

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220期（決算日 2024年1月15日）第222期（決算日 2024年3月15日）第224期（決算日 2024年5月15日）
第221期（決算日 2024年2月15日）第223期（決算日 2024年4月15日）第225期（決算日 2024年6月17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、2024年6月17日に第225期の決算を行ないましたので、第220期から第225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。
	海外株式インデックスMSCI-KOUSAI（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。
組入制限	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。
	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-KOUSAI（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。
分配方針	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	純資産額
		税金分配	み入金	期騰落					
	円		円	中率 %	%	%	%	百万円	
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
214期(2023年7月18日)	10,707		10	0.4	32.6	0.3	32.0	33.0	39,178
215期(2023年8月15日)	10,825		10	1.2	32.9	0.2	31.9	32.8	39,623
216期(2023年9月15日)	10,988		10	1.6	33.4	0.3	31.5	32.7	40,089
217期(2023年10月16日)	10,635		10	△3.1	32.5	0.4	32.6	32.3	38,536
218期(2023年11月15日)	10,958		10	3.1	32.6	0.4	32.0	32.7	39,455
219期(2023年12月15日)	10,988		10	0.4	32.1	0.3	32.0	33.4	38,974
220期(2024年1月15日)	11,278		10	2.7	32.8	0.3	32.0	32.6	39,343
221期(2024年2月15日)	11,324		10	0.5	33.2	0.4	32.2	31.7	38,877
222期(2024年3月15日)	11,424		10	1.0	33.4	0.4	32.2	31.9	38,771
223期(2024年4月15日)	11,619		10	1.8	33.2	0.5	32.1	32.1	39,153
224期(2024年5月15日)	11,866		10	2.2	32.7	0.5	31.7	32.9	39,673
225期(2024年6月17日)	11,834		10	△0.2	32.8	0.4	32.1	32.4	39,212

(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	騰 落 率		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率				
第220期	(期 首) 2023年12月15日	円 10,988	% —	% —	% 32.1	% 0.3	% 32.0	% 33.4
	12月末	11,069	0.7	—	32.3	0.3	32.3	32.9
	(期 末) 2024年1月15日	11,288	2.7	—	32.8	0.3	32.0	32.6
第221期	(期 首) 2024年1月15日	11,278	—	—	32.8	0.3	32.0	32.6
	1月末	11,302	0.2	—	33.0	0.3	32.1	32.2
	(期 末) 2024年2月15日	11,334	0.5	—	33.2	0.4	32.2	31.7
第222期	(期 首) 2024年2月15日	11,324	—	—	33.2	0.4	32.2	31.7
	2月末	11,442	1.0	—	33.5	0.3	32.2	31.6
	(期 末) 2024年3月15日	11,434	1.0	—	33.4	0.4	32.2	31.9
第223期	(期 首) 2024年3月15日	11,424	—	—	33.4	0.4	32.2	31.9
	3月末	11,786	3.2	—	33.2	0.6	31.7	32.3
	(期 末) 2024年4月15日	11,629	1.8	—	33.2	0.5	32.1	32.1
第224期	(期 首) 2024年4月15日	11,619	—	—	33.2	0.5	32.1	32.1
	4月末	11,772	1.3	—	32.9	0.5	31.9	31.8
	(期 末) 2024年5月15日	11,876	2.2	—	32.7	0.5	31.7	32.9
第225期	(期 首) 2024年5月15日	11,866	—	—	32.7	0.5	31.7	32.9
	5月末	11,771	△0.8	—	32.9	0.6	31.9	32.4
	(期 末) 2024年6月17日	11,844	△0.2	—	32.8	0.4	32.1	32.4

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

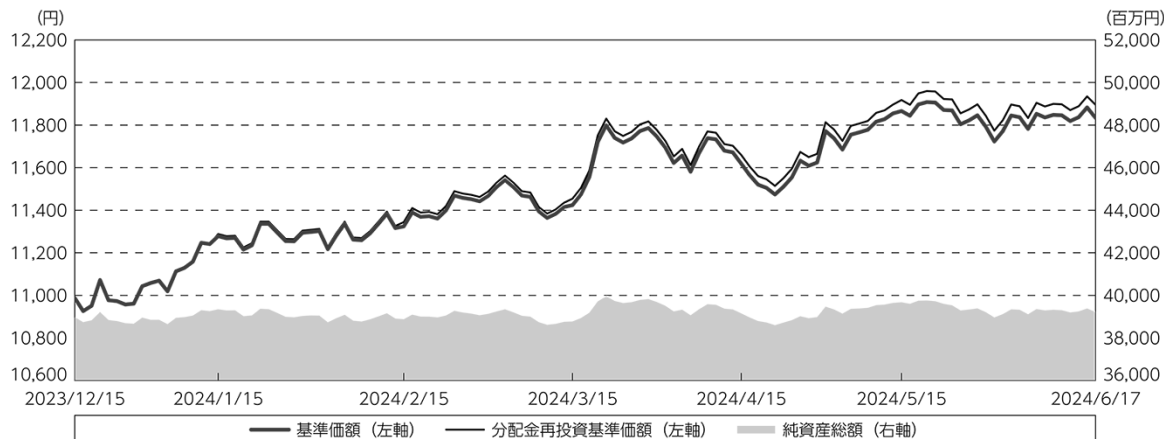
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2023年12月16日～2024年6月17日)

作成期間中の基準価額等の推移



第220期首：10,988円

第225期末：11,834円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：8.3% (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(2023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おりません。

○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なっており、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。

当作成期間中において、基準価額の変動要因となった、各マザーファンドの騰落率および当期間末における組入比率は以下の通りです。

詳しくは「投資環境」をご参照ください。

投資対象資産	投資対象ファンド	騰落率	組入比率
不動産	日本リートインデックスJ-R E I Tマザーファンド	△3.0%	15.4%
	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	8.1%	16.9%
債券	日本債券インデックスマザーファンド	△1.8%	15.6%
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	9.7%	16.8%
株式	日本株式インデックスTOP I Xマザーファンド	17.2%	16.3%
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	25.0%	17.3%

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。

都心部オフィスの空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したことや、国内株式市場が堅調に推移したことなどがREIT価格の支援材料となったものの、米国の商業用不動産市場の混乱が警戒されたことや、日銀がマイナス金利政策の解除を決定したこと、日銀が追加利上げや国債買入れの減額などの金融政策の正常化を進めるとの思惑が高まり国内長期金利が上昇したことなどが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12月下旬にかけては、米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が利下げを巡る議論を始めたことを受けて、FRBが2024年に複数回にわたり利下げを行なうとの観測が強まったことや、原油など資源価格の下落を受けてインフレ懸念が後退し欧米主要国の長期金利が概して低下したことなどから、同指数は上昇しました。

2024年1月上旬から5月下旬にかけては、米国の主要REIT決算が概ね堅調な内容となったことや、世界的な人工知能（AI）の導入の加速とともにAI関連企業の業績拡大および米国経済のソフトランディング（軟着陸）への期待が高まり株式市場が上昇したことがREIT価格の支援材料となったものの、FRB議長が米国連邦公開市場委員会（FOMC）後の記者会見で金融緩和に慎重な考えを示したことを受けてFRBによる政策金利の早期利下げ観測が後退したことや、米国の景況感に関する経済指標などが市場予想を上回り米国の景気減速への懸念が後退し米国の長期金利が上昇したこと、中東情勢の緊迫化などから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。

6月上旬から期間末にかけては、欧州中央銀行（ECB）やカナダの中央銀行が利下げを決定したことや、市場予想を下回る米国のインフレ指標などを受けてFRBによる利下げへの期待が高まり米国をはじめとする主要国の長期金利が低下したこと、株式市場が上昇したことなどが支援材料となり、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。

米国の消費者物価指数（CPI）が市場予想を下回り、米国のインフレへの警戒感が和らいだ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、企業から高い水準の回答が相ついで春闘を受けて日銀が金融政策決定会合でマイナス金利を解除するとの観測が強まったことや、その後にマイナス金利政策の解除を行なったこと、堅調な米国の経済指標の発表を背景にFRBの利下げが遅れるとの見方が強まったこと、円

安ノアメリカドル高が輸入物価の上昇を通じて国内のインフレ圧力となり日銀の追加利上げを促すとの思惑が高まったこと、日銀が実施した国債買い入れオペで購入額を減額したことを受けて国債需給の緩みが意識されたことなどから、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12月下旬にかけては、FRB議長が利下げを巡る議論を始めたことを受けて、FRBが2024年に複数回にわたり利下げを行なうとの観測が強まったことや、原油など資源価格の下落を受けてインフレ懸念が後退したことなどを背景に、各国の10年国債利回りは概して低下しました。2024年1月上旬から5月下旬にかけては、ECBが今後の物価見通しを下方修正したことや、スウェーデンなど先進国の一部の中央銀行が政策金利を引き下げたこと、中東情勢の緊迫化を受けて世界的なリスク回避ムードが強まったことなどが利回りの低下要因となったものの、FRB議長がFOMC後の記者会見で金融緩和に慎重な考えを示したことを受けてFRBによる政策金利の早期利下げ観測が後退したことや、米国の雇用統計の内容が堅調だったこと、米国の景況感に関する経済指標が市場予想を上回り米国の景気減速への懸念が後退したことを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。6月上旬から期間末にかけては、ECBやカナダの中央銀行が利下げを決定したことや、市場予想を下回る米国のインフレ指標などを受けてFRBによる利下げへの期待が高まり、各国の10年国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。

中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、国内の長期金利が上昇したことを受けて株式の相対的な割高感が意識されたことなどが株価の重しとなったものの、企業の好調な業績を受けて海外の投資家が日本株式への関心を高めていることや、日銀による金融緩和の長期化観測を背景に円安ノアメリカドル高が進み輸出企業の好調な業績が期待されたこと、日銀が金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除や上場投資信託（ETF）の買い入れ終了などを決定した一方で日銀総裁の記者会見での発言などから緩和的な金融環境が当面続くとの見方が広がったこと、米国の大手半導体企業の好決算などを背景に半導体関連の銘柄を中心にハイテク株が堅調だったことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。

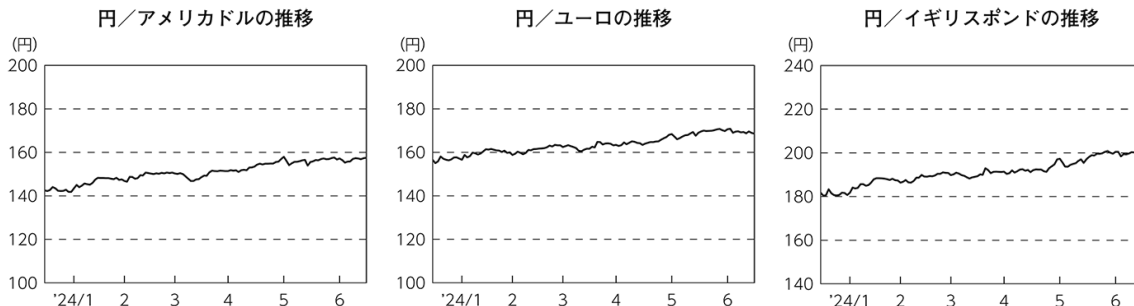
（海外株式市況）

海外株式市場では、欧米諸国などの株価は、期間の初めと比べて総じて上昇しました。

欧米の早期利下げ観測の後退などから欧米の長期金利が上昇したことや、中東情勢が緊迫化したことなどが株価の重しとなったものの、FOMCにおいてFRBが2024年に利下げに転じるとの見方を示したことや、生成AIの活用の広がりからAI関連の大手ハイテク企業などへの業績期待が高まったこと、ECB総裁がECB理事会後の記者会見で利下げを示唆したこと、米国の労働市場における需給のひっ迫が薄れたこと、米国のCPIが市場予想を下回ったことなどが支援材料となり、欧米諸国などの株価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、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、税引後配当込み、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	TOPIX（東証株価指数）配当込み
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220期	第221期	第222期	第223期	第224期	第225期
	2023年12月16日～ 2024年1月15日	2024年1月16日～ 2024年2月15日	2024年2月16日～ 2024年3月15日	2024年3月16日～ 2024年4月15日	2024年4月16日～ 2024年5月15日	2024年5月16日～ 2024年6月17日
当期分配金	10	10	10	10	10	10
(対基準価額比率)	0.089%	0.088%	0.087%	0.086%	0.084%	0.084%
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	3,114	3,159	3,259	3,454	3,702	3,703

(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、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2023年12月16日～2024年6月17日）

項 目	第220期～第225期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 61	% 0.528	(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 ）	(26)	(0.222)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(32)	(0.278)	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)	(0.028)	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	0.001	(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)	(0.000)	
（ 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)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.017	(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)	(0.006)	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)	(0.008)	印刷費用等は、法定開示資料の印刷に係る費用、約款で定めるマザーファンドの運用において利用する指数の標章使用料など
（ そ の 他 ）	(0)	(0.001)	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	63	0.547	
作成期間の平均基準価額は、11,523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。

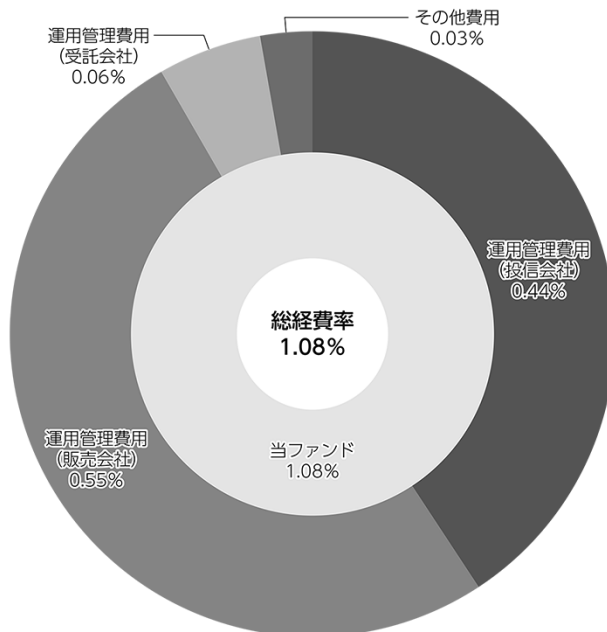
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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1.08%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) 「その他費用」には保管費用が含まれる場合があります。なお、「その他費用」の内訳は「1万口当たりの費用明細」にてご確認いただけますが、期中の費用の総額と年率換算した値は一致しないことがあります。

(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

(2023年12月16日～2024年6月17日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第220期～第225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 925	千円 2,321	千口 1,268	千円 3,265
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	4	14	196,917	630,870
日本債券インデックスマザーファンド	2,391	3,199	—	—
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	—	—	130,440	379,107
日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド	—	—	362,402	969,629
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	—	—	190,395	1,133,952

○株式売買比率

(2023年12月16日～2024年6月17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220期～第225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	6,243,616千円	23,640,884千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	57,938,297千円	366,532,658千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.10	0.06

(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

(2023年12月16日～2024年6月17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220期～第225期		
	買 付 額	売 付 額	第225期末保有額
株式	百万円 3	百万円 5	百万円 193

＜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（2023年12月16日～2024年6月17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

(2023年12月16日～2024年6月17日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年6月17日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第219期末		第225期末	
		口	数	口	数
		千口		千円	
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド		2,487,307		2,486,965	6,033,128
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド		2,138,039		1,941,127	6,641,954
日本債券インデックスマザーファンド		4,634,497		4,636,888	6,108,173
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド		2,280,511		2,150,070	6,579,430
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド		2,642,431		2,280,029	6,377,925
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド		1,204,160		1,013,764	6,769,009

(注) 各親投資信託の2024年6月17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	24,754,972千口	・海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	55,620,468千口
・海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	16,493,547千口	・日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	21,236,631千口
・日本債券インデックスマザーファンド	41,634,998千口	・海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	63,890,308千口

○投資信託財産の構成

(2024年6月17日現在)

項	目	第225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		6,033,128	15.3
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド		6,641,954	16.9
日本債券インデックスマザーファンド		6,108,173	15.5
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド		6,579,430	16.7
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド		6,377,925	16.2
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド		6,769,009	17.2
コール・ローン等、その他		805,718	2.2
投資信託財産総額		39,315,337	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（421,993,038千円）の投資信託財産総額（428,848,776千円）に対する比率は98.4%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（170,279,447千円）の投資信託財産総額（170,366,186千円）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（56,421,034千円）の投資信託財産総額（56,442,196千円）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=157.53円、1カナダドル=114.69円、1メキシコペソ=8.5109円、1ユーロ=168.64円、1イギリスポンド=199.87円、1スイスフラン=176.84円、1スウェーデンクローナ=14.97円、1ノルウェークローネ=14.77円、1デンマーククローネ=22.60円、1ポーランドズロチ=38.5195円、1オーストラリアドル=104.17円、1ニュージーランドドル=96.66円、1香港ドル=20.16円、1シンガポールドル=116.47円、1マレーシアリンギット=33.3525円、1韓国ウォン=0.1143円、1中国人民元=21.7006円、1イスラエルシェケル=42.3507円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第220期末	第221期末	第222期末	第223期末	第224期末	第225期末
	2024年1月15日現在	2024年2月15日現在	2024年3月15日現在	2024年4月15日現在	2024年5月15日現在	2024年6月17日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	39,484,807,652	39,029,223,387	38,872,671,562	39,244,585,393	39,767,995,995	39,315,337,282
コール・ローン等	712,956,274	753,290,246	699,802,779	716,485,507	776,077,987	782,559,668
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド(評価額)	6,351,589,555	5,987,685,551	6,020,530,236	6,187,241,893	6,335,295,181	6,033,128,907
海外リートインデックス(トビジなし)マザーファンド(評価額)	6,453,466,536	6,359,462,314	6,371,810,045	6,384,595,976	6,696,271,330	6,641,954,259
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	6,295,037,463	6,209,257,492	6,187,464,115	6,149,905,318	6,102,145,366	6,108,173,321
海外債券インデックス(トビジなし)マザーファンド(評価額)	6,402,216,690	6,433,555,536	6,371,461,538	6,479,293,843	6,545,422,560	6,579,430,737
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド(評価額)	6,701,975,748	6,557,141,233	6,569,480,344	6,687,269,738	6,516,772,087	6,377,925,683
海外株式インデックスEuronext(トビジなし)マザーファンド(評価額)	6,456,968,072	6,652,398,362	6,628,654,806	6,624,434,523	6,777,425,573	6,769,009,473
未収入金	110,597,314	76,432,653	23,467,699	15,356,981	18,584,164	23,153,468
未収利息	—	—	—	1,614	1,747	1,766
(B) 負債	140,898,304	151,997,436	100,942,528	91,048,370	94,138,492	102,521,195
未払収益分配金	34,885,091	34,332,377	33,939,265	33,698,280	33,433,505	33,134,354
未払解約金	67,197,131	78,153,611	29,273,862	16,429,939	20,614,664	25,582,685
未払信託報酬	34,548,043	34,647,591	32,319,878	34,899,985	33,500,301	37,101,539
未払利息	79	20	25	—	—	—
その他未払費用	4,267,960	4,863,837	5,409,498	6,020,166	6,590,022	6,702,617
(C) 純資産総額(A-B)	39,343,909,348	38,877,225,951	38,771,729,034	39,153,537,023	39,673,857,503	39,212,816,087
元本	34,885,091,925	34,332,377,464	33,939,265,869	33,698,280,672	33,433,505,099	33,134,354,286
次期繰越損益金	4,458,817,423	4,544,848,487	4,832,463,165	5,455,256,351	6,240,352,404	6,078,461,801
(D) 受益権総口数	34,885,091,925口	34,332,377,464口	33,939,265,869口	33,698,280,672口	33,433,505,099口	33,134,354,286口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,278円	11,324円	11,424円	11,619円	11,866円	11,834円

