,829	2033/4/22
BELGIUM KINGDOM	3.0	543	547	80,668	2034/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.0	1,080	1,298	191,347	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.45	425	343	50,582	2037/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.9	485	413	61,001	2038/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.75	160	152	22,446	2039/4/22
BELGIUM KINGDOM	0.4	330	207	30,579	2040/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,142	1,307	192,610	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	455	495	73,048	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.6	658	486	71,722	2047/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.7	650	479	70,701	2050/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.4	485	323	47,640	2053/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.25	412	345	50,973	2057/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	486	396	58,395	2066/6/22

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	0.65	270	123	18,136	2071/6/22
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	750	749	110,391	2023/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	555	537	79,139	2024/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	705	700	103,251	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	400	379	55,883	2025/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	710	688	101,445	2025/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	550	597	88,022	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.0	140	138	20,384	2026/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	963	904	133,354	2026/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	685	627	92,486	2027/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	540	631	92,987	2027/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	660	602	88,719	2028/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	885	774	114,190	2029/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	680	557	82,121	2030/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	665	528	77,835	2031/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9	400	335	49,452	2032/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	515	486	71,684	2034/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	270	185	27,363	2036/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	840	941	138,722	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	345	201	29,647	2040/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	394	404	59,614	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	503	376	55,437	2047/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.85	170	136	20,090	2049/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	405	237	35,016	2051/3/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	190	223	32,911	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7	200	90	13,312	2071/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	173	105	15,579	2086/11/2
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	403	302	44,618	2117/9/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.85	192	85	12,574	2120/6/30
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	2.0	250	250	36,893	2024/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	255	245	36,230	2024/9/15
FINNISH GOVERNMENT	4.0	382	400	59,085	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.875	280	270	39,787	2025/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	435	410	60,424	2026/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	100	91	13,458	2026/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.375	120	114	16,860	2027/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	400	363	53,593	2027/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.75	380	382	56,416	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	270	238	35,190	2028/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	375	324	47,784	2029/9/15
FINNISH GOVERNMENT	—	172	139	20,540	2030/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.75	535	455	67,179	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	125	99	14,661	2031/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.5	65	57	8,478	2032/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.125	325	268	39,520	2034/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	278	191	28,146	2036/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.25	263	163	24,151	2040/9/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	2.625	277	261	38,495	2042/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	210	131	19,372	2043/4/15
FINNISH GOVERNMENT	1.375	260	194	28,650	2047/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	250	118	17,529	2052/4/15
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH TREASURY	3.4	460	468	69,051	2024/3/18
IRISH TREASURY	5.4	580	623	91,943	2025/3/13
IRISH TREASURY	1.0	655	630	92,931	2026/5/15
IRISH TREASURY	0.2	395	360	53,113	2027/5/15
IRISH TREASURY	0.9	520	480	70,863	2028/5/15
IRISH TREASURY	1.1	600	554	81,722	2029/5/15
IRISH TREASURY	2.4	546	545	80,338	2030/5/15
IRISH TREASURY	0.2	282	236	34,808	2030/10/18
IRISH TREASURY	1.35	475	437	64,454	2031/3/18
IRISH TREASURY	—	485	386	57,009	2031/10/18
IRISH TREASURY	0.35	205	164	24,213	2032/10/18
IRISH TREASURY	1.3	285	249	36,700	2033/5/15
IRISH TREASURY	0.4	310	232	34,212	2035/5/15
IRISH TREASURY	1.7	390	333	49,114	2037/5/15
IRISH TREASURY	0.55	250	162	23,893	2041/4/22
IRISH TREASURY	2.0	541	450	66,386	2045/2/18
IRISH TREASURY	1.5	464	331	48,879	2050/5/15
ユーロ計				50,837,708	
(イギリス) 国債証券					
UK TREASURY	0.125	1,230	1,182	200,450	2024/1/31
UK TREASURY	1.0	1,030	995	168,773	2024/4/22
UK TREASURY	2.75	875	865	146,754	2024/9/7
UK TREASURY	0.25	930	862	146,183	2025/1/31
UK TREASURY	5.0	1,205	1,245	211,083	2025/3/7
UK TREASURY	0.625	813	756	128,239	2025/6/7
UK TREASURY	0.125	710	635	107,679	2026/1/30
UK TREASURY	1.5	820	759	128,825	2026/7/22
UK TREASURY	0.375	710	623	105,675	2026/10/22
UK TREASURY	1.25	840	750	127,144	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	850	866	146,893	2027/12/7
UK TREASURY	0.125	745	617	104,596	2028/1/31
UK TREASURY	1.625	720	640	108,511	2028/10/22
UK TREASURY	6.0	710	793	134,586	2028/12/7
UK TREASURY	0.5	565	461	78,308	2029/1/31
UK TREASURY	0.875	856	707	119,976	2029/10/22
UK TREASURY	0.375	920	711	120,571	2030/10/22
UK TREASURY	4.75	1,005	1,084	183,778	2030/12/7
UK TREASURY	0.25	1,365	1,016	172,342	2031/7/31
UK TREASURY	1.0	305	240	40,742	2032/1/31
UK TREASURY	4.25	1,370	1,438	243,789	2032/6/7
UK TREASURY	0.875	370	276	46,790	2033/7/31
UK TREASURY	4.5	849	909	154,188	2034/9/7
UK TREASURY	0.625	1,007	684	116,012	2035/7/31
UK TREASURY	4.25	970	1,008	170,955	2036/3/7

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千イロポンド	千イロポンド	千円	
(イギリス) 国債証券					
UK TREASURY	1.75	1,350	1,019	172,874	2037/9/7
UK TREASURY	4.75	1,060	1,162	197,066	2038/12/7
UK TREASURY	4.25	970	1,003	170,183	2039/9/7
UK TREASURY	4.25	935	972	164,807	2040/12/7
UK TREASURY	1.25	820	531	90,088	2041/10/22
UK TREASURY	4.5	1,090	1,181	200,227	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	1,175	1,067	181,005	2044/1/22
UK TREASURY	3.5	1,160	1,094	185,496	2045/1/22
UK TREASURY	0.875	435	239	40,586	2046/1/31
UK TREASURY	4.25	920	977	165,643	2046/12/7
UK TREASURY	1.5	1,340	853	144,648	2047/7/22
UK TREASURY	1.75	675	453	76,871	2049/1/22
UK TREASURY	4.25	895	967	164,065	2049/12/7
UK TREASURY	0.625	660	311	52,842	2050/10/22
UK TREASURY	1.25	300	171	29,070	2051/7/31
UK TREASURY	3.75	872	882	149,580	2052/7/22
UK TREASURY	1.625	635	397	67,450	2054/10/22
UK TREASURY	4.25	962	1,079	182,964	2055/12/7
UK TREASURY	1.75	1,075	696	118,013	2057/7/22
UK TREASURY	4.0	751	823	139,590	2060/1/22
UK TREASURY	0.5	830	326	55,308	2061/10/22
UK TREASURY	3.5	830	849	143,968	2068/7/22
UK TREASURY	1.625	650	398	67,614	2071/10/22
UK TREASURY	1.125	473	232	39,454	2073/10/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	605	582	98,691	2025/9/7
UNITED KINGDOM GILT	2.5	882	703	119,281	2065/7/22
小 計				6,630,252	
(スウェーデン) 国債証券					
SWEDISH GOVERNMENT	1.5	5,900	5,856	79,010	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	4,420	4,429	59,754	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	4,700	4,452	60,070	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,550	3,260	43,990	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,780	3,402	45,893	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.125	2,600	2,180	29,421	2031/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	2.25	1,800	1,815	24,495	2032/6/1
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	2,985	3,548	47,863	2039/3/30
小 計				390,499	
(ノルウェー) 国債証券					
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	3,820	3,793	53,863	2024/3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	3,190	3,058	43,434	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	2,750	2,570	36,499	2026/2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,400	2,221	31,541	2027/2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	2,340	2,148	30,504	2028/4/26
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,250	1,993	28,305	2029/9/6
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	3,150	2,667	37,881	2030/8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.25	2,040	1,669	23,713	2031/9/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.125	1,900	1,670	23,720	2032/5/18
小 計				309,464	

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
	%	千円	千円	千円	
(デンマーク) 国債証券					
KINGDOM OF DENMARK	1.5	3,190	3,175	62,896	2023/11/15
KINGDOM OF DENMARK	—	1,260	1,205	23,879	2024/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,370	3,319	65,752	2025/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	4,310	3,926	77,785	2027/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,830	2,472	48,970	2029/11/15
KINGDOM OF DENMARK	—	1,150	915	18,130	2031/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	9,450	11,731	232,392	2039/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,300	692	13,717	2052/11/15
小 計				543,525	
(ポーランド) 国債証券					
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,650	1,590	49,176	2023/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,110	1,950	60,312	2024/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	—	310	270	8,350	2024/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	1,980	1,770	54,741	2024/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	0.75	1,440	1,206	37,313	2025/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,570	2,258	69,848	2025/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,590	2,117	65,483	2026/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	0.25	1,950	1,431	44,264	2026/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	460	383	11,849	2027/5/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,140	1,675	51,807	2027/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,160	1,663	51,448	2028/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	555	493	15,248	2029/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,665	1,929	59,682	2029/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.25	2,025	1,237	38,283	2030/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,300	772	23,904	2032/4/25
小 計				641,714	
(オーストラリア) 国債証券					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	755	748	70,777	2024/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,715	1,605	151,778	2024/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	994	93,972	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	950	859	81,218	2025/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	1,130	1,154	109,075	2026/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5	1,310	1,161	109,773	2026/9/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	1,170	1,221	115,435	2027/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	980	935	88,419	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	850	784	74,162	2028/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	720	678	64,101	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	930	897	84,790	2029/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	890	826	78,098	2029/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,300	1,176	111,218	2030/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,180	934	88,352	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	1,378	1,125	106,335	2031/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,790	1,378	130,312	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	1,580	1,230	116,305	2032/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,270	1,028	97,174	2032/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,035	1,072	101,330	2033/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	790	712	67,295	2033/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	530	453	42,898	2035/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	750	705	66,643	2037/4/21

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
	%	千円	千円	千円	
(オーストラリア) 国債証券					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	582	504	47,689	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	790	622	58,810	2041/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	720	565	53,440	2047/3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,020	579	54,783	2051/6/21
小 計				2,264,192	
(シンガポール) 国債証券					
SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	560	551	57,670	2024/2/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	540	538	56,242	2024/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	470	460	48,093	2025/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	0.5	229	210	22,020	2025/11/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	470	450	47,125	2026/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	205	188	19,730	2026/11/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	533	535	55,910	2027/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	290	277	29,014	2028/5/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	450	432	45,238	2029/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	540	516	53,924	2030/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	300	257	26,935	2031/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	120	111	11,633	2032/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	355	351	36,745	2033/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	501	437	45,725	2036/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	220	193	20,208	2039/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	287	266	27,894	2042/4/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	332	310	32,438	2046/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	367	282	29,473	2050/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	150	115	12,068	2051/10/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	140	137	14,392	2072/8/1
小 計				692,485	
(マレーシア) 国債証券					
MALAYSIA GOVERNMENT	3.478	775	773	24,239	2024/6/14
MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	830	836	26,208	2024/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	530	529	16,587	2025/3/14
MALAYSIA GOVERNMENT	3.955	1,550	1,549	48,542	2025/9/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.906	780	774	24,251	2026/7/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.9	1,070	1,058	33,174	2026/11/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	920	905	28,359	2027/11/16
MALAYSIA GOVERNMENT	3.885	1,320	1,274	39,925	2029/8/15
MALAYSIA GOVERNMENT	2.632	985	852	26,691	2031/4/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	700	694	21,768	2033/11/7
MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	1,100	1,009	31,634	2034/7/5
MALAYSIA GOVERNMENT	4.254	960	912	28,570	2035/5/31
MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	1,170	1,177	36,890	2037/4/7
MALAYSIA GOVERNMENT	4.893	590	592	18,554	2038/6/8
MALAYSIA GOVERNMENT	3.757	1,490	1,285	40,282	2040/5/22
MALAYSIA GOVERNMENT	4.696	200	194	6,099	2042/10/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	660	658	20,626	2043/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	4.736	750	723	22,661	2046/3/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.921	510	501	15,715	2048/7/6
MALAYSIA GOVERNMENT	4.065	1,560	1,340	42,004	2050/6/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.181	800	807	25,290	2024/7/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 権 換 算 金 額	
(マレーシア) 国債証券	%	千リンギット	千リンギット	千円	
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	750	763	23,909	2026/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	330	326	10,214	2027/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	950	920	28,838	2027/5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,620	1,566	49,059	2028/6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	910	906	28,409	2030/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	1,035	1,004	31,462	2031/6/30
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	980	912	28,571	2033/4/15
小 計				778,544	
(中国) 国債証券		千中国人民元	千中国人民元		
CHINA GOVERNMENT BOND	3.29	7,000	7,109	144,945	2023/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND	2.88	12,000	12,131	247,319	2023/11/5
CHINA GOVERNMENT BOND	3.19	14,000	14,277	291,069	2024/4/11
CHINA GOVERNMENT BOND	2.47	11,000	11,082	225,937	2024/9/2
CHINA GOVERNMENT BOND	2.94	8,000	8,141	165,975	2024/10/17
CHINA GOVERNMENT BOND	1.99	13,000	12,928	263,572	2025/4/9
CHINA GOVERNMENT BOND	2.18	7,000	6,983	142,379	2025/8/25
CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	9,000	9,203	187,633	2025/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND	3.03	12,000	12,284	250,433	2026/3/11
CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	12,000	12,124	247,181	2026/8/12
CHINA GOVERNMENT BOND	3.12	8,000	8,222	167,641	2026/12/5
CHINA GOVERNMENT BOND	2.85	19,000	19,301	393,495	2027/6/4
CHINA GOVERNMENT BOND	3.28	5,000	5,195	105,919	2027/12/3
CHINA GOVERNMENT BOND	3.01	12,000	12,280	250,355	2028/5/13
CHINA GOVERNMENT BOND	2.91	8,000	8,130	165,764	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND	3.29	14,000	14,607	297,792	2029/5/23
CHINA GOVERNMENT BOND	2.68	11,000	10,949	223,236	2030/5/21
CHINA GOVERNMENT BOND	3.27	8,000	8,326	169,748	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	5,000	5,098	103,937	2031/5/27

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 権 換 算 金 額	
(中国) 国債証券	%	千中国人民元	千中国人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	8,000	7,986	162,825	2032/2/17
CHINA GOVERNMENT BOND	2.76	6,000	6,014	122,627	2032/5/15
CHINA GOVERNMENT BOND	3.81	6,000	6,701	136,621	2050/9/14
CHINA GOVERNMENT BOND	3.72	6,000	6,616	134,890	2051/4/12
CHINA GOVERNMENT BOND	3.53	7,000	7,484	152,576	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	7,000	7,239	147,587	2052/4/15
小 計				4,901,467	
(イスラエル) 国債証券		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
ISRAEL FIXED BOND	1.5	760	748	31,513	2023/11/30
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,420	1,431	60,274	2024/3/31
ISRAEL FIXED BOND	0.4	280	265	11,154	2024/10/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	1,360	1,273	53,607	2025/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.75	1,240	1,191	50,148	2025/8/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	530	484	20,406	2026/2/27
ISRAEL FIXED BOND	6.25	950	1,056	44,468	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND	2.0	1,270	1,205	50,735	2027/3/31
ISRAEL FIXED BOND	2.25	1,040	982	41,342	2028/9/28
ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,515	1,288	54,244	2030/3/31
ISRAEL FIXED BOND	1.3	150	125	5,288	2032/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,050	810	34,111	2037/5/31
ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,160	1,470	61,901	2042/1/31
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,300	1,305	54,970	2047/3/31
小 計				574,169	
合 計				150,981,343	

(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

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 150,981,343	% 99.1
コール・ローン等、その他	1,399,855	0.9
投資信託財産総額	152,381,198	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（152,311,600千円）の投資信託財産総額（152,381,198千円）に対する比率は100.0%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。1アメリカドル=148.23円、1カナダドル=108.69円、1メキシコペソ=7.4535円、1ユーロ=147.36円、1イギリスポンド=169.52円、1スウェーデンクローナ=13.49円、1ノルウェークローネ=14.20円、1デンマーククローネ=19.81円、1ポーランドズロチ=30.9265円、1オーストラリアドル=94.51円、1シンガポールドル=104.50円、1マレーシアリンギット=31.3271円、1中国人民元=20.3869円、1イスラエルシェケル=42.0932円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	152,435,276,404	
コール・ローン等	187,557,731	
公社債(評価額)	150,981,343,458	
未収入金	128,093,818	
未収利息	1,091,775,551	
前払費用	46,505,846	
(B) 負債	161,140,093	
未払金	54,150,439	
未払解約金	106,989,541	
未払利息	113	
(C) 純資産総額(A-B)	152,274,136,311	
元本	57,575,300,165	
次期繰越損益金	94,698,836,146	
(D) 受益権総口数	57,575,300,165口	
1万円当たり基準価額(C/D)	26,448円	

(注) 当ファンドの期首元本額は61,672,878,643円、期中追加設定元本額は3,281,227,327円、期中一部解約元本額は7,378,805,805円です。

(注) 2022年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	16,979,582,310円
・インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	16,794,261,878円
・日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	13,154,930,712円
・インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	3,607,947,517円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,355,333,711円
・財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	835,698,012円
・DCインデックスバランス(株式60)	682,975,875円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	588,340,485円
・DCインデックスバランス(株式80)	560,018,801円
・DCインデックスバランス(株式40)	515,032,949円
・DCインデックスバランス(株式20)	389,007,488円
・海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	302,327,311円
・財産3分法(適格機関投資家専用)	203,841,699円
・世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	173,659,188円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	144,328,916円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	84,495,854円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	82,606,618円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式30)	62,113,777円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	58,797,064円

(注) 1口当たり純資産額は2,6448円です。

○損益の状況（2021年10月27日～2022年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,378,114,420	
受取利息	3,378,307,036	
その他収益金	147,788	
支払利息	△ 340,404	
(B) 有価証券売買損益	177,994,410	
売買益	31,355,023,154	
売買損	△31,177,028,744	
(C) 保管費用等	△ 25,212,768	
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,530,896,062	
(E) 前期繰越損益金	97,543,427,122	
(F) 追加信託差損益金	5,208,060,902	
(G) 解約差損益金	△11,583,547,940	
(H) 計(D+E+F+G)	94,698,836,146	
次期繰越損益金(H)	94,698,836,146	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2022年10月26日）
（2021年10月27日～2022年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1999年10月29日から原則無期限です。
運用方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「東証株価指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主としてわが国の株式に投資し、「東証株価指数」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

【運用報告書の表記について】

・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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
19期(2018年10月26日)	14,423	△7.0	1,596.01	△9.0	98.9	1.1	27,865
20期(2019年10月28日)	15,279	5.9	1,648.43	3.3	98.9	1.1	32,975
21期(2020年10月26日)	15,382	0.7	1,618.98	△1.8	98.9	1.1	33,867
22期(2021年10月26日)	19,593	27.4	2,018.40	24.7	98.2	1.8	41,752
23期(2022年10月26日)	19,126	△2.4	1,918.21	△5.0	98.6	1.3	43,751

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○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 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2021年10月26日	19,593	—	2,018.40	—	98.2	1.8
10月末	19,427	△0.8	2,001.18	△0.9	98.6	1.5
11月末	18,722	△4.4	1,928.35	△4.5	98.4	1.7
12月末	19,375	△1.1	1,992.33	△1.3	99.5	0.6
2022年1月末	18,439	△5.9	1,895.93	△6.1	99.3	0.8
2月末	18,359	△6.3	1,886.93	△6.5	99.6	0.5
3月末	19,149	△2.3	1,946.40	△3.6	98.6	1.4
4月末	18,690	△4.6	1,899.62	△5.9	98.1	1.9
5月末	18,834	△3.9	1,912.67	△5.2	98.4	1.6
6月末	18,448	△5.8	1,870.82	△7.3	99.2	0.8
7月末	19,136	△2.3	1,940.31	△3.9	99.7	0.4
8月末	19,367	△1.2	1,963.16	△2.7	99.2	0.8
9月末	18,305	△6.6	1,835.94	△9.0	98.4	1.6
(期末)						
2022年10月26日	19,126	△2.4	1,918.21	△5.0	98.6	1.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2021年10月27日～2022年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め19,593円の基準価額は、期間末に19,126円となり、騰落率は△2.4%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

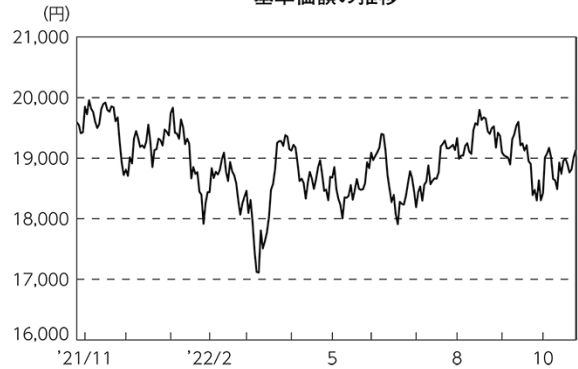
<値上がり要因>

- ・円安／アメリカドル高基調を受けて輸出企業の業績改善が見込まれたこと。
- ・政府が新型コロナウイルスの水際対策で止めていた外国人観光客の受け入れを再開すると表明し、経済活動の正常化が期待されたこと。
- ・参議院議員選挙において与党の自民党が単独で改選議席の過半数を確保し、安定的な政策運営が期待されたこと。

<値下がり要因>

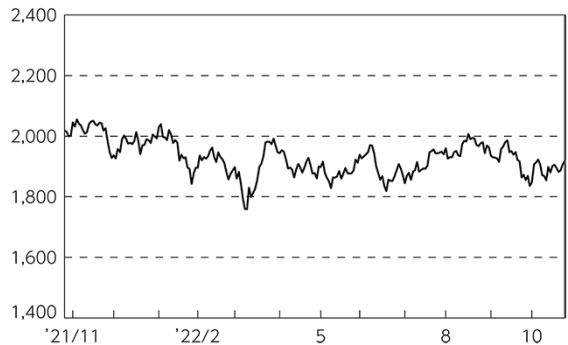
- ・南アフリカにおいて確認された新型コロナウイルスの新たな変異株の感染拡大が懸念されたこと。
- ・ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が継続し、供給混乱を受けたインフレ懸念の高まりから世界景気の悪化が警戒されたこと。
- ・インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行による金融引き締め動きが相ついでいることを受けて世界経済の減速への警戒感が高まったこと。

基準価額の推移



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2021/10/26	2021/11/04	2022/03/09	2022/10/26
19,593円	19,957円	17,113円	19,126円

東証株価指数の推移



(株式市況)

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて下落しました。

円安／アメリカドル高基調を受けて輸出企業の業績改善が見込まれたことや、政府が新型コロナウイルスの水際対策で止めていた外国人観光客の受け入れを再開すると表明し経済活動の正常化が期待されたこと、参議院議員選挙において与党の自民党が単独で改選議席の過半数を確保し、安定的な政策運営が期待されたことなどが株価の支援材料となったものの、南アフリカにおいて確認された新型コロナウイルスの新たな変異株の感染拡大が懸念されたことや、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻が継続し、供給混乱を受けたインフレ懸念の高まりから世界景気の悪化が警戒されたこと、インフレ抑制のため欧米の主要中央銀行による金融引き締め動きが相ついでることを受けて世界経済の減速への警戒感が高まったことなどが株価の重しとなり、TOPIXは下落しました。

ポートフォリオ

TOPIXに連動する投資成果を目標とし、「バール日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、2.4%の値下がりとなり、ベンチマークである「東証株価指数」の下落率5.0%を概ね2.6%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

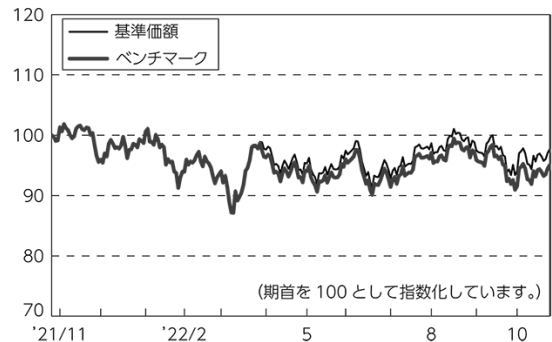
<プラス要因>

- ・株式配当金を受け取ったこと。

<マイナス要因>

- ・売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、TOPIXとの連動をめざし、原則として「バール日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を継続します。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○1万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10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 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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、18,854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

(2021年10月27日～2022年10月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 3,181 (284)	千円 7,590,972 (-)	千株 1,518	千円 3,461,721

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

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 4,883	百万円 5,062	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2021年10月27日～2022年10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	11,052,693千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	41,450,912千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26

(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

(2021年10月27日～2022年10月26日)

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 11	百万円 6	百万円 125

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井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	0.7	0.8	2,904
日本水産	18.7	22.1	11,889
マルハニチロ	3.1	3.2	7,507
雪国まいたけ	1.6	1.7	1,798
カネコ種苗	0.6	0.7	996
サカタのタネ	2.4	2.6	12,363
ホクト	1.7	1.8	3,423
ホクリヨウ	0.3	0.3	190
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	3.4	4.5	967
日鉄鉱業	0.5	0.9	2,673
三井松島ホールディングス	0.8	1	3,145
INPEX	80.7	75.8	112,942
石油資源開発	2.6	2.8	10,906
K&Oエナジーグループ	0.9	0.9	1,827
建設業 (2.0%)			
ヒノキヤグループ	0.5	—	—
ショーボンドホールディングス	2.9	2.8	17,808
ミライト・ワン	7	7.7	11,134
サンヨーホームズ	0.3	0.4	284
日本アクア	0.9	1	706
ファーストコーポレーション	0.7	0.7	502
ベステラ	0.4	0.6	563
キャンディル	0.5	0.5	253
スペースバリューホールディングス	2.5	—	—
ダイセキ環境ソリューション	0.4	0.5	407
第一カッター興業	0.6	0.6	729
安藤・間	13	10.9	9,319
東急建設	5.9	6.5	4,088
コムシスホールディングス	7.1	7.7	18,880
ピーアールホールディングス	2.8	3.1	1,063
高松コンストラクショングループ	1.3	1.6	3,104
東建コーポレーション	0.6	0.7	5,530
ソネック	0.3	0.3	286
ヤマウラ	1	1.1	1,071
オリエンタル白石	7.1	8.3	2,216

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大成建設	14.5	15.4	61,754
大林組	46.5	51.3	48,888
清水建設	43.6	47.5	35,150
飛島建設	1.4	1.6	1,697
長谷工コーポレーション	15.2	14.8	22,747
松井建設	1.9	1.9	1,069
銭高組	0.2	0.2	552
鹿島建設	34.1	37.6	52,376
不動テトラ	1.2	1.2	1,794
大末建設	0.7	0.6	730
鉄建建設	1	1.1	1,963
西松建設	3.3	3.4	12,733
三井住友建設	11.3	12.5	5,500
大豊建設	1	0.8	3,348
ナカノフドー建設	1.3	1.5	460
奥村組	2.6	2.8	7,954
東鉄工業	2	2.2	5,390
イチケン	0.4	0.4	722
富士ビー・エス	0.7	0.9	396
浅沼組	0.6	1.3	3,590
戸田建設	19.3	21.2	16,006
熊谷組	2.2	2.8	7,075
北野建設	0.3	0.4	962
植木組	0.5	0.5	646
矢作建設工業	2.1	2.3	1,734
ビーエス三菱	1.6	1.9	1,166
日本ハウスホールディングス	3.3	3	1,353
大東建託	5.1	—	—
新日本建設	2.1	2.5	1,857
NIPPO	3.9	—	—
東亜道路工業	0.3	0.3	1,803
日本道路	0.5	0.5	3,055
東亜建設工業	1.3	1.3	3,159
日本国土開発	4.6	4.4	2,525
若築建設	0.9	0.9	2,211
東洋建設	5.3	6.2	5,642
五洋建設	19.8	20.4	14,953

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
福田組	0.5	0.6	2,913
住友林業	11.9	11	25,465
日本基礎技術	1.5	1.5	637
巴コーポレーション	2.2	2.1	758
大和ハウス工業	42.9	43.7	132,629
ライト工業	2.7	3.1	6,289
積水ハウス	50.4	52.4	129,847
日特建設	1.3	1.2	1,059
北陸電気工事	0.9	1.1	765
ユアテック	2.8	3.3	2,359
日本リーテック	1	1.1	867
四電工	0.6	0.6	1,104
中電工	2.2	2.2	4,604
関電工	7.6	9.1	7,571
きんでん	9.5	11.2	16,856
東京エネシス	1.6	1.7	1,611
トーエネック	0.5	0.6	2,112
住友電設	1.3	1.4	3,620
日本電設工業	2.6	2.4	4,065
エクシオグループ	7.1	7.7	16,947
新日本空調	1.3	1.2	2,232
九電工	3.3	3.5	10,136
三機工業	3.3	3.5	5,670
日揮ホールディングス	15.5	15.6	27,877
中外炉工業	0.5	0.5	819
ヤマト	1.6	1.4	985
太平電業	1	1	3,280
高砂熱学工業	4.2	4.3	7,933
三見金属工業	0.2	0.3	789
朝日工業社	0.4	0.7	1,411
明星工業	3.1	2.9	2,061
大気社	2.3	2.3	8,268
ダイダン	1.1	1.1	2,362
日比谷総合設備	1.5	1.5	2,854
フィル・カンパニー	0.3	0.3	305
テスホールディングス	0.9	1.6	1,588
インフロニア・ホールディングス	18.3	19.3	19,743
東洋エンジニアリング	2	2.4	1,406
レイズネクスト	2.5	2.4	2,990
食料品 (3.4%)			
ニッポン	4.4	4.3	6,738

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清製粉グループ本社	16.8	16.6	26,709
日東富士製粉	0.2	0.3	1,339
昭和産業	1.3	1.4	3,526
鳥越製粉	1.3	1.3	809
中部飼料	1.8	1.8	1,861
フィード・ワン	2	2.1	1,442
東洋精糖	0.2	0.3	259
日本甜菜製糖	0.8	0.9	1,480
DM三井製糖ホールディングス	1.2	1.4	2,633
塩水港精糖	1.8	2.2	440
日新製糖	0.7	0.8	1,359
森永製菓	3.5	3.6	13,968
中村屋	0.4	0.4	1,244
江崎グリコ	4.1	4.1	13,940
名糖産業	0.7	0.6	977
井村屋グループ	0.9	0.9	2,006
不二家	0.8	1	2,550
山崎製パン	11.2	9.6	14,265
第一屋製パン	0.3	0.3	120
モロゾフ	0.2	0.5	1,887
亀田製菓	0.9	0.9	4,113
寿スピリッツ	1.4	1.5	11,235
カルビー	6.8	8	24,240
森永乳業	2.8	2.9	12,412
六甲バター	1.1	1.1	1,535
ヤクルト本社	10.2	11.2	92,288
明治ホールディングス	9.8	9.7	59,849
雪印メグミルク	3.6	3.9	6,396
プリマハム	2.1	2.2	4,459
日本ハム	5.7	6.2	22,444
林兼産業	0.5	0.6	268
丸大食品	1.5	1.6	2,244
S F o o d s	1.3	1.6	4,283
柿安本店	0.5	0.6	1,349
伊藤ハム米久ホールディングス	9.6	11.3	7,571
サッポロホールディングス	5.1	4.7	15,392
アサヒグループホールディングス	35	33.3	144,155
キリンホールディングス	54.6	65	142,545
宝ホールディングス	11	9.8	10,339
オエノンホールディングス	4.3	4.3	1,221
養命酒製造	0.5	0.5	909

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	10.4	11.3	15,198
サントリー食品インターナショナル	10	10.1	51,207
ダイドーグループホールディングス	0.8	0.9	4,140
伊藤園	4.5	5.4	27,918
キーコーヒー	1.5	1.6	3,304
ユニカフェ	0.5	0.5	467
ジャパンフーズ	0.2	0.3	319
日清オイリオグループ	1.9	2	6,430
不二製油グループ本社	3.6	3.8	8,873
J-オイルミルズ	1.4	1.7	2,669
キッコーマン	10.7	10.6	86,602
味の素	35.3	35.2	143,228
ブルドックソース	0.7	0.6	1,042
キュービー	8.3	7.7	18,310
ハウス食品グループ本社	5.6	5.5	15,372
カゴメ	5.6	6.7	19,945
焼津水産化学工業	0.8	0.8	653
アリアケジャパン	1.4	1.6	8,224
ピエトロ	0.2	0.2	358
エバラ食品工業	0.3	0.4	1,278
やまみ	0.2	0.2	266
ニチレイ	7.1	6.6	15,107
東洋水産	7.7	7.9	46,294
イートアンドホールディングス	0.5	0.7	1,526
大冷	0.2	0.2	374
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.9	0.9	418
日清食品ホールディングス	5.8	5.7	55,347
永谷園ホールディングス	0.7	0.8	1,620
一正蒲鉾	0.6	0.8	594
フジッコ	1.6	1.7	3,245
ロック・フィールド	1.6	1.8	2,593
日本たばこ産業	79.7	94.7	232,725
ケンコーマヨネーズ	0.9	0.9	1,508
わらべや日洋ホールディングス	1	1.1	1,974
なとり	0.8	1	2,071
イフジ産業	0.2	0.3	275
ピックスコーポレーション	0.7	—	—
ファーマフーズ	1.4	2.2	2,794
ユージュレナ	7.6	9.3	8,165
紀文食品	0.9	1.4	1,236
ピックスホールディングス	—	0.8	808

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミヨシ油脂	0.6	0.6	598
理研ビタミン	1.4	1.3	2,414
繊維製品 (0.5%)			
片倉工業	1.6	1.4	2,898
グンゼ	1.1	1	3,805
東洋紡	5.7	6.9	7,148
ユニチカ	4.3	4.7	1,273
富士紡ホールディングス	0.7	0.7	2,380
倉敷紡績	1.2	1.2	2,556
シキボウ	0.9	0.9	763
日本毛織	4.4	4.2	4,170
ダイトウボウ	2.3	3.1	266
トーア紡コーポレーション	0.5	0.7	247
ダイドーリミテッド	1.9	2.5	415
帝国繊維	1.6	1.6	2,572
帝人	13.7	15.1	20,626
東レ	105.1	106.9	77,919
住江織物	0.3	0.3	530
日本フェルト	0.8	1	404
イチカワ	0.2	0.2	265
日東製網	0.1	0.2	267
アツギ	1.2	1.2	451
ダイニック	0.6	0.6	356
セーレン	3.6	3.2	7,625
ソトー	0.6	0.6	486
東海染工	0.2	0.2	227
小松マテール	2.4	2.6	2,012
ワコールホールディングス	3.6	3.5	8,424
ホギメディカル	1.9	2.2	7,249
クラウディアホールディングス	0.3	0.4	118
T S Iホールディングス	4.5	5.2	2,366
マツオカコーポレーション	0.5	0.5	467
ワールド	1.9	2.3	3,176
三陽商会	0.8	0.7	802
ナイガイ	0.5	0.7	184
オンワードホールディングス	8.7	9.5	2,954
ルックホールディングス	0.4	0.5	1,009
ゴールドウイン	2.4	2.9	22,649
デサント	2.5	2.9	10,933
キング	0.8	0.8	374
ヤマトインターナショナル	1.3	1.3	314

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	0.9	0.9	2,624
王子ホールディングス	65.3	66.4	34,793
日本製紙	6.4	7	6,139
三菱製紙	2.1	2.3	644
北越コーポレーション	10.4	10.3	8,116
中越パルプ工業	0.6	0.7	659
巴川製紙所	0.5	0.5	392
大王製紙	7	7.4	8,288
阿波製紙	0.4	0.4	119
レンゴー	14.9	13.3	11,105
トーモク	0.9	0.8	1,152
ザ・バック	1.1	1.1	2,625
化学 (6.0%)			
北の達人コーポレーション	5.2	6.3	1,808
クラレ	21.2	23.3	23,905
旭化成	96.1	106.7	102,762
共和レザー	0.8	1	525
昭和電工	12.6	14.1	30,611
住友化学	114.2	117.6	59,976
住友精化	0.7	0.7	2,103
日産化学	8	7.7	52,206
ラサ工業	0.5	0.6	1,306
クレハ	1.2	1.3	12,181
多木化学	0.6	0.6	3,126
テイカ	1.1	1	1,291
石原産業	2.6	3.1	3,208
片倉コープアグリ	0.4	0.4	480
日本曹達	2	1.9	8,673
東ソー	22.4	21.3	35,102
トクヤマ	4.3	5.1	8,965
セントラル硝子	2.8	2.6	8,710
東亜合成	8.3	7.5	8,647
大阪ソーダ	1.5	1.3	4,790
関東電化工業	3.5	3.2	2,969
デンカ	5.3	5.8	19,865
信越化学工業	26.8	27.3	421,921
日本カーバイド工業	0.6	0.6	753
堺化学工業	1	1.1	2,154
第一稀元素化学工業	1.5	1.5	1,936
エア・ウォーター	14.8	13.8	22,880

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本酸素ホールディングス	12	14.2	33,597
日本化学工業	0.4	0.5	935
東邦アセチレン	0.2	0.4	432
日本パーカラライジング	7.3	7.3	7,000
高压ガス工業	2.3	2.5	1,570
四国化成工業	1.9	2	2,554
戸田工業	0.3	0.4	1,166
ステラ ケミファ	0.8	0.9	2,403
保土谷化学工業	0.4	0.5	1,457
日本触媒	2.6	2.4	12,624
大日精化工業	1.2	1.2	2,113
カネカ	3.8	3.7	13,745
三菱瓦斯化学	14.5	13.4	25,527
三井化学	12.5	13.4	37,439
J S R	14.6	14.8	41,943
東京応化工業	2.5	2.6	16,250
大阪有機化学工業	1.2	1.1	2,168
三菱ケミカルグループ	96.9	107	72,225
KHネオケム	2.4	2.5	6,767
ダイセル	19.5	23.2	19,650
住友ペークライト	2.3	2.4	9,624
積水化学工業	30.4	32.9	59,154
日本ゼオン	13.1	12.5	16,575
アイカ工業	4	4.1	13,058
UBE	7.3	8.1	15,770
積水樹脂	2.2	2.4	4,089
タキロンシーアイ	3.2	3.8	1,983
旭有機材	0.8	1	2,358
ニチバン	0.8	0.9	1,512
リケンテクノス	3.5	3.5	1,802
大倉工業	0.8	0.7	1,301
積水化成成品工業	1.9	2.1	800
群栄化学工業	0.3	0.3	719
タイガースポリマー	0.8	0.9	359
ミライアル	0.5	0.6	936
ダイキアクシス	0.6	0.6	407
ダイキョーニシカワ	3.1	3.7	2,227
竹本容器	0.5	0.6	443
森六ホールディングス	0.8	0.8	1,380
恵和	0.4	0.5	1,807
日本化薬	9	12.1	14,217

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カーリットホールディングス	1.5	1.4	954
日本精化	1.1	1.1	2,255
扶桑化学工業	1.1	1.4	4,634
トリケミカル研究所	1.3	1.8	3,862
ADEKA	6.7	6.8	15,082
日油	5.5	5	25,950
新日本理化	2.5	2.5	702
ハリマ化成グループ	1.1	1.1	982
花王	32.8	36.4	204,531
第一工業製薬	0.5	0.6	1,159
石原ケミカル	0.8	0.8	1,011
日華化学	0.5	0.7	604
ニイタカ	0.3	0.3	620
三洋化成工業	0.9	1	4,215
有機合成薬品工業	1.2	1.2	379
大日本塗料	1.7	2	1,452
日本ペイントホールディングス	54.5	64.7	61,788
関西ペイント	16.3	14.9	29,740
神東塗料	1.3	1.5	216
中国塗料	3.1	3.8	3,515
日本特殊塗料	1.1	1	860
藤倉化成	2	2.1	846
太陽ホールディングス	2.2	2.6	6,630
D I C	6.1	5.7	14,113
サカタインクス	2.9	3.3	3,471
東洋インキS Cホールディングス	3.1	2.9	5,539
T & K TOKA	1	1.4	1,339
富士フイルムホールディングス	26	30.9	213,549
資生堂	27.6	30.6	157,345
ライオン	17.9	17.6	26,681
高砂香料工業	0.9	1	2,844
マンダム	3.1	3.4	5,015
ミルボン	1.8	2.2	13,090
ファンケル	5.4	7.1	19,922
コーセー	2.8	3	42,870
コタ	1	1.2	1,881
ポーラ・オルビスホールディングス	6.3	7.5	12,390
ノエビアホールディングス	1.3	1.3	7,098
アジュバンホールディングス	0.3	0.4	366
新日本製薬	0.4	0.8	1,214
エステー	1	1.1	1,667

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アグロ カネショウ	0.5	0.6	781
コニシ	2.4	2.7	4,673
長谷川香料	2.6	3	9,480
星光PMC	0.9	0.9	471
小林製薬	4.2	4.5	35,505
荒川化学工業	1.2	1.2	1,207
メック	1.1	1.2	2,886
日本高純度化学	0.4	0.4	990
タカラバイオ	3.9	4.6	8,142
J C U	1.7	1.8	5,041
新田ゼラチン	1	1	994
O A Tアグリオ	0.3	0.7	1,204
デクセリアルズ	4.1	4.6	15,341
アース製薬	1.2	1.3	6,682
北興化学工業	1.4	1.5	1,440
大成ラミック	0.5	0.5	1,507
クミアイ化学工業	5.5	5.8	5,684
日本農薬	2.7	3.2	2,934
アキレス	1	1.1	1,498
有沢製作所	2.1	2.4	3,000
日東電工	9	10.6	85,542
レック	1.8	2.1	1,780
三光合成	1.6	2	914
きもと	2.3	2.8	663
藤森工業	1.3	1.4	4,333
前澤化成工業	0.9	1	1,343
未来工業	0.5	0.6	885
ウェーブロックホールディングス	0.6	0.7	410
J S P	0.9	1	1,466
エフビコ	2.7	3.2	11,568
天馬	1.1	1.4	2,916
信越ポリマー	2.3	3.2	4,265
東リ	3.8	4	824
ニフコ	5.4	5.9	18,880
バルカー	1.2	1.4	3,683
ユニ・チャーム	28.5	30.5	139,141
ショーエイコーポレーション	0.3	0.5	289
医薬品 (5.8%)			
協和キリン	17.4	17.7	61,153
武田薬品工業	123.3	138.4	529,380
アステラス製薬	128.4	150.6	307,600

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友ファーマ	11	10.9	11,325
塩野義製薬	18.6	20.5	141,798
わかもと製薬	1.8	1.9	435
日本新薬	4.2	3.8	28,918
中外製薬	46.3	45.9	159,043
科研製薬	2.5	2.5	9,462
エーザイ	16.4	19.5	169,494
ロート製薬	7.1	8.4	38,640
小野薬品工業	34	34	118,558
久光製薬	4.3	3.7	13,634
持田製薬	2.1	2	6,850
参天製薬	25.8	30.7	30,976
扶桑薬品工業	0.5	0.6	1,202
日本ケミファ	0.2	0.2	347
ツムラ	5	5.1	16,065
日医工	4.2	—	—
キッセイ薬品工業	2.6	2.6	6,825
生化学工業	2.6	3.2	2,886
栄研化学	2.6	2.7	4,968
日水製薬	0.5	—	—
鳥居薬品	0.8	0.8	2,400
JCRファーマ	4.2	5	10,235
東和薬品	2.1	2.6	5,813
富士製薬工業	0.9	1	1,044
ゼリア新薬工業	2.7	2.6	5,662
第一三共	116.4	127.7	579,885
キョーリン製薬ホールディングス	3.3	3.2	5,772
大幸薬品	2.2	2.8	1,523
ダイト	1	1.1	2,758
大塚ホールディングス	30.8	33.6	157,416
大正製薬ホールディングス	3.7	3.3	17,358
ベプチドリーム	7.8	7.1	11,565
あすか製薬ホールディングス	1.7	1.7	1,961
サワイグループホールディングス	3.2	3.4	14,314
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	12.5	15.1	1,298
ニチレキ	1.7	1.9	2,527
ユシロ化学工業	0.8	0.8	678
ビービー・カストロール	0.6	0.6	592
富士石油	3.7	3.9	1,201
MORESCO	0.5	0.6	626

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
出光興産	16.4	17.9	58,443
ENEOSホールディングス	222.7	264.9	129,880
コスモエネルギーホールディングス	4.7	7	26,740
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	8.6	8.3	19,347
TOYO TIRE	7.8	8.4	14,355
ブリヂストン	42.7	46.8	245,793
住友ゴム工業	13.3	14.4	18,028
藤倉コンポジット	1.4	1.4	1,201
オカモト	0.9	0.8	2,908
フコク	0.7	0.8	808
ニッタ	1.5	1.6	4,624
住友理工	2.8	3.4	1,948
三ツ星ベルト	1.8	2.2	6,721
バンドー化学	2.6	2.8	2,954
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	2.2	2.2	4,835
AGC	13.6	14.9	68,912
日本板硝子	7.5	8	4,312
石塚硝子	0.3	0.3	454
日本山村硝子	0.6	0.6	354
日本電気硝子	5.9	6	15,306
オハラ	0.6	0.7	858
住友大阪セメント	2.7	2.6	8,450
太平洋セメント	8.4	10	20,370
日本ヒューム	1.3	1.5	963
日本コンクリート工業	3.2	3.2	803
三谷セキサン	0.7	0.7	2,618
アジアパイルホールディングス	2.3	2.5	1,272
東海カーボン	12.4	12.3	11,894
日本カーボン	0.8	0.9	3,735
東洋炭素	1	0.9	3,217
ノリタケカンパニーリミテド	0.8	0.9	3,690
TOTO	10.6	10.6	47,965
日本碍子	16.3	17.3	32,351
日本特殊陶業	11.3	12.3	33,628
ダントーホールディングス	1	1.2	284
MARUWA	0.5	0.6	9,936
品川リフラクトリーズ	0.3	0.4	1,562
黒崎播磨	0.3	0.3	1,395
ユータイ	1	1.1	1,542

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イソライト工業	0.7	—	—
東京窯業	1.9	1.8	459
ニッカトー	0.7	0.7	294
フジミインコーポレーテッド	1.2	1.3	8,099
クニミネ工業	0.5	0.6	441
エーアンドエーマテリアル	0.3	0.3	256
ニチアス	3.7	3.7	8,413
ニチハ	2	2.3	6,343
鉄鋼 (0.8%)			
日本製鉄	69.9	72.7	150,125
神戸製鋼所	26.9	30.4	18,513
合同製鐵	0.8	0.9	1,531
JFEホールディングス	42.4	40.3	55,533
東京製鐵	5.8	5.2	6,526
共英製鋼	1.7	1.8	2,604
大和工業	3.1	2.8	12,124
東京鐵鋼	0.6	0.7	936
大阪製鐵	0.8	1	1,072
淀川製鋼所	1.9	1.9	4,639
丸一鋼管	4.8	5.1	14,631
モリ工業	0.5	0.4	1,051
大同特殊鋼	2.4	2.4	8,748
日本高周波鋼業	0.6	0.8	251
日本冶金工業	1.2	1.2	3,325
山陽特殊製鋼	1.8	1.5	2,835
愛知製鋼	0.8	1	2,066
日立金属	13.8	18.8	40,946
日本金属	0.4	0.5	475
大平洋金属	1	1.1	2,219
新日本電工	9.7	9.8	3,322
栗本鐵工所	0.7	0.7	1,141
缸技	0.2	0.3	275
日本鋳鉄管	0.2	0.2	189
三菱製鋼	1.1	1.2	1,102
日亜鋼業	2.3	2.2	497
日本精線	0.2	0.3	1,387
エンビプロ・ホールディングス	0.6	1.2	925
シンニッタン	1.9	2.4	516
新家工業	0.4	0.4	775
非鉄金属 (0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	2.2	2.2	2,824

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本軽金属ホールディングス	4	4.4	6,459
三井金属鉱業	4	4.7	14,123
東邦亜鉛	0.8	0.9	1,908
三菱マテリアル	9.7	10.1	19,796
住友金属鉱山	18.7	19.1	80,391
DOWAホールディングス	3.7	4.1	19,762
古河機械金属	2.5	2.7	3,472
エス・サイエンス	7.6	8.4	218
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.6	2	6,800
東邦チタニウム	2.7	3.1	6,717
UACJ	2.2	2.4	5,100
CKサンエツ	0.3	0.3	1,270
古河電気工業	4.6	5	11,310
住友電気工業	51.2	60.8	93,814
フジクラ	17.7	19.4	16,839
昭和電線ホールディングス	1.4	1.5	2,631
タツタ電線	2.7	3.1	1,385
カナレ電気	0.3	0.3	418
平河ヒューテック	0.8	1	1,082
リョービ	1.8	1.6	2,068
アーレスティ	1.9	1.9	697
アサヒホールディングス	5.5	7	13,447
金属製品 (0.6%)			
稲葉製作所	0.8	0.9	1,239
宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.5	1,627
トーカロ	3.8	4.5	5,278
アルファCo	0.5	0.6	569
SUMCO	22.6	28.7	53,726
川田テクノロジーズ	0.3	0.3	1,117
RS Technologies	0.5	0.5	3,245
ジェイテックコーポレーション	0.2	0.2	307
信和	0.8	1.1	874
東洋製罐グループホールディングス	9.3	8.9	15,227
ホッカンホールディングス	0.7	0.8	1,041
コロナ	0.8	0.8	676
横河ブリッジホールディングス	2.5	2.5	4,937
駒井ハルテック	0.3	0.3	475
高田機工	0.1	0.2	477
三和ホールディングス	13.8	16.4	20,746
文化シャッター	4.3	5.1	5,451
三協立山	1.9	2.1	1,123

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルインコ	1	1.1	1,068
東洋シャッター	0.3	0.4	203
L I X I L	20.2	25.1	56,249
日本フィルコン	1	1.1	496
ノーリツ	2.8	2.2	3,357
長府製作所	1.5	1.5	3,057
リンナイ	2.8	3	30,450
ダイニチ工業	0.7	0.9	610
日東精工	1.8	2.2	1,170
三洋工業	0.2	0.2	330
岡部	3	2.5	1,632
ジーテクト	1.8	1.9	2,496
東プレ	2.7	2.7	3,123
高周波熱錬	2.8	2.7	1,825
東京製綱	1	1.1	973
サンコール	1.2	1.5	1,005
モリテック スチール	1.1	1.4	460
バイオラックス	2.2	2.3	4,218
エイチワン	1.4	1.5	891
日本発條	14.6	14.6	12,103
中央発條	0.7	0.9	610
アドバネクス	0.2	0.2	229
立川ブラインド工業	0.6	0.7	720
三益半導体工業	1.1	1.4	3,155
機械 (5.1%)			
日本ドライケミカル	0.4	0.4	570
日本製鋼所	4.4	4.5	13,927
三浦工業	6.3	6.8	20,536
タクマ	5	5	6,245
ツガミ	3	3.6	3,981
オークマ	1.7	1.7	8,517
芝浦機械	1.5	2	5,706
アマダ	21.5	27.4	28,687
アイダエンジニアリング	3.8	3.8	3,271
TAKI SAWA	0.4	0.5	535
F U J I	5.8	6.9	13,586
牧野フライス製作所	1.7	1.8	8,127
オーエスジー	6.8	7	13,083
ダイジェット工業	0.2	0.2	163
旭ダイヤモンド工業	3.8	4.2	3,053
DMG森精機	8.7	8.9	15,397

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソディック	3.2	4.1	3,152
ディスコ	2	2.6	89,180
日東工器	0.7	0.8	1,253
日進工具	1.1	1.4	1,647
パンチ工業	1.3	1.5	616
富士ダイス	0.7	0.9	508
豊和工業	0.8	0.9	776
ニデックオーケーケー	0.7	0.6	522
東洋機械金属	1.1	1.2	668
津田駒工業	0.3	—	—
島精機製作所	2.1	2.5	5,365
オプトラン	1.8	2.2	4,631
NCホールディングス	0.5	0.5	935
イワキポンプ	0.9	1.1	1,591
フリュー	1.4	1.5	1,752
ヤマシンフィルタ	3	2.6	1,055
日阪製作所	1.8	1.8	1,510
やまびこ	2.8	2.4	2,719
野村マイクロ・サイエンス	0.3	0.5	1,907
平田機工	0.7	0.8	3,484
ベガサスミシン製造	1.5	1.8	1,612
マルマエ	0.6	0.7	1,181
タツモ	0.7	0.8	1,164
ナプテスコ	8.3	9.2	28,612
三井海洋開発	1.5	1.8	2,773
レオン自動機	1.4	1.8	2,077
SMC	4.4	5.2	303,576
ホソカワミクロン	1	1.1	2,927
ユニオンツール	0.5	0.6	2,109
オイレス工業	2.1	2.3	3,429
日精エー・エス・ピー機械	0.5	0.7	2,670
サトーホールディングス	1.9	2.3	4,245
技研製作所	1.3	1.5	4,777
日本エアテック	0.7	0.7	784
カワタ	0.4	0.5	424
日精樹脂工業	1.1	1.1	1,049
オカダアイオン	0.5	0.5	720
ワイエイシイホールディングス	0.6	0.7	886
小松製作所	67.1	79.8	220,407
住友重機械工業	8.5	9.4	26,423
日立建機	6.9	7	19,187

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日工	2.2	2.1	1,285
巴工業	0.6	0.6	1,458
井関農機	1.4	1.4	1,702
TOWA	1.4	1.5	2,688
丸山製作所	0.3	0.3	429
北川鉄工所	0.7	0.7	884
ローツェ	0.6	0.9	6,570
タカキタ	0.5	0.6	283
クボタ	72.2	78.7	161,059
荏原実業	0.7	0.7	1,546
三菱化工機	0.5	0.5	1,061
月島機械	2.7	2.7	2,646
帝国電機製作所	1	1.1	2,162
新東工業	3.5	3.3	2,306
澁谷工業	1.3	1.4	3,526
アイチ コーポレーション	2.5	2.5	1,935
小森コーポレーション	3.8	4	3,036
鶴見製作所	1.1	1.2	2,734
住友精密工業	0.2	0.3	749
酒井重工業	0.3	0.3	894
荏原製作所	6.1	6	28,710
石井鐵工所	0.2	0.2	493
西島製作所	1.5	1.4	1,824
北越工業	1.5	1.5	1,605
ダイキン工業	18.9	19.2	420,192
オルガノ	0.5	2	5,050
トーヨーカネツ	0.6	0.6	1,489
栗田工業	8	8.9	47,793
椿本チエイン	2.1	2.3	7,291
大同工業	0.7	0.7	514
木村化工機	1.3	1.3	947
アネスト岩田	2.5	2.7	2,467
ダイフク	8.1	8.3	56,025
サムコ	0.4	0.5	1,595
加藤製作所	0.8	0.8	572
油研工業	0.3	0.3	537
タダノ	7.1	8.5	7,743
フジテック	5.1	5.4	16,113
CKD	3.4	4.5	7,974
キトー	1.2	1.4	3,806
平和	4.1	4.9	11,593