(注) 当ファンドの第220期首元本額は35,471,422,735円、第220～225期中追加設定元本額は403,069,289円、第220～225期中一部解約元本額は2,740,137,738円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第220期1.1278円、第221期1.1324円、第222期1.1424円、第223期1.1619円、第224期1.1866円、第225期1.1834円です。

○損益の状況

項 目	第220期	第221期	第222期	第223期	第224期	第225期
	2023年12月16日～ 2024年1月15日	2024年1月16日～ 2024年2月15日	2024年2月16日～ 2024年3月15日	2024年3月16日～ 2024年4月15日	2024年4月16日～ 2024年5月15日	2024年5月16日～ 2024年6月17日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 4,068	△ 3,625	△ 1,523	38,095	47,406	54,864
受取利息	—	—	—	38,162	47,406	54,864
支払利息	△ 4,068	△ 3,625	△ 1,523	△ 67	—	—
(B) 有価証券売買損益	1,082,462,601	224,885,143	405,247,133	724,642,915	894,729,736	△ 36,242,131
売買益	1,089,906,603	734,051,397	453,981,202	769,073,971	995,389,988	338,964,500
売買損	△ 7,444,002	△ 509,166,254	△ 48,734,069	△ 44,431,056	△ 100,660,252	△ 375,206,631
(C) 信託報酬等	△ 35,287,255	△ 35,388,926	△ 33,011,412	△ 35,646,726	△ 34,217,094	△ 37,355,180
(D) 当期繰越損益金 (A+B+C)	1,047,171,278	189,492,592	372,234,198	689,034,284	860,560,048	△ 73,542,447
(E) 前期繰越損益金	7,094,191,967	7,956,563,875	8,007,674,400	8,273,528,134	8,846,271,268	9,570,596,249
(F) 追加信託差損益金	△3,647,660,731	△3,566,875,603	△3,513,506,168	△3,473,607,787	△3,433,045,407	△3,385,457,647
(配当等相当額)	(2,757,728,721)	(2,736,997,804)	(2,717,813,551)	(2,712,362,024)	(2,704,267,110)	(2,697,171,559)
(売買損益相当額)	(△6,405,389,452)	(△6,303,873,407)	(△6,231,319,719)	(△6,185,969,811)	(△6,137,312,517)	(△6,082,629,206)
(G) 計 (D+E+F)	4,493,702,514	4,579,180,864	4,866,402,430	5,488,954,631	6,273,785,909	6,111,596,155
(H) 収益分配金	△ 34,885,091	△ 34,332,377	△ 33,939,265	△ 33,698,280	△ 33,433,505	△ 33,134,354
次期繰越損益金 (G+H)	4,458,817,423	4,544,848,487	4,832,463,165	5,455,256,351	6,240,352,404	6,078,461,801
追加信託差損益金	△3,647,660,731	△3,566,875,603	△3,513,506,168	△3,473,607,787	△3,433,045,407	△3,385,457,647
(配当等相当額)	(2,757,803,840)	(2,737,051,246)	(2,717,861,715)	(2,712,436,152)	(2,704,301,280)	(2,697,214,132)
(売買損益相当額)	(△6,405,464,571)	(△6,303,926,849)	(△6,231,367,883)	(△6,186,043,939)	(△6,137,346,687)	(△6,082,671,779)
分配準備積立金	8,106,478,154	8,111,724,090	8,345,969,333	8,928,864,138	9,673,397,811	9,573,348,931
繰越損益金	—	—	—	—	—	△ 109,429,483

(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(2023年12月16日～2024年6月17日)は以下の通りです。

項 目	2023年12月16日～ 2024年1月15日	2024年1月16日～ 2024年2月15日	2024年2月16日～ 2024年3月15日	2024年3月16日～ 2024年4月15日	2024年4月16日～ 2024年5月15日	2024年5月16日～ 2024年6月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	86,195,842円	47,324,379円	92,765,380円	122,441,811円	65,076,549円	35,887,036円
b. 有価証券売買損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	888,629,111円	142,168,213円	279,468,818円	566,592,473円	795,483,499円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,757,803,840円	2,737,051,246円	2,717,861,715円	2,712,436,152円	2,704,301,280円	2,697,214,132円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,166,538,292円	7,956,563,875円	8,007,674,400円	8,273,528,134円	8,846,271,268円	9,570,596,249円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	10,899,167,085円	10,883,107,713円	11,097,770,313円	11,674,998,570円	12,411,132,596円	12,303,697,417円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,124円	3,169円	3,269円	3,464円	3,712円	3,713円
g. 分配金	34,885,091円	34,332,377円	33,939,265円	33,698,280円	33,433,505円	33,134,354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し処理しています。

○分配金のお知らせ

	第220期	第221期	第222期	第223期	第224期	第225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

2023年12月16日から2024年6月17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19期（決算日 2024年6月17日）
（2023年6月16日～2024年6月17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		
	円	%		%	%	百万円
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
19期(2024年6月17日)	24,259	△4.0	4,239.82	△4.2	99.4	60,052

○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	
(期首) 2023年6月15日	円	%		%	%
	25,260	—	4,424.14	—	99.0
6月末	25,243	△0.1	4,421.28	△0.1	99.0
7月末	25,538	1.1	4,472.88	1.1	98.9
8月末	25,916	2.6	4,539.20	2.6	98.5
9月末	25,517	1.0	4,468.30	1.0	98.6
10月末	25,002	△1.0	4,372.14	△1.2	98.8
11月末	25,483	0.9	4,455.46	0.7	99.1
12月末	25,070	△0.8	4,382.85	△0.9	99.0
2024年1月末	25,048	△0.8	4,378.56	△1.0	98.7
2月末	23,849	△5.6	4,166.74	△5.8	98.4
3月末	25,222	△0.2	4,410.17	△0.3	98.8
4月末	25,481	0.9	4,455.74	0.7	96.3
5月末	24,611	△2.6	4,302.09	△2.8	99.0
(期末) 2024年6月17日	円	%		%	%
	24,259	△4.0	4,239.82	△4.2	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年6月16日～2024年6月17日)

基準価額の推移

期間の初め25,260円の基準価額は、期間末に24,259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>

- ・都心部オフィスにおける空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したこと。
- ・国内株式市場が堅調に推移したこと。

<値下がり要因>

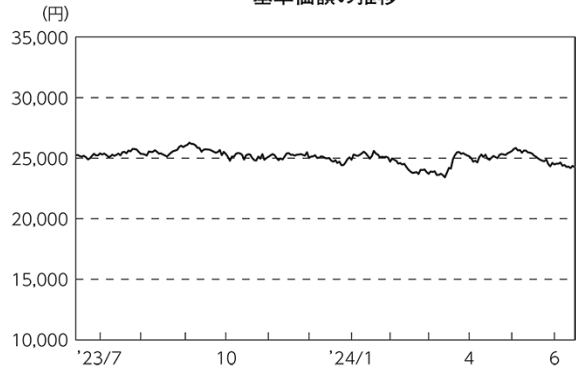
- ・日銀が金融政策決定会合にて長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用の柔軟化を決定したこと。
- ・日銀がマイナス金利政策の解除を決定したことに加え、追加利上げや国債買入れの減額などの金融政策の正常化を進めるとの思惑が高まり国内長期金利が上昇したこと。

(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下落しました。

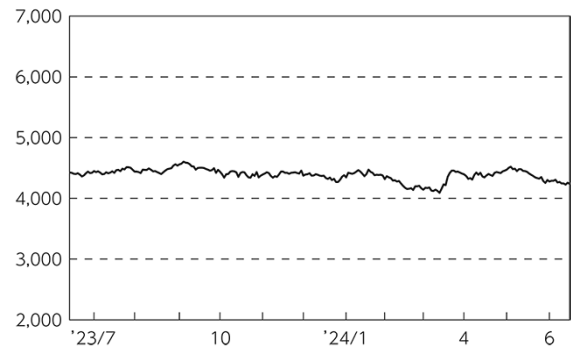
都心部オフィスの空室率が低下したことに加え平均賃料が上昇したことや、国内株式市場が堅調に推移したことなどがREIT価格の支援材料となったものの、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定したことや、米国の商業用不動産市場の混乱が警戒されたこと、日銀がマイナス金利政策の解除を決定したこと、日銀が追加利上げや国債買入れの減額などの金融政策の正常化を進めるとの思惑が高まり国内長期金利が上昇したことなどがREIT価格の重しとなり、東証REIT指数（配当込み）は下落しました。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/06/15	2023/09/05	2024/03/13	2024/06/17
25,260円	26,269円	23,421円	24,259円

東証REIT指数（配当込み）の推移



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、4.0%の値下がりとなり、ベンチマークである「東証REIT指数（配当込み）」の下落率4.2%を概ね0.2%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>

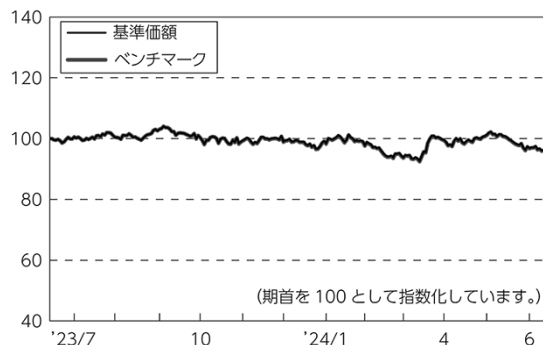
- ・売買委託手数料などの諸費用が発生したこと。

○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。

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

(2023年6月16日~2024年6月17日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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、25,165円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2023年6月16日～2024年6月17日)

投資信託証券

銘柄	買付	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		230	27,122	146	17,291
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券		364	32,587	232	21,137
S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券		575	69,296	359	44,320
東海道リート投資法人 投資証券		307	38,206	210	25,627
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券		391	246,099	248	158,287
森ヒルズリート投資法人 投資証券		1,334	184,392	847	119,456
産業ファンド投資法人 投資証券		3,542	467,232	1,114	151,726
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券		1,278	424,150	977	332,548
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		173 (△ 3,926)	38,712 (△ 848,515)	396	89,047
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券		581	229,541	382	153,284
GLP投資法人 投資証券		3,854	521,187	2,532	335,631
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券		632	205,354	352	116,122
日本プロロジスリート投資法人 投資証券		1,992	534,541	1,252	345,106
星野リゾート・リート投資法人 投資証券		418	238,766	132	81,190
Oneリート投資法人 投資証券		198	51,193	126	32,326
イオンリート投資法人 投資証券		1,831	261,862	878	126,135
ヒューリックリート投資法人 投資証券		1,059	160,715	671	105,573
日本リート投資法人 投資証券		369	125,810	234	81,405
積水ハウス・リート投資法人 投資証券		3,404	272,003	2,158	176,945
トーセイ・リート投資法人 投資証券		238	32,432	214	29,435
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券		99 (△ 2,324)	27,948 (△ 629,957)	235	67,164
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券		278	38,990	176	24,729
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券		379	42,083	196	21,924
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券		3,665	582,030	2,324	379,359
いちごホテルリート投資法人 投資証券		189	20,344	120	13,456
ラサールロジポート投資法人 投資証券		1,752	264,155	917	136,324
スターアジア不動産投資法人 投資証券		3,045	172,313	751	44,224
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券		183	23,270	111	14,025
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券		589	275,529	298	138,332
日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券		172	11,571	157	10,483
投資法人みらい 投資証券		2,392	107,076	932	43,230
三菱地所物流リート投資法人 投資証券		401	153,486	248	95,635
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券		499	78,873	309	49,412
ザイマックス・リート投資法人 投資証券		183	21,439	116	13,566
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券		917	88,769	349	34,101
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券		510	63,977	315	39,426
日本ビルファンド投資法人 投資証券		1,319	792,622	836	495,879

銘柄		買付		売却		
		口数	金額	口数	金額	
国	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,175	653,387	739	416,539	
	日本都市ファンド投資法人 投資証券	5,415	517,768	4,856	465,408	
	オリックス不動産投資法人 投資証券	2,255	381,878	1,429	249,894	
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	776	268,692	493	173,766	
	N T T都市開発リート投資法人 投資証券	1,416	178,766	698	91,980	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	760	130,947	483	85,140	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	850	93,356	530	59,441	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	2,533	374,145	1,606	244,046	
	森トラストリート投資法人 投資証券	2,556	184,381	1,382	100,414	
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	7,968	477,353	3,469	214,762	
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	419	189,472	265	120,742	
	平和不動産リート投資法人 投資証券	1,254	173,768	535	75,677	
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	724	205,567	663	193,191	
	福岡リート投資法人 投資証券	586	95,965	371	60,559	
	KDX不動産投資法人 投資証券	2,700	451,348	1,061	221,884	
		(12,276)	(1,478,472)			
	内	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	929	77,912	589	50,594
		大和証券オフィス投資法人 投資証券	278	147,271	148	94,365
			(1,214)	(-)		
		阪急阪神リート投資法人 投資証券	682	95,492	342	47,984
		スターツプロシード投資法人 投資証券	197	40,498	125	26,535
大和ハウスリート投資法人 投資証券		1,707	452,586	1,082	289,283	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券		4,452	324,744	2,371	179,894	
大和証券リビング投資法人 投資証券		2,122	229,176	1,020	110,654	
ジャパンエクスセレント投資法人 投資証券		984	125,937	898	117,649	
合 計	82,080	12,796,115	47,005	7,854,284		
	(7,240)	(-)				

(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

(2023年6月16日～2024年6月17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 (2023年6月16日～2024年6月17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

(2024年6月17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	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,150	1,234		146,229	0.2
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,813	1,945		161,824	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,814	3,030		348,450	0.6
東海道リート投資法人 投資証券	941	1,038		126,324	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,954	2,097		1,342,080	2.2
森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,654	7,141		927,615	1.5
産業ファンド投資法人 投資証券	8,633	11,061		1,350,548	2.2
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,657	5,958		1,906,560	3.2
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	4,149	—		—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,987	3,186		1,167,669	1.9
G L P 投資法人 投資証券	19,076	20,398		2,649,700	4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,706	2,986		939,097	1.6
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,839	10,579		2,645,807	4.4
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	990	1,276		649,484	1.1
O n e リート投資法人 投資証券	987	1,059		270,045	0.4
イオンリート投資法人 投資証券	6,496	7,449		981,033	1.6
ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,294	5,682		816,503	1.4
日本リート投資法人 投資証券	1,838	1,973		655,036	1.1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,002	18,248		1,412,395	2.4
トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,255	1,279		175,734	0.3
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,460	—		—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,395	1,497		189,220	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,471	1,654		171,850	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,297	19,638		2,755,211	4.6
いちごホテルリート投資法人 投資証券	937	1,006		109,654	0.2
ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,927	7,762		1,139,461	1.9
スターアジア不動産投資法人 投資証券	7,065	9,359		554,988	0.9
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	864	936		122,241	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	2,235	2,526		1,088,706	1.8
日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券	913	928		68,857	0.1
投資法人みらい 投資証券	6,874	8,334		370,446	0.6
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,944	2,097		787,423	1.3
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,424	2,614		371,449	0.6
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	918	985		115,540	0.2
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,667	3,235		318,971	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,466	2,661		316,659	0.5
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,601	7,084		4,101,636	6.8
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,802	6,238		3,162,666	5.3
日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,549	29,108		2,613,898	4.4
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,274	12,100		1,906,960	3.2
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,870	4,153		1,358,031	2.3
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	5,439	6,157		712,980	1.2

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	%
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,794	4,071	4,071	629,783	1.0
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,164	4,484	4,484	446,606	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,657	13,584	13,584	1,931,644	3.2
森トラストリート投資法人 投資証券	10,531	11,705	11,705	804,133	1.3
インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,904	29,403	29,403	1,996,463	3.3
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,099	2,253	2,253	1,002,585	1.7
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,987	4,706	4,706	616,486	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,815	3,876	3,876	1,028,690	1.7
福岡リート投資法人 投資証券	2,926	3,141	3,141	496,278	0.8
KDX不動産投資法人 投資証券	3,292	17,207	17,207	2,624,067	4.4
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,636	4,976	4,976	404,548	0.7
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,172	2,516	2,516	703,473	1.2
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,556	2,896	2,896	379,955	0.6
スターツプロシード投資法人 投資証券	981	1,053	1,053	211,021	0.4
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,529	9,154	9,154	2,239,983	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,247	20,328	20,328	1,603,879	2.7
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,841	8,943	8,943	920,234	1.5
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,191	5,277	5,277	634,295	1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	344,949	387,264	59,683,122	
	銘 柄 数 < 比 率 >	60	58	< 99.4% >	

(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」、「SOSi LA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」、「アクティブ・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」、「日本ホテル&レジデンシャル投資法人 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」、「NTT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」、「KDX不動産投資法人 投資証券」、「大和証券オフィス投資法人 投資証券」、「スターツ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

(2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	59,683,122	99.1
コール・ローン等、その他	550,387	0.9
投資信託財産総額	60,233,509	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 (2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	60,233,509,301	
コール・ローン等	214,999,838	
投資証券(評価額)	59,683,122,100	
未収配当金	335,386,878	
未収利息	485	
(B) 負債	180,665,430	
未払金	179,233,450	
未払解約金	1,431,980	
(C) 純資産総額(A-B)	60,052,843,871	
元本	24,754,972,956	
次期繰越損益金	35,297,870,915	
(D) 受益権総口数	24,754,972,956口	
1万口当たり基準価額(C/D)	24,259円	

(注) 当ファンドの期首元本額は23,882,441,576円、期中追加設定元本額は4,090,508,774円、期中一部解約元本額は3,217,977,394円です。

(注) 2024年6月17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)	19,637,886,849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	2,486,965,212円
・財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	1,696,418,639円
・財産3分法(適格機関投資家専用)	722,843,641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)	159,795,689円
・財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)奇数月分配型	47,493,070円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	1,885,915円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	1,160,932円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	523,009円

(注) 1口当たり純資産額は2,4259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し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2023年6月16日から2024年6月17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 (2023年6月16日～2024年6月17日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	2,616,790,585	
受取配当金	2,616,793,736	
受取利息	44,182	
支払利息	△ 47,333	
(B) 有価証券売買損益	△ 5,006,989,421	
売買益	679,705,241	
売買損	△ 5,686,694,662	
(C) 保管費用等	△ 2	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 2,390,198,838	
(E) 前期繰越損益金	36,443,645,990	
(F) 追加信託差損益金	6,116,019,674	
(G) 解約差損益金	△ 4,871,595,911	
(H) 計(D+E+F+G)	35,297,870,915	
次期繰越損益金(H)	35,297,870,915	

(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19期（決算日 2024年6月17日）
（2023年6月16日～2024年6月17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、税引後配当込み、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、税引後配当込み、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、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
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
19期(2024年6月17日)	34,217	19.6	314.59	18.6	99.1	56,436

(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2024年6月17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、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		投資信託 組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2023年6月15日	円	%		%	%
6月末	28,616	—	265.31	—	99.6
7月末	29,405	2.8	272.31	2.6	99.0
8月末	29,568	3.3	273.71	3.2	99.5
9月末	30,023	4.9	277.81	4.7	99.3
10月末	28,349	△0.9	261.72	△1.4	98.9
11月末	26,722	△6.6	246.55	△7.1	99.5
12月末	29,490	3.1	272.10	2.6	99.5
2024年1月末	31,842	11.3	294.08	10.8	99.0
2月末	31,587	10.4	291.24	9.8	99.1
3月末	32,144	12.3	296.38	11.7	99.0
4月末	33,396	16.7	307.65	16.0	98.7
5月末	32,823	14.7	302.02	13.8	97.2
6月末	33,368	16.6	306.99	15.7	99.4
(期末) 2024年6月17日					
	34,217	19.6	314.59	18.6	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2023年6月16日～2024年6月17日）