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
理想科学工業	1.1	1.5	3,658
SANKYO	3.5	3.6	17,820
日本金銭機械	1.6	1.7	1,215
マースグループホールディングス	0.9	1.1	1,958
フクシマガリレイ	1	1.1	4,488
オーイズミ	0.7	0.7	292
ダイコク電機	0.7	0.8	1,139
竹内製作所	2.5	2.7	8,029
アマノ	3.9	4.6	11,711
JUKI	2.1	2.3	1,672
サンデン	2.1	2.5	525
ジャノメ	1.3	1.4	883
マックス	2	2.1	4,464
グローリー	3.8	4.2	9,508
新晃工業	1.4	1.6	2,502
大和冷機工業	2.1	2.2	2,684
セガサミーホールディングス	13.5	15.8	29,972
日本ビストンリング	0.5	0.6	712
リケン	0.7	0.6	1,386
TPR	2	1.9	2,350
ツバキ・ナカシマ	3.2	3.6	4,291
ホシザキ	4.3	9.5	40,185
大豊工業	1.2	1.4	991
日本精工	30.4	30.1	22,484
NTN	34.2	31.9	8,070
ジェイテクト	14.2	15	14,415
不二越	1.3	1.1	4,180
日本トムソン	4	4	2,092
THK	8.6	8.5	21,352
ユースン精機	1	1.3	920
前澤給装工業	1	1.1	1,023
イーグル工業	1.8	1.9	2,099
前澤工業	0.9	1	608
日本ビラー工業	1.5	1.5	3,676
キッツ	5	5.4	4,644
マキタ	19.3	19.9	56,008
三井E&Sホールディングス	5.8	6.6	2,673
日立造船	11.7	13.9	11,773
三菱重工業	23.3	25.8	128,793
IHI	10	11	36,520
サノヤスホールディングス	2.2	2.1	262

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スター精密	2.3	2.8	4,664
電気機器 (16.8%)			
日清紡ホールディングス	9	12	12,372
イビデン	7.1	8.5	37,145
コニカミノルタ	30	35.6	16,162
ブラザー工業	18.1	20	51,680
ミネベアミツミ	25.5	28	61,012
日立製作所	71.2	84.7	554,276
東芝	29.3	30.8	160,375
三菱電機	148.1	164.3	229,198
富士電機	8.9	9.8	54,096
東洋電機製造	0.6	0.6	510
安川電機	15.9	17.5	71,225
シンフォニアテクノロジー	1.9	1.8	2,455
明電舎	2.5	2.5	4,917
オリジン	0.4	0.4	512
山洋電気	0.7	0.6	2,976
デンヨー	1.3	1.2	1,726
PHCホールディングス	—	2.7	4,087
東芝テック	1.6	1.9	7,457
芝浦メカトロニクス	0.3	0.3	2,883
マブチモーター	3.5	3.7	14,800
日本電産	35.7	39.1	321,832
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.8	0.7	362
トレックス・セミコンダクター	0.8	0.8	2,249
東光高岳	0.8	1	1,880
ダブル・スコープ	4.3	4.8	8,870
ダイヘン	1.6	1.6	6,008
ヤーマン	2.5	2.9	3,221
JVCケンウッド	12.8	14.3	3,003
ミマキエンジニアリング	1.3	1.6	1,121
I-PEX	0.7	0.8	1,014
日新電機	3.5	4.1	5,596
大崎電気工業	3	3	1,572
オムロン	12.3	14.7	103,105
日東工業	2.2	2.2	5,387
I D E C	2	2.2	6,798
正興電機製作所	0.5	0.7	700
不二電機工業	0.3	0.3	326
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.3	5.3	11,845
サクサホールディングス	0.4	0.4	482

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メルコホールディングス	0.5	0.5	1,530
テクノメディカ	0.3	0.4	660
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.4	0.5	587
日本電気	18.8	20.9	103,559
富士通	13.3	15.8	267,020
沖電気工業	6	6.6	4,818
岩崎通信機	0.7	0.8	609
電気興業	0.7	0.8	1,896
サンケン電気	1.7	1.5	7,117
ナカヨ	0.3	0.3	328
アイホン	0.9	0.8	1,618
ルネサスエレクトロニクス	79.9	96.2	118,807
セイコーエプソン	18.4	19.6	40,924
ワコム	10.7	13.5	8,545
アルバック	2.7	3.5	19,880
アクセル	0.6	0.7	823
E I Z O	1.3	1.2	4,500
日本信号	3.5	3.8	3,841
京三製作所	3.2	3.4	1,373
能美防災	2	2	3,232
ホーチキ	1.1	1.1	1,621
星和電機	0.7	0.7	299
エレコム	3.4	4	5,516
パナソニック ホールディングス	157.9	187.8	201,133
シャープ	19.7	16.7	14,846
アンリツ	8.9	11.1	18,115
富士通ゼネラル	4.5	4.8	14,400
ソニーグループ	92.8	110.3	1,090,205
T D K	21.3	25.5	118,192
帝国通信工業	0.7	0.8	1,176
タムラ製作所	5.3	6.3	4,517
アルプスアルパイン	12.1	14.4	16,099
池上通信機	0.5	0.6	325
日本電波工業	1.4	1.8	2,750
鈴木	0.7	0.9	782
メイコー	1.1	1.9	4,915
日本トリム	0.3	0.3	702
ローランド ディー・ジー	0.9	0.8	2,480
フォスター電機	1.5	1.6	1,241
SMK	0.4	0.4	1,097
ヨコオ	1.2	1.2	2,392

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホシデン	3.9	3.9	5,990
ヒロセ電機	2.3	2.4	46,080
日本航空電子工業	3.4	3.6	7,380
TOA	1.8	1.9	1,506
マクセル	2.9	3.2	4,275
古野電気	1.9	2.1	2,202
ユニデンホールディングス	0.4	0.2	818
スミダコーポレーション	1.4	1.3	1,207
アイコム	0.6	0.6	1,522
リオン	0.6	0.6	1,231
本多通信工業	1.2	—	—
横河電機	14.8	16.1	38,157
新電元工業	0.6	0.6	2,184
アズビル	10	10.2	41,208
東亜ディーケーケー	0.8	0.9	768
日本光電工業	6.1	6.7	22,713
チノー	0.5	0.5	862
共和電業	1.5	1.7	566
日本電子材料	0.6	0.8	1,162
堀場製作所	2.7	3.3	19,701
アドバンテスト	11	13.1	97,071
小野測器	0.6	0.7	268
エスベック	1.3	1.3	2,375
キーエンス	14.6	16	819,520
日置電機	0.7	0.8	5,432
シスメックス	11.6	12.6	101,077
日本マイクロニクス	2.6	2.4	3,276
メガチップス	1.5	1.6	4,049
OBARA GROUP	0.7	0.7	2,394
澤藤電機	0.2	0.2	236
原田工業	0.6	0.8	633
コーセル	1.8	2	1,676
イリソ電子工業	1.2	1.5	6,142
オブテックスグループ	2.4	2.7	5,373
千代田インテグレ	0.6	0.6	1,387
アイ・オー・データ機器	0.6	—	—
レーザーテック	6.5	7.2	144,180
スタンレー電気	10.4	11.3	28,137
岩崎電気	0.5	0.6	1,573
ウシオ電機	7.6	8.3	12,682
岡谷電機産業	1.1	1.4	365

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヘリオス テクノ ホールディング	1.4	1.5	708
エノモト	0.4	0.5	879
日本セラミック	1.4	1.5	3,861
遠藤照明	0.8	0.9	665
古河電池	1.1	1.3	1,387
双信電機	0.8	0.8	328
山一電機	1	1.1	2,238
図研	1	1.2	3,942
日本電子	2.7	3.4	18,190
カシオ計算機	11.9	10.9	14,202
ファナック	13	15.5	317,517
日本シイエムケイ	3.2	3.1	1,559
エンプラス	0.7	0.4	1,650
大真空	0.5	2.2	2,008
ローム	6.2	7.3	75,555
浜松トホニクス	10.6	11.7	77,454
三井ハイテック	1.5	1.5	11,415
新光電気工業	5	5.2	17,290
京セラ	22.6	24.8	183,296
太陽誘電	6.6	7.8	31,044
村田製作所	43.5	48	344,208
双葉電子工業	2.6	3	1,827
北陸電気工業	0.6	0.7	732
ニチコン	4.7	4.7	6,410
日本ケミコン	1.5	1.7	3,027
KOA	2.1	2.4	5,083
市光工業	1.8	2.1	825
小糸製作所	8.9	17.6	37,100
ミツバ	2.8	2.7	1,058
SCREENホールディングス	2.6	2.8	22,792
キヤノン電子	1.4	1.6	2,532
キヤノン	73.6	80.2	268,188
リコー	37.7	41.8	46,356
象印マホービン	4	4.4	6,626
MUTOHホールディングス	0.2	0.2	376
東京エレクトロン	8.7	11.2	438,816
イノテック	—	1	1,251
輸送用機器 (7.8%)			
トヨタ紡織	4.3	6.1	11,516
芦森工業	0.3	0.3	312
ユニプレス	2.4	2.9	2,476

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
豊田自動織機	12	12.5	92,875
モリタホールディングス	2.4	2.8	3,628
三櫻工業	2	2.5	1,672
デンソー	32.6	34.5	251,850
東海理化電機製作所	3.9	4.7	7,035
川崎重工業	11.6	11.9	29,107
名村造船所	4.6	4.5	2,529
日本車輛製造	0.6	0.6	1,207
三菱ロジスネクスト	2	2.3	1,685
近畿車輛	0.3	0.3	298
日産自動車	174.5	207.6	97,094
いすゞ自動車	39.4	51	87,465
トヨタ自動車	750.5	802.5	1,621,050
日野自動車	18.5	21.9	13,074
三菱自動車工業	54.8	65.1	32,354
エフテック	1.1	1.2	628
レシップホールディングス	0.6	0.7	341
GMB	0.3	0.3	218
ファルテック	0.3	0.3	182
武蔵精密工業	3.3	4	6,704
日産車体	2.2	2.6	2,145
新明和工業	4.2	4.6	4,687
極東開発工業	2.6	2.8	3,883
トビー工業	1.2	1.3	2,047
ティラド	0.5	0.5	1,358
タチエス	2.3	2.9	3,221
NOK	7.2	6.7	8,080
フタバ産業	3.8	3.9	1,287
KYB	1.7	1.5	4,687
大同メタル工業	3.1	3.4	1,727
プレス工業	7.3	7.9	3,215
ミクニ	2	2.1	665
太平洋工業	3.1	3.4	3,600
河西工業	2.2	2.2	420
アイシン	10.8	12.9	50,632
マツダ	46.5	51.8	51,541
今仙電機製作所	1.3	1.2	690
本田技研工業	116.6	128.7	432,560
スズキ	29.3	34.9	168,113
SUBARU	42.4	46.3	107,416
安永	0.7	0.7	434

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマハ発動機	19.3	23	69,230
TBK	1.9	1.9	539
エクセディ	2	2.6	4,498
豊田合成	4.8	5	11,490
愛三工業	2.4	2.8	1,951
盟和産業	0.3	0.3	293
日本プラスト	1.3	1.4	596
ヨロズ	1.3	1.4	1,209
エフ・シー・シー	2.5	2.9	4,118
シマノ	6	6	136,140
テイ・エス テック	6.9	7.4	11,388
ジャムコ	0.9	1	1,604
精密機器 (2.9%)			
テルモ	45.4	49.8	225,345
クリエートメディック	0.4	0.5	441
日機装	4.4	3.7	3,663
日本エム・ディ・エム	0.9	1	1,246
島津製作所	19.1	21	81,795
JMS	1.2	1.3	686
長野計器	1	1.1	1,191
ブイ・テクノロジー	0.7	0.8	2,217
東京計器	1	1.1	1,386
愛知時計電機	0.2	0.6	800
インターアクション	0.7	0.9	1,295
オーバル	1.3	1.6	795
東京精密	2.5	2.7	11,853
マニー	5.9	6.4	13,504
ニコン	22.6	24.8	35,637
トプコン	7.5	8.3	13,271
オリンパス	77.8	84.3	258,716
理研計器	1.3	1.2	4,950
タムロン	1.1	1.1	3,542
HOYA	28.9	33.6	493,920
シード	0.6	0.8	400
ノーリツ銅機	1.3	1.4	3,684
A&Dホロンホールディングス	1.2	2	1,834
朝日インテック	16.2	19.3	48,404
シチズン時計	18.8	16.1	10,046
リズム	0.5	0.5	823
大研医器	1.2	1.4	635
メニコン	4.6	5.4	15,660

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
シンシア	0.2	0.2	101	
松風	0.7	0.6	1,490	
セイコーグループ	2.1	2.5	8,200	
ニプロ	11	12.2	13,627	
その他製品 (2.5%)				
KYORITSU	—	2.6	304	
中本ボックス	0.3	0.5	751	
スノーピーク	0.9	2.5	4,977	
パラマウントベッドホールディングス	2.8	3.4	9,020	
トランザクション	0.7	1.1	1,156	
粧美堂	0.4	0.4	147	
ニホンブラッシュ	1.2	1.4	1,366	
前田工織	1.6	1.6	4,740	
永大産業	1.6	1.9	423	
アートネイチャー	1.3	1.5	1,114	
バンダイナムコホールディングス	12.2	14.6	144,058	
アイフィスジャパン	0.3	0.5	310	
共立印刷	1.8	—	—	
SHOEI	1.4	1.5	8,145	
フランスベッドホールディングス	1.8	2.2	2,041	
パイロットコーポレーション	2.5	2.3	13,202	
萩原工業	0.9	0.9	957	
トッパン・フォームズ	2.5	—	—	
フジシールインターナショナル	3	3.6	6,354	
タカラトミー	6.5	7.2	9,050	
広済堂ホールディングス	1	1.1	1,711	
エステールホールディングス	0.3	0.4	246	
タカノ	0.4	0.6	405	
プロネクサス	1.1	1.3	1,251	
ホクシン	0.7	1.2	178	
ウッドワン	0.4	0.5	475	
大建工業	0.9	0.9	1,696	
凸版印刷	22.4	22.9	51,341	
大日本印刷	17.5	19.1	57,586	
共同印刷	0.4	0.4	1,042	
NISSHA	3	2.8	4,799	
光村印刷	0.1	0.1	119	
TAKARA & COMPANY	0.7	1	2,160	
アシックス	13	13.5	31,171	
ツツミ	0.3	0.4	791	
ローランド	1	1.1	4,521	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
小松ウオール工業	0.4	0.5	934	
ヤマハ	8.8	10.2	57,324	
河合楽器製作所	0.4	0.4	1,097	
クリナップ	1.2	1.6	953	
ビジョン	8.9	9.3	18,209	
兼松サステック	0.1	0.1	159	
キングジム	1.1	1.3	1,196	
リンテック	3.1	3.4	7,616	
イトーキ	2.5	3	1,269	
任天堂	8.6	99.4	603,556	
三菱鉛筆	2.4	2.1	3,024	
タカラスタンダード	3	2.8	3,631	
コクヨ	7	7	12,908	
ナカバヤシ	1.3	1.4	742	
グローブライド	1.4	1.3	2,964	
オカムラ	5	5	6,785	
美津濃	1.4	1.5	3,774	
電気・ガス業 (1.2%)				
東京電力ホールディングス	125.7	131.6	62,115	
中部電力	45.3	49.7	60,584	
関西電力	56.1	61.5	69,187	
中国電力	21.4	25.3	17,077	
北陸電力	13.5	15	7,035	
東北電力	34.7	38.4	23,232	
四国電力	12.3	14.6	9,811	
九州電力	32.7	33.7	24,230	
北海道電力	13.8	15.4	6,683	
沖縄電力	2.9	3.8	3,815	
電源開発	11.8	13	27,196	
エフオン	0.9	1.1	694	
イーレックス	2.2	2.3	5,710	
レノバ	2.5	3.4	11,441	
東京瓦斯	28.5	30.9	78,207	
大阪瓦斯	26.8	29.6	64,587	
東邦瓦斯	7.3	6.9	19,837	
北海道瓦斯	0.8	0.9	1,503	
広島ガス	3.1	3	1,026	
西部ガスホールディングス	1.7	1.7	2,915	
静岡ガス	3.9	3.3	3,524	
メタウォーター	1.7	1.8	3,445	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
陸運業 (3.2%)			
SBSホールディングス	1.1	1.3	3,724
東武鉄道	15.5	16	54,080
相鉄ホールディングス	5.1	5.2	11,746
東急	37.4	41	68,552
京浜急行電鉄	19	19.6	29,243
小田急電鉄	23.7	22.1	39,757
京王電鉄	8.3	7.7	39,424
京成電鉄	11.1	10.7	41,088
富士急行	2	1.8	8,091
東日本旅客鉄道	26.1	26.9	212,805
西日本旅客鉄道	16.5	18.7	106,664
東海旅客鉄道	12.3	12.4	209,374
西武ホールディングス	17.9	21.2	27,835
鴻池運輸	2.4	2.5	3,865
西日本鉄道	4.1	4.2	12,066
ハマキョウレックス	1.1	1.2	3,930
サカイ引越センター	0.7	0.8	3,728
近鉄グループホールディングス	14	15.6	76,518
阪急阪神ホールディングス	18.7	19.5	84,240
南海電気鉄道	6.7	7	20,020
京阪ホールディングス	6.3	6.5	24,407
神戸電鉄	0.3	0.4	1,296
名古屋鉄道	11.6	16.1	36,015
山陽電気鉄道	1	1.2	2,710
アルプス物流	1	1.2	1,282
日本通運	4.9	—	—
ヤマトホールディングス	19.7	22.8	49,772
山九	3.6	4	17,360
丸運	0.9	1	215
丸全昭和運輸	1.1	1.1	3,382
センコーグループホールディングス	7.8	7.8	7,651
トナミホールディングス	0.3	0.3	1,075
ニッコンホールディングス	4.7	5	11,525
日本石油輸送	0.2	0.2	447
福山通運	1.8	2.2	7,150
セイノーホールディングス	10.5	9.1	10,355
エスライン	0.4	0.5	403
神奈川中央交通	0.4	0.4	1,334
日立物流	2.9	3.2	27,840
AZ-COM丸和ホールディングス	3	2.9	4,132

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
C&Fロジホールディングス	1.4	1.4	1,702
九州旅客鉄道	10.9	11.2	34,328
SGホールディングス	26.5	28	56,896
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	5.4	39,582
海運業 (0.6%)			
日本郵船	11.7	41.9	116,607
商船三井	8.4	25.8	77,658
川崎汽船	4.4	15.5	36,952
NSユナイテッド海運	0.7	0.8	3,124
飯野海運	6.9	6.9	5,271
乾汽船	1	1.2	2,295
空運業 (0.5%)			
日本航空	34.2	35.8	99,416
ANAホールディングス	37.9	39.7	114,792
パスコ	0.2	0.3	389
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.4	0.5	3,705
日新	1.1	1.2	2,302
三菱倉庫	4.8	4	13,680
三井倉庫ホールディングス	1.5	1.6	5,152
住友倉庫	5	4.9	10,064
澁澤倉庫	0.8	0.8	1,644
東陽倉庫	2.3	2.5	620
日本トランスシティ	3	2.9	1,421
ケイヒン	0.3	0.3	424
中央倉庫	0.9	0.9	828
川西倉庫	0.3	0.3	298
安田倉庫	1.2	1.1	1,028
ファイズホールディングス	0.3	0.4	343
東洋埠頭	0.4	0.5	572
宇徳	1	—	—
上組	7.7	7.9	22,364
サンリツ	0.4	0.4	269
キムラユニティー	0.4	0.9	682
キューソー流通システム	0.3	0.9	964
近鉄エクスプレス	2.7	—	—
東海運	0.8	1	280
エーアイテイー	0.9	1	1,524
内外トランスライン	0.5	0.5	1,002
日本コンセプト	0.5	0.5	873

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
情報・通信業 (9.5%)				
NECネットエスアイ	4.8	5.7	9,416	
クロスキャット	0.4	0.9	1,316	
システナ	5.2	24.7	10,497	
デジタルアーツ	0.8	0.9	5,751	
日鉄ソリューションズ	2.1	3	10,755	
キューブシステム	0.8	0.9	891	
WOW WORLD	0.2	—	—	
コア	0.6	0.7	1,019	
手間いらず	—	0.3	1,719	
ラクーンホールディングス	1	1.5	1,756	
ソリトンシステムズ	0.7	0.7	737	
ソフトクリエイトホールディングス	0.6	0.8	2,760	
T I S	14.5	15.1	61,155	
J N Sホールディングス	0.8	0.9	326	
グリー	8.9	7.9	6,667	
GMOペパボ	0.2	0.2	400	
コーエーテックモホールディングス	3.9	11	24,442	
三菱総合研究所	0.6	0.7	3,577	
ボルテージ	0.4	0.5	174	
電算	0.2	0.2	323	
AGS	0.8	0.7	424	
ファインデックス	1.2	1.2	734	
ブレインパッド	0.4	1.5	1,372	
K L a b	2.7	2.7	1,242	
ポルトゥウィンホールディングス	2	2.5	2,360	
イーブックイニシアティブジャパン	0.2	—	—	
ネクソン	32.7	37.9	94,446	
アイスタイル	4.5	4.5	2,232	
エムアップホールディングス	0.4	2	3,158	
エイチーム	1	1.1	825	
エニグモ	1.4	1.8	948	
テクノスジャパン	1.2	1.4	634	
e n i s h	0.9	1.3	564	
コロブラ	4.8	5.7	4,064	
ブロードリーフ	7.3	8.6	4,532	
クロス・マーケティンググループ	0.6	0.7	616	
デジタルハーツホールディングス	0.7	0.8	1,609	
システム情報	1.1	1.3	1,290	
メディアドゥ	0.6	0.6	1,294	
じげん	3.6	4.9	1,778	

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
ブイキューブ	1.5	1.8	1,836	
エンカレッジ・テクノロジー	0.3	0.4	206	
サイバーリンクス	0.5	0.6	830	
フィックスターズ	1.6	1.7	1,963	
CARTA HOLDINGS	0.6	0.7	1,230	
オプティム	1	1.2	1,074	
セレス	0.5	0.6	541	
SHIFT	0.7	1.1	24,266	
ティーガイア	1.6	1.5	2,482	
セック	0.2	0.3	672	
テクマトリックス	2.2	2.9	5,211	
プロシップ	0.5	0.6	933	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3.9	4.5	9,697	
GMOペイメントゲートウェイ	2.8	3.3	36,003	
ザッパラス	0.6	0.6	219	
システムリサーチ	0.4	0.5	1,000	
インターネットイニシアティブ	3.9	9.2	21,997	
さくらインターネット	1.6	1.8	1,000	
ヴインクス	0.4	0.5	764	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.3	0.5	2,332	
SRAホールディングス	0.8	0.8	2,576	
システムインテグレータ	0.4	0.6	282	
朝日ネット	1.2	1.6	956	
eBASE	1.8	2.1	1,167	
アバントグループ	1.6	1.9	2,762	
アドソル日進	0.5	0.6	910	
ODKソリューションズ	0.3	0.4	242	
フリービット	0.9	0.9	940	
コムチュア	1.3	1.9	4,634	
サイバーコム	0.2	0.3	430	
アステリア	1.1	1.2	1,009	
アイル	0.8	0.8	1,460	
マークラインズ	0.7	0.8	1,952	
メディカル・データ・ビジョン	1.8	2.2	2,446	
gumi	2	2.4	2,265	
ショーケース	0.4	0.4	160	
モバイルファクトリー	0.4	0.4	384	
テラスカイ	0.5	0.6	1,442	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.6	0.8	1,384	
P C Iホールディングス	0.7	0.7	707	
パイブドHD	0.3	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイビーシー	0.3	0.3	142
ネオジャパン	0.3	0.5	500
P R T I M E S	0.3	0.4	922
ラクス	4.4	7.9	13,027
ランドコンピュータ	0.3	0.4	335
ダブルスタンダード	0.4	0.5	1,277
オープンドア	0.9	1	1,800
マイネット	0.5	0.6	281
アカツキ	0.6	0.8	1,712
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	157
U b i c o mホールディングス	0.4	0.4	918
カナミックネットワーク	1.6	2.1	1,276
ノムラシステムコーポレーション	0.8	1.6	200
チェンジ	2.7	3.6	7,300
シンクロ・フード	0.9	0.9	462
オークネット	0.8	0.8	1,807
キャピタル・アセット・プランニング	0.3	0.3	173
エイトレッド	0.3	0.2	313
マクロミル	3	3.4	3,780
ビーグリー	0.4	0.3	402
オロ	0.5	0.4	624
ユーザーローカル	0.4	0.5	790
テモナ	0.3	0.3	82
マネーフォワード	2.2	3.5	14,262
サインポスト	0.4	0.6	449
電算システムホールディングス	0.6	0.7	1,635
ソルクシーズ	1.2	1.3	475
フェイス	0.5	0.5	277
プロトコーポレーション	1.7	1.8	2,044
ハイマックス	0.4	0.5	746
野村総合研究所	25.2	30	109,800
サイバネットシステム	1.1	1.2	1,200
CEホールディングス	0.8	0.8	384
日本システム技術	0.3	0.6	840
インテージホールディングス	1.8	2	3,340
東邦システムサイエンス	0.4	0.5	488
ソースネクスト	7	7.5	2,197
インフォコム	1.3	1.9	3,906
シンプレクス・ホールディングス	—	2.7	5,464
HEROZ	0.4	0.5	533
ラクスル	1.6	2.1	6,117

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メルカリ	—	6.6	15,516
I P S	0.4	0.5	1,500
F I G	1.7	1.9	765
システムサポート	0.4	0.6	812
イーソル	0.9	1	572
アルテリア・ネットワークス	1.6	1.7	2,031
E d u L a b	0.1	—	—
東海ソフト	0.2	0.3	274
ウイングアーク1 s t	0.8	1.3	3,030
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.3	0.4	662
サーバーワークス	0.1	0.3	734
東名	0.2	0.1	148
ヴィッツ	0.1	0.2	191
トビラシステムズ	0.3	0.4	366
S a n s a n	1.3	5.5	8,057
L i n k - U	0.3	0.3	244
ギフティ	1.3	1.6	3,512
ベース	0.2	0.5	2,030
J M D C	—	2.3	12,006
フォーカスシステムズ	1	1.1	1,111
クレスコ	1	1.2	2,128
フジ・メディア・ホールディングス	15.1	15.3	16,080
オービック	4.6	5.4	121,878
ジャストシステム	2.1	2.5	7,750
TDCソフト	1.3	1.4	1,820
Zホールディングス	199.6	249.2	98,060
トレンドマイクロ	7.8	8.5	64,770
IDホールディングス	0.9	1.1	1,019
日本オラクル	2.9	2.8	23,072
アルファシステムズ	0.4	0.5	2,152
チャーチャ	1.5	3.6	6,030
C A C H o l d i n g s	0.9	0.9	1,381
SBテクノロジー	0.5	0.8	1,815
トーセ	0.4	0.5	405
オービックビジネスコンサルタント	1.4	1.7	7,675
伊藤忠テクノソリューションズ	6.6	7.9	28,203
アイティフォー	1.9	2.1	1,648
東計電算	0.2	0.2	1,206
エクスネット	0.3	0.3	301
大塚商会	7.9	8.3	39,715
サイボウズ	1.9	2	3,768

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
電通国際情報サービス	2.1	1.8	8,280	
ACCESS	1.9	2	1,574	
デジタルガレージ	2.4	2.9	10,309	
EMシステムズ	2.4	2.5	2,320	
ウェザーニューズ	0.4	0.5	3,780	
C I J	1	1.3	1,038	
ビジネスエン지니어リング	0.1	0.4	851	
日本エンタープライズ	1.5	1.9	266	
WOWOW	0.7	0.7	895	
スカラ	1.3	1.4	1,036	
インテリジェント ウェイブ	0.9	0.9	745	
WOW WORLD GROUP	—	0.3	293	
IMAGICA GROUP	1.3	1.2	1,092	
ネットワンシステムズ	5.9	6.4	19,552	
システムソフト	3.1	5.5	550	
アルゴグラフィックス	1.1	1.3	5,057	
マーベラス	2.3	2.7	1,836	
エイベックス	2.5	3	5,094	
B I P R O G Y	5	5.4	17,604	
兼松エレクトロニクス	0.8	0.9	3,793	
都築電気	0.7	0.8	1,019	
TBSホールディングス	9.6	8.4	13,246	
日本テレビホールディングス	12.1	14.4	16,444	
朝日放送グループホールディングス	1.5	1.4	868	
テレビ朝日ホールディングス	4.5	4.1	5,776	
スカパーJ SATホールディングス	9.7	14.7	7,702	
テレビ東京ホールディングス	1	1.1	2,117	
日本BS放送	0.5	0.6	545	
ビジョン	2.5	1.9	2,352	
スマートバリュー	0.4	0.4	188	
USEN-NEXT HOLDINGS	1.4	1.3	2,922	
コネクシオ	0.8	1.2	1,370	
日本通信	12.9	14.4	3,211	
クロップス	0.3	0.3	306	
日本電信電話	170	193.6	794,921	
KDD I	116.6	125.9	554,715	
ソフトバンク	132.1	261.7	385,091	
光通信	1.7	2	36,040	
エムティーアイ	1.4	1.3	657	
GMOインターネットグループ	5.1	5.4	14,018	
ファイバーゲート	—	0.7	619	

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йдママーケティングコミュニケーション	0.4	0.4	113	
KADOKAWA	3.8	9.3	25,305	
学研ホールディングス	2	2.5	2,392	
ゼンリン	2.6	2.8	2,506	
昭文社ホールディングス	0.6	0.7	212	
インプレスホールディングス	1.2	1.6	334	
アイネット	0.8	0.8	1,101	
松竹	1	1	11,750	
東宝	8.6	10.2	53,346	
東映	0.5	0.5	9,345	
エヌ・ティ・ティ・データ	38.7	46	98,762	
ビー・シー・エー	0.6	1	1,111	
ビジネスブレイン太田昭和	0.5	0.6	900	
DTS	3	3.2	11,296	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6.2	8	52,160	
シーイーシー	1.6	1.9	2,935	
カブコン	12.5	16	60,880	
アイ・エス・ピー	0.7	0.7	893	
ジャステック	0.9	0.9	1,170	
SCSK	10.2	12	26,928	
NSW	0.5	0.7	1,522	
アイネス	1.4	1.5	2,260	
TKC	2.5	2.6	9,828	
富士ソフト	1.6	1.7	13,838	
NSD	4.7	5.4	13,640	
コナミグループ	5.3	6.3	40,950	
福井コンピュータホールディングス	0.7	0.8	2,788	
JBC Cホールディングス	1	1.2	2,354	
ミロク情報サービス	1.4	1.5	2,188	
ソフトバンクグループ	115.4	103.6	624,811	
卸売業 (5.7%)				
ホウスイ	0.2	—	—	
高千穂交易	0.6	0.6	1,231	
オルパヘルスケアホールディングス	0.3	0.3	445	
伊藤忠食品	0.4	0.4	1,956	
エレマテック	1.2	1.4	1,857	
JALUX	0.5	—	—	
あらた	1.2	1.3	5,278	
トーマンデバイス	0.2	0.3	1,629	
東京エレクトロン デバイス	0.5	0.5	2,980	
円谷フィールズホールディングス	1.4	1.6	3,216	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
双日	16.1	17.8	39,551
アルフレッサ ホールディングス	15.2	18	30,150
横浜冷凍	4.1	4.3	3,861
神栄	0.2	0.3	242
ラサ商事	0.9	0.8	803
アルコニックス	1.6	2.3	3,153
神戸物産	11.3	12	37,860
ハイパー	0.5	0.4	183
あい ホールディングス	2.1	2.5	5,410
ディーブイエックス	0.5	0.7	649
ダイワボウホールディングス	6.7	7.4	13,586
マクニカホールディングス	3.5	4.2	11,869
ラクト・ジャパン	0.5	0.6	1,311
グリムス	0.4	0.8	1,326
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.6	2.9	1,899
八洲電機	1.2	1.3	1,320
メディアスホールディングス	0.9	1.1	781
レスターホールディングス	1.5	1.7	3,457
ジュアテックホールディングス	0.4	0.4	413
大光	0.6	0.9	615
OCHIホールディングス	0.5	0.4	483
TOKAIホールディングス	7.1	8.5	7,633
黒谷	0.5	0.6	336
Cominix	0.3	0.4	288
三洋貿易	1.5	1.7	1,761
ビューティガレージ	0.2	0.3	786
ウイン・パートナーズ	1.1	1.3	1,300
ミタチ産業	0.5	0.5	459
シップヘルスケアホールディングス	5.2	5	14,225
明治電機工業	0.6	0.6	628
デリカフーズホールディングス	0.7	0.8	404
スターティアホールディングス	0.3	0.5	559
コマダホールディングス	3.2	3.8	9,279
ピーバンドットコム	0.3	0.3	153
アセンテック	0.4	0.7	362
富士興産	0.5	0.5	591
協栄産業	0.2	0.2	301
フルサト・マルカホールディングス	1.4	1.5	5,542
ヤマエグループホールディングス	1.1	1	1,547
小野建	1.3	1.6	2,332
南陽	0.3	0.4	732

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
佐鳥電機	1	1.1	1,410
エコートレーディング	0.4	0.4	217
伯東	0.9	1	3,630
コンドーテック	1.2	1.3	1,316
中山福	1	1.2	384
ナガイレーベン	2	2	4,000
三菱食品	1.6	1.7	5,159
松田産業	1.1	1.2	2,631
第一興商	2.8	3.3	13,893
メディバルホールディングス	14.7	16.1	29,414
S P K	0.7	0.7	999
萩原電気ホールディングス	0.6	0.6	1,313
アズワン	1.1	2.5	16,050
スズデン	0.5	0.6	1,397
シモジマ	0.9	1.1	1,115
ドウシシャ	1.4	1.7	2,527
小津産業	0.3	0.4	600
高速	0.8	1	1,576
たけびし	0.5	0.6	913
リックス	0.4	0.4	860
丸文	1.3	1.4	1,159
ハビネット	1.3	1.4	2,893
橋本総業ホールディングス	0.3	0.6	584
日本ライフライン	4.7	5	5,105
タカショー	1	1.4	940
IDOM	5	5.3	3,959
進和	0.9	1	2,004
エスケイジャパン	0.5	0.5	245
ダイトロン	0.6	0.6	1,246
シークス	2.1	2.2	2,483
田中商事	0.5	0.7	378
オーハシテクニカ	0.8	0.9	1,284
白銅	0.5	0.6	1,454
ダイコー通産	0.2	0.2	219
伊藤忠商事	99.7	101.3	395,880
丸紅	143.9	150.3	197,569
高島	0.3	0.3	797
長瀬産業	8	8	16,232
蝶理	1	1	1,936
豊田通商	14.7	15.5	74,400
三共生興	2.3	2.3	1,092

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
兼松	5.9	6	8,790
ツカモトコーポレーション	0.3	0.4	492
三井物産	113.4	121.9	402,270
日本紙パルプ商事	0.8	0.8	3,660
カメイ	1.9	1.9	2,135
東都水産	0.2	0.1	479
OUGホールディングス	0.3	0.3	720
スターゼン	1.1	1.2	2,481
山善	5.7	6.3	5,827
椿本興業	0.3	0.3	1,191
住友商事	92.1	102.6	197,248
内田洋行	0.6	0.7	3,094
三菱商事	88.8	113.7	465,601
第一実業	0.7	0.7	2,817
キヤノンマーケティングジャパン	3.6	3.6	10,980
西華産業	0.8	0.8	1,304
佐藤商事	1.2	1.2	1,412
菱洋エレクトロ	1.1	1	2,243
東京産業	1.4	1.5	1,194
ユアサ商事	1.5	1.4	5,180
神鋼商事	0.3	0.4	1,562
トルク	1	1.2	256
阪和興業	2.9	3	10,755
正栄食品工業	1	1.1	4,526
カナデン	1.2	1.5	1,653
菱電商事	1.1	1.4	2,254
岩谷産業	3.5	3.9	21,255
ナイス	0.6	0.6	828
ニチモウ	0.3	0.2	504
極東貿易	0.4	1	1,294
アステナホールディングス	2.1	2.8	1,156
三愛オブリ	3.6	3.9	4,824
稲畑産業	3.5	3.5	8,561
G S Iクレオス	0.8	0.9	1,304
明和産業	1.4	1.7	1,258
クワザワホールディングス	0.6	0.8	329
ワキタ	2.9	3.2	3,792
東邦ホールディングス	4.7	4.7	9,404
サンゲツ	3.9	4.3	6,798
ミツウロコグループホールディングス	2.2	2.1	2,129
シナネンホールディングス	0.6	0.6	2,448

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠エネクス	3.3	3.9	4,017
サンリオ	4.1	4.9	18,693
サンワテクノス	1	0.9	1,233
リョーサン	1.6	1.8	4,788
新光商事	2	2.4	2,296
トーホー	0.7	0.7	1,188
三信電気	0.8	0.7	1,320
東陽テクニカ	1.5	1.7	2,136
モスフードサービス	2.1	2.3	7,164
加賀電子	1.3	1.4	5,936
ソーダニッカ	1.5	1.5	855
立花エレテック	1.1	1.2	1,974
フォーバル	0.6	0.7	624
PALTAC	2.4	2.4	10,128
三谷産業	2.1	2.9	849
太平洋興発	0.7	0.7	478
西本Wismettacホールディングス	0.3	0.4	1,670
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.2	0.2	332
コア商事ホールディングス	1.2	1.2	735
KPPグループホールディングス	3.2	3.3	2,805
ヤマタネ	0.7	0.8	1,292
丸紅建材リース	0.2	0.2	357
日鉄物産	1	1.1	5,522
泉州電業	0.4	0.4	2,176
トラスコ中山	3.1	3.3	6,728
オートボックスセブン	5.3	5.5	7,722
モリト	1.2	1.2	890
加藤産業	2.1	1.9	6,526
北恵	0.4	0.5	389
イノテック	0.9	—	—
イエローハット	2.8	2.7	4,838
J Kホールディングス	1.4	1.3	1,375
日伝	1.2	1.2	2,091
北沢産業	1.2	1.2	234
杉本商事	0.7	0.8	1,550
因幡電機産業	3.9	4.3	11,846
東テク	0.5	0.5	1,717
ミスミグループ本社	18.3	21.8	70,196
アルテック	1.2	1.2	348
タキヒヨー	0.5	0.5	385
蔵王産業	0.3	0.4	671

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スズケン	6.2	6.2	19,716
ジェコス	1.1	1.3	1,040
グローセル	1.8	2	834
小売業 (4.5%)			
ローソン	3.7	3.8	18,050
サンエー	1.1	1.2	5,256
カワチ薬品	1	1.4	2,896
エービーシー・マート	2.3	2.7	17,712
ハードオフコーポレーション	0.7	0.8	984
アスクル	2.4	3.7	5,575
ゲオホールディングス	2	2.1	4,084
アダストリア	2	1.9	3,680
ジーフット	1	1.1	324
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.4	0.4	162
くら寿司	1.5	1.8	5,895
キャンドゥ	0.7	0.6	1,318
アイケイ	0.5	0.7	298
バルグループホールディングス	1.3	1.5	2,965
エディオン	6.2	8	9,640
サーラコーポレーション	3	3.3	2,666
ワッツ	0.8	0.9	581
ハローズ	0.6	0.8	2,408
フジオフードグループ本社	1.2	1.3	1,788
あみやき亭	0.3	0.4	1,167
ひらまつ	2.9	3.8	725
大黒天物産	0.5	0.6	2,568
ハニーズホールディングス	1.2	1.4	1,681
ファーマライズホールディングス	0.4	0.4	263
アルペン	1.1	1.3	2,624
ハブ	0.5	0.6	380
クオールホールディングス	2	2.2	2,629
ジーンズホールディングス	1	0.9	3,937
ビックカメラ	8.7	10.3	12,092
DCMホールディングス	9	10.3	11,845
ペッパーフードサービス	—	3.3	735
M o n o t a R O	18.5	21.9	49,997
東京一番フーズ	0.5	0.4	234
アークランドサービスホールディングス	1.1	1.3	2,826
J. フロント リテイリング	17.4	19.2	22,502
ドトール・日レスホールディングス	2.3	2.8	4,580
マツキヨココカラ&カンパニー	8.2	10.2	54,774

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブロンコビリー	0.9	0.8	1,965
Z O Z O	8.6	11.9	37,604
トレジャー・ファクトリー	0.5	0.5	1,114
物語コーポレーション	0.8	0.9	5,985
三越伊勢丹ホールディングス	25.5	26	33,774
H a m e e	0.4	0.7	595
マーケットエンタープライズ	0.2	0.2	217
ウエルシアホールディングス	7.7	9.2	28,198
クリエイトSDホールディングス	2.2	2.6	8,177
丸善CHIホールディングス	1.9	2.1	678
ミサワ	0.4	0.4	236
ティーライフ	0.2	0.3	375
シュッピン	1	1.4	2,059
オイシックス・ラ・大地	1.9	2.5	4,460
ネクステージ	2.9	3.5	9,450
ジヨイフル本田	4.3	5	9,005
鳥貴族ホールディングス	0.6	0.6	1,250
ホットランド	1.1	1.2	1,668
すかいらくホールディングス	18.8	21.1	33,063
S F Pホールディングス	0.7	0.9	1,483
綿半ホールディングス	1.1	1.2	1,681
ヨシックスホールディングス	0.3	0.4	844
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4.2	5.1	5,319
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	0.7	1,005
BEENOS	0.7	0.9	2,423
あさひ	1.1	1.5	1,953
日本調剤	0.9	1.1	1,436
コスモス薬品	1.5	1.7	24,633
トーエル	0.7	0.8	627
オンリー	0.3	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	57.1	58.1	324,895
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7.8	11.7	10,342
ツルハホールディングス	3.2	3.8	32,490
サンマルクホールディングス	1.2	1.4	2,254
フェリシモ	0.3	0.4	405
トリドールホールディングス	3.6	4.3	12,005
TOKYO BASE	1.4	1.8	588
ウイルプラスホールディングス	0.3	0.4	408
J Mホールディングス	1	1.3	2,174
サツドラホールディングス	0.2	0.9	615
アレンザホールディングス	1.1	1.2	1,107

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
串カツ田中ホールディングス	0.4	0.4	727
パロックジャパンリミテッド	1	1.2	942
クスリのアオキホールディングス	1.5	1.6	11,056
力の源ホールディングス	—	1	766
FOOD & LIFE COMPANIES	8.5	8.9	22,365
メディカルシステムネットワーク	1.3	1.6	652
一家ホールディングス	—	0.4	248
ジャパンクラフトホールディングス	—	0.6	376
はるやまホールディングス	0.7	0.9	390
ノジマ	2.6	5.7	7,022
カップ・クリエイト	2.1	2.5	3,485
ライトオン	1.2	1.3	800
良品計画	16.8	20	28,300
バリミキホールディングス	1.9	2.4	614
アドヴァングループ	1.5	1.5	1,309
アルビス	0.5	0.5	1,189
コナカ	1.8	2	668
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.2	323
G-7ホールディングス	1.4	2	3,106
イオン北海道	1.9	2.3	2,679
コジマ	2.5	3	1,848
ヒマラヤ	0.6	0.6	548
コーナン商事	2.1	2.5	7,625
エコス	0.6	0.6	1,092
ワタミ	—	2.1	1,871
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	29.2	34.7	83,384
西松屋チェーン	3.2	3.4	4,603
ゼンショーホールディングス	7.8	8.5	31,067
幸楽苑ホールディングス	0.9	1	1,062
ハークスレイ	0.8	0.8	400
サイゼリヤ	2.2	2.6	6,845
V Tホールディングス	5.5	6.6	3,154
魚力	0.5	0.5	1,024
フジ・コーポレーション	0.8	0.9	1,125
ユナイテッドアローズ	1.7	1.8	3,573
ハイデイ日高	2.1	2.5	4,625
YU-WA Creation Holdings	1.2	1.3	287
コロワイド	4.9	7.1	12,716
ピーシーデポコーポレーション	1.9	2.2	638
老番屋	1	1.2	5,454
PLANT	0.5	0.4	256

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スギホールディングス	2.9	3.5	20,615
薬王堂ホールディングス	0.6	0.9	2,385
スクロール	2.1	2.7	1,873
ヨンドシーホールディングス	1.3	1.5	2,565
木曾路	1.9	2.3	4,951
S R Sホールディングス	2	2.6	2,285
千趣会	2.7	2.9	1,154
リテールパートナーズ	1.8	2.3	2,732
ケーヨー	2.7	3.2	2,864
上新電機	1.7	1.7	3,260
日本瓦斯	7.1	8.3	17,571
ロイヤルホールディングス	2.5	3	6,972
東天紅	0.2	0.2	160
いなげや	1.6	1.7	1,900
チヨダ	1.5	1.5	1,080
ライフコーポレーション	1.4	1.4	3,164
リンガーハット	1.8	2	4,278
MrMa x HD	2	2.2	1,500
AOKIホールディングス	2.9	3.4	2,437
オークワ	2.3	2.5	2,280
コメリ	2.3	2.7	7,119
青山商事	3.3	3.3	3,405
しまむら	1.7	2	24,400
はせがわ	1	1	416
高島屋	10.6	11.7	21,200
松屋	3.3	2.9	2,923
エイチ・ツー・オー リテイリング	6.9	7.5	9,352
近鉄百貨店	0.6	0.5	1,241
丸井グループ	12.3	12.5	30,387
アクシアル リテイリング	1.2	1.2	4,146
イオン	56.1	57.2	158,186
イズミ	3	2.7	8,140
平和堂	2.7	2.6	4,885
フジ	1.8	3.8	6,957
ヤオコー	1.7	2	12,780
ゼビオホールディングス	1.8	2.4	2,416
ケーズホールディングス	12.4	14.8	17,212
Olympicグループ	0.8	0.8	410
日産東京販売ホールディングス	2.3	2.6	699
シルバライフ	0.3	0.4	568
Genky DrugStores	0.6	0.8	2,952

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ナルミヤ・インターナショナル	0.3	0.4	334
ブックオフグループホールディングス	0.9	1	1,188
ギフトホールディングス	0.2	0.3	954
アインホールディングス	2.1	2.1	13,356
元気寿司	0.4	0.5	1,620
ヤマダホールディングス	48.9	61.4	29,901
アーケランズ	2.3	2.7	4,128
ニトリホールディングス	5.8	6.9	92,149
愛眼	1.4	1.4	249
ケーユーホールディングス	0.8	0.9	1,086
吉野家ホールディングス	4.8	6.1	13,926
松屋フーズホールディングス	0.7	0.8	3,200
サガミホールディングス	2.2	2.5	3,007
関西フードマーケット	1.1	1.4	2,014
王将フードサービス	1	1.2	7,584
プレナス	1.7	2	5,270
ミニストップ	1.1	1.3	1,835
アークス	2.8	3.1	6,131
バローホールディングス	3	3.6	6,246
藤久	0.4	—	—
ベルク	0.7	0.8	4,472
大庄	0.8	0.9	923
ファーストリテイリング	2	2.3	191,337
サンドラッグ	5.5	6.5	22,392
サックスパー ホールディングス	1.3	1.7	1,198
ヤマザワ	0.4	0.4	476
やまや	0.3	0.4	996
ベルーナ	3.2	3.8	2,766
銀行業 (5.4%)			
いよぎんホールディングス	—	19.4	14,142
しずおかフィナンシャルグループ	—	35.8	34,618
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	12.2	11,102
島根銀行	0.5	0.6	272
じもとホールディングス	1	1.2	537
めぶきフィナンシャルグループ	75.9	71.4	21,134
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1.8	2	4,452
九州フィナンシャルグループ	29.8	30.4	12,038
ゆうちょ銀行	41.4	40.9	40,981
富山第一銀行	3.5	3.9	1,696
コンコルディア・フィナンシャルグループ	89.1	85.9	41,403
西日本フィナンシャルホールディングス	9.5	9.2	7,258

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三十三フィナンシャルグループ	1.3	1.4	2,114
第四北越フィナンシャルグループ	2.4	2.5	6,735
ひろぎんホールディングス	21.5	22.2	14,052
おきなわフィナンシャルグループ	1.3	1.5	3,129
十六フィナンシャルグループ	1.8	2	5,174
北國フィナンシャルホールディングス	1.4	1.4	7,056
プロクレアホールディングス	—	1.8	3,972
あいちフィナンシャルグループ	—	2.1	4,204
新生銀行	11.9	11.3	25,436
あおぞら銀行	8.7	9.7	25,142
三菱UFJフィナンシャル・グループ	999.6	1,016.3	720,963
りそなホールディングス	162.9	183.7	106,582
三井住友トラスト・ホールディングス	27.6	28.8	125,510
三井住友フィナンシャルグループ	101.1	112.7	474,692
千葉銀行	48.8	49	41,993
群馬銀行	30.1	27.9	11,606
武蔵野銀行	2.2	2.2	3,927
千葉興業銀行	3.7	3.7	1,098
筑波銀行	6.1	6.8	1,326
七十七銀行	4.6	4.6	8,611
青森銀行	1.1	—	—
秋田銀行	0.9	1	1,663
山形銀行	1.7	1.6	1,689
岩手銀行	1	1.1	2,028
東邦銀行	13.1	12.5	2,612
東北銀行	0.7	0.8	771
みちのく銀行	1	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	13.2	12.5	33,250
静岡銀行	35.6	—	—
スルガ銀行	12.8	15.2	6,125
八十二銀行	32.9	32.2	15,971
山梨中央銀行	1.7	1.8	1,960
大垣共立銀行	2.9	3	5,421
福井銀行	1.3	1.4	1,919
清水銀行	0.6	0.6	873
富山銀行	0.3	0.3	493
滋賀銀行	2.9	2.8	7,467
南都銀行	2.1	2.3	5,053
百五銀行	13.2	14.5	4,872
京都銀行	5.2	5.4	30,726
紀陽銀行	5.2	5.2	7,675

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ほくほくフィナンシャルグループ	9.7	9.8	8,996
山陰合同銀行	9.2	9.7	7,178
中国銀行	12.6	—	—
鳥取銀行	0.5	0.6	656
伊予銀行	19.4	—	—
百十四銀行	1.6	1.6	2,758
四国銀行	2.1	2.3	2,019
阿波銀行	2.2	2.3	4,422
大分銀行	0.8	0.9	1,664
宮崎銀行	0.9	0.9	2,048
佐賀銀行	0.8	0.9	1,407
琉球銀行	3.2	3.8	3,009
セブン銀行	48.8	51.5	14,059
みずほフィナンシャルグループ	198.5	208.2	338,845
高知銀行	0.6	0.6	386
山口フィナンシャルグループ	18.3	17.3	13,995
長野銀行	0.5	0.5	610
名古屋銀行	1.2	1.1	3,448
北洋銀行	22	21.7	5,294
愛知銀行	0.5	—	—
中京銀行	0.6	—	—
大光銀行	0.5	0.5	579
愛媛銀行	2.1	2.3	2,033
トマト銀行	0.6	0.6	589
京葉銀行	6.3	7.3	3,752
栃木銀行	7	7.8	2,457
北日本銀行	0.5	0.5	942
東和銀行	2.6	2.9	1,537
福島銀行	1.7	1.9	408
大東銀行	0.7	0.8	500
トモニホールディングス	11.3	12.6	4,195
フィデアホールディングス	1.4	1.6	2,112
池田泉州ホールディングス	16.9	18.5	4,088
証券・商品先物取引業 (0.7%)			
F P G	5	5.9	6,891
ジャパンインベストメントアドバイザー	1.1	1.2	1,621
マーキュリアホールディングス	0.5	1	612
S B I ホールディングス	18	21.4	57,095
ジャフコ グループ	1.9	6	14,016
大和証券グループ本社	109.5	111.5	64,290
野村ホールディングス	222.9	265.2	127,030

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岡三証券グループ	12.5	12.6	4,195
丸三証券	4.4	5.2	2,178
東洋証券	5.1	5.3	1,266
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	15.6	17.3	5,968
光世証券	0.4	0.4	151
水戸証券	4	4.2	1,008
いちよし証券	2.9	2.9	1,774
松井証券	7.2	8.6	6,682
マネックスグループ	13.1	14.7	7,247
極東証券	2	2	1,306
岩井コスモホールディングス	1.5	1.7	2,128
アイザワ証券グループ	2.6	2.4	1,593
マネーパートナーズグループ	1.7	1.9	535
スパークス・グループ	6.9	1.6	2,310
保険業 (2.3%)			
かんぽ生命保険	18.1	17.5	38,185
S O M P O ホールディングス	25.8	24.7	151,905
アニコム ホールディングス	4.1	5.3	3,095
M S & A D インシュアランスグループ ホールディングス	35.5	35.7	141,336
第一生命ホールディングス	71.9	84.6	199,909
東京海上ホールディングス	48.1	144.9	385,361
T & D ホールディングス	43.7	38.6	55,777
アドバンスクリエイト	0.7	0.8	780
その他金融業 (1.1%)			
全国保証	3.8	4.1	19,762
あんしん保証	0.5	0.7	177
ジェイリース	0.5	0.6	1,608
イントラスト	0.4	0.8	503
日本モーゲージサービス	0.8	1	836
C a s a	0.4	0.6	501
アルヒ	2.2	2.6	3,629
プレミアグループ	0.7	2.7	4,368
ネットプロテクションズホールディングス	—	5.3	2,406
クレディセゾン	8.5	10.1	15,776
芙蓉総合リース	1.5	1.5	12,330
みずほリース	2.3	2.2	7,051
東京センチュリー	3.4	2.7	13,338
日本証券金融	6.2	6.8	5,929
アイフル	24.6	29.1	11,436
リコーリース	1.2	1.5	5,430
イオンフィナンシャルサービス	9	9.4	13,507

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アコム	28.9	34.2	11,012
ジャックス	1.6	1.7	6,103
オリエントコーポレーション	39.5	4.6	5,308
オリックス	88.7	103.2	223,582
三菱HCキャピタル	50.6	56.1	35,904
九州リースサービス	0.7	0.8	493
日本取引所グループ	39.4	40.4	80,800
イー・ギャランティ	1.7	2.6	6,312
アサックス	0.7	0.9	519
NECキャピタルソリューション	0.6	0.7	1,474
不動産業 (2.2%)			
大東建託	—	5.7	80,598
いちご	16.5	19.7	6,520
日本駐車場開発	16.5	17.8	4,307
スター・マイカ・ホールディングス	0.8	0.7	989
SREホールディングス	0.2	0.5	1,932
ADワークスグループ	3.4	4.7	770
ヒューリック	34.9	33.6	35,280
三栄建築設計	0.6	0.8	1,224
野村不動産ホールディングス	8.4	9	30,330
三重交通グループホールディングス	3.1	3.8	1,960
サムディ	2.1	2.3	5,372
ディア・ライフ	2.1	2.3	1,419
コーセーアールイー	0.6	0.7	462
地主	1	1.2	2,406
ブレサンスコーポレーション	2.4	2	3,004
THEグローバル社	1.2	1.5	375
ハウスコム	0.3	0.5	502
JPMC	0.8	0.8	815
サンセイランディック	0.5	0.6	514
エストラスト	0.3	0.4	230
フージャースホールディングス	2.5	2.4	1,869
オープンハウスグループ	4.7	5.3	28,090
東急不動産ホールディングス	39.8	47.3	35,758
飯田グループホールディングス	12.2	14.2	30,075
イーグランド	0.3	0.3	499
ムゲンエステート	1.1	1.3	616
ビーロッド	1.1	1.3	718
ファーストブラザーズ	0.4	0.5	445
And Doホールディングス	0.8	1	872
シーアールイー	0.4	0.7	930