基準価額の推移

期間の初め28,616円の基準価額は、期間末に34,217円となり、騰落率は+19.6%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>

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が利下げを巡る議論を始めたことを受けて、FRBが2024年に複数回にわたり利下げを行なうとの観測が強まり米国の長期金利が総じて低下したこと（2023年11月上旬～12月下旬）。
- ・欧州中央銀行（ECB）やカナダの中央銀行が利下げを決定したことや、市場予想を下回る米国のインフレ指標などを受けてFRBによる利下げへの期待が高まり米国をはじめとする主要国の長期金利が低下したこと（2024年6月上旬～期間末）。
- ・米国の主要REIT決算が概ね堅調な内容となったこと。

<値下がり要因>

- ・格付け会社が米国国債の格付けを引き下げたことや、米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて米国の金融引き締めが長期化する見方が改めて広がり米国の長期金利が上昇したこと（期間の初め～2023年10月下旬）。
- ・中東情勢の緊迫化などからリスク回避姿勢が強まったこと。

（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2023年10月下旬にかけては、格付け会社が米国国債の格付けを引き下げたことや、FOMCの結果を受けて米国の金融引き締めが長期化する見方が改めて広がり米国の長期金利が上昇したこと、米国連邦議会で政府の予算案を巡る協議が難航し政府機関の一部が閉鎖される懸念が高まったことなどが重しとなり、同指数は下落しました。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2023/06/15	2024/05/20	2023/10/30	2024/06/17
28,616円	34,271円	26,637円	34,217円

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

11月上旬から12月下旬にかけては、米国の雇用統計で非農業部門の雇用者数が市場予想を下回ったことや、FRB議長が利下げを巡る議論を始めたと明言したことを受けて、FRBが2024年に複数回にわたり利下げを行なうとの観測が強まり米国の長期金利が総じて低下したことなどから、同指数は上昇しました。

2024年1月上旬から5月下旬にかけては、米国の主要REIT決算が概ね堅調な内容となったことや、世界的な人工知能（AI）の導入の加速とともにAI関連企業の業績拡大および米国経済のソフトランディング（軟着陸）への期待が高まり株式市場が上昇したことがREIT価格の支援材料となったものの、FRB議長がFOMC後の記者会見で金融緩和に慎重な考えを示したことを受けてFRBによる政策金利の早期引き下げ観測が後退したことや、米国の景況感に関する経済指標などが市場予想を上回り米国の景気減速への懸念が後退し米国の長期金利が上昇したこと、中東情勢の緊迫化などから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。

6月上旬から期間末にかけては、ECBやカナダの中央銀行が利下げを決定したことや、市場予想を下回る米国のインフレ指標などを受けてFRBによる利下げへの期待が高まり米国をはじめとする主要国の長期金利が低下したこと、株式市場が上昇したことなどが支援材料となり、同指数は上昇しました。

（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。



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、19.6%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、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」の上昇率18.6%を概ね1.0%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>

- ・ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異が寄与したこと。

<マイナス要因>

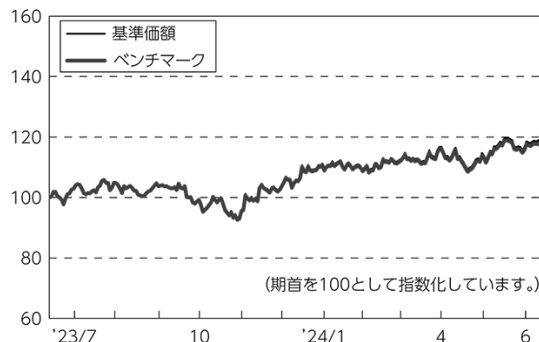
- ・REITの組入比率による要因が影響したこと。
- ・売買手数料や海外口座管理費用などのコストが発生したこと。

○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、税引後配当込み、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。

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

(2023年6月16日～2024年6月17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 4 (4)	% 0.013 (0.013)	(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)	2 (2)	0.006 (0.006)	(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)	18 (15) (3)	0.059 (0.049) (0.010)	(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	24	0.078	
期中の平均基準価額は、30,726円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2023年6月16日～2024年6月17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	5,492	86	8,958	140
AGREE REALTY CORPORATION	5,781	364	7,389	451
ALEXANDER & BALDWIN INC	1,564	30	6,106	107
ALEXANDER'S INC	62	11	248	48
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	4,296	505	13,000	1,512
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	1,095	17	2,210	37
AMERICAN ASSETS TRUST INC	—	—	3,978	83
PROLOGIS INC	23,576	2,848	74,310	8,841
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	10,239	368	24,165	855
AMERICOLD REALTY TRUST INC	10,244	315	25,892	778
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	3,632	26	5,287	37
	(△ 40,796)	(△ 288)		
APPLE HOSPITALITY REIT INC	6,138	94	17,684	273
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	—	—	13,941	108
APARTMENT INCOME REIT CO	3,632	124	12,896	452
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	—	—	2,869	34
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	3,792	10
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	3,185	11	9,401	29
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,803	715	11,004	2,026
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	—	1,014	14
BOSTON PROPERTIES INC	3,948	248	11,339	699
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,912	176	23,970	524
BRANDYWINE REALTY TRUST	10,170	44	19,563	88
BRT APARTMENTS CORP	—	—	772	15
BROADSTONE NET LEASE INC-A	7,781	127	13,671	213
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,780	295	9,715	1,013
CARETRUST REIT INC	12,620	282	9,792	211
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,596	35	2,820	63
CHATHAM LODGING TRUST	2,726	25	5,463	53
CLIPPER REALTY INC	—	—	1,958	10
COPT DEFENSE PROPERTIES	2,414	61	8,817	216
COUSINS PROPERTIES INC	3,430	80	11,866	268
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	961	27	1,784	51
CTO REALTY GROWTH INC	667	11	2,214	38
SITE CENTERS CORP	5,439	73	15,996	215
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5,128	41	16,639	139
DIGITAL REALTY TRUST INC	16,273	2,137	22,724	2,880
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	139,224	79	29,300	18
	(—)	(△ 3)	(—)	(0.914)

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
DOUGLAS EMMETT INC	3,808	51	15,997	213
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,773	64	9,168	116
EASTGROUP PROPERTIES INC	2,133	381	3,443	591
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	3,304	26	10,302	91
EPR PROPERTIES	1,803	80	5,806	253
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,855	533	14,353	949
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	9,409	610	26,960	1,707
EQUINIX INC	2,398	1,899	7,148	5,473
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	6,875	168	10,985	268
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,657	393	5,328	1,263
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,403	738	14,931	2,047
	(22,715)	(3,248)		
FARMLAND PARTNERS INC	1,048	11	6,172	70
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,919	192	5,844	572
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	3,471	176	10,744	544
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,830	98	6,670	162
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8,667	414	20,194	936
GETTY REALTY CORPORATION	2,811	88	3,769	109
GLOBAL NET LEASE INC	3,331	30	12,312	109
	(27,333)	(288)		
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,397	16	2,845	36
GLADSTONE LAND CORP	1,786	29	3,424	50
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,777	27	7,397	72
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14,089	286	46,925	924
	(45,491)	(976)		
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	9,836	174	30,824	526
WELLTOWER INC	35,331	2,963	39,847	3,455
HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	—	1,161	11
			(9,863)	(59)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,316	56	8,101	190
SERVICE PROPERTIES TRUST	3,787	33	13,216	104
HOST HOTELS & RESORTS INC	18,344	313	59,987	1,066
EQUITY COMMONWEALTH	3,388	67	9,015	174
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	8,533	47	14,389	81
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,421	76	16,450	271
CENTERSPACE	—	—	901	56
INVITATION HOMES INC	14,925	515	48,526	1,647
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	3,168	12	10,088	38
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	647	50	2,124	179
INDUS REALTY TRUST INC	—	—	—	—
			(1,721)	(115)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	1,675	41	5,238	126
IRON MOUNTAIN INC	7,512	471	23,193	1,500
JBG SMITH PROPERTIES	2,702	40	11,659	183

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
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	-	-	46,700	15
	(-)	(△ 2)		
KILROY REALTY CORPORATION	3,343	112	8,756	297
KIMCO REALTY CORP	16,298	322	50,832	980
	(13,409)	(229)		
KITE REALTY GROUP TRUST	5,894	132	17,650	382
LXP INDUSTRIAL TRUST	10,527	107	22,020	205
LTC PROPERTIES INC	1,209	40	3,266	107
MACERICH CO/THE	5,161	65	17,728	232
VERIS RESIDENTIAL INC	745	12	4,882	79
MANULIFE US REAL ESTATE INV	73,100	8	243,300	25
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	14,072	117	46,972	309
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,034	439	9,061	1,263
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,074	70	8,638	310
NNN REIT INC	4,909	205	14,649	596
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,333	70	3,717	204
NEXPOINT RESIDENTIAL	-	-	1,450	54
NETSTREIT CORP	4,996	88	4,369	75
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	1,853	11	2,863	19
	(375)	(2)		
NET LEASE OFFICE PROPERTY	-	-	-	-
	(42)	(1)		
NET LEASE OFFICE PROPERTY (N)	-	-	-	-
	(4,209)	(54)		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,018	291	18,877	584
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	580	11	1,835	37
ORION OFFICE REIT INC	3,800	23	10,795	55
PARAMOUNT GROUP INC	4,879	24	15,441	74
PARK HOTELS & RESORTS INC	5,135	69	21,266	304
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,342	44	14,013	195
PEAKSTONE REALTY TRUST	11,627	221	1,923	28
PHYSICIANS REALTY TRUST	7,243	105	13,431	181
	(△ 67,495)	(△ 976)		
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	4,654	163	9,768	331
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	1,987	15	8,057	58
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	814	20	4,368	97
PRIME US REIT	-	-	-	-
	(-)	(△ 1)		
PRIME US REIT(N)	-	-	-	-
	(18,420)	(-)		
PUBLIC STORAGE	4,049	1,134	12,725	3,541
RPT REALTY	-	-	5,103	59
	(△ 22,168)	(△ 229)		
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	2,101	30	8,202	109

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
REALTY INCOME CORP	43,862 (30,279)	2,552 (1,585)	54,222	3,027
REGENCY CENTERS CORP	4,273 (3,003)	268 (180)	12,932	795
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	10,786	571	15,454	779
RLJ LODGING TRUST	2,259	22	13,002	137
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,921	265	4,716	463
SABRA HEALTH CARE REIT INC	5,562	72	17,853	232
SAUL CENTERS INC	—	—	725	26
SAFEHOLD INC	2,144	44	3,455	73
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	8,479	23	27,417	72
SIMON PROPERTY GROUP INC	8,268	1,001	26,603	3,383
SL GREEN REALTY CORP	1,664	61	5,206	200
LIFE STORAGE INC	— (△ 25,381)	— (△ 3,248)	1,890	248
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,433 (△ 39,736)	138 (△ 1,585)	8,533	335
STAG INDUSTRIAL INC	5,195	193	14,503	521
STAR HOLDINGS	—	—	4,193	58
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,937	23	8,590	52
SUN COMMUNITIES INC	3,192	417	9,857	1,237
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,992	65	19,350	192
TANGER INC	3,079	75	8,029	198
TERRENO REALTY CORP	7,633	470	6,173	358
CUBESMART	5,691	243	18,040	769
UDR INC	7,928	317	26,771	1,044
UMH PROPERTIES INC	772	11	1,857	28
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	252	11	848	37
UNITI GROUP INC	75,581	400	11,703	59
URBAN EDGE PROPERTIES	2,924	47	9,377	152
URSTADT BIDDLE - CLASS A	— (△ 8,655)	— (△ 180)	953	19
VENTAS INC	10,560	492	32,000	1,467
VICI PROPERTIES INC	32,478	1,017	79,282	2,393
VORNADO REALTY TRUST	4,460	97	13,579	307
ELME COMMUNITIES	1,709	28	6,337	97
WHITESTONE REIT	2,889	29	6,374	68
WP CAREY INC	6,970	459	16,472 (—)	1,031 (54)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,144	14	9,806	125
小 計	1,001,751 (△ 38,955)	33,849 (52)	2,146,742 (11,584)	79,574 (230)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	1,410	23	5,299	97

銘柄		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
外 国	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	2,823	19
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	—	—	6,925	70
	BOARDWALK EQUITIES INC	850	58	1,638	109
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	47	0.686	—	—
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	11,109	37	12,900	41
	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	1,595	81	6,830	322
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,422	34	4,617	108
	CHOICE PROPERTIES REIT	5,203	69	13,428	178
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	2,556	34
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	—	—	2,850	39
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	4,727	63	9,454	123
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,430 (△ 3,012)	51 (△ 41)	6,379	78
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV(N)	— (1,506)	— (41)	—	—
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	5,674	16	18,801	46
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	6,555	98
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,181	85	3,024	222
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,675	24	10,456	99
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,252	15	3,539	45
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	—	7,702	24
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,292	41	5,400	96
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,070	16	1,178	16
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	—	—	957	14
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	—	—	2,049	14
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,331	15	7,683	41
	PRIMARIS REIT	4,115	56	7,695	101
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	6,325	33	4,896	26
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,375	66	11,269	209
	SLATE GROCERY REIT	3,463	46	6,007	76
	SLATE OFFICE REIT	—	—	12,044	18
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	— (△ 12,783)	— (△ 32)	—	—
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E(N)	— (2,223)	— (32)	—	—
小計	63,546 (△ 12,066)	839 (—)	184,954	2,378	
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ	
ドイツ					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	—	—	2,768	11	
HAMBORNER REIT AG	— (—)	— (△ 5)	3,652	23	
小計	— (—)	— (△ 5)	6,420	34	

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ	
	イタリア					
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,956	21	7,153	17
		小 計	8,956	21	7,153	17
	フランス					
		ALTAREA	240 (-)	22 (△ 0.121)	545	48
		CARMILA	1,432 (-)	21 (△ 14)	5,521	83
		COVIVIO	1,724	76	3,941	174
		GECINA SA	1,358	133	5,171	504
		ICADE	595 (-)	22 (△ 16)	2,851	92
		KLEPIERRE	5,041 (-)	119 (△ 51)	15,604	368
		MERCIALYS	7,496	64	7,169	65
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,697 (-)	143 (△ 69)	9,942	556
		小 計	20,583 (-)	604 (△ 151)	50,744	1,893
	オランダ					
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,888	41	4,126	88
		NSI NV	-	-	821	16
		VASTNED RETAIL	1,411	28	2,435	47
		WERELDHAVE NV	1,553	24	4,759	68
		小 計	4,852	94	12,141	221
	スペイン					
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	6,854 (-)	39 (△ 4)	28,376	160
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	- (-)	- (△ 0.754)	5,305	32
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	7,444 (-)	63 (△ 21)	25,773	229
		小 計	14,298 (-)	102 (△ 27)	59,454	423
	ベルギー					
		AEDIFICA	1,306 (2,254)	78 (131)	3,715 (-)	223 (14)
		AEDIFICA SA-RTS	-	-	- (12,400)	- (14)
		AEDIFICA SA-RTS (N)	- (12,400)	- (14)	-	-
	CARE PROPERTY INVEST	1,623	20	3,751	49	
	COFINIMMO	2,952	206	3,022	203	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	-	-	8,508	176	

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				
MONTEA	1,461	109	917	70
RETAIL ESTATES	689	39	811	47
WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,640	258	13,331	341
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,902	77	1,561	42
小 計	20,573 (14,654)	791 (145)	35,616 (12,400)	1,155 (28)
アイルランド				
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,708	10	29,794	31
小 計	10,708	10	29,794	31
ガーンジー				
SHURGARD SELF STORAGE LTD	9,300	371	1,034	41
小 計	9,300	371	1,034	41
シンガポール				
CROMWELL REIT EUR	7,200 (-)	10 (△ 9)	45,400	66
小 計	7,200 (-)	10 (△ 9)	45,400	66
ユ ー ロ 計	96,470 (14,654)	2,007 (△ 47)	247,756 (12,400)	3,883 (28)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
AEW UK REIT PLC	12,301	12	9,248	9
ASSURA PLC	131,515	59	287,533	125
BIG YELLOW GROUP PLC	10,105	117	14,176	150
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	25,143	19	97,308	69
BRITISH LAND COMPANY PLC	25,176	85	76,443	266
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	82,646	99	143,092	176
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	-	-	205,988	163
CLS HOLDINGS PLC	-	-	24,512	31
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	28,116	23	49,132	38
DERWENT LONDON PLC	2,110	44	8,527	176
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	-	-	76,805	52
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	-	-	19,978	18
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	3,911	17	20,263 (-)	81 (58)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC(N)	- (41,438)	- (153)	-	-
GREAT PORTLAND ESTATES -NIL-RTS	- (41,438)	- (58)	- (41,438)	- (58)
HAMMERSON PLC	198,068	50	477,180	122
HELICAL PLC	33,388	91	4,241	8
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	-	-	32,084	28
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	-	-	41,928	17
PICTON PROPERTY INCOME LTD	42,814	29	82,902	54

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	18,916	120	60,259	368
	LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	77	—	—
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	57,388	110	95,564	176
	LXI REIT PLC	(266,982)	(461)		
		57,859	54	123,185	111
		(△ 485,422)	(△ 461)		
	NEWRIVER REIT PLC	24,244	19	33,017	26
	PRS REIT PLC/THE	19,156	15	56,814	43
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	45,151	43	117,806	110
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	3,847	34	15,851	129
	SEGRO PLC	61,702	510	94,309	737
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	39,617	19	80,302	40
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	13,026	9	79,179	59
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	197,418	155	28,404	22
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	46,279	64	146,617	212
		(106,872)	(127)		
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	—	—	19,080	10
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	41,433	22	78,700	41
		(△ 240,704)	(△ 127)		
UNITE GROUP PLC/THE	21,897	209	44,591	409	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	16,766	20	47,154	55	
WAREHOUSE REIT PLC	13,438	12	43,925	34	
WORKSPACE GROUP PLC	3,835	19	13,178	65	
小 計	1,387,478	2,172	2,849,275	4,248	
	(△ 269,396)	(212)	(41,438)	(116)	
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 GROUP	16,470	17	25,646	41
				(—)	(161)
	ABACUS STORAGE KING	38,130	45	17,021	19
	ABACUS STORAGE KING(N)	—	—	—	—
		(125,940)	(161)		
	ARENA REIT	10,400	38	30,244	113
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	15,528	45	27,756	78
	BWP TRUST	10,300	36	18,344	63
	VICINITY CENTRES	102,628	193	316,779	591
	CENTURIA OFFICE REIT	—	—	23,484	26
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	—	—	27,204	85
	CENTURIA CAPITAL GROUP	52,852	81	62,798	102
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	24,939	90	56,099	204
	CHARTER HALL GROUP	10,825	121	37,271	410
	CROMWELL PROPERTY GROUP	—	—	78,933	38
	DEXUS/AU	27,964	215	86,934	650
	GOODMAN GROUP	46,134	1,027	136,128	3,246
	GPT GROUP	50,157	208	157,020	654