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
プロパティエージェント	0.3	0.3	408
ケイアイスター不動産	0.5	0.8	3,752
アグレ都市デザイン	0.4	0.4	604
グッドコムアセット	0.7	0.7	1,111
ジェイ・エス・ビー	0.3	0.4	1,550
ロードスターキャピタル	—	0.7	1,183
テンポイノベーション	0.5	0.6	556
グローバル・リンク・マネジメント	0.3	0.5	504
フェイスネットワーク	0.2	0.3	398
パーク24	7.9	11.3	21,854
バラカ	0.4	0.6	1,123
三井不動産	66.6	67.8	191,704
三菱地所	96	98.9	184,794
平和不動産	2.5	2.8	11,368
東京建物	14.5	13.8	28,110
ダイビル	3.7	—	—
京阪神ビルディング	2.6	2.4	3,002
住友不動産	32.8	31.3	106,607
テアオーシー	2.8	2.8	2,116
東京築天地	0.3	0.3	1,273
スターツコーポレーション	1.8	2.4	6,204
フジ住宅	1.8	2.2	1,377
空港施設	1.7	1.9	1,039
明和地所	0.8	1	612
ゴールドクレスト	1.4	1.4	2,440
エスリード	0.6	0.7	1,235
日神グループホールディングス	2.3	3.1	1,345
日本エスコ	2.8	3.4	2,784
MIRARTHホールディングス	6.5	7.6	3,047
AVANTIA	0.9	1	789
イオンモール	7.4	8.8	14,097
毎日コムネット	0.6	0.8	544
ファースト住建	0.6	0.8	875
カチタス	3.6	4.3	13,910
トーセイ	2.1	2.5	3,407
サンフロンティア不動産	1.9	2.5	2,825
FJネクストホールディングス	1.5	1.8	1,798
インテリックス	0.5	0.6	326
ランドビジネス	0.8	1.1	248
グランディハウス	1.2	1.4	775
日本空港ビルデング	5.1	5.6	34,832

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サービス業 (5.5%)			
明豊ファシリティアワークス	0.6	0.8	540
日本工営	0.8	1.1	3,718
L I F U L L	4.4	5	825
M I X I	3.6	3.8	8,895
ジェイエシーリクルートメント	1.2	1.4	3,381
日本M&Aセンターホールディングス	23.2	27.6	49,404
メンバーズ	0.4	0.4	1,114
中広	0.2	0.3	127
UTグループ	2	2.4	5,738
アイティメディア	0.5	0.8	1,419
E・Jホールディングス	0.8	1	1,268
夢真ビーネックスグループ	3.8	5.5	9,757
コシダカホールディングス	3.8	4.5	4,734
アルトナー	0.3	0.4	408
パソナグループ	1.5	1.8	3,558
CDS	0.4	0.4	731
リンクアンドモチベーション	3.2	4.3	3,762
エス・エム・エス	4.8	5.7	18,696
サニーサイドアップグループ	0.5	0.6	348
パーソルホールディングス	14.2	16.8	50,198
リニカル	0.8	0.9	667
クックパッド	4.5	4.1	832
エスクリ	0.5	0.8	291
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.7	0.8	503
学情	0.6	0.7	963
スタジオアリス	0.7	0.8	1,658
シミックホールディングス	0.8	0.8	1,348
エプコ	0.3	0.4	262
NJS	0.3	0.3	616
総合警備保障	5.6	6.1	22,905
カカコム	10.5	12.3	31,746
アイロムグループ	0.5	0.6	1,552
セントケア・ホールディング	1.1	1.1	926
サイネックス	0.3	0.3	172
ルネサンス	0.9	1.1	1,032
ディップ	2.2	3	12,345
デジタルホールディングス	1	1.2	1,405
新日本科学	1.7	2	5,556
キャリアデザインセンター	0.4	0.4	597
ベネフィット・ワン	5.2	6.1	13,767

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エムスリー	25	29.7	132,283
ツカダ・グローバルホールディング	0.9	1	370
プラス	0.2	0.2	186
アウトソーシング	8.1	8.9	10,315
ウェルネット	1.5	1.4	928
ワールドホールディングス	0.6	0.7	1,809
ディー・エヌ・エー	6	6.4	12,640
博報堂DYホールディングス	19.7	21.3	27,796
ぐるなび	2.5	2.4	1,039
タカミヤ	1.8	2	786
ジャパンバストレスキューシステム	1	0.9	693
ファンコムコミュニケーションズ	3.6	2.9	1,284
ライク	0.4	0.5	958
ビジネス・ブレークスルー	0.6	0.7	281
エスプール	4	4.3	4,106
WDBホールディングス	0.6	0.8	2,029
手間いらず	0.2	—	—
ティア	0.9	1	426
CDG	0.1	0.2	243
アドウエイズ	2.3	2.1	1,602
バリューコマース	1.1	1.1	2,525
インフォマート	15.5	15.7	7,488
J Pホールディングス	4.1	4.3	1,264
エコナックホールディングス	2.8	3.1	282
CLホールディングス	0.3	0.4	344
プレステージ・インターナショナル	5.3	6.3	4,284
アミューズ	0.8	0.9	1,635
ドリームインキュベータ	0.5	0.5	1,115
クイック	0.9	1	1,891
TAC	0.8	0.9	187
電通グループ	14.6	15.8	75,998
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.7	0.8	1,310
びあ	0.4	0.5	1,657
イオンファンタジー	0.6	0.6	1,806
シーティーエス	1.6	1.9	1,502
ネクシィーズグループ	0.5	0.5	339
H. U. グループホールディングス	4	4.4	12,183
アルプス技研	1.3	1.3	2,615
ダイオーズ	0.3	0.3	449
日本空調サービス	1.5	1.7	1,259
オリエンタルランド	15.1	17.9	343,232

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
ダスキン	3.3	3.6	10,396	
明光ネットワークジャパン	1.7	1.9	1,143	
ファルコホールディングス	0.7	0.7	1,235	
秀英予備校	0.3	0.4	178	
ラウンドワン	4.8	14.1	8,770	
リゾートトラスト	6.5	7.1	15,790	
ビー・エム・エル	1.8	2.2	7,590	
りらいあコミュニケーションズ	2.2	2.5	2,500	
リソー教育	7.2	7.7	2,348	
早稲田アカデミー	0.6	0.9	1,045	
ユー・エス・エス	15.8	18.8	41,848	
東京個別指導学院	1.3	1.5	765	
サイバーエージェント	34.9	35.9	46,490	
楽天グループ	72.6	69.4	46,636	
クリーク・アンド・リバー社	0.7	0.9	1,822	
モーニングスター	2.1	2.9	1,351	
テー・オー・ダブリュ	2.6	3.1	951	
山田コンサルティンググループ	0.8	0.8	972	
セントラルスポーツ	0.5	0.6	1,438	
フルキャストホールディングス	1.2	1.4	4,130	
エン・ジャパン	2.5	3	7,833	
リソルホールディングス	0.2	0.2	892	
テクノプロ・ホールディングス	8.5	10.1	34,794	
アトラグループ	0.4	0.4	76	
インターワークス	0.5	0.5	194	
アイ・アールジャパンホールディングス	0.6	0.8	1,761	
Keeper 技研	0.9	1.1	4,174	
ファーストロジック	0.3	0.3	240	
三機サービス	0.3	0.3	280	
Gunosy	0.9	0.9	585	
デザインワン・ジャパン	0.4	0.5	103	
イー・ガーディアン	0.6	0.6	1,815	
リブセンス	0.9	0.8	232	
ジャパンマテリアル	4.3	5.2	9,968	
ベクトル	1.8	2.4	2,632	
ウチヤマホールディングス	0.7	0.9	270	
チャーム・ケア・コーポレーション	1.1	1.2	1,292	
キャリアリンク	0.5	0.6	1,459	
IBJ	1.2	0.9	877	
アサンテ	0.5	0.7	1,110	
バリューHR	0.6	1.3	2,034	

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
M&Aキャピタルパートナーズ	1.2	1.4	5,257	
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.6	0.7	739	
ERIホールディングス	0.4	0.5	537	
アビスト	0.2	0.3	859	
シグマクス・ホールディングス	0.8	2	2,350	
ウィルグループ	1.1	1.2	1,728	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.2	1.9	281	
メドピア	1.1	1.2	1,861	
レアジョブ	0.3	0.3	300	
リクルートホールディングス	101.4	120.5	556,830	
エラン	2	2	2,252	
土木管理総合試験所	0.7	0.7	216	
ネットマーケティング	0.7	0.8	718	
日本郵政	107	183.8	183,542	
ベルシステム24ホールディングス	2.4	2.4	3,410	
鎌倉新書	1.5	1.9	1,520	
SMN	0.3	0.4	197	
一蔵	0.2	0.2	95	
グローバルキッズCOMPANY	0.3	0.3	173	
エアトリ	0.9	1	2,475	
アトラエ	1	1.2	1,794	
ストライク	0.5	0.7	2,793	
ソラスト	3.5	4.1	3,640	
セラク	0.5	0.6	720	
インソース	1.4	1.9	5,572	
ペイカレント・コンサルティング	0.9	1.2	47,640	
Orchestra Holdings	0.3	0.3	741	
アイモバイル	0.4	0.8	944	
キャリアインデックス	0.6	0.6	251	
MS-Japan	0.6	0.7	574	
船場	0.3	0.3	232	
グレイステクノロジー	1.5	—	—	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4.1	5.3	9,243	
フルテック	0.2	0.3	339	
グリーンズ	—	0.6	562	
ツナググループ・ホールディングス	0.4	0.5	218	
GameWith	0.4	0.5	185	
ソウルアウト	0.3	—	—	
MS&Consulting	0.3	0.2	126	
ウエルビー	0.5	1.1	1,026	
エル・ティール・エス	0.2	0.2	618	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ミダックホールディングス	0.6	0.8	2,956
日総工産	1.1	1.3	731
キュービーネットホールディングス	0.7	0.8	1,038
RPAホールディングス	1.7	2.4	729
スプリックス	0.4	0.6	567
マネジメントソリューションズ	0.7	0.8	2,394
ブロード・パートナーズ	0.3	0.4	212
and factory	0.4	0.5	206
テノ.ホールディングス	0.2	0.2	113
フロンティア・マネジメント	0.4	0.5	606
ピアラ	0.3	0.3	207
コプロ・ホールディングス	0.2	0.3	268
ギークス	0.3	0.3	247
カーブスホールディングス	3.9	4.6	3,988
フォーラムエンジニアリング	1	1	925
Fast Fitness Japan	—	0.3	428
ダイレクトマーケティングミックス	0.8	1.7	2,888
ポピンズ	0.3	0.2	314
LITALICO	1.2	1.4	4,270
アドバンテッジリスクマネジメント	0.7	0.8	344
リロググループ	7.7	9.2	19,697
東祥	0.9	1.3	1,449
ビーウィズ	—	0.5	586
TREホールディングス	1.9	3.1	4,953
人・夢・技術グループ	0.6	0.7	1,874
エイチ・アイ・エス	3.1	3.9	7,932
ラックランド	0.4	0.5	1,387
共立メンテナンス	2.3	3	17,490
イチネンホールディングス	1.5	1.7	2,169
建設技術研究所	0.8	0.8	2,380
スペース	1	1.1	960
燦ホールディングス	0.6	0.7	1,202
スバル興業	0.1	0.1	850
東京アートル	0.6	0.6	668

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
タナベコンサルティンググループ	0.6	0.6	373	
ナガワ	0.5	0.5	3,650	
東京都競馬	1.1	1.3	5,024	
常磐興産	0.6	0.6	711	
カナモト	2.5	2.7	5,737	
西尾レントオール	1.3	1.4	4,207	
トランス・コスモス	1.3	2.1	7,444	
乃村工藝社	6.1	7.2	7,675	
藤田観光	0.6	0.7	2,131	
KNT-C Tホールディングス	0.8	1	1,647	
日本管財	1.5	1.8	4,500	
トーカイ	1.4	1.3	2,418	
白洋舎	—	0.2	312	
セコム	13.9	16.6	143,573	
セントラル警備保障	0.7	0.8	2,026	
丹青社	2.7	3.2	2,595	
メイテック	1.7	6	14,832	
応用地質	1.6	1.5	3,333	
船井総研ホールディングス	2.9	3.2	8,432	
進学会ホールディングス	0.6	0.6	186	
オオバ	1	1	690	
いであ	0.4	0.4	612	
学究社	0.4	0.5	822	
ベネッセホールディングス	5.2	5.6	12,118	
イオンディライト	1.7	1.9	5,646	
ナック	0.7	0.8	735	
ダイセキ	2.8	3.1	13,965	
ステップ	0.5	0.6	1,138	
合 計	株数・金額	16,105	18,053	43,156,227
	銘柄数<比率>	2,123	2,115	<98.6%>

(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	
			買建額	売建額
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ先物	百万円 575	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	千円 43,156,227	% 98.6
コール・ローン等、その他	604,557	1.4
投資信託財産総額	43,760,784	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	44,429,869,805	
コール・ローン等	148,573,517	
株式(評価額)	43,156,227,610	
未収入金	21,683,500	
未収配当金	453,000,178	
差入委託証拠金	650,385,000	
(B) 負債	678,709,562	
未払解約金	9,624,321	
未払利息	241	
差入委託証拠金代用有価証券	669,085,000	
(C) 純資産総額(A-B)	43,751,160,243	
元本	22,875,362,128	
次期繰越損益金	20,875,798,115	
(D) 受益権総口数	22,875,362,128口	
1万口当たり基準価額(C/D)	19,126円	

(注) 当ファンドの期首元本額は21,309,131,563円、期中追加設定元本額は3,195,854,871円、期中一部解約元本額は1,629,624,306円です。

(注) 2022年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・DCインデックスバランス(株式80)	4,651,930,057円
・DCインデックスバランス(株式60)	4,264,520,991円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,238,040,982円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,446,891,512円
・DCインデックスバランス(株式40)	2,151,421,241円
・インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,697,661,452円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,049,367,499円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,030,777,683円
・DCインデックスバランス(株式20)	812,653,264円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	685,625,100円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	600,774,622円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	245,697,725円

(注) 1口当たり純資産額は1,9126円です。

(注) 2022年10月26日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

・株式	530,690千円
-----	-----------

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○損益の状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,120,464,508	
受取配当金	1,119,819,678	
その他収益金	691,722	
支払利息	△ 46,892	
(B) 有価証券売買損益	△ 1,994,049,870	
売買益	2,790,739,134	
売買損	△ 4,784,789,004	
(C) 先物取引等取引損益	6,742,650	
取引益	91,224,000	
取引損	△ 84,481,350	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 866,842,712	
(E) 前期繰越損益金	20,442,896,044	
(F) 追加信託差損益金	2,753,007,206	
(G) 解約差損益金	△ 1,453,262,423	
(H) 計(D+E+F+G)	20,875,798,115	
次期繰越損益金(H)	20,875,798,115	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

〇お知らせ

約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2022年10月26日）
（2021年10月27日～2022年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2000年5月17日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<935026>

【運用報告書の表記について】

・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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	騰落	中率	(ベンチマーク) 騰落	中率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
19期(2018年10月26日)	23,897	1.0	161.04	△ 1.2	95.9	1.7	2.4	90,718
20期(2019年10月28日)	26,268	9.9	173.01	7.4	95.7	2.0	2.8	185,690
21期(2020年10月26日)	28,388	8.1	183.11	5.8	96.4	1.3	2.3	231,675
22期(2021年10月26日)	41,177	45.1	261.23	42.7	96.5	1.3	2.3	254,055
23期(2022年10月26日)	44,171	7.3	274.85	5.2	96.2	1.9	2.2	258,049

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の(円ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2022年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク) 騰落	率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2021年10月26日	41,177	—	261.23	—	96.5	1.3	2.3
10月末	41,392	0.5	262.51	0.5	96.2	1.7	2.3
11月末	41,241	0.2	261.00	△0.1	94.8	1.8	2.3
12月末	42,928	4.3	271.51	3.9	95.3	1.3	2.3
2022年1月末	39,927	△3.0	252.31	△3.4	96.2	1.5	2.3
2月末	39,660	△3.7	250.44	△4.1	96.5	1.1	2.3
3月末	43,894	6.6	276.37	5.8	96.7	0.9	2.4
4月末	42,017	2.0	263.96	1.0	96.1	1.4	2.6
5月末	41,897	1.7	262.71	0.6	95.8	1.8	2.4
6月末	40,924	△0.6	256.16	△1.9	95.8	1.8	2.4
7月末	42,542	3.3	265.63	1.7	96.6	1.4	2.5
8月末	42,839	4.0	267.03	2.2	96.0	1.6	2.4
9月末	40,741	△1.1	253.24	△3.1	95.4	1.3	2.3
(期末)							
2022年10月26日	44,171	7.3	274.85	5.2	96.2	1.9	2.2

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○運用経過

(2021年10月27日～2022年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め41,177円の基準価額は、期間末に44,171円となり、騰落率は+7.3%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

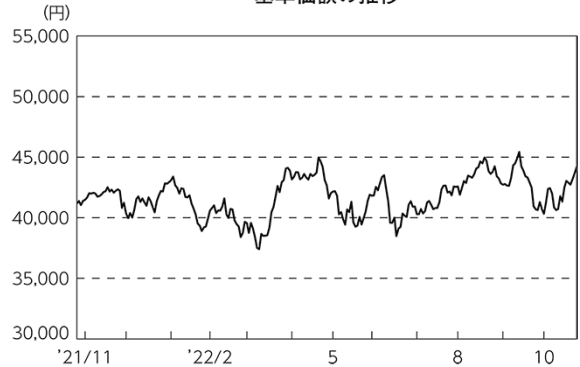
<値上がり要因>

- ・新型コロナウイルスの新たな変異株は重症化しにくいとの見解から景気への悪影響は限定的との見方が強まったこと。
- ・円安/アメリカドル高、円安/ユーロ高、円安/イギリスポンド高となったこと。

<値下がり要因>

- ・ロシアによるウクライナ侵攻を受けたサプライチェーン（供給網）の混乱などからインフレ高進が警戒されたこと。
- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）が大幅な利上げを実施し、急激な金融引き締めによる景気後退への警戒感が強まったことや、欧州中央銀行（ECB）が政策金利の引き上げ開始や大幅な利上げの可能性を示唆したこと。
- ・経済政策シンポジウム（ジャクソンホール会議）においてFRB議長がインフレ抑制を優先し利上げを継続する姿勢を強調したことを受けて、金融引き締めの長期化観測が強まったこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2021/10/26	2022/09/13	2022/03/09	2022/10/26
41,177円	45,424円	37,417円	44,171円

MSCI-KOKUSAIインデックス
(円ヘッジなし・円ベース) (指数化) の推移

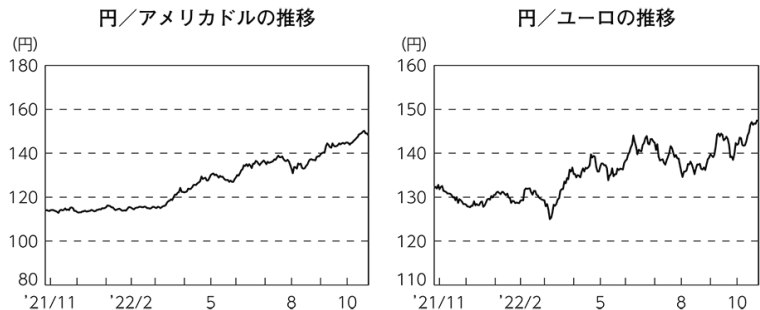
（海外株式市況）

海外株式市場では、期間の初めと比べて欧米各国の株価は総じて下落しました。

期間の初めから、2021年12月下旬にかけては、米国や欧州の主要企業の業績が概ね堅調となったことや、新型コロナウイルスの新たな変異株は重症化しにくいとの見解から景気への悪影響は限定的との見方が強まったことなどから欧米各国の株価は概して上昇しました。2022年1月上旬から期間末にかけては、FRBがインフレ抑制のため早期利上げを開始し金融政策の正常化を加速させるとの見方が広がったことや、ロシアによるウクライナ侵攻を受けたサプライチェーンの混乱などからインフレ高進が警戒されたこと、FRBが大幅な利上げを実施し、急激な金融引き締めによる景気後退への警戒感が強まったこと、ECBが政策金利の引き上げ開始や大幅な利上げの可能性を示唆したこと、ジャクソンホール会議においてFRB議長がインフレ抑制を優先し利上げを継続する姿勢を強調したことを受けて、金融引き締めの長期化観測が強まったことなどを背景に、欧米各国の株価は総じて下落しました。

（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、7.3%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率5.2%を概ね2.1%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・ 現物株式、株式先物の組入れに基づく要因が寄与したこと。
- ・ 株式配当金を受け取ったこと。

<マイナス要因>

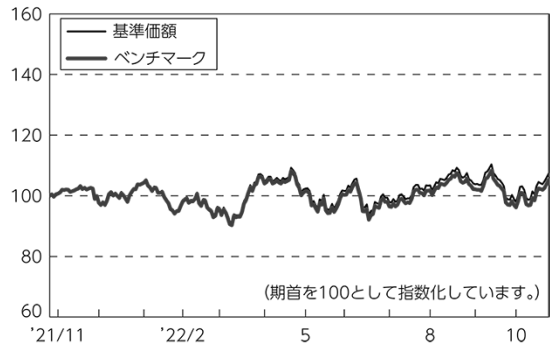
- ・ 海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.004	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.003	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	7	0.016	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(9)	(0.021)	
(そ の 他)	(△ 2)	(△0.005)	
合 計	10	0.023	
期中の平均基準価額は、41,666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

(2021年10月27日～2022年10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 11,448 (10,035)	千アメリカドル 117,616 (3,786)	百株 16,022 (443)	千アメリカドル 169,685 (6,585)
	カナダ	1,293 (662)	千カナダドル 7,336 (947)	2,428	千カナダドル 10,600
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	624 (465)	3,122 (808)	1,148 (221)	5,430 (633)
	イタリア	1,587 (ー)	687 (△ 1)	3,263	1,010
	フランス	618 (477)	3,601 (862)	1,279 (230)	6,844 (864)
	オランダ	477 (80)	2,959 (64)	805 (ー)	3,616 (78)
	スペイン	762 (9,017)	873 (55)	10,639 (ー)	1,471 (56)
	ベルギー	74 (10)	608 (8)	73 (9)	395 (0.64)
	オーストリア	ー	ー	53	66
	ルクセンブルク	150	139	269	452
	フィンランド	104	191	218	463
	アイルランド	25	105	40	194
	ポルトガル	32	32	137	94
	スイス	ー	ー	8	27
	イギリス	5,962 (7,551)	千イギリスポンド 4,433 (8,710)	13,706 (6,270)	千イギリスポンド 8,344 (10,595)
	スイス	535 (84)	千スイスフラン 4,723 (138)	859 (6)	千スイスフラン 6,860 (253)
	スウェーデン	1,775 (3,184)	千スウェーデンクローナ 35,090 (27,810)	2,066 (1,193)	千スウェーデンクローナ 28,645 (27,426)
	ノルウェー	378	千ノルウェークローネ 9,157	340	千ノルウェークローネ 5,687
	デンマーク	174	千デンマーククローネ 7,712	277	千デンマーククローネ 13,930

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 3,044 (1,599)	千オーストラリアドル 5,133 (3,280)	百株 6,005 (159)	千オーストラリアドル 7,936 (484)
	ニュージーランド	19	千ニュージーランドドル 54	632	千ニュージーランドドル 469
	香港	1,608	千香港ドル 6,546	4,063	千香港ドル 11,602
	シンガポール	217	千シンガポールドル 237	1,107 (-)	千シンガポールドル 767 (3)
	イスラエル	864	千イスラエルシェケル 1,456	47	千イスラエルシェケル 377

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	700	104	250	35
	PROLOGIS INC	1,990 (6,927)	261 (812)	3,230	444
	AMERICAN TOWER CORP	1,725	432	2,285	564
	AGNC INVESTMENT CORP	—	—	19,130	233
	VEREIT INC	— (△ 8,272)	— (△ 429)	—	—
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,380	456	1,200	39
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,580 (△ 46,673)	37 (—)	4,250	35
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	155	28
	BOSTON PROPERTIES INC	—	—	260	32
	CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	340	48
	CROWN CASTLE INC	1,110	203	1,740	292
	DIGITAL REALTY TRUST INC	450	61	910	113
	DUKE REALTY CORPORATION	— (△ 14,585)	— (△ 812)	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	680	49	430	26
	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	—	—	950	74
	EQUINIX INC	320	223	415	279
	EXTRA SPACE STORAGE INC	180	33	330	63
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,370	452	—	—
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,000	264	—	—
	WELLTOWER INC	1,000	85	970	71
	IRON MOUNTAIN INC	880	43	1,710	88
	KIMCO REALTY CORP	24,630	576	2,800	50
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3,370	52	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	240	41	190	29
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	—	11,160	310
	ORION OFFICE REIT INC	—	—	2,086	36
	ORION OFFICE REIT INC(N)	— (2,086)	— (44)	—	—
	PUBLIC STORAGE	245	80	445	163
	REALTY INCOME CORP	1,360	93	— (—)	— (44)
	REALTY INCOME CORP(N)	— (5,831)	— (429)	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	—	—	690	45
	SBA COMMUNICATIONS CORP	180	62	400	126
	SIMON PROPERTY GROUP INC	—	—	860	103
	SUN COMMUNITIES INC	1,020	131	760	121
	UDR INC	3,910	230	1,400	82
	VENTAS INC	660	33	590	23
	VICI PROPERTIES INC	16,670	492	2,400	78
	WEYERHAEUSER CO	—	—	1,160	48
	WP CAREY INC	2,860	228	2,010	166
小	計	102,510 (△ 54,686)	4,734 (44)	65,506 (—)	3,860 (44)

銘	柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
ユーロ		口	千ユーロ	口	千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	3,260 (-)	63 (△ 14)	1,500	34
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-	-	1,200	58
	小計	3,260 (-)	63 (△ 14)	2,700	92
ベルギー					
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	177	-	-
	小計	5,160	177	-	-
ユーロ計		8,420 (-)	240 (△ 14)	2,700	92
イギリス			千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND COMPANY PLC	-	-	6,380	29
	小計	-	-	6,380	29
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	-	-	23,900	43
	DEXUS/AU	6,480	61	-	-
	LENDLEASE GROUP	-	-	5,560	50
	STOCKLAND	-	-	14,600	47
	小計	6,480	61	44,060	141
香港			千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	-	-	10,200	628
	小計	-	-	10,200	628
シンガポール			千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	22,000 (-)	65 (△ 4)	-	-
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	-	-	-	-
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	-	-	2,750	3
	CDL HOSPITALITY TRUSTS (N)	-	-	-	-
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	33,800 (-)	63 (△0.454)	-	-
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	-	-	-
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST (N)	(-)	(△ 3)	(-)	(0.11)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUS-RTS	-	-	-	-
	MAPLETREE LOGISTICS TRUS-RTS (N)	(5,157)	(9)	(5,157)	(0.11)
	小計	55,800 (13,064)	128 (4)	2,750 (5,157)	3 (0.22)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は分割・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 36,461	百万円 35,295	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）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

(2021年10月27日～2022年10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	50,090,526千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	242,660,473千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(注) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

(2022年10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	
3M CO	224	207	2,456	364,057	資本財
ABBVIE INC	682	657	9,857	1,461,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	687	653	6,405	949,492	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	245	236	6,647	985,298	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	173	158	3,197	473,995	保険
ADVANCE AUTO PARTS INC	24	21	391	58,026	小売
AES CORP	277	251	633	93,863	公益事業
AERCAP HOLDINGS NV	—	48	248	36,887	資本財
AFLAC INC	257	229	1,420	210,599	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	117	112	1,511	224,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	87	82	2,067	306,513	素材
ALLEGHANY CORP	5	—	—	—	保険
ALLSTATE CORP	116	102	1,276	189,258	保険
ALTRIA GROUP INC	717	677	3,098	459,334	食品・飲料・タバコ
ALLIANT ENERGY CORP	82	88	446	66,160	公益事業
ALBEMARLE CORP	46	43	1,228	182,091	素材
ALLEGION PLC	38	33	325	48,290	資本財
ALLY FINANCIAL INC	140	122	331	49,204	各種金融
ALCOA CORP	—	67	277	41,205	素材
ALTICE USA INC- A	106	—	—	—	メディア・娯楽
AMPHENOL CORP-CL A	231	220	1,602	237,565	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	41	41	1,150	170,554	各種金融
AMEREN CORPORATION	109	95	761	112,827	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329	295	1,602	237,599	保険
AMERICAN EXPRESS CO	265	238	3,512	520,716	各種金融
AMETEK INC	89	85	1,049	155,626	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	198	189	1,659	246,051	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	67	67	935	138,696	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	57	57	882	130,752	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	29	26	354	52,543	保険
AMCOR PLC	632	546	626	92,830	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	181	194	131	19,420	メディア・娯楽
AON PLC	87	79	2,218	328,797	保険
APOLLO ASSET MANAGEMENT INC	72	—	—	—	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	150	819	121,480	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	91	91	389	57,717	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	213	210	1,920	284,689	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	27	25	252	37,380	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	81	79	1,392	206,459	保険
ARAMARK	78	88	311	46,122	消費者サービス
HOWMET AEROSPACE INC	146	137	489	72,565	資本財
ARISTA NETWORKS INC	21	87	982	145,581	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	23	19	299	44,375	保険
AT&T INC	2,756	2,670	4,723	700,195	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	48	47	489	72,593	公益事業
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	55	—	—	—	保険
AUTOLIV INC	25	—	—	—	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	8	7	1,785	264,738	小売
EVERY DENNISON CORP	32	30	538	79,764	素材
AVALARA INC	33	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	210	227	466	69,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	期末(前期末)				業種等
		株数	当		額	
			株数	評価		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
EQUITABLE HOLDINGS INC	171	144	423	62,756	各種金融	
BALL CORP	126	117	570	84,548	素材	
BANK OF AMERICA CORP	2,983	2,703	9,567	1,418,160	銀行	
BAXTER INTERNATIONAL INC	196	187	1,070	158,633	ヘルスケア機器・サービス	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	329	286	1,191	176,555	各種金融	
BAKER HUGHES CO	281	371	969	143,745	エネルギー	
TRUIST FINANCIAL CORP	518	497	2,179	323,044	銀行	
BECTON DICKINSON AND CO	112	106	2,397	355,364	ヘルスケア機器・サービス	
BEST BUY CO INC	90	73	485	71,997	小売	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	512	480	13,887	2,058,597	各種金融	
BIO-RAD LABORATORIES-A	8	8	334	49,588	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BILL.COM HOLDINGS INC	—	36	485	71,994	ソフトウェア・サービス	
BLACKROCK INC	59	56	3,602	534,013	各種金融	
BLACK KNIGHT INC	65	58	375	55,635	ソフトウェア・サービス	
BLACKSTONE INC	265	262	2,401	355,953	各種金融	
BORGWARNER INC	98	91	331	49,153	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	529	532	2,200	326,162	ヘルスケア機器・サービス	
BOEING CO/THE	214	209	3,071	455,235	資本財	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	55	50	514	76,264	商業・専門サービス	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	3	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	861	793	5,775	856,086	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	46	44	635	94,172	ソフトウェア・サービス	
BROWN & BROWN INC	96	90	500	74,242	保険	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	116	116	780	115,687	食品・飲料・タバコ	
BUNGE LTD	54	55	512	76,029	食品・飲料・タバコ	
BURLINGTON STORES INC	24	25	363	53,824	小売	
CARMAX INC	62	59	367	54,540	小売	
CARDINAL HEALTH INC	113	103	759	112,608	ヘルスケア機器・サービス	
CATERPILLAR INC	212	198	3,876	574,619	資本財	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	174	146	1,488	220,663	各種金融	
CARNIVAL CORP	310	350	302	44,819	消費者サービス	
COTERRA ENERGY INC	268	301	909	134,833	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	68	78	403	59,795	食品・飲料・タバコ	
CARLISLE COS INC	—	19	538	79,842	資本財	
CATALENT INC	65	65	465	68,966	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CABLE ONE INC	2	2	168	24,933	メディア・娯楽	
CARRIER GLOBAL CORP	318	316	1,178	174,713	資本財	
CARVANA CO	29	—	—	—	小売	
CBRE GROUP INC - A	132	120	869	128,959	不動産	
CENTENE CORP	229	218	1,827	270,825	ヘルスケア機器・サービス	
CELANESE CORP	39	40	392	58,213	素材	
CENTERPOINT ENERGY INC	222	222	613	90,996	公益事業	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	343	343	237	35,271	電気通信サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	55	52	335	49,667	ソフトウェア・サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	80	78	842	124,841	素材	
CHURCH & DWIGHT CO INC	96	90	687	101,891	家庭用品・パーソナル用品	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	10	1,639	243,017	消費者サービス	
CHEVRON CORP	746	696	12,182	1,805,782	エネルギー	
CHARLES RIVER LABORATORIES	19	19	418	62,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHEWY INC - CLASS A	34	34	135	20,112	小売	
CITIGROUP INC	796	719	3,261	483,458	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	155	176	715	106,041	銀行	
CIGNA CORP	131	118	3,682	545,908	ヘルスケア機器・サービス	
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	191	273	40,486	素材	
CLOROX COMPANY	49	46	652	96,731	家庭用品・パーソナル用品	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	88	97	561	83,173	ソフトウェア・サービス	
CLARIVATE PLC	124	108	109	16,292	商業・専門サービス	
CMS ENERGY CORP	122	105	586	86,935	公益事業	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
COLGATE-PALMOLIVE CO	299	294	2,139	317,193	家庭用品・パーソナル用品
CONOCOPHILLIPS	523	482	5,983	886,908	エネルギー
CONAGRA BRANDS INC	194	180	632	93,699	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA CO/THE	1,580	1,538	9,071	1,344,732	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	128	128	1,107	164,108	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	66	61	1,459	216,409	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	328	298	948	140,526	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	82	77	360	53,508	食品・飲料・タバコ
CORTEVA INC	290	272	1,771	262,602	素材
CROWN HOLDINGS INC	52	45	322	47,833	素材
CSX CORP	881	805	2,315	343,217	運輸
CUMMINS INC	56	51	1,219	180,716	資本財
CVS HEALTH CORP	510	489	4,515	669,381	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	26	21	201	29,822	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	50	45	624	92,571	消費者サービス
DANAHER CORP	249	257	6,487	961,704	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEVON ENERGY CORPORATION	262	235	1,775	263,143	エネルギー
DEERE & CO	115	108	4,245	629,276	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	101	101	383	56,904	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	51	55	186	27,712	運輸
APTIV PLC	101	101	912	135,190	自動車・自動車部品
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	121	104	1,041	154,409	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	15	13	452	67,031	消費者サービス
DOMINION ENERGY INC	315	302	2,025	300,274	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	91	84	2,105	312,041	小売
DOVER CORP	53	53	681	100,944	資本財
DUPONT DE NEMOURS INC	203	191	1,091	161,788	素材
DOW INC	288	273	1,307	193,810	素材
DOORDASH INC - A	25	69	330	48,963	小売
DR HORTON INC	133	124	942	139,680	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	80	71	784	116,275	公益事業
DUKE ENERGY CORP	297	287	2,594	384,514	公益事業
DYNATRACE INC	66	75	266	39,513	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	50	48	363	53,850	素材
EATON CORP PLC	158	149	2,177	322,699	資本財
ECOLAB INC	100	95	1,462	216,798	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	240	231	1,987	294,589	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	148	144	820	121,675	公益事業
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	165	165	219	32,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	232	220	1,863	276,223	資本財
ENTERGY CORP	71	75	786	116,561	公益事業
EOG RESOURCES INC	226	218	2,883	427,368	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	22	21	746	110,689	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	46	45	738	109,484	商業・専門サービス
EQT CORP	—	126	501	74,313	エネルギー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	91	85	1,759	260,874	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	13	14	415	61,636	保険
EVERGY INC	87	87	518	76,855	公益事業
EXXON MOBIL CORP	1,638	1,571	16,641	2,466,734	エネルギー
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14	14	586	87,005	各種金融
FAIR ISAAC CORP	10	9	419	62,222	ソフトウェア・サービス
FEDEX CORP	98	92	1,434	212,651	運輸
FIRST REPUBLIC BANK/CA	67	67	792	117,464	銀行
FIRSTENERGY CORP	223	202	759	112,551	公益事業
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	240	226	1,807	267,927	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	30	26	478	70,971	ソフトウェア・サービス
FMC CORP	51	48	574	85,123	素材
FNF GROUP	115	95	365	54,151	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
FORD MOTOR COMPANY	1,475	1,479	1,898	281,360	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	55	50	297	44,037	資本財
FORTIVE CORP	132	126	809	120,065	資本財
NEXTERA ENERGY INC	758	734	5,574	826,262	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	124	103	241	35,854	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	574	535	1,696	251,471	素材
INGERSOLL-RAND INC	152	151	741	109,849	資本財
GENERAL MOTORS CORP	515	518	1,919	284,530	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	56	53	913	135,385	小売
GENERAL ELECTRIC CO	425	407	2,973	440,698	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	94	88	2,165	320,999	資本財
GENERAL MILLS INC	234	225	1,767	262,061	食品・飲料・タバコ
GENERAC HOLDINGS INC	25	24	295	43,868	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	117	105	1,251	185,496	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	131	127	4,254	630,578	各種金融
GODADDY INC-CLASS A	70	60	479	71,075	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	16	16	884	131,160	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	28	28	168	24,997	ソフトウェア・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	138	123	860	127,540	保険
HALLIBURTON CO	346	338	1,183	175,395	エネルギー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	82	72	1,792	265,660	資本財
HCA HEALTHCARE INC	104	88	1,893	280,621	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	57	53	1,263	187,225	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	109	102	1,395	206,856	エネルギー
HP INC	473	393	1,085	160,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	506	482	668	99,128	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEICO CORP	20	18	286	42,426	資本財
HEICO CORP-CLASS A	24	24	311	46,109	資本財
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	109	104	1,359	201,587	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	269	254	4,833	716,457	資本財
HOME DEPOT INC	410	383	11,135	1,650,663	小売
HORMEL FOODS CORP	115	115	519	76,981	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	49	47	2,496	370,041	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	18	15	386	57,312	資本財
HUBSPOT INC	17	17	501	74,300	ソフトウェア・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	346	336	4,470	662,692	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	28	28	611	90,648	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	121	114	2,366	350,782	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	96	96	927	137,477	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	135	150	453	67,287	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	216	206	1,966	291,562	各種金融
INVESCO LTD	135	135	203	30,176	各種金融
INTERNATIONAL PAPER CO	145	127	426	63,248	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	92	86	1,338	198,455	資本財
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	50	—	—	—	商業・専門サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	—	48	549	81,443	商業・専門サービス
JM SMUCKER CO/THE	47	41	598	88,730	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	1,017	982	16,770	2,485,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,170	1,095	13,436	1,991,748	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	126	119	348	51,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	36	—	—	—	運輸
KEYCORP	394	346	615	91,264	銀行
KELLOGG CO	105	93	693	102,772	食品・飲料・タバコ
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	72	67	1,174	174,063	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	130	125	1,496	221,807	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	803	754	1,320	195,727	エネルギー
KKR & CO INC -A	200	210	993	147,213	各種金融
KROGER CO	282	259	1,159	171,945	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LAS VEGAS SANDS CORP	149	129	448	66,486	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38	34	779	115,521	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDING INC	59	—	—	—	食品・飲料・タバコ
LENNAR CORP-CL A	104	94	741	109,984	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	14	11	269	39,978	資本財
LEAR CORP	27	22	311	46,229	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	315	301	10,577	1,567,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	60	64	524	77,758	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	75	64	340	50,447	保険
BATH & BODY WORKS INC	106	92	321	47,680	小売
LINDE PLC	202	187	5,406	801,369	素材
LOCKHEED MARTIN CORP	96	89	4,123	611,212	資本財
LOWE'S COS INC	274	239	4,633	686,809	小売
LOEWS CORP	70	71	396	58,724	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	100	97	798	118,365	素材
M & T BANK CORP	52	67	1,100	163,178	銀行
MARATHON OIL CORP	—	266	788	116,907	エネルギー
MASTERCARD INC	341	324	10,094	1,496,286	ソフトウェア・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	196	187	2,869	425,381	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	24	23	785	116,417	素材
MASCO CORP	89	84	410	60,827	資本財
MARKEL CORP	5	5	576	85,488	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	257	202	2,260	335,033	エネルギー
IHS MARKIT LTD	146	—	—	—	商業・専門サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	104	92	704	104,383	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	287	276	7,071	1,048,162	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	92	129	4,051	600,584	各種金融
MCKESSON CORP	62	54	2,083	308,890	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	292	257	1,823	270,366	保険
MERCK & CO. INC.	976	942	9,211	1,365,408	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	519	497	4,204	623,240	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	9	8	1,027	152,349	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM RESORTS INTERNATIONAL	128	129	441	65,376	消費者サービス
MICRON TECHNOLOGY INC	433	417	2,330	345,483	半導体・半導体製造装置
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	83	66	334	49,548	食品・飲料・タバコ
MOHAWK INDUSTRIES INC	24	18	188	27,904	耐久消費財・アパレル
MOSAIC CO/THE	148	135	728	107,955	素材
MORGAN STANLEY	542	490	3,952	585,875	各種金融
MOODY'S CORP	64	61	1,582	234,544	各種金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	66	62	1,490	220,982	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOLINA HEALTHCARE INC	23	21	785	116,450	ヘルスケア機器・サービス
MSCI INC	32	30	1,360	201,734	各種金融
NEWMONT CORP	310	295	1,264	187,387	素材
NEWELL BRANDS INC	161	146	230	34,174	耐久消費財・アパレル
NIKE INC -CL B	492	474	4,349	644,678	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	150	156	392	58,147	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	58	55	2,915	432,095	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	98	88	1,904	282,255	運輸
EVERSOURCE ENERGY	134	126	940	139,369	公益事業
NRG ENERGY INC	100	87	382	56,666	公益事業
NUCOR CORP	117	99	1,363	202,126	素材
OAK STREET HEALTH INC	34	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	362	351	2,496	369,988	エネルギー
OMNICOM GROUP	83	78	559	82,985	メディア・娯楽
ONEOK INC	170	168	969	143,755	エネルギー
ORACLE CORP	728	598	4,375	648,573	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	160	156	1,077	159,656	資本財
OWENS CORNING	40	35	317	47,038	資本財

銘柄	株数	当期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
P G & E CORP	604	558	844	125,143	公益事業	
PARKER HANNIFIN CORP	48	47	1,345	199,500	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	35	415	61,519	素材	
PALO ALTO NETWORKS INC	37	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PAYCOM SOFTWARE INC	19	19	655	97,205	ソフトウェア・サービス	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	594	610	528	78,368	ソフトウェア・サービス	
PEPSICO INC	533	516	9,211	1,365,404	食品・飲料・タバコ	
PENTAIR PLC	55	59	253	37,545	資本財	
PERKINELMER INC	45	47	641	95,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PFIZER INC	2,165	2,091	9,535	1,413,395	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	600	579	5,127	760,051	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	168	178	1,784	264,504	エネルギー	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	85	85	2,274	337,206	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	44	—	—	—	公益事業	
PINTEREST INC- CLASS A	209	209	473	70,151	メディア・娯楽	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	164	154	2,526	374,524	銀行	
PPL CORP	298	269	699	103,697	公益事業	
PPG INDUSTRIES INC	91	87	991	146,912	素材	
PROCTER & GAMBLE CO	946	895	11,722	1,737,597	家庭用品・パーソナル用品	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	108	95	762	113,089	保険	
PROGRESSIVE CORP	225	218	2,668	395,492	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	152	139	1,416	210,006	保険	
PULTE GROUP INC	100	88	350	51,883	耐久消費財・アパレル	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	188	187	1,051	155,847	公益事業	
QUANTA SERVICES INC	—	53	754	111,832	資本財	
QUEST DIAGNOSTICS	52	43	631	93,652	ヘルスケア機器・サービス	
IQVIA HOLDINGS INC	74	70	1,385	205,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	76	70	734	108,876	各種金融	
REGIONS FINANCIAL CORP	370	351	746	110,658	銀行	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	18	—	—	—	保険	
REPUBLIC SERVICES INC	81	81	1,098	162,846	商業・専門サービス	
RESMED INC	56	53	1,237	183,403	ヘルスケア機器・サービス	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	32	29	105	15,565	ソフトウェア・サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	43	43	1,039	154,132	資本財	
ROBERT HALF INTL INC	44	39	297	44,043	商業・専門サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	40	39	1,496	221,882	ソフトウェア・サービス	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	87	87	445	66,002	消費者サービス	
WESTROCK CO	105	99	334	49,572	素材	
ROLLINS INC	90	82	297	44,030	商業・専門サービス	
ROBLOX CORP -CLASS A	—	126	579	85,846	メディア・娯楽	
RPM INTERNATIONAL INC	55	49	460	68,279	素材	
SALESFORCE INC	375	370	6,120	907,306	ソフトウェア・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	48	49	482	71,544	商業・専門サービス	
SCHLUMBERGER LTD	545	523	2,748	407,477	エネルギー	
SCHWAB (CHARLES) CORP	560	539	3,910	579,602	各種金融	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	64	56	223	33,164	資本財	
SEALED AIR CORP	63	57	273	40,559	素材	
SEMPRA ENERGY	122	117	1,719	254,931	公益事業	
SERVICENOW INC	77	74	2,798	414,834	ソフトウェア・サービス	
SEA LTD-ADR	25	133	668	99,111	メディア・娯楽	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	98	91	2,015	298,690	素材	
SMITH (A.O.) CORP	47	50	261	38,768	資本財	
SNAP-ON INC	18	19	431	63,890	資本財	
SNAP INC - A	368	404	388	57,574	メディア・娯楽	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	72	83	1,510	223,964	ソフトウェア・サービス	
SOUTHWEST AIRLINES CO	54	54	189	28,070	運輸	
SOUTHERN CO	409	394	2,591	384,065	公益事業	
BLOCK INC	152	194	1,157	171,561	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	
STANLEY BLACK & DECKER INC	61	58	458	67,894	資本財
STRYKER CORP	130	127	2,862	424,283	ヘルスケア機器・サービス
STATE STREET CORP	136	137	988	146,497	各種金融
STERIS PLC	36	37	637	94,533	ヘルスケア機器・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	61	56	270	40,141	運輸
SYSCO CORP	198	192	1,587	235,293	食品・生活必需品小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	228	190	664	98,483	各種金融
TARGET CORP	192	173	2,868	425,174	小売
TARGA RESOURCES CORP	—	81	545	80,899	エネルギー
TEXTRON INC	92	79	512	75,912	資本財
TERADYNE INC	65	61	493	73,082	半導体・半導体製造装置
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	435	435	373	55,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELADOC HEALTH INC	51	66	176	26,209	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	17	17	630	93,486	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELEFLEX INC	17	17	359	53,322	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	2	475	70,467	エネルギー
THE WALT DISNEY CO.	703	677	7,074	1,048,693	メディア・娯楽
COOPER COS INC/THE	18	17	454	67,432	ヘルスケア機器・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	152	145	7,507	1,112,879	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TJX COMPANIES INC	467	436	3,078	456,269	小売
GLOBE LIFE INC	32	35	411	60,937	保険
TRAVELERS COS INC/THE	98	88	1,565	232,019	保険
TRANSDIGM GROUP INC	20	19	1,076	159,610	資本財
TRANSUNION	71	72	417	61,845	商業・専門サービス
TWITTER INC	308	240	1,270	188,313	メディア・娯楽
TWILIO INC - A	62	64	492	73,075	ソフトウェア・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	15	543	80,535	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	112	109	731	108,360	食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	125	119	1,406	208,508	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	278	258	1,480	219,472	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	469	543	1,540	228,308	運輸
UGI CORP	77	77	263	38,987	公益事業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	279	274	4,580	678,939	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	588	555	4,905	727,126	資本財
UNION PACIFIC CORP	256	234	4,567	677,068	運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	364	350	18,913	2,803,489	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	30	24	237	35,253	ヘルスケア機器・サービス
UNITED RENTALS INC	28	26	786	116,511	資本財
UNITY SOFTWARE INC	19	67	200	29,774	ソフトウェア・サービス
US BANCORP	548	526	2,211	327,865	銀行
VF CORP	136	121	348	51,647	耐久消費財・アパレル
VALERO ENERGY CORP	156	152	1,939	287,421	エネルギー
VAIL RESORTS INC	15	15	333	49,365	消費者サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,594	1,566	5,707	846,058	電気通信サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	53	52	873	129,464	ヘルスケア機器・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	653	614	11,941	1,770,036	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	182	147	323	47,980	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	32	76	857	127,122	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	55	—	—	—	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	53	49	798	118,421	素材
WALMART INC	598	565	7,921	1,174,165	食品・生活必需品小売り
WATERS CORP	23	22	666	98,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE MANAGEMENT INC	167	155	2,572	381,268	商業・専門サービス
WABTEC CORP	57	64	582	86,295	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	106	95	1,268	187,994	商業・専門サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	—	28	98	14,531	小売
WESTLAKE CORP	—	13	132	19,637	素材
WESTERN UNION CO	145	145	202	30,044	ソフトウェア・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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
WELLS FARGO & CO	1,607	1,412	6,408	950,001	銀行	
ELEVANCE HEALTH INC	94	90	4,716	699,063	ヘルスケア機器・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	29	27	692	102,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	63	336	49,921	銀行	
WHIRLPOOL CORP	26	20	284	42,219	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	483	449	1,430	211,997	エネルギー	
WEC ENERGY GROUP INC	120	117	1,033	153,129	公益事業	
WORKDAY INC-CLASS A	74	73	1,147	170,156	ソフトウェア・サービス	
WR BERKLEY CORP	53	80	558	82,837	保険	
XCEL ENERGY INC	200	203	1,266	187,802	公益事業	
XYLEM INC	63	66	655	97,226	資本財	
YUM! BRANDS INC	116	105	1,174	174,026	消費者サービス	
ZENDESK INC	45	47	364	54,096	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	79	76	846	125,432	ヘルスケア機器・サービス	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	—	29	71	10,569	運輸	
ZOETIS INC	183	175	2,670	395,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHENIERE ENERGY INC	97	86	1,455	215,794	エネルギー	
NVR INC	1	1	504	74,828	耐久消費財・アパレル	
10X GENOMICS INC-CLASS A	27	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABIOMED INC	17	16	436	64,639	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	302	289	2,099	311,223	メディア・娯楽	
ADOBE INC	184	176	5,708	846,110	ソフトウェア・サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	471	601	3,695	547,831	半導体・半導体製造装置	
AFFIRM HOLDINGS INC	—	66	137	20,386	ソフトウェア・サービス	
AIRBNB INC-CLASS A	45	140	1,658	245,809	消費者サービス	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	63	60	533	79,058	ソフトウェア・サービス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	47	45	897	133,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIGEN TECHNOLOGY INC	28	28	619	91,763	ヘルスケア機器・サービス	
AMAZON.COM INC	175	3,415	41,186	6,105,016	小売	
AMGEN INC	221	199	5,185	768,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMERCO	3	3	216	32,117	運輸	
ANALOG DEVICES INC	208	194	2,842	421,279	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	34	32	723	107,207	ソフトウェア・サービス	
APA CORP	—	127	576	85,424	エネルギー	
APPLE INC	6,456	6,037	91,980	13,634,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	352	323	2,830	419,636	半導体・半導体製造装置	
APPROVIN CORP-CLASS A	—	39	74	11,035	ソフトウェア・サービス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	152	140	691	102,543	保険	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	164	157	3,741	554,586	ソフトウェア・サービス	
AUTODESK INC	85	81	1,753	259,966	ソフトウェア・サービス	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	63	75	267	39,691	ソフトウェア・サービス	
BIOGEN INC	58	55	1,516	224,767	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	75	71	653	96,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADCOM INC	157	150	6,942	1,029,080	半導体・半導体製造装置	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	51	49	467	69,277	運輸	
CADENCE DESIGN SYS INC	109	102	1,548	229,460	ソフトウェア・サービス	
CARLYLE GROUP INC/THE	68	76	213	31,580	各種金融	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	79	79	338	50,197	消費者サービス	
PARAMOUNT GLOBAL	228	228	448	66,544	メディア・娯楽	
CDW CORP/DE	55	50	849	125,927	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CERNER CORP	111	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	43	38	448	66,443	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATION-A	51	43	1,520	225,408	メディア・娯楽	
CINTAS CORP	35	34	1,418	210,296	商業・専門サービス	
CISCO SYSTEMS INC	1,628	1,548	6,869	1,018,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	62	56	555	82,283	保険	
CITRIX SYSTEMS INC	50	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CME GROUP INC	138	134	2,359	349,709	各種金融	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	当		額	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
COMCAST CORP-CLASS A	1,776	1,663	5,250	778,227	メディア・娯楽	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	208	192	1,185	175,683	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION ENERGY	-	122	1,080	160,168	公益事業	
COSTCO WHOLESALE CORP	171	165	8,261	1,224,593	食品・生活必需品小売り	
COPART INC	81	78	891	132,220	商業・専門サービス	
COSTAR GROUP INC	149	149	1,110	164,653	商業・専門サービス	
COGNEX CORP	70	64	298	44,174	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COUPA SOFTWARE INC	28	28	151	22,524	ソフトウェア・サービス	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	-	42	320	47,502	各種金融	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	71	74	1,214	179,981	ソフトウェア・サービス	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	14	16	257	38,200	ソフトウェア・サービス	
DATADOG INC-CLASS A	72	82	729	108,137	ソフトウェア・サービス	
DEXCOM INC	37	146	1,477	219,070	ヘルスケア機器・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	93	82	249	36,940	ヘルスケア機器・サービス	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	57	-	-	-	メディア・娯楽	
DISH NETWORK CORP-A	92	92	138	20,562	メディア・娯楽	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	124	-	-	-	メディア・娯楽	
DIAMONDBACK ENERGY INC	-	63	967	143,442	エネルギー	
DOLLAR TREE INC	92	84	1,302	193,131	小売	
DOCUSIGN INC	73	74	375	55,693	ソフトウェア・サービス	
KEURIG DR PEPPER INC	270	291	1,122	166,399	食品・飲料・タバコ	
DROPBOX INC-CLASS A	107	116	257	38,231	ソフトウェア・サービス	
DRAFTKINGS INC - CL A	114	-	-	-	消費者サービス	
EBAY INC	263	207	810	120,076	小売	
PAYPAL HOLDINGS INC	431	407	3,638	539,267	ソフトウェア・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	110	104	1,340	198,702	メディア・娯楽	
ENPHASE ENERGY INC	49	50	1,345	199,400	半導体・半導体製造装置	
ENTEGRIS INC	-	50	402	59,690	半導体・半導体製造装置	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	11	9	221	32,822	保険	
ETSY INC	49	48	495	73,455	小売	
EXPEDIA GROUP INC	54	56	558	82,845	消費者サービス	
EXPEDITORS INTL WASH INC	65	61	590	87,499	運輸	
EXELON CORP	383	367	1,386	205,505	公益事業	
EXACT SCIENCES CORP	69	65	217	32,210	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
F5 INC	23	23	366	54,256	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
META PLATFORMS INC-CLASS A	926	855	11,759	1,743,163	メディア・娯楽	
FASTENAL CO	216	216	1,020	151,235	資本財	
FISERV INC	236	229	2,295	340,222	ソフトウェア・サービス	
FIFTH THIRD BANCORP	271	255	903	133,874	銀行	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	-	4	381	56,559	銀行	
FORTINET INC	54	255	1,427	211,577	ソフトウェア・サービス	
FOX CORP- CLASS B	54	54	153	22,686	メディア・娯楽	
FOX CORP - CLASS A	144	114	341	50,618	メディア・娯楽	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	18	25	82	12,206	各種金融	
GARMIN LTD	58	58	497	73,800	耐久消費財・アパレル	
GARTNER INC	32	30	911	135,146	ソフトウェア・サービス	
GILEAD SCIENCES INC	484	467	3,256	482,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALPHABET INC-CL A	116	2,244	23,454	3,476,692	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL C	112	2,103	22,068	3,271,269	メディア・娯楽	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	-	381	91	13,554	運輸	
HASBRO INC	52	47	317	47,133	耐久消費財・アパレル	
HENRY SCHEIN INC	50	52	367	54,527	ヘルスケア機器・サービス	
HOLOGIC INC	102	92	601	89,128	ヘルスケア機器・サービス	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	82	79	528	78,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	32	31	525	77,835	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	563	537	797	118,169	銀行	
IAC INC	33	30	155	23,029	メディア・娯楽	
IDEXX LABORATORIES INC	32	31	1,109	164,520	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	当		額	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
ILLUMINA INC	56	59	1,361	201,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTUIT INC	106	100	4,323	640,856	ソフトウェア・サービス	
INTEL CORP	1,560	1,524	4,179	619,491	半導体・半導体製造装置	
INTUITIVE SURGICAL INC	138	133	3,186	472,300	ヘルスケア機器・サービス	
INCYTE CORP	71	71	514	76,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INSULET CORP	27	26	618	91,736	ヘルスケア機器・サービス	
IPG PHOTONICS CORP	13	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	22	24	337	49,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	28	26	518	76,824	ソフトウェア・サービス	
KLA CORP	60	55	1,706	253,023	半導体・半導体製造装置	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	539	519	3,079	456,411	食品・飲料・タバコ	
KRAFT HEINZ CO/THE	268	271	1,006	149,151	食品・飲料・タバコ	
LAM RESEARCH CORP	55	51	1,972	292,344	半導体・半導体製造装置	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	152	111	198	29,418	電気通信サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	52	54	91	13,607	電気通信サービス	
LIBERTY BROADBAND-A	7	—	—	—	メディア・娯楽	
LIBERTY BROADBAND-C	58	48	385	57,089	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	33	33	141	20,922	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	66	57	242	35,911	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C	69	71	420	62,366	メディア・娯楽	
LKQ CORP	108	102	553	81,973	小売	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	30	736	109,121	各種金融	
LULULEMON ATHLETICA INC	46	43	1,404	208,168	耐久消費財・アパレル	
LUCID GROUP INC	—	165	229	34,066	自動車・自動車部品	
LYFT INC-A	96	105	156	23,204	運輸	
MASIMO CORP	20	20	272	40,416	ヘルスケア機器・サービス	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	106	104	1,618	239,909	消費者サービス	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14	14	350	51,941	各種金融	
MATCH GROUP INC	98	98	449	66,613	メディア・娯楽	
MARVELL TECHNOLOGY INC	309	320	1,302	193,133	半導体・半導体製造装置	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	80	—	—	—	消費者サービス	
T-MOBILE US INC	241	234	3,299	489,016	電気通信サービス	
MERCADOLIBRE INC	17	16	1,462	216,821	小売	
MICROSOFT CORP	2,768	2,650	66,445	9,849,283	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	206	207	1,337	198,306	半導体・半導体製造装置	
MONSTER BEVERAGE CORP	156	148	1,357	201,219	食品・飲料・タバコ	
MONGODB INC	22	25	505	74,965	ソフトウェア・サービス	
MODERNA INC	132	125	1,713	253,958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	17	583	86,474	半導体・半導体製造装置	
NASDAQ INC	44	129	784	116,275	各種金融	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	36	36	408	60,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NETAPP INC	81	82	559	82,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	171	165	4,812	713,285	メディア・娯楽	
NEWS CORP - CLASS A	165	147	253	37,540	メディア・娯楽	
NORTHERN TRUST CORP	79	73	602	89,238	各種金融	
NOVAVAX INC	26	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NORDSON CORP	20	18	423	62,768	資本財	
NOVOCURE LTD	34	34	229	34,018	ヘルスケア機器・サービス	
NVIDIA CORP	964	933	12,379	1,834,960	半導体・半導体製造装置	
NXP SEMICONDUCTORS NV	106	98	1,464	217,103	半導体・半導体製造装置	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	26	24	1,900	281,716	小売	
OKTA INC	49	56	330	49,007	ソフトウェア・サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	39	36	1,001	148,464	運輸	
ON SEMICONDUCTOR CORP	166	161	1,077	159,706	半導体・半導体製造装置	
PACCAR INC	140	129	1,185	175,748	資本財	
PAYCHEX INC	125	120	1,401	207,742	ソフトウェア・サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	—	110	1,842	273,071	ソフトウェア・サービス	
PELTON INTERACTIVE INC-A	102	—	—	—	耐久消費財・アパレル	