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	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
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	—	—	22,189	59
	HEALTHCO REIT	12,629 (2,114)	18 (—)	13,665 (451)	15 (—)
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	12,889	39	23,455	74
	HMC CAPITAL LTD	20,438	98	19,494	111
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	152,142	186	163,419	191
	DEXUS INDUSTRIA REIT	14,502	39	24,936	67
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	15,636	64	36,597	155
	CHARTER HALL RETAIL REIT	12,214	45	39,337	139
	MIRVAC GROUP	100,697	228	320,682	693
	NATIONAL STORAGE REIT	34,301	77	78,842	173
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	—	132,547	94
	RURAL FUNDS GROUP	17,224	34	39,171	77
	SCENTRE GROUP	132,176	363	419,593	1,168
	REGION RE LTD	29,439	67	89,128	197
STOCKLAND	59,863	246	194,389	814	
WAYPOINT REIT	—	—	35,841	85	
小 計	1,020,477 (128,054)	3,635 (161)	2,754,946 (451)	10,447 (161)	
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	38,815	86	112,622	247
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	27,888	64	257,844	531
	STRIDE PROPERTY GROUP	27,285	39	352,069	457
	小 計	93,988	191	722,535	1,236
香港			千香港ドル		千香港ドル
	CHAMPION REIT	—	—	114,000	254
	FORTUNE REIT	85,000	440	171,000	839
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	—	—	193,500	217
	LINK REIT	70,200	2,843	197,000	7,694
	PROSPERITY REIT	—	—	94,000	130
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	25,000	64
小 計	155,200	3,283	794,500	9,200	
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	—	—	— (5,992)	— (—)
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	143,600 (—)	401 (△ 13)	277,400	753
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	126,900 (—)	125 (△ 11)	169,000	164
	CAPITALAND CHINA TRUST	20,100 (—)	15 (△ 14)	84,400	68
	ESR-LOGOS REIT	342,500 (—)	107 (△ 5)	684,300	210
国					

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
外	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
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	130,200 (-)	254 (△ 6)	398,900	767	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	15,100 (-)	15 (△ 2)	110,000	115	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	- (-)	- (△ 4)	173,500	95	
	EC WORLD REIT	-	-	7,400	2	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	32,000	20	92,100	56	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	- (-)	- (△ 1)	428,740	97	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	41,300	90	78,400	170	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	82,800 (-)	100 (△ 10)	243,400	275	
	KEPPEL REIT	128,400 (-)	109 (△ 3)	160,300	142	
	KEPPEL DC REIT	38,600 (-)	85 (△ 7)	112,400	221	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	83,000	51	208,500	125	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	45,300 (-)	73 (△ 7)	164,100	245	
	AIMS APAC REIT	59,900 (-)	77 (△ 3)	40,400	51	
	AIMS APAC REIT(N)	- (5,992)	- (7)	-	-	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	111,300 (-)	184 (△ 31)	258,800	402	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	60,800 (-)	137 (△ 0.935)	150,300	339	
	国	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△ 0.437)	808,535	182
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	15,300 (-)	56 (△ 3)	38,600	140
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	45,000 (-)	31 (△ 0.315)	60,000	42
PARAGON REIT		88,200	80	103,000	92	
STARHILL GLOBAL REIT		68,200	34	141,700	70	
SUNTEC REIT		89,700 (-)	108 (△ 3)	200,700	240	
小 計		1,768,200 (5,992)	2,162 (△ 126)	5,194,875 (5,992)	5,073 (-)	
韓国			千韓国ウォン		千韓国ウォン	
D&D PLATFORM REIT CO LTD		-	-	6,184	19,617	
E KOCREF CR-REIT CO LTD		1,650	8,566	10,420	51,842	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	-	-	9,603	38,857		

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	—	—	16,227	68,786
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD(N)	(—)	(0.00042)	(—)	(1,947)
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	—	—	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS(N)	(4,636)	(21,743)	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	(4,636)	(1,947)	(4,636)	(1,947)
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS(N)	—	—	—	—
	JR REIT XXVII	(4,636)	(921)	(4,636)	(921)
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	5,242	21,524	11,062	44,669
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	2,772	15,538	4,869	22,726
	LOTTE REIT CO LTD	—	—	4,526	14,264
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	—	—	8,226	32,907
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7,252	45,219	7,989	47,596
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	—	—	9,014	29,080
	SK REITS CO LTD	8,635	39,901	14,246	64,034
	SK REITS CO LTD(N)	—	—	(—)	(1,929)
SK REITS CO LTD-RIGHTS	(10,314)	(44,835)	—	—	
SK REITS CO LTD-RIGHTS	(—)	(1,199)	(10,314)	(1,929)	
SK REITS CO LTD-RIGHTS(N)	—	—	—	—	
SK REITS CO LTD-RIGHTS(N)	(10,314)	(729)	—	—	
小 計	25,551	130,749	102,366	434,384	
小 計	(34,536)	(71,377)	(19,586)	(8,675)	
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	27,785	43	61,119	100	
REIT 1 LTD	2,737	42	7,274	116	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	—	—	7,388	56	
小 計	30,522	86	75,781	273	

(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

(2023年6月16日～2024年6月17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 (2023年6月16日～2024年6月17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

(2024年6月17日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	30,497	27,031	467	73,666	0.1
AGREE REALTY CORPORATION	28,539	26,931	1,650	259,934	0.5
ALEXANDER & BALDWIN INC	23,359	18,817	310	48,939	0.1
ALEXANDER'S INC	722	536	114	18,005	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	50,562	41,858	4,868	767,001	1.4
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,274	3,159	47	7,509	0.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,903	12,925	279	44,081	0.1
PROLOGIS INC	296,391	245,657	27,584	4,345,437	7.7
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	98,538	84,612	2,998	472,377	0.8
AMERICOLD REALTY TRUST INC	86,587	70,939	1,808	284,851	0.5
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,451	—	—	—	—
APPLE HOSPITALITY REIT INC	68,189	56,643	817	128,847	0.2
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	48,569	34,628	279	44,021	0.1
APARTMENT INCOME REIT CO	47,872	38,608	1,502	236,708	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,195	18,326	202	31,871	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,534	8,742	8	1,376	0.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	19,121	12,905	37	5,956	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,944	37,743	7,619	1,200,368	2.1
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,014	—	—	—	—
BOSTON PROPERTIES INC	45,817	38,426	2,368	373,122	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	96,060	80,002	1,782	280,788	0.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	54,422	45,029	206	32,487	0.1
BRT APARTMENTS CORP	4,170	3,398	58	9,265	0.0
BROADSTONE NET LEASE INC-A	55,637	49,747	760	119,743	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	35,361	28,426	3,071	483,797	0.9
CARETRUST REIT INC	32,095	34,923	879	138,470	0.2
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,008	6,784	148	23,372	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	15,405	12,668	104	16,523	0.0
CITY OFFICE REIT INC	11,825	11,825	58	9,146	0.0
CLIPPER REALTY INC	5,351	3,393	12	1,961	0.0
COPT DEFENSE PROPERTIES	36,311	29,908	729	114,864	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	48,600	40,164	927	146,091	0.3
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,590	6,767	158	24,912	0.0
CTO REALTY GROWTH INC	6,938	5,391	93	14,793	0.0
SITE CENTERS CORP	58,231	47,674	694	109,346	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	66,791	55,280	453	71,494	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	92,356	85,905	12,878	2,028,809	3.6
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	209,224	112	17,797	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	56,612	44,423	590	93,072	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	29,998	25,603	311	49,084	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	
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,983	12,673	2,101	331,119	0.6
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	500,700	68	10,805	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	41,824	34,826	324	51,130	0.1
EPR PROPERTIES	24,069	20,066	809	127,483	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,245	49,747	3,120	491,514	0.9
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	109,435	91,884	6,129	965,592	1.7
EQUINIX INC	29,720	24,970	19,133	3,014,102	5.3
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,562	41,452	1,144	180,226	0.3
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,763	17,092	4,760	749,862	1.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	42,999	56,186	8,797	1,385,798	2.5
FARMLAND PARTNERS INC	16,202	11,078	126	19,894	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,502	19,577	1,980	312,066	0.6
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	42,418	35,145	1,669	262,923	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,250	24,410	595	93,748	0.2
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	26,426	43	6,868	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	82,740	71,213	3,091	486,981	0.9
GETTY REALTY CORPORATION	13,776	12,818	343	54,054	0.1
GLOBAL NET LEASE INC	33,648	52,000	374	59,061	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	12,252	10,804	152	23,980	0.0
GLADSTONE LAND CORP	10,188	8,550	114	18,021	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC	19,349	14,729	132	20,928	0.0
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	15,503	34	5,470	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	175,861	188,516	3,704	583,544	1.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	122,512	101,524	1,675	263,885	0.5
WELLTOWER INC	151,742	147,226	15,317	2,412,948	4.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	11,024	—	—	—	—
HIGHWOODS PROPERTIES INC	33,638	27,853	715	112,675	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	53,199	43,770	215	33,992	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	229,502	187,859	3,347	527,354	0.9
EQUITY COMMONWEALTH	35,461	29,834	573	90,329	0.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	40,730	34,874	172	27,193	0.0
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	71,469	59,440	1,065	167,889	0.3
CENTERSPACE	4,765	3,864	261	41,172	0.1
INVITATION HOMES INC	186,547	152,946	5,429	855,322	1.5
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	22,244	15,324	57	9,100	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,884	7,407	789	124,406	0.2
INDUS REALTY TRUST INC	1,721	—	—	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,653	18,090	447	70,445	0.1
IRON MOUNTAIN INC	93,321	77,640	6,833	1,076,539	1.9
JBG SMITH PROPERTIES	32,271	23,314	342	53,988	0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	265,800	219,100	30	4,832	0.0
KILROY REALTY CORPORATION	33,819	28,406	903	142,388	0.3
KIMCO REALTY CORP	198,312	177,187	3,322	523,355	0.9
KITE REALTY GROUP TRUST	70,167	58,411	1,282	202,064	0.4
LXP INDUSTRIAL TRUST	88,596	77,103	678	106,885	0.2

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	%	
LTC PROPERTIES INC	13,161	11,104	373	58,878	0.1	
MACERICH CO/THE	69,743	57,176	827	130,420	0.2	
VERIS RESIDENTIAL INC	25,599	21,462	324	51,085	0.1	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	602,247	432,047	29	4,628	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	192,265	159,365	772	121,758	0.2	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,085	31,058	4,327	681,632	1.2	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	27,073	20,509	837	131,977	0.2	
NNN REIT INC	58,384	48,644	2,048	322,760	0.6	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,925	11,541	766	120,791	0.2	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,127	5,677	210	33,160	0.1	
NETSTREIT CORP	17,712	18,339	314	49,545	0.1	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,913	9,278	44	7,073	0.0	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	—	4,251	105	16,641	0.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	75,381	65,522	2,120	334,112	0.6	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,324	4,069	96	15,127	0.0	
ORION OFFICE REIT INC	19,338	12,343	42	6,669	0.0	
PARAMOUNT GROUP INC	52,137	41,575	192	30,388	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC	72,033	55,902	820	129,275	0.2	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	42,092	31,421	436	68,752	0.1	
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	9,704	111	17,533	0.0	
PHYSICIANS REALTY TRUST	73,683	—	—	—	—	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	37,757	32,643	1,052	165,734	0.3	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,572	33,502	237	37,417	0.1	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,592	9,038	189	29,827	0.1	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	5,728	75	11,901	0.0	
PRIME US REIT	184,200	202,620	23	3,734	0.0	
PUBLIC STORAGE	50,764	42,088	11,921	1,877,982	3.3	
RPT REALTY	27,271	—	—	—	—	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	39,729	33,628	413	65,211	0.1	
REALTY INCOME CORP	201,523	221,442	11,818	1,861,746	3.3	
REGENCY CENTERS CORP	49,444	43,788	2,704	426,084	0.8	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	60,598	55,930	2,507	394,981	0.7	
RLJ LODGING TRUST	51,972	41,229	394	62,155	0.1	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,684	15,889	1,570	247,370	0.4	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	74,182	61,891	884	139,323	0.2	
SAUL CENTERS INC	4,133	3,408	125	19,724	0.0	
SAFEHOLD INC	12,902	11,591	217	34,236	0.1	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	77,917	58,979	166	26,200	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	105,004	86,669	12,898	2,031,971	3.6	
SL GREEN REALTY CORP	20,710	17,168	977	153,965	0.3	
LIFE STORAGE INC	27,271	—	—	—	—	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	44,836	—	—	—	—	
STAG INDUSTRIAL INC	57,532	48,224	1,685	265,581	0.5	
STAR HOLDINGS	4,193	—	—	—	—	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,272	29,619	172	27,108	0.0	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
SUN COMMUNITIES INC	39,798	33,133	3,864	608,795	1.1	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,090	54,732	545	85,874	0.2	
TANGER INC	33,546	28,596	773	121,852	0.2	
TERRENO REALTY CORP	23,355	24,815	1,439	226,689	0.4	
CUBESMART	72,101	59,752	2,642	416,325	0.7	
UDR INC	99,430	80,587	3,246	511,349	0.9	
UMH PROPERTIES INC	17,055	15,970	246	38,792	0.1	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,210	3,614	139	22,038	0.0	
UNITI GROUP INC	—	63,878	175	27,672	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	37,518	31,065	556	87,743	0.2	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	9,608	—	—	—	—	
VENTAS INC	128,494	107,054	5,363	844,897	1.5	
VICI PROPERTIES INC	322,178	275,374	7,790	1,227,210	2.2	
VORNADO REALTY TRUST	51,585	42,466	1,079	170,118	0.3	
ELME COMMUNITIES	28,439	23,811	371	58,589	0.1	
WHITESTONE REIT	15,152	11,667	156	24,591	0.0	
WP CAREY INC	67,745	58,243	3,266	514,626	0.9	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	36,413	27,751	395	62,251	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	8,680,656	7,485,126	276,110	43,495,744	
	銘 柄 数 < 比 率 >	145	138	—	< 77.1% >	
(カナダ)			千カナダドル			
ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	20,353	16,464	259	29,721	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,810	15,987	103	11,863	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	6,925	—	—	—	—	
BOARDWALK EQUITIES INC	7,139	6,351	436	50,055	0.1	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	5,317	81	9,299	0.0	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	12,031	10,240	32	3,693	0.0	
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	27,035	21,800	952	109,235	0.2	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,078	19,883	437	50,145	0.1	
CHOICE PROPERTIES REIT	52,246	44,021	559	64,169	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,470	14,914	186	21,398	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,654	13,804	186	21,357	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	40,108	35,381	443	50,885	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6,850	2,395	45	5,235	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	13,127	—	—	—	—	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,752	28,197	414	47,570	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,051	8,208	547	62,817	0.1	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	41,720	33,939	305	35,032	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,919	19,632	230	26,478	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	7,702	—	—	—	—	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,130	15,022	257	29,547	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,756	5,648	84	9,697	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	4,944	74	8,550	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	7,802	54	6,245	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	38,193	32,841	159	18,305	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)			千カナダドル	千円	%	
PRIMARIS REIT	16,018	12,438	167	19,200	0.0	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	7,180	8,609	43	4,976	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	47,388	39,494	659	75,643	0.1	
SLATE GROCERY REIT	9,526	6,982	77	8,912	0.0	
SLATE OFFICE REIT	12,044	—	—	—	—	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	2,223	19	2,187	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	566,010	432,536	6,820	782,226	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	26	—	< 1.4% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,768	—	—	—	—	
HAMBORNER REIT AG	23,984	20,332	131	22,218	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	26,752	20,332	131	22,218	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,466	17,269	31	5,311	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	15,466	17,269	31	5,311	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)						
ALTAREA	1,522	1,217	102	17,362	0.0	
CARMILA	18,680	14,591	233	39,419	0.1	
COVIVIO	14,961	12,744	570	96,238	0.2	
GECINA SA	17,487	13,674	1,251	211,112	0.4	
ICADE	10,336	8,080	206	34,882	0.1	
KLEPIERRE	62,529	51,966	1,327	223,820	0.4	
MERCIALYS	24,638	24,965	270	45,553	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,229	26,984	1,956	329,917	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	184,382	154,221	5,919	998,307	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 1.8% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,509	11,271	244	41,151	0.1	
NSI NV	5,548	4,727	92	15,672	0.0	
VASTNED RETAIL	5,856	4,832	113	19,067	0.0	
WERELDHAVE NV	13,084	9,878	131	22,255	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	37,997	30,708	581	98,146	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.2% >	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	97,537	76,015	456	77,043	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,678	14,373	99	16,724	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	107,784	89,455	948	159,908	0.3	
小 計	口 数 ・ 金 額	224,999	179,843	1,504	253,676	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.4% >	
(ユーロ…ベルギー)						
AEDIFICA	12,843	12,688	714	120,465	0.2	
CARE PROPERTY INVEST	12,243	10,115	141	23,812	0.0	
COFINIMMO	9,907	9,837	564	95,221	0.2	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)	口	口	千ユーロ	千円	%	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	—	—	—	—	
MONTEA	4,282	4,826	383	64,701	0.1	
RETAIL ESTATES	3,603	3,481	217	36,748	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	49,759	46,068	1,165	196,553	0.3	
XIOR STUDENT HOUSING NV	7,427	8,768	251	42,436	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	108,572	95,783	3,438	579,940	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<1.0%>	
(ユーロ…アイルランド)						
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	148,779	129,693	118	19,968	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	148,779	129,693	118	19,968	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…ガーンジー)						
SHURGARD SELF STORAGE LTD	—	8,266	319	53,946	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	—	8,266	319	53,946	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.1%>	
(ユーロ…シンガポール)						
CROMWELL REIT EUR	119,560	81,360	115	19,483	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	119,560	81,360	115	19,483	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	866,507	717,475	12,162	2,051,000	
	銘柄 数 < 比 率 >	28	27	—	<3.6%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
AEW UK REIT PLC	45,713	48,766	41	8,353	0.0	
ASSURA PLC	959,228	803,210	319	63,765	0.1	
BIG YELLOW GROUP PLC	55,973	51,902	608	121,579	0.2	
BALANCED COMM PROPERTY TRUST	263,699	191,534	144	28,902	0.1	
BRITISH LAND COMPANY PLC	301,054	249,787	1,065	212,979	0.4	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	580,353	519,907	711	142,258	0.3	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	205,988	—	—	—	—	
CLS HOLDINGS PLC	65,076	40,564	34	6,988	0.0	
CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	145,337	124,321	89	17,890	0.0	
DERWENT LONDON PLC	36,165	29,748	690	138,059	0.2	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	76,805	—	—	—	—	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,560	168,582	157	31,504	0.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	81,648	106,734	362	72,425	0.1	
HAMMERSON PLC	1,284,082	1,004,970	281	56,281	0.1	
HELICAL PLC	—	29,147	63	12,699	0.0	
HOME REIT PLC	256,438	256,438	97	19,502	0.0	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	138,665	106,581	90	18,128	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	181,830	139,902	62	12,443	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	178,755	138,667	89	17,793	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	241,057	199,714	1,242	248,282	0.4	
INTU PROPERTIES PLC	758,746	758,746	0	0	0.0	
LIFE SCIENCE REIT PLC	—	110,213	37	7,555	0.0	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	312,753	541,559	1,053	210,529	0.4	