銘柄	株数	当期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
PLUG POWER INC	190	192	319	47,354	資本財	
POOL CORP	14	15	459	68,148	小売	
PPD INC	55	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOOKING HOLDINGS INC	15	15	2,826	419,033	消費者サービス	
PTC INC	46	41	479	71,135	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	46	38	327	48,591	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	438	418	4,983	738,767	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	40	40	3,015	446,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	107	371	55,061	自動車・自動車部品	
ROSS STORES INC	137	131	1,224	181,579	小売	
ROKU INC	43	47	260	38,554	メディア・娯楽	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	64	130	538	79,877	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEI INVESTMENTS COMPANY	46	41	204	30,317	各種金融	
SEAGEN INC	51	53	685	101,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	79	77	452	67,007	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	472	302	190	28,187	メディア・娯楽	
SIGNATURE BANK	—	23	364	54,043	銀行	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	62	59	516	76,577	半導体・半導体製造装置	
SOLAREDEGE TECHNOLOGIES INC	20	20	432	64,079	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	63	61	507	75,176	ソフトウェア・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	84	84	419	62,248	ソフトウェア・サービス	
STEEL DYNAMICS INC	75	71	697	103,412	素材	
STARBUCKS CORP	453	428	3,653	541,527	消費者サービス	
SUNRUN INC	71	—	—	—	資本財	
SVB FINANCIAL GROUP	22	21	516	76,504	銀行	
NORTONLIFELOCK INC	222	222	494	73,234	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSIS INC	58	57	1,686	249,981	ソフトウェア・サービス	
T ROWE PRICE GROUP INC	90	81	883	130,902	各種金融	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	44	59	747	110,828	メディア・娯楽	
TESLA INC	316	985	21,913	3,248,228	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	359	344	5,593	829,083	半導体・半導体製造装置	
BIO-TECHNE CORP	14	14	438	65,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRIMBLE INC	89	95	553	82,058	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	44	42	906	134,362	小売	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	43	42	229	33,960	各種金融	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	171	165	954	141,550	メディア・娯楽	
ULTA BEAUTY INC	20	19	778	115,461	小売	
VERISIGN INC	39	36	693	102,731	ソフトウェア・サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	99	95	2,957	438,404	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISK ANALYTICS INC	59	58	1,008	149,438	商業・専門サービス	
VIATRIS INC	484	458	448	66,423	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	286	270	961	142,590	食品・生活必需品小売り	
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	867	1,177	174,516	メディア・娯楽	
WESTERN DIGITAL CORP	124	118	417	61,820	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WIX.COM LTD	22	22	196	29,054	ソフトウェア・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	49	41	887	131,591	保険	
WYNN RESORTS LTD	35	41	240	35,589	消費者サービス	
XILINX INC	94	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	21	19	525	77,942	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - A	27	—	—	—	不動産	
ZILLOW GROUP INC - C	57	63	198	29,469	不動産	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	81	85	717	106,323	ソフトウェア・サービス	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	98	459	68,086	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	31	31	501	74,280	ソフトウェア・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	492	405	157	23,292	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	93	57	260	38,547	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
COBE GLOBAL MARKETS INC	39	39	490	72,658		各種金融
小 計	株 数	121,991	127,008	1,248,313	185,037,456	
	銘柄 数 < 比 率 >	598	598		< 71.7% >	
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES LTD	97	168	982	106,822		素材
AIR CANADA	71	71	134	14,644		運輸
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	326	—	—	—		食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	90	111	282	30,667		公益事業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	270	270	396	43,119		公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	310	1,852	201,331		食品・生活必需品小売り
ARC RESOURCES LTD	—	255	477	51,876		エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	23	—	—	—		公益事業
B2GOLD CORP	420	—	—	—		素材
BARRICK GOLD CORP	667	667	1,385	150,628		素材
BANK OF MONTREAL	241	252	3,143	341,670		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	469	444	2,903	315,597		銀行
BALLARD POWER SYSTEMS INC	83	—	—	—		資本財
BCE INC	30	30	179	19,492		電気通信サービス
BAUSCH HEALTH COS INC	126	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	496	528	2,820	306,566		各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54	54	228	24,868		公益事業
CAE INC	102	123	307	33,435		資本財
CAMECO CORP	142	149	498	54,206		エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	179	337	2,027	220,362		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	470	427	3,454	375,472		エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	275	218	3,430	372,902		運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19	19	296	32,263		小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	45	45	161	17,505		公益事業
CANOPY GROWTH CORP	91	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	57	57	380	41,366		素材
CENOVUS ENERGY INC	551	498	1,323	143,811		エネルギー
CGI INC	89	80	871	94,714		ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	7	1,442	156,792		ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	258	348	3,409	370,553		運輸
DOLLARAMA INC	117	103	849	92,334		小売
EMPIRE CO LTD 'A'	69	69	239	26,053		食品・生活必需品小売り
EMERA INC	75	104	537	58,413		公益事業
ENBRIDGE INC	784	759	3,942	428,560		エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	11	9	582	63,279		保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	226	226	565	61,471		素材
FIRSTSERVICE CORP	17	15	261	28,430		不動産
FORTIS INC	196	171	891	96,885		公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	76	71	1,194	129,829		素材
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	57	74	269	29,251		商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	64	70	304	33,109		耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFE CO INC	89	89	270	29,352		保険
HYDRO ONE LTD	117	132	433	47,165		公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	38	40	301	32,731		保険
IGM FINANCIAL INC	33	33	122	13,310		各種金融
IMPERIAL OIL LTD	96	89	587	63,808		エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	69	65	1,320	143,478		保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	210	245	225	24,562		素材
KEYERA CORP	84	84	242	26,353		エネルギー
KINROSS GOLD CORP	460	460	225	24,512		素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	106	—	—	—		素材
LIGHTSPEED COMMERCE INC	43	43	110	12,038		ソフトウェア・サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	55	55	613	66,679		食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	211	250	176	19,191		素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等		
	株 数	株 数	評 価 額	額			
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円			
MANULIFE FINANCIAL CORP	795	719	1,602	174,164	保険		
MAGNA INTERNATIONAL INC	118	106	782	85,014	自動車・自動車部品		
METRO INC	77	87	620	67,400	食品・生活必需品小売り		
NATIONAL BANK OF CANADA	126	126	1,143	124,295	銀行		
NORTHLAND POWER INC	86	86	335	36,426	公益事業		
NUTRIEN LTD	216	204	2,316	251,821	素材		
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	22	22	89	9,733	ソフトウェア・サービス		
ONEX CORPORATION	27	27	187	20,393	各種金融		
OPEN TEXT CORP	109	96	373	40,558	ソフトウェア・サービス		
PAN AMERICAN SILVER CORP	87	76	167	18,166	素材		
PARKLAND CORP	61	61	166	18,106	エネルギー		
PEMBINA PIPELINE CORP	224	204	891	96,907	エネルギー		
POWER CORP OF CANADA	232	204	669	72,718	保険		
QUEBECOR INC -CL B	61	61	149	16,290	メディア・娯楽		
BLACKBERRY LTD	222	222	137	14,989	ソフトウェア・サービス		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	123	109	859	93,442	消費者サービス		
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	40	40	352	38,338	商業・専門サービス		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	115	138	744	80,877	電気通信サービス		
ROYAL BANK OF CANADA	554	527	6,530	709,835	銀行		
SAPUTO INC	96	96	314	34,159	食品・飲料・タバコ		
SHOPIFY INC - CLASS-A	43	423	1,719	186,932	ソフトウェア・サービス		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	174	174	594	64,655	メディア・娯楽		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	185	168	756	82,249	素材		
SUN LIFE FINANCIAL INC	232	215	1,226	133,308	保険		
SUNCOR ENERGY INC	599	534	2,432	264,349	エネルギー		
TELUS CORP	126	126	358	39,016	電気通信サービス		
TECK RESOURCES LTD-CLS B	179	179	842	91,530	素材		
TFI INTERNATIONAL INC	—	32	426	46,315	運輸		
THOMSON REUTERS CORP	65	65	932	101,400	商業・専門サービス		
TMX GROUP LTD	18	21	283	30,772	各種金融		
TOURMALINE OIL CORP	—	112	846	91,988	エネルギー		
TORONTO-DOMINION BANK	705	680	5,937	645,343	銀行		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	37	32	325	35,376	資本財		
TC ENERGY CORP	387	366	2,131	231,635	エネルギー		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	37	24	246	26,756	素材		
WESTON (GEORGE) LTD	33	28	416	45,267	食品・生活必需品小売り		
WSP GLOBAL INC	40	45	740	80,465	資本財		
YAMAHA GOLD INC	328	—	—	—	素材		
小 計	株 数	金 額	15,668	15,196	85,311	9,272,480	
	銘柄 数 < 比 率 >		88	84	—	< 3.6% >	
(ユーロ…ドイツ)					千ユーロ		
ADIDAS AG	73	64	648	95,537	耐久消費財・アパレル		
ALLIANZ SE-REG	158	151	2,688	396,165	保険		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	132	123	968	142,755	自動車・自動車部品		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	17	22	162	23,887	自動車・自動車部品		
BASF SE	353	334	1,538	226,640	素材		
BAYER AG-REG	363	367	1,867	275,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
BEIERSDORF AG	38	38	387	57,107	家庭用品・パーソナル用品		
BECHTLE AG	36	30	112	16,512	ソフトウェア・サービス		
BRENNTAG SE	60	56	341	50,284	資本財		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	16	16	195	28,837	ヘルスケア機器・サービス		
COMMERZBANK AG	388	404	333	49,205	銀行		
CONTINENTAL AG	43	43	226	33,433	自動車・自動車部品		
COVESTRO AG	74	74	254	37,529	素材		
MERCEDES-BENZ GROUP AG	332	299	1,744	257,062	自動車・自動車部品		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	167	441	65,065	資本財		
DEUTSCHE BOERSE AG	72	70	1,138	167,828	各種金融		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	818	757	702	103,466	各種金融		

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額	額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	383	367	1,307	192,647	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,293	1,199	2,221	327,326	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	123	—	—	—	不動産	
VONOVIA SE	221	271	604	89,036	不動産	
DELIVERY HERO SE	60	66	238	35,178	小売	
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	—	35	343	50,544	自動車・自動車部品	
E.ON SE	863	826	686	101,221	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG	85	82	154	22,733	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	82	76	214	31,681	ヘルスケア機器・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	166	156	347	51,228	ヘルスケア機器・サービス	
FUCHS PETROLUB SE-PRF	29	—	—	—	素材	
GEA GROUP AG	66	60	214	31,634	資本財	
HANNOVER RUECK SE-REG	22	22	365	53,823	保険	
HEIDELBERGCEMENT AG	57	57	255	37,577	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	64	67	429	63,284	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL AG & CO KGAA	44	34	203	30,020	家庭用品・パーソナル用品	
HELLOFRESH SE	60	60	136	20,054	食品・生活必需品小売り	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	505	475	1,249	184,166	半導体・半導体製造装置	
KION GROUP AG	22	28	61	9,109	資本財	
KNORR-BREMSE AG	29	29	133	19,725	資本財	
LANXESS AG	31	—	—	—	素材	
LEG IMMOBILIEN SE	24	24	162	23,935	不動産	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	238	238	158	23,334	運輸	
MERCK KGAA	51	48	805	118,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MTU AERO ENGINES AG	20	20	351	51,868	資本財	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	55	51	1,355	199,684	保険	
NEMETSCHKE SE	17	23	122	18,014	ソフトウェア・サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	56	56	325	48,026	自動車・自動車部品	
PUMA SE	45	42	196	28,977	耐久消費財・アパレル	
QIAGEN N.V.	96	83	365	53,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RATIONAL AG	2	2	130	19,234	資本財	
RHEINMETALL AG	—	17	285	42,127	資本財	
RWE AG	246	236	926	136,584	公益事業	
SAP SE	402	388	3,774	556,205	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	10	9	338	49,894	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCOUT24 SE	38	29	156	23,047	メディア・娯楽	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	112	106	493	72,766	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS AG-REG	295	284	3,166	466,623	資本財	
SIEMENS ENERGY AG	158	158	178	26,252	資本財	
SYMRISE AG	53	49	506	74,705	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	324	464	98	14,469	電気通信サービス	
TEAMVIEWER AG	70	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	40	40	74	11,007	電気通信サービス	
UNIPER SE	35	—	—	—	公益事業	
VOLKSWAGEN AG	12	11	195	28,800	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	71	67	887	130,733	自動車・自動車部品	
ZALANDO SE	82	82	199	29,358	小売	
小 計	株数 銘柄数	9,759 61	9,478 59	38,176 —	5,625,721 <2.2%>	
(ユーロ…イタリア)						
AMPLIFON SPA	56	48	126	18,683	ヘルスケア機器・サービス	
ATLANTIA SPA	187	187	425	62,631	運輸	
DIASORIN ITALIA SPA	9	9	126	18,672	ヘルスケア機器・サービス	
ENEL SPA	3,155	3,009	1,317	194,191	公益事業	
ENI SPA	968	924	1,139	167,860	エネルギー	
FINECOBANK SPA	261	235	318	46,968	銀行	
ASSICURAZIONI GENERALI	387	422	627	92,482	保険	
INTESA SANPAOLO	6,438	6,137	1,144	168,650	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	151	151	132	19,591	電気通信サービス	
MEDIOBANCA SPA	200	205	181	26,705	銀行	
MONCLER SPA	88	80	395	58,259	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	171	212	186	27,480	ソフトウェア・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	195	195	166	24,528	保険	
PRYSMIAN SPA	95	95	320	47,232	資本財	
RECORDATI SPA	39	37	141	20,792	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SNAM SPA	793	724	321	47,329	公益事業	
TELECOM ITALIA SPA	3,177	4,005	78	11,620	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,980	—	—	—	電気通信サービス	
TERNA SPA	490	536	352	51,935	公益事業	
UNICREDIT SPA	838	793	913	134,645	銀行	
小 計	株 数	金 額	19,688	18,012	8,416	1,240,262
銘 柄 数 < 比 率 >	20	19	—	< 0.5% >		
(ユーロ…フランス)						
ACCOR SA	76	60	139	20,489	消費者サービス	
ADP	10	10	141	20,832	運輸	
AIR LIQUIDE SA	183	195	2,586	381,112	素材	
ALSTOM	116	116	223	33,004	資本財	
AMUNDI SA	21	21	101	14,903	各種金融	
ARKEMA	22	22	175	25,857	素材	
ATOS SE	38	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
AXA SA	742	695	1,736	255,958	保険	
BIOMERIEUX	13	16	155	22,986	ヘルスケア機器・サービス	
BNP PARIBAS	434	411	1,946	286,837	銀行	
BOLLORE SE	335	335	171	25,223	メディア・娯楽	
BOUYGUES SA	94	84	237	35,068	資本財	
BUREAU VERITAS SA	109	109	267	39,489	商業・専門サービス	
CAP GEMINI SA	61	61	1,056	155,738	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA	247	226	351	51,828	食品・生活必需品小売り	
CNP ASSURANCES	60	—	—	—	保険	
CREDIT AGRICOLE SA	407	440	400	59,047	銀行	
DANONE	252	236	1,147	169,064	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT SYSTEMES SE	258	246	904	133,219	ソフトウェア・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	9	9	133	19,721	資本財	
EDENRED	96	96	480	70,782	ソフトウェア・サービス	
EIFFAGE	32	32	285	42,077	資本財	
EDF	169	213	254	37,534	公益事業	
ESSILORLUXOTTICA	111	107	1,774	261,501	ヘルスケア機器・サービス	
EURAZEO SE	18	14	84	12,490	各種金融	
FAURECIA	42	—	—	—	自動車・自動車部品	
ORANGE S. A.	769	743	699	103,062	電気通信サービス	
ENGIE	701	683	891	131,309	公益事業	
GETLINK	147	173	267	39,384	運輸	
HERMES INTERNATIONAL	12	11	1,587	233,930	耐久消費財・アパレル	
IPSEN	13	13	132	19,485	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	107	103	6,822	1,005,408	耐久消費財・アパレル	
L'OREAL	99	90	2,898	427,106	家庭用品・パーソナル用品	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	39	39	126	18,591	消費者サービス	
LEGRAND SA	105	100	768	113,295	資本財	
MICHELIN (CGDE)	66	252	645	95,053	自動車・自動車部品	
ORPEA	17	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PERNOD-RICARD SA	80	77	1,371	202,141	食品・飲料・タバコ	
KERING	29	27	1,314	193,662	耐久消費財・アパレル	
PUBLICIS GROUPE	86	86	506	74,601	メディア・娯楽	
RENAULT SA	68	68	217	32,078	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	8	8	127	18,739	食品・飲料・タバコ	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	10	344	50,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		外貨換算金額	
			株数	外貨建金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SAFRAN SA	135	127	1,411	207,961	資本財	
SANOFI	437	421	3,470	511,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	195	184	764	112,655	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	208	200	2,629	387,509	資本財	
SCOR SE	74	—	—	—	保険	
SEB SA	8	9	65	9,613	耐久消費財・アパレル	
SODEXO	40	32	282	41,604	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	313	298	694	102,388	銀行	
SUEZ	132	—	—	—	公益事業	
TELEPERFORMANCE	24	22	615	90,707	商業・専門サービス	
THALES SA	37	40	488	71,944	資本財	
TOTALENERGIES SE	964	926	4,933	727,072	エネルギー	
UBISOFT ENTERTAINMENT	35	35	95	14,094	メディア・娯楽	
VALEO SA	80	74	126	18,598	自動車・自動車部品	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	246	247	563	83,033	公益事業	
VINCI SA	204	198	1,793	264,346	資本財	
VIVENDI SE	277	260	216	31,962	メディア・娯楽	
WENDEL	10	10	80	11,825	各種金融	
WORLDLINE SA	89	89	391	57,727	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,848 62	9,433 56	52,103 —	7,677,922 <3.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
ABN AMRO BANK NV-CVA	133	151	148	21,911	銀行	
ADYEN NV	7	8	1,160	170,997	ソフトウェア・サービス	
AEGON NV	779	696	305	44,993	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	422	384	1,082	159,557	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	68	69	436	64,278	素材	
ARGENX SE	18	19	773	114,049	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASM INTERNATIONAL NV	18	17	490	72,344	半導体・半導体製造装置	
ASML HOLDING NV	162	151	7,527	1,109,295	半導体・半導体製造装置	
CNH INDUSTRIAL NV	422	395	504	74,407	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	229	198	181	26,682	食品・飲料・タバコ	
AIRBUS GROUP SE	226	218	2,269	334,410	資本財	
EURONEXT NV	—	34	223	32,981	各種金融	
EXOR NV	34	—	—	—	各種金融	
EXOR NV	—	41	281	41,467	各種金融	
FERRARI NV	49	44	890	131,231	自動車・自動車部品	
STELLANTIS NV	753	832	1,125	165,914	自動車・自動車部品	
HEINEKEN NV	104	96	852	125,692	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	40	36	257	38,016	食品・飲料・タバコ	
IMCD NV	—	21	274	40,456	資本財	
ING GROEP NV-CVA	1,516	1,469	1,452	214,105	銀行	
JDE PEET'S NV	24	40	112	16,533	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	65	63	809	119,294	素材	
KONINKLIJKE KPN NV	1,316	1,240	335	49,413	電気通信サービス	
NN GROUP NV	99	102	435	64,152	保険	
OCI NV	—	35	147	21,733	素材	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	360	325	423	62,403	ヘルスケア機器・サービス	
PROSUS	361	307	1,283	189,088	小売	
RANDSTAD NV	49	46	227	33,494	商業・専門サービス	
JUST EAT TAKEAWAY	65	64	108	16,026	小売	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	277	277	584	86,200	メディア・娯楽	
VOPAK	25	—	—	—	エネルギー	
WOLTERS KLUWER	103	96	1,032	152,115	商業・専門サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,736 28	7,488 30	25,741 —	3,793,251 <1.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	104	80	198	29,297	資本財	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額	価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株		千ユーロ	千円	
ACCIONA SA	—	8		145	21,514	公益事業
AENA SA	28	28		313	46,162	運輸
AMADEUS IT GROUP SA	170	170		881	129,898	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,608	2,505		1,310	193,122	銀行
BANCO SANTANDER SA	6,827	6,315		1,729	254,874	銀行
CELLNEX TELECOM SA	203	197		605	89,183	電気通信サービス
CAIXABANK S.A	1,630	1,630		575	84,791	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	104	110		227	33,551	公益事業
ENDESA SA	107	120		187	27,638	公益事業
ENAGAS SA	82	86		133	19,678	公益事業
FERROVIAL SA	184	184		436	64,339	資本財
NATURGY ENERGY GROUP SA	90	62		154	22,792	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	102	88		158	23,429	資本財
GRIFOLS SA	99	120		100	14,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA	2,280	2,204		2,174	320,375	公益事業
INDITEX	421	401		947	139,601	小売
RED ELECTRICA CORPORACION SA	192	155		244	36,079	公益事業
REPSOL SA	576	548		718	105,840	エネルギー
TELEFONICA SA	2,021	1,956		635	93,719	電気通信サービス
小計	株数・金額	17,837	16,977	11,880	1,750,761	
	銘柄数<比率>	19	20	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	295	324		1,538	226,643	食品・飲料・タバコ
PROXIMUS	56	56		53	7,936	電気通信サービス
COLRUYT SA	23	—		—	—	食品・生活必需品小売り
ELIA GROUP SA/NV	9	13		169	24,917	公益事業
AGEAS	67	59		226	33,312	保険
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	40	34		258	38,059	各種金融
KBC GROEP NV	97	97		496	73,156	銀行
D'IETTEREN GROUP	—	8		136	20,144	小売
SOLVAY SA	32	28		257	37,901	素材
SOFINA	4	6		128	18,975	各種金融
UCB SA	49	49		367	54,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE	79	79		264	39,025	素材
小計	株数・金額	755	756	3,896	574,218	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.2%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG	114	114		284	41,890	銀行
VERBUND AG	27	27		227	33,469	公益事業
OMV AG	54	54		225	33,270	エネルギー
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	53	—		—	—	銀行
VOESTALPINE AG	42	42		93	13,825	素材
小計	株数・金額	293	239	830	122,455	
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.0%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
AROUNDTOWN SA	335	359		72	10,630	不動産
ARCELORMITTAL	288	191		437	64,440	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	54	50		328	48,356	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA	199	156		235	34,641	エネルギー
小計	株数・金額	877	757	1,072	158,068	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)						
ELISA OYJ	54	54		257	37,987	電気通信サービス
FORTUM OYJ	164	167		234	34,516	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	109	109		207	30,578	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ-B	136	122		481	70,907	資本財
NESTE OYJ	163	155		742	109,347	エネルギー
NOKIA OYJ	2,080	2,038		912	134,520	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	価 値			
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ORION OYJ-CLASS B	40	36	160	23,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMPO OYJ-A SHS	202	177	819	120,808	保険	
STORA ENSO OYJ-R SHS	193	197	278	41,065	素材	
UPM-KYMMENE OYJ	195	195	688	101,500	素材	
WARTSILA OYJ ABP	211	181	122	18,115	資本財	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,552	3,438	4,906	723,070	
		11	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC	298	284	1,007	148,515	素材	
KERRY GROUP PLC-A	58	59	555	81,881	食品・飲料・タバコ	
KINGSPAN GROUP PLC	62	59	305	44,966	資本財	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	67	63	834	122,931	消費者サービス	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	84	90	305	44,995	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	571	556	3,008	443,291	
		5	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,137	1,058	465	68,556	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	212	187	182	26,835	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	90	90	194	28,625	食品・生活必需品小売り	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,441	1,336	841	124,017	
		3	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…スイス)						
STMICROELECTRONICS NV	260	252	887	130,811	半導体・半導体製造装置	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	260	252	887	130,811	
		1	1	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	72,621	68,728	151,763	22,363,851	
		230	223	—	<8.7%>	
(イギリス)						
3I GROUP PLC	368	368	421	71,528	各種金融	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	149	131	177	30,159	食品・飲料・タバコ	
ADMIRAL GROUP PLC	65	67	136	23,141	保険	
ANGLO AMERICAN PLC	506	466	1,240	210,210	素材	
ANTOFAGASTA PLC	143	143	164	27,851	素材	
ASTRAZENECA PLC	597	577	5,629	954,334	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASHTED GROUP PLC	173	161	717	121,610	資本財	
AUTO TRADER GROUP PLC	364	364	187	31,712	メディア・娯楽	
AVEVA GROUP PLC	45	45	141	24,002	ソフトウェア・サービス	
AVIVA PLC	1,585	1,016	423	71,734	保険	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	844	801	2,713	460,054	食品・飲料・タバコ	
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,210	1,173	944	160,185	資本財	
BARCLAYS PLC	6,684	6,134	921	156,217	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	407	407	151	25,740	耐久消費財・アパレル	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	45	45	158	26,941	耐久消費財・アパレル	
BHP GROUP PLC	810	—	—	—	素材	
BP PLC	7,785	7,209	3,356	569,072	エネルギー	
BT GROUP PLC	3,558	2,677	336	57,054	電気通信サービス	
BUNZL PLC	138	128	363	61,539	資本財	
BURBERRY GROUP PLC	141	155	291	49,345	耐久消費財・アパレル	
COCA-COLA HBC AG-CDI	76	76	150	25,465	食品・飲料・タバコ	
COMPASS GROUP PLC	693	666	1,213	205,724	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	55	50	347	58,867	素材	
DCC PLC	38	38	186	31,640	資本財	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	510	—	—	—	保険	
DIAGEO PLC	900	850	3,085	522,994	食品・飲料・タバコ	
EVRAZ PLC	217	—	—	—	素材	
EXPERIAN PLC	354	339	931	157,869	商業・専門サービス	
GLENCORE PLC	3,852	3,676	1,847	313,271	素材	
GSK PLC	1,935	1,513	2,093	354,917	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
ENTAIN PLC	214	214	265	45,056	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	130	130	101	17,149	各種金融	
HALMA PLC	146	146	318	54,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HALEON PLC	—	1,946	531	90,115	家庭用品・パーソナル用品	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	76	57	68	11,584	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HSBC HOLDINGS PLC	7,870	7,492	3,316	562,245	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	374	331	696	118,033	食品・飲料・タバコ	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	78	64	297	50,378	消費者サービス	
INTERTEK GROUP PLC	60	60	229	38,985	商業・専門サービス	
INFORMA PLC	565	565	319	54,095	メディア・娯楽	
JD SPORTS FASHION PLC	194	973	95	16,222	小売	
JOHNSON MATTHEY PLC	65	73	142	24,123	素材	
KINGFISHER PLC	883	781	166	28,240	小売	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,375	2,256	530	89,893	保険	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	27,374	25,535	1,097	186,028	銀行	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	127	124	927	157,237	各種金融	
M&G PLC	995	995	180	30,561	各種金融	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,629	1,629	177	30,168	資本財	
MONDI PLC	183	183	276	46,835	素材	
NATIONAL GRID PLC	1,408	1,349	1,268	215,022	公益事業	
NEXT PLC	54	46	233	39,554	小売	
NMC HEALTH PLC	80	80	0	0	ヘルスケア機器・サービス	
OCADO GROUP PLC	200	226	114	19,399	食品・生活必需品小売り	
PERSIMMON PLC	135	124	162	27,467	耐久消費財・アパレル	
PEARSON PLC	262	260	249	42,342	メディア・娯楽	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	248	302	165	28,123	保険	
PRUDENTIAL PLC	1,022	1,017	831	140,931	保険	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	283	265	1,583	268,464	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	740	715	1,653	280,249	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	789	859	448	76,018	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC	431	420	1,981	335,829	素材	
NATWEST GROUP PLC	2,078	1,929	471	79,955	銀行	
SHELL PLC-A SHS	1,592	—	—	—	エネルギー	
SHELL PLC-B SHS	1,441	—	—	—	エネルギー	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,210	3,210	236	40,102	資本財	
SAINSBURY (J) PLC	595	706	134	22,751	食品・生活必需品小売り	
SAGE GROUP PLC/THE	428	388	289	49,130	ソフトウェア・サービス	
SCHRODERS PLC	41	302	120	20,365	各種金融	
SSE PLC	398	398	606	102,850	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	115	90	222	37,673	公益事業	
SHELL PLC-NEW	—	2,780	6,364	1,078,989	エネルギー	
SMITHS GROUP PLC	154	136	210	35,708	資本財	
SMITH & NEPHEW PLC	350	315	316	53,641	ヘルスケア機器・サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	26	28	316	53,620	資本財	
ST JAMES'S PLACE PLC	192	205	217	36,838	各種金融	
ABRDN PLC	885	885	137	23,340	各種金融	
STANDARD CHARTERED PLC	1,097	954	529	89,677	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,240	1,240	117	20,000	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	3,045	2,778	586	99,371	食品・生活必需品小売り	
UNILEVER PLC	1,009	953	3,743	634,549	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	261	261	242	41,137	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	10,974	9,965	983	166,684	電気通信サービス	
WHITBREAD PLC	82	69	181	30,758	消費者サービス	
FERGUSON PLC	87	79	755	128,062	資本財	
WPP PLC	501	411	316	53,677	メディア・娯楽	
小 計	株数・金額	113,073	106,610	63,865	10,826,472	
	銘柄数<比率>	83	80	—	<4.2%>	

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	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
ABB LTD-REG	674	612	1,704	253,580		資本財
ADECCO GROUP AG-REG	54	55	166	24,810		商業・専門サービス
ALCON INC	188	186	1,112	165,577		ヘルスケア機器・サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	16	17	234	34,877		保険
CLARIANT AG-REG	75	79	137	20,510		素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,046	987	473	70,393		各種金融
VIFOR PHARMA AG	19	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEBERIT AG-REG	14	13	592	88,210		資本財
GIVAUDAN-REG	3	3	1,071	159,396		素材
HOLCIM LTD	216	206	882	131,330		素材
JULIUS BAER GROUP LTD	81	84	394	58,702		各種金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19	19	444	66,185		運輸
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.04	401	59,702		食品・飲料・タバコ
LONZA GROUP AG-REG	28	27	1,447	215,460		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG	1,111	1,051	11,367	1,691,614		食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG	856	806	6,280	934,581		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	8	8	762	113,460		各種金融
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	202	195	2,015	299,926		耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	271	261	8,668	1,289,894		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	14	13	212	31,619		資本財
SGS SA-REG	2	2	528	78,589		商業・専門サービス
SIKA AG-REG	55	55	1,257	187,186		素材
SONOVA HOLDING AG-REG	22	20	492	73,219		ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11	11	548	81,564		保険
SWISSCOM AG-REG	10	9	439	65,457		電気通信サービス
SWISS RE AG	122	113	869	129,334		保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	10	11	259	38,638		耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	1,423	1,301	2,121	315,769		各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG	56	56	2,375	353,525		保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	244	36,311		食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	8	—	—	—		銀行
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	14	107	15,989		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	178	26,578		素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.44	0.4	394	58,631		食品・飲料・タバコ
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	66	66	340	50,723		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	12	10	413	61,473		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5	10	166	24,775		資本財
SIG GROUP AG	—	109	217	32,408		素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4	40	408	60,750		ヘルスケア機器・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	25	27	221	32,919		不動産
TEMENOS AG	26	22	133	19,848		ソフトウェア・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	18	18	79	11,859		耐久消費財・アパレル
VAT GROUP AG	—	10	239	35,645		資本財
小計	株数 銘柄数	6,793 40	6,547 41	50,406 —	7,501,036 <2.9%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ALFA LAVAL AB	105	107	2,777	37,463		資本財
ASSA ABLOY AB-B	385	374	8,262	111,465		資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	257	1,029	12,171	164,186		資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	153	534	5,705	76,963		資本財
BOLIDEN AB	108	102	3,380	45,606		素材
ELECTROLUX AB-B	80	80	1,029	13,888		耐久消費財・アパレル
EMBRACER GROUP AB	186	239	1,302	17,568		メディア・娯楽
EPIROC AB-A	275	249	4,353	58,727		資本財
EPIROC AB-B	154	154	2,355	31,773		資本財
EQT AB	106	106	2,392	32,272		各種金融
ERICSSON LM-B SHS	1,154	1,076	6,520	87,960		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESSITY AKTIEBOLAG-B	210	236	5,378	72,559		家庭用品・パーソナル用品

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
EVOLUTION AB	68	67	6,850	92,413	消費者サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	45	232	916	12,360	不動産	
GETINGE AB-B SHS	—	76	1,682	22,699	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	301	278	3,249	43,833	小売	
HEXAGON AB-B SHS	788	719	8,100	109,272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLMEN AB-B SHARES	—	35	1,502	20,271	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	150	150	958	12,926	資本財	
ICA GRUPPEN AB	42	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	59	59	1,483	20,006	各種金融	
INVESTOR AB-B SHS	693	693	12,568	169,555	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	42	49	1,243	16,768	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS(N)	7	—	—	—	各種金融	
INVESTOR AB-A SHS	—	191	3,593	48,474	各種金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	68	68	1,306	17,621	資本財	
INDUTRADE AB	—	101	2,006	27,067	資本財	
KINNEVIK AB - B	102	82	1,190	16,060	各種金融	
LIFCO AB-B SHS	—	84	1,395	18,824	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	23	22	988	13,329	各種金融	
LUNDIN ENERGY AB	85	—	—	—	エネルギー	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	561	564	5,001	67,464	資本財	
NORDEA BANK ABP	1,284	1,260	13,533	182,569	銀行	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	624	624	7,478	100,883	銀行	
SANDVIK AB	457	389	6,744	90,979	資本財	
SAGAX AB-B	—	79	1,550	20,919	不動産	
SECURITAS AB-B SHS	146	94	834	11,254	商業・専門サービス	
SECURITAS AB-B SHS(N)	—	83	739	9,977	商業・専門サービス	
SINCH AB	188	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SKANSKA AB-B SHS	114	143	2,224	30,011	資本財	
SKF AB-B SHARES-B	140	140	2,222	29,979	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	223	226	3,270	44,118	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	477	534	5,531	74,621	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	362	345	5,569	75,132	銀行	
SWEDISH MATCH AB	632	567	6,421	86,622	食品・飲料・タバコ	
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	—	71	1,457	19,659	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELE2 AB-B SHS	187	232	2,058	27,770	電気通信サービス	
TELIA CO AB	942	942	2,736	36,914	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS-B	576	566	9,976	134,578	資本財	
VOLVO AB-A SHS	71	71	1,300	17,548	資本財	
VOLVO CAR AB-B	—	204	929	12,539	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額	12,647	14,348	184,244	2,485,464	
	銘柄数<比率>	42	47	—	<1.0%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
ADEVINTA ASA	114	114	790	11,226	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	—	121	3,862	54,844	エネルギー	
DNB BANK ASA	397	358	6,453	91,645	銀行	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	68	74	1,407	19,981	保険	
MOWI ASA	153	163	2,305	32,732	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO A S	538	506	3,274	46,500	素材	
ORKLA ASA	226	259	2,021	28,701	食品・飲料・タバコ	
SALMAR ASA	—	21	661	9,393	食品・飲料・タバコ	
SCHIBSTED ASA-CL A	24	—	—	—	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	38	—	—	—	メディア・娯楽	
EQUINOR ASA	374	364	13,063	185,501	エネルギー	
TELENOR ASA	239	239	2,161	30,692	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	76	66	3,050	43,322	素材	
小計	株数・金額	2,250	2,288	39,052	554,542	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.2%>	

銘柄	株数	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		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円			
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	2	1	3,115	61,710	運輸		
AP MOELLER - MAERSK A/S - A	1	1	1,674	33,165	運輸		
AMBU A/S-B	67	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス		
CARLSBERG AS-B	39	36	3,248	64,359	食品・飲料・タバコ		
CHR HANSEN HOLDING A/S	38	38	1,656	32,816	素材		
COLOPLAST-B	42	44	3,785	74,987	ヘルスケア機器・サービス		
DANSKE BANK A/S	207	266	2,706	53,608	銀行		
ORSTED A/S	73	70	4,405	87,276	公益事業		
DSV A/S	76	69	7,040	139,474	運輸		
GENMAB A/S	25	24	6,972	138,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
GN STORE NORD A/S	49	49	788	15,619	ヘルスケア機器・サービス		
NOVO NORDISK A/S-B	652	617	49,826	987,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
NOVOZYMES A/S-B SHARES	79	72	2,854	56,540	素材		
PANDORA A/S	40	33	1,337	26,503	耐久消費財・アパレル		
ROCKWOOL A/S-B SHS	3	3	463	9,173	資本財		
TRYG A/S	154	139	2,181	43,219	保険		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	391	382	5,475	108,469	資本財		
DEMANT A/S	44	36	764	15,142	ヘルスケア機器・サービス		
小 計	株 数	金 額	1,991	1,888	98,296	1,947,244	
	銘柄数 < 比率 >		18	17	—	< 0.8% >	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル				
AFTERPAY LTD	82	—	—	—	ソフトウェア・サービス		
AGL ENERGY LTD	212	—	—	—	公益事業		
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,057	1,103	2,835	268,003	銀行		
APA GROUP	458	458	452	42,782	公益事業		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	252	220	795	75,205	消費者サービス		
ARISTOCRAT LEISURE LTD-RTS(N)	12	—	—	—	消費者サービス		
ASX LTD	79	71	470	44,506	各種金融		
BHP GROUP LTD	1,141	1,892	7,284	688,455	素材		
BLUESCOPE STEEL LTD	183	183	287	27,168	素材		
BRAMBLES LTD	624	547	612	57,848	商業・専門サービス		
AMPOL LTD	87	87	239	22,682	エネルギー		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	689	639	6,505	614,832	銀行		
COCHLEAR LTD	29	25	495	46,829	ヘルスケア機器・サービス		
COMPUTERSHARE LTD	158	209	516	48,772	ソフトウェア・サービス		
COLES GROUP LTD	520	492	817	77,274	食品・生活必需品小売り		
CROWN RESORTS LTD	113	—	—	—	消費者サービス		
CSL LTD	175	179	4,951	468,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	21	21	124	11,784	消費者サービス		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	504	504	369	34,910	食品・生活必需品小売り		
EVOLUTION MINING LTD	690	690	133	12,618	素材		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	660	640	1,041	98,435	素材		
IDP EDUCATION LTD	—	72	208	19,658	消費者サービス		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	951	951	461	43,602	保険		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	178	169	562	53,184	素材		
LOTTERY CORP LTD/THE	—	855	360	34,040	消費者サービス		
SYDNEY AIRPORT	470	—	—	—	運輸		
MACQUARIE GROUP LTD	133	136	2,246	212,298	各種金融		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	48	—	—	—	各種金融		
MEDIBANK PRIVATE LTD	925	1,084	380	35,918	保険		
MINERAL RESOURCES LTD	—	62	466	44,083	素材		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,295	1,194	3,815	360,639	銀行		
NEWCREST MINING LTD	302	323	552	52,215	素材		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	421	421	348	32,975	素材		
OIL SEARCH LTD	776	—	—	—	エネルギー		
ORIGIN ENERGY LTD	535	683	366	34,673	公益事業		
ORICA LIMITED	121	176	241	22,785	素材		
QANTAS AIRWAYS LTD	440	350	208	19,665	運輸		

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
QBE INSURANCE GROUP LTD	450	552	663	62,666	保険	
AURIZON HOLDINGS LTD	735	735	260	24,613	運輸	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	63	71	406	38,416	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	18	18	217	20,563	メディア・娯楽	
REECE LTD	102	102	149	14,103	資本財	
RIO TINTO LTD	141	140	1,287	121,674	素材	
SANTOS LTD	654	1,216	931	88,075	エネルギー	
SEEK LTD	107	128	271	25,644	メディア・娯楽	
SONIC HEALTHCARE LTD	176	176	557	52,725	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	2,057	1,698	611	57,801	素材	
AUSNET SERVICES	728	—	—	—	公益事業	
SUNCORP GROUP LTD	572	442	488	46,144	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	709	—	—	—	消費者サービス	
TELSTRA CORPORATION LTD	1,820	—	—	—	電気通信サービス	
TELSTRA GROUP LTD	—	1,449	561	53,028	電気通信サービス	
TRANSURBAN GROUP	1,270	1,136	1,433	135,499	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	257	279	355	33,574	食品・飲料・タバコ	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	66	83	230	21,817	エネルギー	
WESTPAC BANKING CORP	1,445	1,313	3,139	296,739	銀行	
WESFARMERS LTD	454	409	1,824	172,466	小売	
WISETECH GLOBAL LTD	51	59	336	31,790	ソフトウェア・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	504	439	1,467	138,657	食品・生活必需品小売り	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	383	712	2,512	237,423	エネルギー	
XERO LTD	54	49	376	35,597	ソフトウェア・サービス	
小 計	株数・金額	27,182	25,662	56,236	5,314,888	
	銘柄数<比率>	57	51	—	<2.1%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
A2 MILK CO LTD	351	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	565	471	347	29,518	運輸	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	212	231	442	37,555	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	459	459	209	17,805	公益事業	
MERCURY NZ LTD	204	204	108	9,233	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD	188	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	765	765	390	33,164	電気通信サービス	
小 計	株数・金額	2,745	2,132	1,498	127,277	
	銘柄数<比率>	7	5	—	<0.0%>	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	4,661	4,491	26,097	492,729	保険	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,500	1,345	3,328	62,849	銀行	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	679	1,117	21,100	食品・飲料・タバコ	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	250	250	893	16,874	公益事業	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,112	977	3,937	74,342	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	770	730	3,228	60,949	不動産	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	570	779	14,721	小売	
CLP HOLDINGS LTD	595	595	3,085	58,246	公益事業	
ESR GROUP LTD	758	758	1,155	21,810	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	920	810	2,980	56,277	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	780	884	16,699	不動産	
HANG SENG BANK LTD	291	291	3,256	61,478	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	579	579	1,172	22,136	不動産	
HKT TRUST AND HKT LTD	1,500	1,500	1,344	25,374	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS	550	495	1,767	33,363	公益事業	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	950	950	447	8,447	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	3,842	4,032	2,459	46,439	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	463	446	9,990	188,618	各種金融	
MTR CORP	575	575	1,946	36,747	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	726	616	1,084	20,467	不動産	
SANDS CHINA LTD	1,114	966	1,325	25,022	消費者サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SINO LAND CO	1,430	1,230	1,133	21,396	不動産
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	520	520	750	14,176	運輸
SJM HOLDINGS LTD	910	—	—	—	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	529	524	4,510	85,161	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	175	175	956	18,057	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	416	416	643	12,158	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	550	525	4,016	75,826	資本財
WH GROUP LTD	3,393	2,998	1,349	25,478	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	638	638	2,089	39,448	不動産
WYNN MACAU LTD	630	—	—	—	消費者サービス
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	820	710	782	14,772	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	32,630 31	30,175 30	88,515 —	1,671,175 <0.6%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALLAND INVESTMENT LTD/SI	1,185	1,050	322	33,685	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	173	173	126	13,215	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	717	673	2,207	230,721	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	2,111	2,111	166	17,427	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	533	533	351	36,746	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,377	1,240	1,451	151,657	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	539	539	271	28,331	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	297	252	210	21,988	各種金融
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,691	3,047	740	77,394	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	519	633	201	21,101	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	418	418	1,092	114,138	銀行
UOL GROUP LTD	155	155	93	9,733	不動産
VENTURE CORP LTD	99	99	157	16,438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD	739	739	257	26,896	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,556 14	11,665 14	7,650 —	799,477 <0.3%>
(イスラエル)			千イスラエルシケル		
AZRIELI GROUP LTD	13	17	462	19,450	不動産
BANK LEUMI LE-ISRAEL	570	625	2,114	88,988	銀行
BANK HAPOALIM BM	455	411	1,396	58,801	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	—	687	420	17,715	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	12	10	719	30,274	資本財
ICL GROUP LTD	260	260	812	34,209	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	403	483	964	40,585	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	49	49	645	27,184	銀行
NICE LTD	25	24	1,692	71,258	ソフトウェア・サービス
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	37	555	23,393	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,789 8	2,606 10	9,784 —	411,861 <0.2%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	423,944 1,227	414,859 1,211	— —	248,313,230 <96.2%>

(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) 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)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,240	5,690	797	118,257	0.0	
PROLOGIS INC	28,678	34,365	3,722	551,824	0.2	
AMERICAN TOWER CORP	17,649	17,089	3,341	495,297	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	19,130	—	—	—	—	
VEREIT INC	8,272	—	—	—	—	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	11,180	366	54,339	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	60,900	15,557	275	40,770	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	5,220	933	138,348	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	5,977	5,717	430	63,836	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	3,700	432	64,042	0.0	
CROWN CASTLE INC	16,670	16,040	2,027	300,601	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,095	10,635	1,079	160,086	0.1	
DUKE REALTY CORPORATION	14,585	—	—	—	—	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,300	6,550	396	58,778	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	14,290	13,340	883	130,922	0.1	
EQUINIX INC	3,463	3,368	1,868	277,022	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	2,480	586	86,921	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	4,960	859	127,465	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	9,370	446	66,181	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	20,375	469	69,585	0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	11,000	215	31,974	0.0	
WELLTOWER INC	16,720	16,750	1,011	149,864	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	27,179	489	72,517	0.0	
INVITATION HOMES INC	22,810	22,810	774	114,823	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	11,725	10,895	539	79,956	0.0	
KIMCO REALTY CORP	—	21,830	447	66,335	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,100	23,470	254	37,677	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	4,300	661	98,126	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	6,119	5,919	1,776	263,308	0.1	
REALTY INCOME CORP	15,030	22,221	1,344	199,243	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	6,695	6,005	349	51,751	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,250	4,030	1,034	153,284	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,974	12,114	1,282	190,052	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	4,380	4,640	600	89,047	0.0	
UDR INC	9,590	12,100	490	72,765	0.0	
VENTAS INC	14,825	14,895	582	86,372	0.0	
VICI PROPERTIES INC	21,340	35,610	1,094	162,260	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	6,851	6,851	162	24,118	0.0	
WEYERHAEUSER CO	28,918	27,758	857	127,181	0.0	
WP CAREY INC	6,460	7,310	537	79,641	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	501,005	483,323	33,424	4,954,585	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	37	—	< 1.9% >	
(カナダ)			千カナダドル			
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	2,800	116	12,657	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,800	2,800	116	12,657	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 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		
(ユーロ…フランス)			千ユーロ	千円	%	
COVIVIO	1,925	1,925	103	15,318	0.0	
GECINA SA	1,950	1,950	175	25,832	0.0	
KLEPIERRE	6,642	8,402	166	24,465	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,360	4,160	195	28,845	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	15,877	16,437	641	94,461	
銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>		
(ユーロ…ベルギー)						
WAREHOUSES DE PAUW SCA	—	5,160	136	20,089	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	—	5,160	136	20,089	
銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.0%>		
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	15,877	21,597	777	114,550	
銘 柄 数 < 比 率 >	4	5	—	<0.0%>		
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	30,601	111	18,835	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	26,624	151	25,671	0.0	
SEGRO PLC	45,033	45,033	359	60,919	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	108,638	102,258	621	105,426	
銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>		
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
VICINITY CENTRES	178,802	154,902	281	26,571	0.0	
DEXUS/AU	35,587	42,067	322	30,494	0.0	
GOODMAN GROUP	63,582	63,582	1,052	99,511	0.0	
GPT GROUP	71,335	71,335	287	27,169	0.0	
LENLEASE GROUP	28,927	23,367	191	18,086	0.0	
MIRVAC GROUP	135,075	135,075	264	25,021	0.0	
SCENTRE GROUP	198,271	198,271	531	50,219	0.0	
STOCKLAND	96,900	82,300	278	26,290	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	808,479	770,899	3,209	303,364	
銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>		
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	87,500	77,300	3,644	68,811	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	87,500	77,300	3,644	68,811	
銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>		
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND ASCENDAS REIT	116,243	138,243	346	36,260	0.0	
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	209,556	381	39,855	0.0	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	72,200	106,000	167	17,501	0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	139,399	144,556	211	22,054	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	537,398	598,355	1,106	115,672	
銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>		
合 計	口 数 ・ 金 額	2,061,697	2,056,532	—	5,675,069	
銘 柄 数 < 比 率 >	58	59	—	<2.2%>		

(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) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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		百万円	百万円
		DJSTX5	745	—
		SP EMINI	4,159	—

(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

(2022年10月26日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
	千円	%
株式	248,313,230	96.2
投資証券	5,675,069	2.2
コール・ローン等、その他	4,249,676	1.6
投資信託財産総額	258,237,975	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（256,547,480千円）の投資信託財産総額（258,237,975千円）に対する比率は99.3%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。1アメリカドル=148.23円、1カナダドル=108.69円、1ユーロ=147.36円、1イギリスポンド=169.52円、1スイスフラン=148.81円、1スウェーデンクローナ=13.49円、1ノルウェークローネ=14.20円、1デンマーククローネ=19.81円、1オーストラリアドル=94.51円、1ニュージーランドドル=84.92円、1香港ドル=18.88円、1シンガポールドル=104.50円、1イスラエルシェケル=42.0932円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年10月26日現在）

項目	当期末	円
(A) 資産	260,726,731,092	
コール・ローン等	1,722,516,775	
株式(評価額)	248,313,230,169	
投資証券(評価額)	5,675,069,108	
未収入金	2,695,285,827	
未収配当金	187,388,237	
差入委託証拠金	2,133,240,976	
(B) 負債	2,677,329,468	
未払金	2,561,360,392	
未払解約金	115,966,485	
未払利息	2,591	
(C) 純資産総額(A-B)	258,049,401,624	
元本	58,419,890,528	
次期繰越損益金	199,629,511,096	
(D) 受益権総口数	58,419,890,528口	
1万口当たり基準価額(C/D)	44,171円	

(注) 当ファンドの期首元本額は61,697,952,086円、期中追加設定元本額は10,737,486,481円、期中一部解約元本額は14,015,548,039円です。

(注) 2022年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	29,264,146,292円
・グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	10,069,193,942円
・インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	5,927,380,507円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,109,823,145円
・日興五大陸株式ファンド	3,657,320,915円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,821,226,129円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	1,452,645,742円
・DCインデックスバランス(株式80)	699,491,289円
・DCインデックスバランス(株式60)	642,259,230円
・DCインデックスバランス(株式40)	324,451,133円
・DCインデックスバランス(株式20)	122,426,648円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	90,192,400円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	78,434,511円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	76,968,989円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	51,457,152円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	18,154,493円
・インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	14,318,011円

(注) 1口当たり純資産額は4,4171円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○損益の状況（2021年10月27日～2022年10月26日）

項目	当期	円
(A) 配当等収益	5,015,504,071	
受取配当金	5,012,222,996	
受取利息	791	
その他収益金	4,495,501	
支払利息	△ 1,215,217	
(B) 有価証券売買損益	13,458,860,888	
売買益	76,738,919,962	
売買損	△ 63,280,059,074	
(C) 先物取引等取引損益	△ 368,222,175	
取引益	782,590,689	
取引損	△ 1,150,812,864	
(D) 保管費用等	△ 39,197,432	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	18,066,945,352	
(F) 前期繰越損益金	192,357,632,211	
(G) 追加信託差損益金	33,693,950,995	
(H) 解約差損益金	△ 44,489,017,462	
(I) 計(E+F+G+H)	199,629,511,096	
次期繰越損益金(I)	199,629,511,096	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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

約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。