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	口	口	千イギリスポンド	千円	%
LXI REIT PLC	550,748	—	—	—	—
NEWRIVER REIT PLC	104,390	95,617	69	13,836	0.0
PRS REIT PLC/THE	183,163	145,505	111	22,247	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	434,401	361,746	329	65,939	0.1
REGIONAL REIT LTD	147,696	147,696	31	6,317	0.0
SAFESTORE HOLDINGS PLC	69,370	57,366	457	91,496	0.2
SEGREO PLC	388,367	355,760	3,233	646,351	1.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	136,620	95,935	48	9,740	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	402,889	336,736	242	48,525	0.1
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	—	169,014	134	26,855	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	599,772	606,306	932	186,378	0.3
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	122,256	103,176	58	11,692	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	277,971	—	—	—	—
UNITE GROUP PLC/THE	128,188	105,494	959	191,874	0.3
URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,039	116,651	139	27,884	0.0
WAREHOUSE REIT PLC	133,669	103,182	82	16,415	0.0
WORKSPACE GROUP PLC	43,943	34,600	195	39,003	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	10,228,407	8,455,776	14,271	2,852,484
	銘 柄 数 < 比 率 >	37	36	—	< 5.1% >
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
ABACUS GROUP	134,724	125,548	141	14,778	0.0
ABACUS STORAGE KING	—	147,049	179	18,688	0.0
ARENA REIT	111,547	91,703	341	35,536	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	106,144	93,916	226	23,577	0.0
BWP TRUST	159,304	151,260	544	56,724	0.1
VICINITY CENTRES	1,248,198	1,034,047	1,923	200,353	0.4
CENTURIA OFFICE REIT	145,435	121,951	145	15,117	0.0
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	175,393	148,189	460	48,008	0.1
CENTURIA CAPITAL GROUP	219,440	209,494	362	37,753	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	211,787	180,627	619	64,538	0.1
CHARTER HALL GROUP	151,785	125,339	1,540	160,465	0.3
CROMWELL PROPERTY GROUP	463,054	384,121	161	16,805	0.0
DEXUS/AU	347,700	288,730	1,873	195,199	0.3
GDI PROPERTY GROUP	181,454	181,454	109	11,435	0.0
GOODMAN GROUP	549,629	459,635	16,441	1,712,673	3.0
GPT GROUP	618,719	511,856	2,083	217,012	0.4
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	98,916	76,727	175	18,303	0.0
HEALTHCO REIT	135,075	135,702	154	16,044	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	65,655	55,089	177	18,535	0.0
HMC CAPITAL LTD	63,267	64,211	474	49,430	0.1
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	505,795	494,518	605	63,104	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	70,496	60,062	177	18,519	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	120,549	99,588	484	50,521	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	169,868	142,745	468	48,772	0.1
MIRVAC GROUP	1,273,685	1,053,700	1,986	206,905	0.4

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	口	口	千オーストラリアドル	千円	%
NATIONAL STORAGE REIT	389,844	345,303	797	83,091	0.1
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	132,547	—	—	—	—
RURAL FUNDS GROUP	125,402	103,455	207	21,661	0.0
SCENTRE GROUP	1,673,884	1,386,467	4,325	450,616	0.8
REGION RE LTD	374,135	314,446	691	72,062	0.1
STOCKLAND	768,929	634,403	2,816	293,420	0.5
WAYPOINT REIT	220,218	184,377	427	44,559	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	11,012,578	9,405,712	41,127	4,284,218
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 7.6% >
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
GOODMAN PROPERTY TRUST	428,056	354,249	745	72,078	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	229,956	—	—	—	—
STRIDE PROPERTY GROUP	324,784	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	982,796	354,249	745	72,078
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	1	—	< 0.1% >
(香港)			千香港ドル		
CHAMPION REIT	617,000	503,000	804	16,224	0.0
FORTUNE REIT	484,900	398,900	1,555	31,363	0.1
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	733,110	539,610	555	11,204	0.0
LINK REIT	812,880	686,080	22,366	450,902	0.8
PROSPERITY REIT	411,000	317,000	427	8,627	0.0
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	331,000	306,000	529	10,672	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3,389,890	2,750,590	26,239	528,995
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.9% >
(シンガポール)			千シンガポールドル		
AIMS APAC REIT-RIGHTS	5,992	—	—	—	—
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,085,132	951,332	2,444	284,760	0.5
CAPITALAND ASCOTT TRUST	714,492	672,392	598	69,699	0.1
CAPITALAND CHINA TRUST	374,585	310,285	203	23,670	0.0
ESR-LOGOS REIT	1,938,319	1,596,519	447	52,065	0.1
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,620,692	1,351,992	2,622	305,485	0.5
CDL HOSPITALITY TRUSTS	267,100	172,200	164	19,153	0.0
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	173,500	—	—	—	—
EC WORLD REIT	77,700	70,300	19	2,292	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355,700	295,600	181	21,173	0.0
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	428,740	—	—	—	—
FRASERS CENTREPOINT TRUST	347,005	309,905	666	77,603	0.1
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	928,360	767,760	733	85,397	0.2
KEPPEL REIT	649,000	617,100	518	60,373	0.1
KEPPEL DC REIT	431,277	357,477	639	74,527	0.1
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	602,552	477,052	264	30,837	0.1
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	742,831	624,031	761	88,670	0.2
AIMS APAC REIT	171,225	196,717	249	29,097	0.1
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,038,387	890,887	1,175	136,965	0.2
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	646,408	556,908	1,202	140,104	0.2

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)			千シンガポールドル	千円	%
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	808,535	—	—	—	—
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	125,800	102,500	373	43,454	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	169,400	154,400	102	11,958	0.0
PARAGON REIT	360,200	345,400	288	33,590	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	467,500	394,000	189	22,026	0.0
SUNTEC REIT	730,000	619,000	656	76,420	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	15,260,432 26	11,833,757 22	14,504 —	1,689,328 <3.0%>
(韓国)			千韓国ウォン		
D&D PLATFORM REIT CO LTD	22,899	16,715	58,669	6,705	0.0
E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	—	—	—	—
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	55,071	45,468	209,380	23,932	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,591	—	—	—	—
JR REIT XXVII	51,208	45,388	187,679	21,451	0.0
KORAMCO LIFE INFRA REIT	13,627	11,530	53,268	6,088	0.0
LOTTE REIT CO LTD	39,257	34,731	115,654	13,219	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	—	—	—	—
NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	12,699	46,859	5,356	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,648	22,911	139,986	16,000	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	—	—	—	—
SK REITS CO LTD	29,394	34,097	165,881	18,960	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	285,404 12	223,539 8	977,379 —	111,714 <0.2%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	231,039	197,705	307	13,028	0.0
REIT 1 LTD	60,560	56,023	771	32,694	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	71,314	63,926	414	17,573	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	362,913 3	317,654 3	1,494 —	63,296 <0.1%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	51,635,593 321	41,976,414 298	—	55,931,087 <99.1%>

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

(注) 比率は、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

(2024年6月17日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	55,931,087	99.1
コール・ローン等、その他	511,109	0.9
投資信託財産総額	56,442,196	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（56,421,034千円）の投資信託財産総額（56,442,196千円）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=157.53円、1カナダドル=114.69円、1ユーロ=168.64円、1イギリスポンド=199.87円、1オーストラリアドル=104.17円、1ニュージーランドドル=96.66円、1香港ドル=20.16円、1シンガポールドル=116.47円、1韓国ウォン=0.1143円、1イスラエルシェケル=42.3507円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2024年6月17日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	56,442,196,143	
コール・ローン等	363,354,170	
投資証券(評価額)	55,931,087,801	
未収入金	1,339,882	
未収配当金	146,414,243	
未収利息	47	
(B) 負債	6,033,914	
未払解約金	6,033,914	
(C) 純資産総額(A－B)	56,436,162,229	
元本	16,493,547,462	
次期繰越損益金	39,942,614,767	
(D) 受益権総口数	16,493,547,462口	
1口当たり基準価額(C/D)	34,217円	

(注) 当ファンドの期首元本額は20,078,950,947円、期中追加設定元本額は1,493,687,941円、期中一部解約元本額は5,079,091,426円です。

(注) 2024年6月17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） 14,316,410,946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 1,941,127,001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） 213,731,951円
- ・Tracers グローバル3分法（おとなのバランス） 20,686,523円
- ・Niつみインデックススラップ世界10指数（均等型） 841,098円
- ・Niつみインデックススラップ世界10指数（安定成長型） 749,943円

(注) 1口当たり純資産額は3,4217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

2023年6月16日から2024年6月17日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、運用目標とするベンチマークを構成する指数につき「S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」を採用しておりました。このたび、当該ベンチマークが「税引後配当込み」の値動きであることを明確化するため、そのベンチマーク表記を「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」に変更すべく、2023年6月20日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。（付表、第28条）

○損益の状況

（2023年6月16日～2024年6月17日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	2,358,564,395	
受取配当金	2,356,553,122	
受取利息	22,832	
その他収益金	2,006,164	
支払利息	△ 17,723	
(B) 有価証券売買損益	7,581,454,103	
売買益	11,176,846,404	
売買損	△ 3,595,392,301	
(C) 保管費用等	△ 35,228,093	
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,904,790,405	
(E) 前期繰越損益金	37,378,877,807	
(F) 追加信託差損益金	2,904,525,394	
(G) 解約差損益金	△10,245,578,839	
(H) 計(D+E+F+G)	39,942,614,767	
次期繰越損益金(H)	39,942,614,767	

(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25期（決算日 2023年10月26日）
（2022年10月27日～2023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。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、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 (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
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
25期(2023年10月26日)	13,204	△2.5	519.13	△2.5	99.8	50,785

(注) NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、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 (ベンチマーク)		債組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2022年10月26日	円	%		%	%
	13,539	—	532.71	—	99.8
10月末	13,649	0.8	536.96	0.8	99.8
11月末	13,585	0.3	534.19	0.3	99.7
12月末	13,412	△0.9	527.38	△1.0	99.8
2023年1月末	13,377	△1.2	525.95	△1.3	99.7
2月末	13,522	△0.1	531.67	△0.2	99.8
3月末	13,711	1.3	539.11	1.2	99.9
4月末	13,747	1.5	540.35	1.4	99.8
5月末	13,731	1.4	539.86	1.3	99.7
6月末	13,763	1.7	541.33	1.6	99.8
7月末	13,551	0.1	532.90	0.0	99.7
8月末	13,454	△0.6	529.06	△0.7	99.7
9月末	13,358	△1.3	525.28	△1.4	99.8
(期末) 2023年10月26日					
	13,204	△2.5	519.13	△2.5	99.8

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2022年10月27日～2023年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め13,539円の基準価額は、期間末に13,204円となり、騰落率は△2.5%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>

- ・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金融緩和政策を継続する考えを示したこと。

<値下がり要因>

- ・日銀が金融政策決定会合で長短金利操作（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。
- ・日銀がイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定し、長期金利の先高観が強まったこと。
- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）後に公表されたFOMC参加者による政策金利の見通しの内容から、米国の金融引き締め長期化が意識され米国長期金利が上昇したこと。

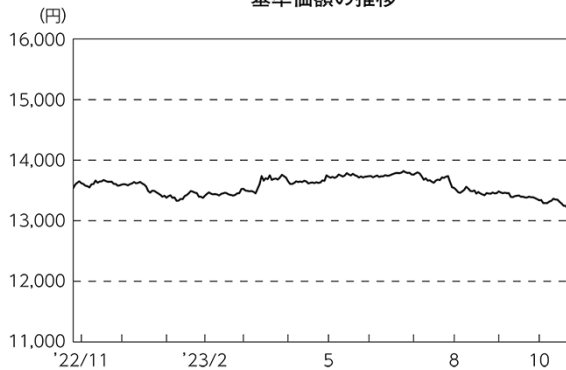
(国内債券市況)

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。

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

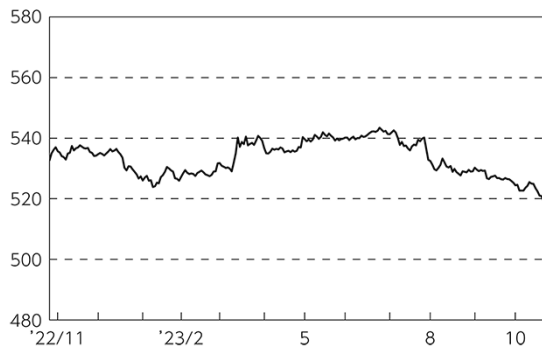
回避姿勢が強まったことや、日銀新総裁が就任会見で金融緩和政策を継続する考えを示したことなどから、利回りが低下（債券価格は上昇）する局面があったものの、日銀が金融政策決定会合でイールドカーブ・コントロールにおける長期金利の許容変動幅の拡大を決定したこと、米国の金融当局が預金者保護を表明したことや主要中央銀行による流動性供給などを受けて金融システムへの警戒感が和らいだこと、米国で発表された経済指標が市場予想を上回り、米国連邦準備制度理事会（FRB）による利上げが継続するとの見方が強まったこと、日銀がイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定し長期金利の先高観が強まったこと、

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2022/10/26	2023/06/26	2023/10/26	2023/10/26
13,539円	13,819円	13,204円	13,204円

NOMURA - BPI総合の推移



FOMC後に公表されたFOMC参加者による政策金利の見通しの内容から、米国の金融引き締めは長期化が意識され米国長期金利が上昇したことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

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、2.5%の値下がりとなり、ベンチマークである「NOMURA-BPI総合」の下落率を2.5%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。

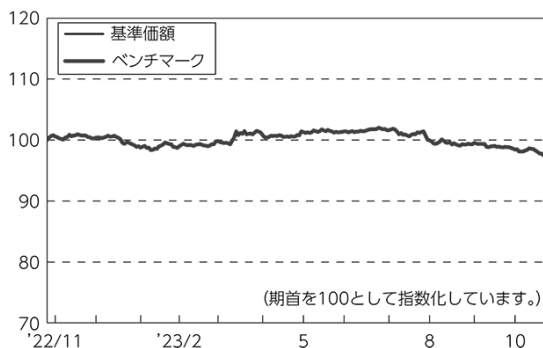
<プラス要因>

- ・金利効果。
- ・売買要因。

<マイナス要因>

- ・債券種別効果。
- ・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

(2022年10月27日～2023年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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、13,571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10月27日～2023年10月26日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 8,037,465	千円 1,962,885
	地方債証券	—	804,103 (10,000)
	特殊債券	100,064	1,106,168
	社債券(投資法人債券を含む)	1,102,310	402,498

(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

(2022年10月27日～2023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（2022年10月27日～2023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

(2023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	45,217,000 (16,579,000)	44,169,559 (16,185,674)	87.0 (31.9)	— (—)	61.1 (18.7)	20.2 (10.8)	5.6 (2.4)
地方債証券	2,720,000 (2,720,000)	2,728,710 (2,728,710)	5.4 (5.4)	— (—)	— (—)	1.8 (1.8)	3.6 (3.6)
特殊債券 (除く金融債)	2,300,000 (2,300,000)	2,304,518 (2,304,518)	4.5 (4.5)	— (—)	— (—)	3.5 (3.5)	1.0 (1.0)
金融債券	200,000 (200,000)	198,756 (198,756)	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)	1,300,000 (1,300,000)	1,296,449 (1,296,449)	2.6 (2.6)	— (—)	— (—)	1.2 (1.2)	1.4 (1.4)
合 計	51,737,000 (23,099,000)	50,697,992 (22,714,107)	99.8 (44.7)	— (—)	61.1 (18.7)	26.9 (17.5)	11.8 (8.5)

(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	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449回利付国債(2年)	0.005	80,000	79,968	2025/6/1	第358回利付国債(10年)	0.1	590,000	574,306	2030/3/20
第450回利付国債(2年)	0.005	200,000	199,882	2025/7/1	第359回利付国債(10年)	0.1	420,000	407,488	2030/6/20
第451回利付国債(2年)	0.005	50,000	49,977	2025/8/1	第360回利付国債(10年)	0.1	580,000	560,784	2030/9/20
第149回利付国債(5年)	0.005	100,000	99,595	2026/9/20	第361回利付国債(10年)	0.1	460,000	443,016	2030/12/20
第150回利付国債(5年)	0.005	50,000	49,741	2026/12/20	第362回利付国債(10年)	0.1	400,000	383,800	2031/3/20
第152回利付国債(5年)	0.1	100,000	99,679	2027/3/20	第363回利付国債(10年)	0.1	500,000	477,875	2031/6/20
第153回利付国債(5年)	0.005	300,000	297,612	2027/6/20	第364回利付国債(10年)	0.1	500,000	475,940	2031/9/20
第157回利付国債(5年)	0.2	120,000	119,401	2028/3/20	第365回利付国債(10年)	0.1	350,000	331,891	2031/12/20
第158回利付国債(5年)	0.1	180,000	178,322	2028/3/20	第366回利付国債(10年)	0.2	400,000	381,268	2032/3/20
第159回利付国債(5年)	0.1	120,000	118,682	2028/6/20	第367回利付国債(10年)	0.2	360,000	341,978	2032/6/20
第160回利付国債(5年)	0.2	120,000	119,203	2028/6/20	第368回利付国債(10年)	0.2	390,000	369,330	2032/9/20
第1回利付国債(40年)	2.4	70,000	78,788	2048/3/20	第369回利付国債(10年)	0.5	390,000	378,413	2032/12/20
第2回利付国債(40年)	2.2	125,000	135,483	2049/3/20	第370回利付国債(10年)	0.5	420,000	406,854	2033/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	85,000	91,988	2050/3/20	第371回利付国債(10年)	0.4	290,000	277,744	2033/6/20
第4回利付国債(40年)	2.2	95,000	102,630	2051/3/20	第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	56,784	2029/9/20
第5回利付国債(40年)	2.0	95,000	98,477	2052/3/20	第3回利付国債(30年)	2.3	70,000	77,905	2030/5/20
第6回利付国債(40年)	1.9	110,000	111,577	2053/3/20	第5回利付国債(30年)	2.2	80,000	88,904	2031/5/20
第7回利付国債(40年)	1.7	130,000	125,716	2054/3/20	第6回利付国債(30年)	2.4	50,000	56,446	2031/11/20
第8回利付国債(40年)	1.4	115,000	102,782	2055/3/20	第8回利付国債(30年)	1.8	170,000	184,376	2032/11/22
第9回利付国債(40年)	0.4	180,000	116,620	2056/3/20	第9回利付国債(30年)	1.4	70,000	73,454	2032/12/20
第10回利付国債(40年)	0.9	175,000	133,516	2057/3/20	第11回利付国債(30年)	1.7	170,000	183,209	2033/6/20
第11回利付国債(40年)	0.8	140,000	102,425	2058/3/20	第13回利付国債(30年)	2.0	180,000	199,058	2033/12/20
第12回利付国債(40年)	0.5	175,000	113,317	2059/3/20	第14回利付国債(30年)	2.4	108,000	123,692	2034/3/20
第13回利付国債(40年)	0.5	180,000	115,126	2060/3/20	第15回利付国債(30年)	2.5	147,000	169,933	2034/6/20
第14回利付国債(40年)	0.7	190,000	129,796	2061/3/20	第16回利付国債(30年)	2.5	35,000	40,497	2034/9/20
第15回利付国債(40年)	1.0	210,000	158,207	2062/3/20	第17回利付国債(30年)	2.4	50,000	57,366	2034/12/20
第16回利付国債(40年)	1.3	70,000	57,740	2063/3/20	第18回利付国債(30年)	2.3	110,000	125,074	2035/3/20
第336回利付国債(10年)	0.5	180,000	181,094	2024/12/20	第19回利付国債(30年)	2.3	40,000	45,495	2035/6/20
第337回利付国債(10年)	0.3	230,000	230,869	2024/12/20	第20回利付国債(30年)	2.5	40,000	46,404	2035/9/20
第338回利付国債(10年)	0.4	390,000	392,172	2025/3/20	第21回利付国債(30年)	2.3	70,000	79,684	2035/12/20
第339回利付国債(10年)	0.4	570,000	573,516	2025/6/20	第22回利付国債(30年)	2.5	70,000	81,309	2036/3/20
第340回利付国債(10年)	0.4	620,000	624,054	2025/9/20	第23回利付国債(30年)	2.5	55,000	63,902	2036/6/20
第341回利付国債(10年)	0.3	700,000	703,297	2025/12/20	第24回利付国債(30年)	2.5	68,000	79,021	2036/9/20
第342回利付国債(10年)	0.1	630,000	630,000	2026/3/20	第25回利付国債(30年)	2.3	60,000	68,230	2036/12/20
第343回利付国債(10年)	0.1	645,000	644,658	2026/6/20	第26回利付国債(30年)	2.4	170,000	195,343	2037/3/20
第344回利付国債(10年)	0.1	700,000	699,090	2026/9/20	第27回利付国債(30年)	2.5	89,000	103,335	2037/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	660,000	658,548	2026/12/20	第28回利付国債(30年)	2.5	144,000	167,078	2038/3/20
第346回利付国債(10年)	0.1	660,000	657,881	2027/3/20	第29回利付国債(30年)	2.4	176,000	201,673	2038/9/20
第347回利付国債(10年)	0.1	680,000	676,919	2027/6/20	第30回利付国債(30年)	2.3	147,000	166,174	2039/3/20
第348回利付国債(10年)	0.1	500,000	497,005	2027/9/20	第31回利付国債(30年)	2.2	120,000	133,700	2039/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	590,000	585,521	2027/12/20	第32回利付国債(30年)	2.3	160,000	180,161	2040/3/20
第350回利付国債(10年)	0.1	540,000	534,967	2028/3/20	第33回利付国債(30年)	2.0	175,000	188,832	2040/9/20
第351回利付国債(10年)	0.1	535,000	529,002	2028/6/20	第34回利付国債(30年)	2.2	160,000	176,913	2041/3/20
第352回利付国債(10年)	0.1	520,000	513,120	2028/9/20	第35回利付国債(30年)	2.0	193,000	207,200	2041/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	400,000	393,944	2028/12/20	第36回利付国債(30年)	2.0	195,000	208,605	2042/3/20
第354回利付国債(10年)	0.1	325,000	319,429	2029/3/20	第37回利付国債(30年)	1.9	211,000	221,792	2042/9/20
第355回利付国債(10年)	0.1	350,000	343,346	2029/6/20	第38回利付国債(30年)	1.8	165,000	170,134	2043/3/20
第356回利付国債(10年)	0.1	350,000	342,566	2029/9/20	第39回利付国債(30年)	1.9	165,000	172,656	2043/6/20
第357回利付国債(10年)	0.1	560,000	546,638	2029/12/20	第40回利付国債(30年)	1.8	130,000	133,420	2043/9/20

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		国債証券	%	千円	千円	
第41回利付国債 (30年)	1.7	160,000	161,209	2043/12/20	第92回利付国債 (20年)	2.1	60,000	63,635	2026/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	135,000	135,926	2044/3/20	第93回利付国債 (20年)	2.0	60,000	63,662	2027/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	155,000	155,832	2044/6/20	第94回利付国債 (20年)	2.1	50,000	53,220	2027/3/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	150,000	150,696	2044/9/20	第95回利付国債 (20年)	2.3	82,000	88,169	2027/6/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	120,000	116,175	2044/12/20	第96回利付国債 (20年)	2.1	248,000	264,866	2027/6/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	160,000	154,614	2045/3/20	第97回利付国債 (20年)	2.2	45,000	48,397	2027/9/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	125,000	122,827	2045/6/20	第98回利付国債 (20年)	2.1	94,000	100,733	2027/9/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	85,000	80,353	2045/9/20	第99回利付国債 (20年)	2.1	117,000	125,756	2027/12/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	140,000	132,073	2045/12/20	第100回利付国債 (20年)	2.2	30,000	32,465	2028/3/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	145,000	120,415	2046/3/20	第101回利付国債 (20年)	2.4	66,000	71,995	2028/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	140,000	102,823	2046/6/20	第102回利付国債 (20年)	2.4	81,000	88,673	2028/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	130,000	99,921	2046/9/20	第103回利付国債 (20年)	2.3	11,000	11,991	2028/6/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	105,000	82,392	2046/12/20	第104回利付国債 (20年)	2.1	33,000	35,673	2028/6/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	110,000	90,256	2047/3/20	第105回利付国債 (20年)	2.1	77,000	83,428	2028/9/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	110,000	89,963	2047/6/20	第106回利付国債 (20年)	2.2	2,000	2,176	2028/9/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	140,000	114,125	2047/9/20	第107回利付国債 (20年)	2.1	130,000	141,254	2028/12/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	190,000	154,380	2047/12/20	第108回利付国債 (20年)	1.9	134,000	144,246	2028/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	140,000	113,384	2048/3/20	第109回利付国債 (20年)	1.9	27,000	29,130	2029/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	170,000	133,846	2048/6/20	第110回利付国債 (20年)	2.1	98,000	106,769	2029/3/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	120,000	98,964	2048/9/20	第111回利付国債 (20年)	2.2	25,000	27,446	2029/6/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	100,000	78,182	2048/12/20	第112回利付国債 (20年)	2.1	80,000	87,388	2029/6/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	120,000	88,640	2049/3/20	第113回利付国債 (20年)	2.1	290,000	317,494	2029/9/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	120,000	85,779	2049/6/20	第114回利付国債 (20年)	2.1	52,000	57,047	2029/12/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	100,000	71,183	2049/9/20	第115回利付国債 (20年)	2.2	125,000	137,880	2029/12/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	110,000	78,039	2049/12/20	第116回利付国債 (20年)	2.2	135,000	149,219	2030/3/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	180,000	127,063	2050/3/20	第117回利付国債 (20年)	2.1	343,000	377,005	2030/3/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	110,000	81,877	2050/6/20	第118回利付国債 (20年)	2.0	70,000	76,581	2030/6/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	140,000	103,812	2050/9/20	第119回利付国債 (20年)	1.8	60,000	64,850	2030/6/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	110,000	83,661	2050/12/20	第120回利付国債 (20年)	1.6	170,000	181,561	2030/6/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	110,000	83,436	2051/3/20	第121回利付国債 (20年)	1.9	22,000	23,942	2030/9/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	120,000	90,693	2051/6/20	第122回利付国債 (20年)	1.8	17,000	18,387	2030/9/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	160,000	120,593	2051/9/20	第123回利付国債 (20年)	2.1	195,000	214,973	2030/12/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	150,000	112,848	2051/12/20	第124回利付国債 (20年)	2.0	90,000	98,602	2030/12/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	130,000	106,072	2052/3/20	第125回利付国債 (20年)	2.2	50,000	55,546	2031/3/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	180,000	158,641	2052/6/20	第126回利付国債 (20年)	2.0	105,000	115,122	2031/3/20
第76回利付国債 (30年)	1.4	150,000	135,376	2052/9/20	第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	54,467	2031/3/20
第77回利付国債 (30年)	1.6	160,000	151,563	2052/12/20	第128回利付国債 (20年)	1.9	65,000	70,840	2031/6/20
第78回利付国債 (30年)	1.4	150,000	135,216	2053/3/20	第129回利付国債 (20年)	1.8	85,000	91,986	2031/6/20
第79回利付国債 (30年)	1.2	100,000	85,508	2053/6/20	第130回利付国債 (20年)	1.8	150,000	162,288	2031/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	113,000	115,634	2024/12/20	第131回利付国債 (20年)	1.7	92,000	98,848	2031/9/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	118,000	120,885	2024/12/20	第132回利付国債 (20年)	1.7	135,000	145,069	2031/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	10,000	10,292	2025/3/20	第133回利付国債 (20年)	1.8	110,000	119,050	2031/12/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	21,000	21,556	2025/3/20	第134回利付国債 (20年)	1.8	120,000	129,950	2032/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	40,000	41,115	2025/3/20	第135回利付国債 (20年)	1.7	30,000	32,250	2032/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	160,000	165,200	2025/6/20	第136回利付国債 (20年)	1.6	220,000	234,674	2032/3/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	60,000	62,326	2025/9/20	第137回利付国債 (20年)	1.7	200,000	214,990	2032/6/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	130,000	136,520	2026/3/20	第138回利付国債 (20年)	1.5	120,000	126,998	2032/6/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	300,000	317,253	2026/6/20	第139回利付国債 (20年)	1.6	230,000	245,276	2032/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	16,000	16,951	2026/9/20	第140回利付国債 (20年)	1.7	318,000	342,199	2032/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	250,000	265,587	2026/9/20	第141回利付国債 (20年)	1.7	235,000	252,813	2032/12/20

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142回利付国債 (20年)	1.8	165,000	178,911	2032/12/20	第744回東京都公募公債	0.577	100,000	100,735	2025/6/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	94,000	100,394	2033/3/20	令和2年度第2回北海道公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,810	2025/5/29
第144回利付国債 (20年)	1.5	330,000	349,420	2033/3/20	令和3年度第6回北海道公募公債 (5年)	0.005	100,000	99,275	2026/7/30
第145回利付国債 (20年)	1.7	315,000	339,475	2033/6/20	第214回神奈川県公募公債	0.563	100,000	100,704	2025/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	195,000	210,132	2033/9/20	平成27年度第10回静岡県公募公債	0.461	200,000	201,120	2025/9/19
第147回利付国債 (20年)	1.6	208,000	221,950	2033/12/20	平成22年度第1回福岡県公募公債 (15年)	1.67	100,000	103,046	2025/11/21
第148回利付国債 (20年)	1.5	180,000	190,173	2034/3/20	平成26年度第2回新潟県公募公債	0.429	100,000	100,427	2025/2/27
第149回利付国債 (20年)	1.5	185,000	195,213	2034/6/20	第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	100,461	2024/11/25
第150回利付国債 (20年)	1.4	210,000	219,223	2034/9/20	第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	200,610	2025/1/24
第151回利付国債 (20年)	1.2	240,000	245,059	2034/12/20	第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	100,501	2025/3/25
第152回利付国債 (20年)	1.2	250,000	254,852	2035/3/20	第147回共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	100,684	2025/6/25
第153回利付国債 (20年)	1.3	270,000	277,578	2035/6/20	第165回共同発行市場公募地方債	0.145	200,000	199,052	2026/12/25
第154回利付国債 (20年)	1.2	160,000	162,451	2035/9/20	平成28年度第1回長崎県公募公債	0.105	100,000	99,522	2026/9/30
第155回利付国債 (20年)	1.0	270,000	267,534	2035/12/20	平成27年度第1回佐賀県公募公債	0.476	100,000	100,587	2025/11/28
第156回利付国債 (20年)	0.4	160,000	147,060	2036/3/20	平成29年度第1回滋賀県公募公債	0.19	100,000	99,152	2027/11/30
第157回利付国債 (20年)	0.2	150,000	133,749	2036/6/20	平成27年度第2回熊本県公募公債 (10年)	0.476	100,000	100,598	2025/10/30
第158回利付国債 (20年)	0.5	170,000	156,882	2036/9/20	第2回名古屋市定時償還公募公債 (10年)	0.275	20,000	20,026	2025/7/17
第159回利付国債 (20年)	0.6	150,000	139,620	2036/12/20	平成27年度第5回札幌市公募公債 (10年)	0.47	100,000	100,577	2025/9/19
第160回利付国債 (20年)	0.7	140,000	131,467	2037/3/20	令和元年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,932	2024/10/31
第161回利付国債 (20年)	0.6	120,000	110,776	2037/6/20	令和2年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,684	2025/10/30
第162回利付国債 (20年)	0.6	150,000	137,883	2037/9/20	小 計		2,720,000	2,728,710	
第163回利付国債 (20年)	0.6	165,000	151,016	2037/12/20	特殊債券 (除く金融債)				
第164回利付国債 (20年)	0.5	255,000	229,012	2038/3/20	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	106,664	2027/2/26
第165回利付国債 (20年)	0.5	170,000	151,957	2038/6/20	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	107,668	2027/10/29
第166回利付国債 (20年)	0.7	150,000	137,479	2038/9/20	第58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	100,459	2025/10/31
第167回利付国債 (20年)	0.5	160,000	141,648	2038/12/20	第70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	99,525	2026/4/30
第168回利付国債 (20年)	0.4	140,000	121,422	2039/3/20	第82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	197,944	2027/9/30
第169回利付国債 (20年)	0.3	160,000	135,840	2039/6/20	第51回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	98,624	2028/6/30
第170回利付国債 (20年)	0.3	140,000	118,204	2039/9/20	第38回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.01	200,000	198,686	2026/9/14
第171回利付国債 (20年)	0.3	170,000	142,738	2039/12/20	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	99,113	2027/1/29
第172回利付国債 (20年)	0.4	230,000	195,421	2040/3/20	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.414	100,000	100,432	2025/2/17
第173回利付国債 (20年)	0.4	190,000	160,555	2040/6/20	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.11	200,000	198,566	2027/5/21
第174回利付国債 (20年)	0.4	200,000	168,074	2040/9/20	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	100,000	99,318	2027/6/14
第175回利付国債 (20年)	0.5	180,000	153,149	2040/12/20	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	200,000	198,218	2028/2/15
第176回利付国債 (20年)	0.5	190,000	160,903	2041/3/20	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	0.13	100,000	98,517	2028/7/19
第177回利付国債 (20年)	0.4	200,000	165,492	2041/6/20	第5回政府保証新関西国際空港債	0.145	100,000	99,509	2027/3/30
第178回利付国債 (20年)	0.5	220,000	184,657	2041/9/20	第13回新関西国際空港株式会社社債 (一般担保付)	0.506	200,000	200,794	2024/12/20
第179回利付国債 (20年)	0.5	190,000	158,707	2041/12/20	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	100,397	2024/12/20
第180回利付国債 (20年)	0.8	190,000	166,973	2042/3/20	第29回国際協力機構債券	0.583	100,000	100,671	2025/6/20
第181回利付国債 (20年)	0.9	190,000	169,438	2042/6/20	第37回国際協力機構債券	0.1	100,000	99,413	2026/9/18
第182回利付国債 (20年)	1.1	200,000	184,152	2042/9/20	小 計		2,300,000	2,304,518	
第183回利付国債 (20年)	1.4	190,000	183,756	2042/12/20	金融債券				
第184回利付国債 (20年)	1.1	170,000	155,575	2043/3/20	第363回信金中金債 (5年)	0.01	100,000	99,780	2025/2/27
第185回利付国債 (20年)	1.1	130,000	118,511	2043/6/20	第395回信金中金債 (5年)	0.2	100,000	98,976	2027/10/27
小 計		45,217,000	44,169,559		小 計		200,000	198,756	
地方債証券					普通社債券 (含む投資法人債券)				
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	99,725	2025/9/19	第510回関西電力株式会社社債 (一般担保付)	0.49	100,000	99,432	2027/7/23
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	102,633	2025/3/19	第552回関西電力株式会社社債 (一般担保付)	0.4	100,000	100,040	2025/7/25
第32回東京都公募公債 (5年)	0.02	200,000	199,620	2025/6/20	第400回中国電力株式会社社債 (一般担保付)	0.34	100,000	98,929	2027/9/24
第739回東京都公募公債	0.29	100,000	100,229	2024/12/20	第40回中国電力株式会社社債 (一般担保付) (トランプファンデ)	0.455	100,000	98,911	2028/5/25

銘柄	当 期 末			
	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	
第26回西日本高速道路株式会社債(一般担保付、独立行政法人 日本高速道路保有・債務返済機構重層的融資引受条項付)	0.524	100,000	100,429	2024/12/20
第20回体の妻株式会社無担保社債(特定社債間定同順位特約付)	0.305	100,000	99,906	2026/3/2
第25回体の妻株式会社無担保社債(特定社債間定同順位特約付)	0.355	100,000	99,670	2027/3/9
第10回株式会社資生堂無担保社債(社債間定同順位特約付)	0.08	100,000	99,761	2025/2/26
第16回株式会社小糸製作所無担保社債(社債間定同順位特約付)(グリーンボンド)	0.13	100,000	99,723	2025/7/16

銘柄	当 期 末			
	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	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間定同順位特約付)	0.536	100,000	100,331	2024/12/20
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債(日本電信電話株式会社保証付)	0.18	100,000	99,619	2025/12/19
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間定同順位特約付)	0.21	100,000	99,840	2025/10/14
第31回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	0.18	100,000	99,858	2025/6/25
小 計		1,300,000	1,296,449	
合 計		51,737,000	50,697,992	

○投資信託財産の構成

(2023年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	50,697,992	99.7
コール・ローン等、その他	127,332	0.3
投資信託財産総額	50,825,324	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10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	50,825,324,868	
コール・ローン等	35,789,646	
公社債(評価額)	50,697,992,880	
未収利息	89,566,486	
前払費用	1,975,856	
(B) 負債	39,615,864	
未払解約金	39,615,852	
未払利息	12	
(C) 純資産総額(A-B)	50,785,709,004	
元本	38,462,644,652	
次期繰越損益金	12,323,064,352	
(D) 受益権総口数	38,462,644,652口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,204円	

(注) 当ファンドの期首元本額は35,139,813,158円、期中追加設定元本額は4,986,525,327円、期中一部解約元本額は1,663,693,833円です。

(注) 2023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)	5,944,219,944円
・DCインデックスバランス(株式20)	5,672,585,007円
・DCインデックスバランス(株式40)	5,467,454,315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	4,634,497,139円
・DCインデックスバランス(株式60)	4,301,495,149円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,086,148,563円
・インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,204,907,921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)	1,729,528,043円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,578,117,566円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,574,305,602円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	932,779,513円
・DCインデックスバランス(株式80)	771,286,086円
・日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	408,919,917円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	141,132,311円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	13,139,320円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	1,124,075円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	1,004,181円

(注) 1口当たり純資産額は1,3204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し処理しています。

○損益の状況 (2022年10月27日～2023年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	406,475,409	
受取利息	406,532,314	
支払利息	△ 56,905	
(B) 有価証券売買損益	△ 1,727,982,670	
売買益	1,971,272	
売買損	△ 1,729,953,942	
(C) 保管費用等	△ 12	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,321,507,273	
(E) 前期繰越損益金	12,437,621,998	
(F) 追加信託差損益金	1,795,990,191	
(G) 解約差損益金	△ 589,040,564	
(H) 計(D+E+F+G)	12,323,064,352	
次期繰越損益金(H)	12,323,064,352	

(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。

○お知らせ

約款変更について

2022年10月27日から2023年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当マザーファンドについて、つみたてNISAの対象商品に係る登録要件に適合させるため、当該マザーファンドにて行なうデリバティブ取引の利用目的を明確化するべく、2023年2月8日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。(付表、第12条、第13条、第14条)

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25期（決算日 2023年10月26日）
（2022年10月27日～2023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。

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、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
	期騰落	中率	期騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
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
25期(2023年10月26日)	27,113	2.5	270.19	2.5	99.1	155,398

(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2023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) 2022年10月26日	円	%		%	%
	26,448	—	263.52	—	99.2
10月末	26,701	1.0	265.69	0.8	99.2
11月末	25,902	△2.1	257.96	△2.1	99.2
12月末	24,634	△6.9	245.10	△7.0	99.1
2023年1月末	24,928	△5.7	248.29	△5.8	99.2
2月末	25,227	△4.6	250.95	△4.8	99.4
3月末	25,549	△3.4	254.17	△3.5	99.1
4月末	25,735	△2.7	255.83	△2.9	99.1
5月末	26,388	△0.2	262.67	△0.3	99.2
6月末	27,452	3.8	273.46	3.8	99.2
7月末	26,854	1.5	267.41	1.5	99.1
8月末	27,599	4.4	274.63	4.2	99.2
9月末	27,186	2.8	270.54	2.7	99.1
(期末) 2023年10月26日	円	%		%	%
	27,113	2.5	270.19	2.5	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2022年10月27日～2023年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め26,448円の基準価額は、期間末に27,113円となり、騰落率は+2.5%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。

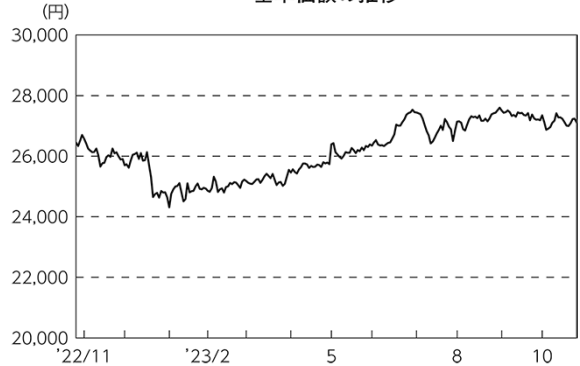
<値上がり要因>

- ・欧米の金融システムに対する不安が広がり投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・米国の市場予想を下回るISM製造業景況感指数を受けた米国連邦準備制度理事会（FRB）の利上げの鈍化が見込まれたこと。
- ・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。

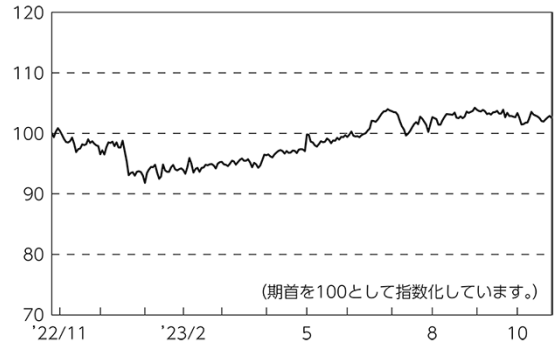
<値下がり要因>

- ・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。
- ・米国連邦政府の債務上限停止法案が上下両院で可決され、懸念された債務不履行（デフォルト）が回避され投資家のリスク回避姿勢が和らいだこと。
- ・原油価格の上昇を受けて、インフレの長期化が懸念されたこと（2023年5月後半～期間末）。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2022/10/26	2023/08/31	2023/01/04	2023/10/26
26,448円	27,599円	24,315円	27,113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

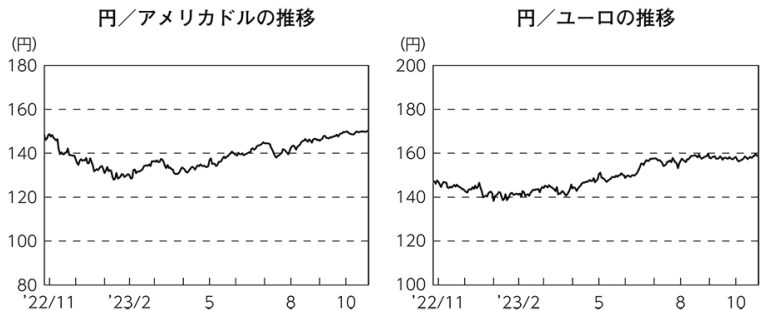
（海外債券市況）

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2023年5月前半にかけては、米国の消費者物価指数（CPI）や個人消費支出（PCE）コアデフレーターなどのインフレ指標が市場予想を上回ったことを背景に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、FRBやECBなど主要国の中央銀行が政策金利を引き上げたこと、FRB高官のタカ派（金融引き締めの政策を支持）的な発言などが利回りの上昇要因となったものの、欧米の金融システムに対する不安が広がり投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、米国の市場予想を下回るISM製造業景況感指数を受けたFRBの利上げの鈍化が見込まれたことなどが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となり、各国の10年国債利回りはまちまちの動きとなりました。5月後半から期間末にかけては、一時強まった米国地方銀行の破綻連鎖への懸念が後退したことや、米国連邦政府の債務上限停止法案が上下両院で可決され、懸念されたデフォルトが回避され投資家のリスク回避姿勢が和らいだこと、FRB議長の議会証言などからFRBによる金融引き締めの長期化が見込まれたこと、ECBやイングランド銀行（BOE）などの中央銀行が政策金利引き上げの継続を示したこと、格付け会社が米国国債の格付けを引き下げたこと、原油価格の上昇を受けてインフレの長期化が懸念されたことなどから、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、2.5%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>

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

<マイナス要因>

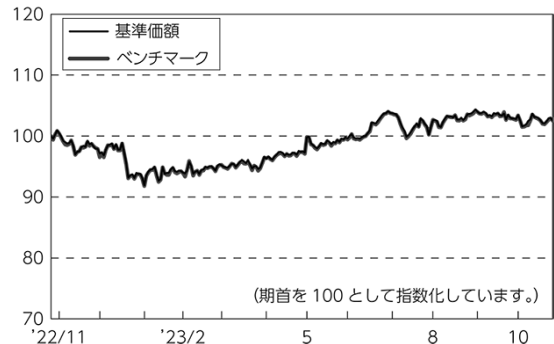
- ・投資通貨の選択が影響したこと。
- ・外国口座の管理費用を支払ったこと。

○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

(2022年10月27日～2023年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 5	% 0.018	(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 ）	(5)	(0.018)	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 ）	(0)	(0.000)	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	5	0.018	
期中の平均基準価額は、26,179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10月27日～2023年10月26日）

公社債

		買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	千アメリカドル 107,263	千アメリカドル 124,582
	カナダ	千カナダドル 7,073	千カナダドル 6,570
	メキシコ	千メキシコペソ 34,406	千メキシコペソ 36,237
	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券 14,283	13,170
	イタリア	国債証券 9,847	14,298
	フランス	国債証券 7,525	11,282
	オランダ	国債証券 1,559	2,445
	スペイン	国債証券 4,692	6,913
	ベルギー	国債証券 1,490	2,418
	オーストリア	国債証券 1,425	1,747
	フィンランド	国債証券 757	700
	アイルランド	国債証券 207	878
	イギリス	国債証券 千イギリスポンド 10,621	千イギリスポンド 4,124
	スウェーデン	国債証券 千スウェーデンクローナ 1,402	千スウェーデンクローナ 6,639
	ノルウェー	国債証券 千ノルウェークローネ 1,592	千ノルウェークローネ 4,603
	デンマーク	国債証券 千デンマーククローネ 1,791	千デンマーククローネ 5,252
	ポーランド	国債証券 千ポーランドズロチ 4,155	千ポーランドズロチ 4,660
	オーストラリア	国債証券 千オーストラリアドル 2,699	千オーストラリアドル 2,440
ニュージーランド	国債証券 千ニュージーランドドル 4,737	千ニュージーランドドル 477	
シンガポール	国債証券 千シンガポールドル 799	千シンガポールドル 1,259	
マレーシア	国債証券 千マレーシアリンギット 3,394	千マレーシアリンギット 2,807	
中国	国債証券 千中国人民元 335,531	千中国人民元 49,372	
イスラエル	国債証券 千イスラエルシュケル 1,540	千イスラエルシュケル 2,206	

（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

(2022年10月27日～2023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（2022年10月27日～2023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

(2023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 586,340	千アメリカドル 495,557	千円 74,472,336	% 47.9	% —	% 19.6	% 18.4	% 9.8
カナダ	千カナダドル 32,109	千カナダドル 28,281	3,077,834	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 187,160	千メキシコペソ 164,712	1,348,467	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	69,805	63,210	10,031,540	6.5	—	3.5	1.9	1.0
イタリア	80,114	71,554	11,355,742	7.3	—	3.9	2.4	0.9
フランス	91,380	80,901	12,839,021	8.3	—	4.9	2.6	0.8
オランダ	16,315	14,215	2,256,067	1.5	—	0.9	0.5	0.1
スペイン	53,090	47,628	7,558,638	4.9	—	2.8	1.5	0.6
ベルギー	20,150	17,558	2,786,540	1.8	—	1.2	0.5	0.2
オーストリア	13,641	11,630	1,845,690	1.2	—	0.7	0.4	0.2
フィンランド	6,102	5,024	797,314	0.5	—	0.3	0.2	0.1
アイルランド	6,725	5,670	899,874	0.6	—	0.4	0.1	0.1
イギリス	千イギリスポンド 52,190	千イギリスポンド 41,155	7,478,778	4.8	—	3.4	0.9	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 24,605	千スウェーデンクローナ 22,799	306,887	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 20,850	千ノルウェークローネ 18,765	251,271	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 23,800	千デンマーククローネ 23,017	489,346	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 25,425	千ポーランドズロチ 23,009	816,224	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 27,236	千オーストラリアドル 23,519	2,219,994	1.4	—	0.9	0.3	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランドドル 4,850	千ニュージーランドドル 4,037	350,798	0.2	—	0.1	0.1	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 6,613	千シンガポールドル 6,209	680,052	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 26,310	千マレーシアリンギット 26,205	822,312	0.5	—	0.3	0.1	0.1
中国	千中国人民元 518,000	千中国人民元 527,317	10,826,835	7.0	—	2.9	2.5	1.6
イスラエル	千イスラエルシェケル 13,515	千イスラエルシェケル 12,165	449,511	0.3	—	0.1	0.1	0.1
合 計	—	—	153,961,084	99.1	—	48.3	33.8	17.0

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	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	2.125	2,015	1,954	293,695	2024/9/30
US TREASURY N/B	1.5	2,200	2,121	318,839	2024/9/30
US TREASURY N/B	2.25	5,190	5,027	755,464	2024/10/31
US TREASURY N/B	1.5	2,140	2,057	309,177	2024/10/31
US TREASURY N/B	2.25	4,650	4,499	676,125	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.125	1,400	1,351	203,061	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.5	3,470	3,326	499,858	2024/11/30
US TREASURY N/B	4.5	2,150	2,128	319,877	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.0	2,450	2,332	350,510	2024/12/15
US TREASURY N/B	2.25	1,900	1,832	275,421	2024/12/31
US TREASURY N/B	1.75	1,300	1,246	187,335	2024/12/31
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,448	217,618	2025/1/31
US TREASURY N/B	1.375	3,510	3,340	502,056	2025/1/31
US TREASURY N/B	4.125	1,190	1,172	176,168	2025/1/31
US TREASURY N/B	2.0	4,530	4,340	652,274	2025/2/15
US TREASURY N/B	1.5	3,000	2,855	429,160	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.75	2,060	1,991	299,267	2025/2/28
US TREASURY N/B	1.125	5,740	5,428	815,837	2025/2/28
US TREASURY N/B	2.625	2,010	1,936	290,971	2025/3/31
US TREASURY N/B	0.5	3,470	3,242	487,290	2025/3/31
US TREASURY N/B	2.625	2,600	2,503	376,159	2025/4/15
US TREASURY N/B	2.875	2,200	2,123	319,192	2025/4/30
US TREASURY N/B	0.375	2,150	1,998	300,269	2025/4/30
US TREASURY N/B	2.125	3,800	3,623	544,596	2025/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,420	1,368	205,724	2025/5/31
US TREASURY N/B	0.25	3,820	3,530	530,520	2025/5/31
US TREASURY N/B	2.875	5,000	4,816	723,867	2025/6/15
US TREASURY N/B	2.75	1,370	1,315	197,748	2025/6/30
US TREASURY N/B	3.0	5,000	4,819	724,337	2025/7/15
US TREASURY N/B	2.875	1,440	1,383	207,949	2025/7/31
US TREASURY N/B	0.25	3,000	2,751	413,557	2025/7/31
US TREASURY N/B	2.0	4,730	4,471	672,020	2025/8/15
US TREASURY N/B	2.75	3,000	2,871	431,573	2025/8/31
US TREASURY N/B	5.0	5,000	4,983	748,933	2025/8/31
US TREASURY N/B	3.0	4,200	4,034	606,323	2025/9/30
US TREASURY N/B	0.25	1,570	1,430	215,018	2025/9/30
US TREASURY N/B	4.25	170	167	25,121	2025/10/15
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,343	201,877	2025/10/31
US TREASURY N/B	0.25	2,110	1,915	287,821	2025/10/31
US TREASURY N/B	2.25	3,440	3,249	488,307	2025/11/15
US TREASURY N/B	2.875	1,320	1,261	189,628	2025/11/30
US TREASURY N/B	0.375	3,420	3,101	466,135	2025/11/30
US TREASURY N/B	4.0	210	205	30,861	2025/12/15
US TREASURY N/B	2.625	2,000	1,899	285,437	2025/12/31
US TREASURY N/B	3.875	1,150	1,120	168,460	2026/1/15
US TREASURY N/B	2.625	1,850	1,753	263,552	2026/1/31
US TREASURY N/B	0.375	3,000	2,701	406,037	2026/1/31
US TREASURY N/B	6.0	1,800	1,835	275,839	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	3,310	3,065	460,624	2026/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	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	4.0	3,000	2,930	440,467	2026/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,790	1,690	253,995	2026/2/28
US TREASURY N/B	0.5	3,650	3,286	493,862	2026/2/28
US TREASURY N/B	2.25	2,070	1,939	291,527	2026/3/31
US TREASURY N/B	0.75	2,400	2,169	326,069	2026/3/31
US TREASURY N/B	2.375	1,050	985	148,036	2026/4/30
US TREASURY N/B	0.75	2,740	2,467	370,783	2026/4/30
US TREASURY N/B	1.625	4,840	4,449	668,654	2026/5/15
US TREASURY N/B	3.625	6,750	6,527	980,946	2026/5/15
US TREASURY N/B	2.125	2,740	2,549	383,096	2026/5/31
US TREASURY N/B	0.75	2,800	2,512	377,587	2026/5/31
US TREASURY N/B	4.125	3,000	2,935	441,100	2026/6/15
US TREASURY N/B	1.875	2,000	1,846	277,466	2026/6/30
US TREASURY N/B	1.875	960	883	132,777	2026/7/31
US TREASURY N/B	0.625	3,260	2,897	435,505	2026/7/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,638	546,737	2026/8/15
US TREASURY N/B	0.75	3,000	2,666	400,789	2026/8/31
US TREASURY N/B	1.625	1,620	1,475	221,685	2026/9/30
US TREASURY N/B	0.875	2,000	1,781	267,650	2026/9/30
US TREASURY N/B	1.625	250	226	34,083	2026/10/31
US TREASURY N/B	1.125	3,950	3,530	530,581	2026/10/31
US TREASURY N/B	2.0	3,040	2,786	418,785	2026/11/15
US TREASURY N/B	1.625	2,400	2,172	326,506	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.25	2,210	1,977	297,142	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,813	272,582	2026/12/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,588	539,246	2027/1/31
US TREASURY N/B	2.25	2,680	2,461	369,963	2027/2/15
US TREASURY N/B	1.125	1,530	1,352	203,261	2027/2/28
US TREASURY N/B	0.625	2,700	2,336	351,058	2027/3/31
US TREASURY N/B	0.5	2,450	2,102	315,942	2027/4/30
US TREASURY N/B	2.75	1,430	1,329	199,823	2027/4/30
US TREASURY N/B	2.375	3,530	3,236	486,391	2027/5/15
US TREASURY N/B	0.5	2,100	1,795	269,827	2027/5/31
US TREASURY N/B	2.625	1,750	1,616	242,988	2027/5/31
US TREASURY N/B	0.5	3,100	2,641	397,006	2027/6/30
US TREASURY N/B	3.25	5,000	4,717	708,986	2027/6/30
US TREASURY N/B	0.375	7,000	5,912	888,494	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.75	930	860	129,305	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.25	2,960	2,686	403,751	2027/8/15
US TREASURY N/B	0.5	4,100	3,468	521,222	2027/8/31
US TREASURY N/B	0.375	4,090	3,429	515,317	2027/9/30
US TREASURY N/B	0.5	3,860	3,241	487,176	2027/10/31
US TREASURY N/B	4.125	800	776	116,668	2027/10/31
US TREASURY N/B	6.125	1,400	1,461	219,637	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	3,020	2,725	409,559	2027/11/15
US TREASURY N/B	0.625	220	185	27,822	2027/11/30
US TREASURY N/B	3.875	2,320	2,229	335,043	2027/11/30
US TREASURY N/B	0.625	3,960	3,321	499,147	2027/12/31
US TREASURY N/B	0.75	2,850	2,395	360,054	2028/1/31

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	3.5	1,450	1,371	206,040	2028/1/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,665	550,787	2028/2/15
US TREASURY N/B	1.125	3,830	3,265	490,787	2028/2/29
US TREASURY N/B	4.0	2,650	2,555	384,070	2028/2/29
US TREASURY N/B	1.25	960	820	123,332	2028/3/31
US TREASURY N/B	1.25	3,370	2,873	431,762	2028/4/30
US TREASURY N/B	3.5	3,000	2,829	425,286	2028/4/30
US TREASURY N/B	2.875	2,440	2,237	336,259	2028/5/15
US TREASURY N/B	1.25	4,300	3,653	549,109	2028/5/31
US TREASURY N/B	3.625	1,020	966	145,309	2028/5/31
US TREASURY N/B	1.25	3,300	2,796	420,266	2028/6/30
US TREASURY N/B	4.0	200	192	28,920	2028/6/30
US TREASURY N/B	1.0	2,920	2,436	366,120	2028/7/31
US TREASURY N/B	4.125	5,950	5,753	864,651	2028/7/31
US TREASURY N/B	2.875	4,200	3,832	575,898	2028/8/15
US TREASURY N/B	1.125	2,960	2,477	372,378	2028/8/31
US TREASURY N/B	1.25	4,000	3,359	504,869	2028/9/30
US TREASURY N/B	1.375	3,800	3,202	481,344	2028/10/31
US TREASURY N/B	5.25	1,070	1,084	162,903	2028/11/15
US TREASURY N/B	3.125	2,610	2,399	360,545	2028/11/15
US TREASURY N/B	1.5	4,930	4,171	626,824	2028/11/30
US TREASURY N/B	1.375	870	728	109,538	2028/12/31
US TREASURY N/B	2.625	4,590	4,096	615,565	2029/2/15
US TREASURY N/B	2.375	4,630	4,062	610,520	2029/3/31
US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,799	270,433	2029/4/30
US TREASURY N/B	2.375	4,810	4,212	633,027	2029/5/15
US TREASURY N/B	3.25	4,980	4,557	684,839	2029/6/30
US TREASURY N/B	1.625	4,370	3,651	548,748	2029/8/15
US TREASURY N/B	4.0	1,920	1,822	273,896	2029/10/31
US TREASURY N/B	1.75	7,190	6,014	903,789	2029/11/15
US TREASURY N/B	1.5	4,340	3,534	531,134	2030/2/15
US TREASURY N/B	4.0	1,650	1,562	234,808	2030/2/28
US TREASURY N/B	3.625	2,550	2,361	354,817	2030/3/31
US TREASURY N/B	6.25	1,060	1,135	170,652	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	4,590	3,484	523,724	2030/5/15
US TREASURY N/B	3.75	710	661	99,379	2030/5/31
US TREASURY N/B	4.0	4,900	4,628	695,526	2030/7/31
US TREASURY N/B	0.625	5,090	3,830	575,650	2030/8/15
US TREASURY N/B	0.875	5,910	4,500	676,384	2030/11/15
US TREASURY N/B	5.375	560	575	86,523	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.125	4,400	3,394	510,181	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.625	6,930	5,500	826,643	2031/5/15
US TREASURY N/B	1.25	7,130	5,443	818,041	2031/8/15
US TREASURY N/B	1.375	6,830	5,225	785,245	2031/11/15
US TREASURY N/B	1.875	6,240	4,943	742,907	2032/2/15
US TREASURY N/B	2.875	4,800	4,107	617,199	2032/5/15
US TREASURY N/B	2.75	5,100	4,301	646,403	2032/8/15
US TREASURY N/B	4.125	6,110	5,740	862,615	2032/11/15
US TREASURY N/B	3.5	2,610	2,330	350,188	2033/2/15
US TREASURY N/B	3.375	1,490	1,313	197,466	2033/5/15
US TREASURY N/B	4.5	800	769	115,640	2036/2/15

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	5.0	750	749	112,679	2037/5/15
US TREASURY N/B	4.375	670	622	93,615	2038/2/15
US TREASURY N/B	4.5	720	675	101,574	2038/5/15
US TREASURY N/B	3.5	800	660	99,241	2039/2/15
US TREASURY N/B	4.25	1,450	1,306	196,285	2039/5/15
US TREASURY N/B	4.5	1,420	1,313	197,426	2039/8/15
US TREASURY N/B	4.375	750	681	102,477	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.625	680	636	95,611	2040/2/15
US TREASURY N/B	4.375	1,590	1,440	216,441	2040/5/15
US TREASURY N/B	1.125	3,700	2,011	302,322	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	1,440	1,220	183,460	2040/8/15
US TREASURY N/B	1.125	3,000	1,616	242,960	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.25	1,010	897	134,808	2040/11/15
US TREASURY N/B	1.375	3,100	1,741	261,740	2040/11/15
US TREASURY N/B	4.75	1,500	1,416	212,836	2041/2/15
US TREASURY N/B	1.875	4,200	2,582	388,024	2041/2/15
US TREASURY N/B	4.375	870	782	117,648	2041/5/15
US TREASURY N/B	2.25	4,900	3,205	481,776	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	960	792	119,100	2041/8/15
US TREASURY N/B	1.75	3,190	1,889	284,002	2041/8/15
US TREASURY N/B	2.0	3,000	1,853	278,499	2041/11/15
US TREASURY N/B	3.125	500	373	56,164	2042/2/15
US TREASURY N/B	2.75	800	558	83,856	2042/8/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,389	208,771	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	1,765	1,301	195,627	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	2,050	1,445	217,228	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	1,950	1,551	233,143	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	2,090	1,691	254,237	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	1,080	855	128,510	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	2,000	1,518	228,131	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.125	2,150	1,561	234,627	2044/8/15
US TREASURY N/B	3.0	2,100	1,487	223,488	2044/11/15
US TREASURY N/B	2.5	2,820	1,815	272,831	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	1,400	986	148,309	2045/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,390	955	143,525	2045/8/15
US TREASURY N/B	3.0	1,190	834	125,378	2045/11/15
US TREASURY N/B	2.5	1,500	951	143,013	2046/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,500	948	142,525	2046/5/15
US TREASURY N/B	2.25	1,650	986	148,176	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	540	366	55,033	2046/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,387	208,478	2047/2/15
US TREASURY N/B	3.0	1,530	1,059	159,216	2047/5/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,314	197,535	2047/8/15
US TREASURY N/B	2.75	1,740	1,142	171,662	2047/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,750	1,895	284,793	2048/2/15
US TREASURY N/B	3.125	2,400	1,693	254,470	2048/5/15
US TREASURY N/B	3.0	4,100	2,820	423,793	2048/8/15
US TREASURY N/B	3.375	2,950	2,180	327,662	2048/11/15
US TREASURY N/B	3.0	3,300	2,268	340,967	2049/2/15
US TREASURY N/B	2.875	3,000	2,010	302,203	2049/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,950	1,720	258,600	2049/8/15

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	千アメリカドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
US TREASURY N/B	2.375	3,100	1,860	279,611	2049/11/15
US TREASURY N/B	2.0	3,700	2,024	304,299	2050/2/15
US TREASURY N/B	1.25	2,450	1,077	161,944	2050/5/15
US TREASURY N/B	1.375	2,920	1,329	199,781	2050/8/15
US TREASURY N/B	1.625	3,000	1,469	220,875	2050/11/15
US TREASURY N/B	1.875	4,750	2,494	374,872	2051/2/15
US TREASURY N/B	2.375	4,100	2,441	366,920	2051/5/15
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,081	162,466	2051/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,400	730	109,732	2051/11/15
US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,151	173,103	2052/2/15
US TREASURY N/B	2.875	600	400	60,141	2052/5/15
US TREASURY N/B	3.0	1,100	754	113,345	2052/8/15
US TREASURY N/B	4.0	1,500	1,253	188,304	2052/11/15
US TREASURY N/B	3.625	2,900	2,258	339,456	2053/2/15
US TREASURY N/B	3.625	2,150	1,675	251,842	2053/5/15
US TREASURY N/B	4.125	1,000	855	128,536	2053/8/15
小 計				74,472,336	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	800	769	83,732	2024/10/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.0	600	587	63,955	2024/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.75	550	541	58,934	2025/2/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	710	676	73,611	2025/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	760	724	78,814	2025/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.75	530	521	56,724	2025/5/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	950	913	99,364	2025/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	80	78	8,514	2025/8/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,755	1,624	176,773	2025/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	4.5	450	448	48,762	2025/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	995	899	97,919	2026/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.0	700	674	73,402	2026/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	770	713	77,681	2026/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	990	898	97,798	2026/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	520	469	51,067	2027/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	750	668	72,759	2027/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	620	585	63,694	2027/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	580	562	61,169	2028/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	897	816	88,808	2028/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.25	630	603	65,637	2028/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	410	442	48,190	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	364	330	35,966	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,998	1,665	181,242	2030/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,405	1,091	118,798	2030/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,966	1,625	176,934	2031/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,950	1,594	173,533	2031/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,070	903	98,315	2032/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.5	890	778	84,770	2032/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	710	799	86,970	2033/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	500	445	48,483	2033/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.25	100	92	10,114	2033/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	340	369	40,199	2037/6/1

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	千カナダドル	千円	
(カナダ) 国債証券					
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	600	596	64,869	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	730	678	73,856	2045/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	650	529	57,585	2048/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	2,123	1,439	156,667	2051/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,131	706	76,920	2053/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	200	158	17,209	2055/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	335	258	28,078	2064/12/1
小 計				3,077,834	
(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	10.0	14,900	14,690	120,267	2024/12/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	6,400	5,916	48,433	2025/3/6
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	24,250	21,688	177,560	2026/3/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.0	2,500	2,271	18,592	2026/9/3
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5	13,350	11,497	94,129	2027/3/4
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	21,600	19,716	161,417	2027/6/3
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	14,120	13,109	107,325	2029/5/31
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	22,400	19,467	159,372	2031/5/29
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	10,800	9,018	73,828	2033/5/26
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,300	4,445	36,393	2034/11/23
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	600	512	4,193	2035/5/24
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	4,400	4,339	35,526	2036/11/20
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	11,970	10,402	85,164	2038/11/18
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	13,200	10,461	85,462	2042/11/13
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	13,570	10,953	89,674	2047/11/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	7,800	6,222	50,945	2053/7/31
小 計				1,348,467	
(ユーロ…ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BUNDES OBLIGATION	—	1,360	1,314	208,604	2024/10/18
BUNDES OBLIGATION	—	1,300	1,240	196,806	2025/4/11
BUNDES OBLIGATION	—	1,650	1,553	246,555	2025/10/10
BUNDES OBLIGATION	—	1,600	1,489	236,326	2026/4/10
BUNDES OBLIGATION	—	1,150	1,044	165,686	2027/4/16
BUNDES OBLIGATION	1.3	1,130	1,068	169,517	2027/10/15
BUNDES OBLIGATION	2.2	750	732	116,187	2028/4/13
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.5	1,990	1,918	304,398	2025/2/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.0	2,070	1,992	316,177	2025/8/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.5	1,820	1,719	272,902	2026/2/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	2,010	1,855	294,456	2026/8/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.25	2,405	2,211	351,017	2027/2/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	6.5	910	1,024	162,526	2027/7/4
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.5	1,770	1,626	258,182	2027/8/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	1,565	1,401	222,373	2027/11/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	5.625	650	722	114,712	2028/1/4
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.5	1,690	1,538	244,098	2028/2/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	4.75	970	1,054	167,395	2028/7/4
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.25	1,670	1,486	235,924	2028/8/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	1,180	1,030	163,521	2028/11/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.25	1,875	1,649	261,790	2029/2/15
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	1,830	1,566	248,538	2029/8/15

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…ドイツ)					
国債証券					
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.1	620	597	94,865	2029/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	660	790	125,477	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,490	1,258	199,666	2030/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,800	1,498	237,841	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	740	616	97,913	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,110	1,305	207,138	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,920	1,575	249,960	2031/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,565	1,265	200,769	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	323	51,356	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,623	1,291	204,969	2032/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.7	1,680	1,535	243,730	2032/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3	1,450	1,386	220,022	2033/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.3	50	47	7,594	2033/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.6	500	488	77,467	2033/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,375	1,603	254,416	2034/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,200	854	135,556	2035/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	687	109,174	2036/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,790	1,973	313,204	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	50	37	6,011	2038/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,235	1,408	223,531	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,355	1,640	260,392	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	955	970	153,956	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,635	1,480	235,026	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,827	1,644	260,907	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	2,040	1,396	221,628	2048/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,630	727	115,388	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	640	287	45,571	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	750	315	50,024	2052/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8	1,040	776	123,254	2053/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.8	500	374	59,469	2053/8/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.2	240	236	37,561	2024/12/12
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.5	680	672	106,654	2025/3/13
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	2.8	910	903	143,337	2025/6/12
(ユーロ…イタリア)					
国債証券					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,260	1,227	194,878	2024/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,080	1,063	168,823	2024/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	870	832	132,123	2024/12/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,485	1,420	225,370	2025/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,540	1,560	247,663	2025/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	855	823	130,765	2025/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,300	1,251	198,586	2025/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	966	153,362	2025/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.6	85	84	13,393	2025/9/29
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,100	1,069	169,712	2025/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,085	1,043	165,530	2025/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.5	810	802	127,318	2026/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	850	786	124,866	2026/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,330	1,345	213,456	2026/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,220	1,108	175,946	2026/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.8	950	945	150,118	2026/4/15

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…イタリア)					
国債証券					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.6	1,330	1,252	198,840	2026/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.1	950	904	143,534	2026/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	870	779	123,758	2026/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	7.25	720	785	124,585	2026/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,080	994	157,784	2026/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.85	1,180	1,068	169,561	2027/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.1	410	371	59,007	2027/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.2	1,160	1,089	172,848	2027/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.05	995	925	146,875	2027/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,275	1,132	179,785	2027/9/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.5	1,560	1,697	269,443	2027/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.65	950	897	142,481	2027/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,650	1,513	240,211	2028/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.25	1,230	1,039	164,923	2028/3/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	1,130	953	151,313	2028/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,330	1,361	216,001	2028/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,030	963	152,888	2028/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.45	735	602	95,623	2029/2/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	305	281	44,696	2029/6/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.0	2,025	1,888	299,736	2029/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,750	1,832	290,794	2029/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.85	535	518	82,305	2029/12/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.5	1,620	1,540	244,457	2030/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,075	891	141,448	2030/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.7	170	162	25,775	2030/6/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,087	865	137,283	2030/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,287	1,064	168,905	2030/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.9	1,295	1,000	158,791	2031/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.0	1,515	1,655	262,803	2031/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.6	1,120	831	131,988	2031/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	290	278	44,209	2031/10/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,010	762	120,978	2031/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,550	1,233	195,779	2032/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,200	887	140,826	2032/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	630	527	83,751	2032/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,475	1,583	251,313	2033/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.4	765	742	117,901	2033/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,365	1,116	177,187	2033/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.35	300	288	45,742	2033/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.2	240	226	35,935	2034/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,580	1,588	252,084	2034/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.35	980	841	133,559	2035/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	400	366	58,216	2035/4/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	607	96,371	2036/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.25	965	712	113,102	2036/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,825	1,644	261,039	2037/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	400	243	38,596	2037/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.25	200	161	25,692	2038/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.95	855	663	105,220	2038/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,250	1,225	194,471	2039/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.1	810	625	99,303	2040/3/1

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,070	1,045	165,884	2040/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8	830	513	81,433	2041/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.45	500	449	71,399	2043/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,165	1,090	173,106	2044/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	440	234	37,146	2045/4/30
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	820	608	96,555	2046/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	970	649	103,009	2047/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	1,015	772	122,541	2048/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	850	684	108,646	2049/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	870	530	84,133	2050/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7	850	429	68,102	2051/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	280	154	24,595	2052/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	475	417	66,221	2053/10/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	500	299	47,583	2067/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	300	149	23,726	2072/3/1
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,383	2,337	371,008	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	375	358	56,866	2025/2/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,865	2,731	433,480	2025/3/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,610	2,495	396,088	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	1,820	1,913	303,680	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,070	1,976	313,704	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,440	2,265	359,598	2026/2/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	2,470	2,485	394,473	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,450	2,287	363,008	2026/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	400	392	62,220	2026/9/24
FRANCE (GOVT OF)	0.25	2,820	2,580	409,549	2026/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,005	1,806	286,736	2027/2/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	1,775	1,646	261,293	2027/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	3,250	3,199	507,837	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,275	1,152	182,835	2028/2/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,765	3,382	536,870	2028/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,080	2,734	434,038	2028/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	2,105	2,342	371,783	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	3,060	2,646	419,967	2029/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,580	2,130	338,068	2029/11/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	3,065	2,936	465,960	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	3,049	2,428	385,463	2030/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	3,040	2,683	425,850	2031/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,605	1,998	317,190	2031/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,068	1,555	246,909	2032/5/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	2,085	2,458	390,139	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	2,075	1,848	293,429	2032/11/25
FRANCE (GOVT OF)	3.0	935	900	142,925	2033/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,475	1,980	314,317	2034/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	1,605	1,775	281,741	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,555	1,936	307,355	2036/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	190	136	21,621	2038/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,590	1,630	258,724	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,060	1,575	249,958	2039/6/25

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…フランス) 国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	4.5	2,780	3,006	477,077	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	135	108	17,268	2043/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,160	606	96,302	2044/6/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	1,580	1,425	226,282	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,580	1,099	174,555	2048/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	1,960	1,175	186,520	2050/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,500	685	108,744	2052/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,320	587	93,185	2053/5/25
FRANCE (GOVT OF)	3.0	540	442	70,232	2054/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,300	1,292	205,165	2055/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,070	1,065	169,043	2060/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	945	532	84,584	2066/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	515	159	25,357	2072/5/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,035	983	156,143	2025/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	455	424	67,386	2026/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,100	1,026	162,945	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	828	752	119,349	2027/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	870	801	127,263	2027/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	655	717	113,930	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	961	866	137,565	2028/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	620	530	84,195	2029/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	645	551	87,569	2029/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	365	353	56,062	2030/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	670	547	86,839	2030/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	775	612	97,147	2031/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	700	559	88,824	2032/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	855	809	128,388	2033/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	280	262	41,732	2033/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	1,025	1,091	173,299	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	395	244	38,848	2038/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	848	543	86,314	2040/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	957	996	158,110	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,004	902	143,195	2047/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	907	364	57,911	2052/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	365	271	43,044	2054/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,420	1,406	223,178	2024/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,350	1,290	204,816	2025/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	1,350	1,311	208,152	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,490	1,518	240,956	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	1,455	1,419	225,256	2025/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,455	1,346	213,712	2026/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,055	1,017	161,476	2026/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.8	85	83	13,258	2026/5/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	1,360	1,445	229,326	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,640	1,541	244,569	2026/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	755	675	107,217	2027/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,275	1,194	189,498	2027/4/30

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外債建金額	償還年月日
	%	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	0.8	1,315	1,193	189,427	2027/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,400	1,296	205,694	2027/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,125	972	154,385	2028/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,270	1,161	184,333	2028/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,275	1,176	184,111	2028/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,095	1,160	186,658	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	1,545	1,726	273,927	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,275	1,143	181,482	2029/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	515	441	70,089	2029/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	1,280	1,076	170,849	2029/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,400	1,149	182,499	2030/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,330	1,196	189,877	2030/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	1,330	1,133	179,866	2030/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1	1,325	1,014	161,057	2031/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,175	913	144,907	2031/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7	1,270	986	156,570	2032/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	1,390	1,586	251,775	2032/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.55	1,045	940	149,326	2032/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.15	1,082	1,015	161,106	2033/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,165	1,016	161,355	2033/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.55	600	578	91,788	2033/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,195	946	150,273	2035/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	1,190	1,188	188,627	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.85	670	434	68,944	2037/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.9	340	320	50,935	2039/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,045	1,103	175,184	2040/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	1,000	619	98,386	2040/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,265	1,306	207,417	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	390	221	35,152	2042/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	300	258	41,083	2043/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	830	905	143,641	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,060	818	129,920	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	985	717	113,886	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	1,170	535	84,962	2050/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9	560	320	50,791	2052/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	848	661	104,929	2066/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	345	138	21,991	2071/10/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	0.5	670	650	103,259	2024/10/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	1,135	1,089	172,836	2025/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.5	585	602	95,568	2026/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.0	852	805	127,791	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	830	764	121,273	2027/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	545	481	76,480	2027/10/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	970	1,064	168,945	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.8	900	810	128,642	2028/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.9	1,000	883	140,195	2029/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.1	770	626	99,352	2030/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	915	770	122,274	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	750	573	91,053	2031/10/22

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	外債建金額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	4.0	565	588	93,376	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.35	725	557	88,504	2032/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.25	525	432	68,689	2033/4/22
BELGIUM KINGDOM	3.0	373	356	56,538	2033/6/22
BELGIUM KINGDOM	3.0	543	513	81,510	2034/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.0	974	1,091	173,241	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.45	425	319	50,711	2037/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.9	485	378	60,085	2038/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.75	160	138	22,029	2039/4/22
BELGIUM KINGDOM	0.4	405	231	36,742	2040/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,112	1,153	183,050	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	645	619	98,286	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.6	658	415	65,999	2047/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.7	650	401	63,728	2050/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.4	485	264	41,906	2053/6/22
BELGIUM KINGDOM	3.3	370	316	50,254	2054/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.25	412	278	44,205	2057/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	446	285	45,256	2066/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.65	270	92	14,749	2071/6/22
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	595	584	92,739	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	475	451	71,695	2025/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	710	682	108,321	2025/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	550	569	90,445	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.0	170	164	26,156	2026/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	773	720	114,352	2026/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	685	625	99,251	2027/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	487	539	85,598	2027/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	660	596	94,680	2028/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	255	217	34,521	2028/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	885	767	121,866	2029/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9	150	147	23,445	2029/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	680	553	87,814	2030/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	745	583	92,649	2031/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.9	610	498	79,178	2032/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.9	450	428	68,000	2033/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	455	409	64,988	2034/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	270	175	27,810	2036/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	840	875	139,001	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	345	184	29,274	2040/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	394	359	57,033	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	503	326	51,800	2047/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.85	200	137	21,785	2049/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	455	225	35,748	2051/3/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	106	94	14,924	2053/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	245	246	39,084	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7	200	72	11,498	2071/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	173	85	13,510	2086/11/2
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	383	235	37,423	2117/9/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.85	192	69	11,086	2120/6/30

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	4.0	332	335	53,205	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.875	280	267	42,490	2025/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	335	314	49,851	2026/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	180	164	26,088	2026/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.375	170	159	25,382	2027/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	400	361	57,344	2027/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.75	380	372	59,166	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	270	237	37,638	2028/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.875	105	103	16,353	2029/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	375	320	50,867	2029/9/15
FINNISH GOVERNMENT	—	172	137	21,809	2030/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.75	465	386	61,333	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	200	155	24,674	2031/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.5	230	196	31,184	2032/9/15
FINNISH GOVERNMENT	3.0	110	105	16,750	2033/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.125	325	257	40,870	2034/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	278	180	28,651	2036/4/15
FINNISH GOVERNMENT	2.75	210	186	29,628	2038/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.25	263	149	23,764	2040/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.625	277	236	37,484	2042/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	235	130	20,751	2043/4/15
FINNISH GOVERNMENT	1.375	260	167	26,539	2047/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	250	97	15,481	2052/4/15
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH TREASURY	5.4	580	596	94,623	2025/3/13
IRISH TREASURY	1.0	595	563	89,503	2026/5/15
IRISH TREASURY	0.2	327	295	46,862	2027/5/15
IRISH TREASURY	0.9	455	412	65,537	2028/5/15
IRISH TREASURY	1.1	525	470	74,710	2029/5/15
IRISH TREASURY	2.4	476	453	72,015	2030/5/15
IRISH TREASURY	0.2	282	229	36,424	2030/10/18
IRISH TREASURY	1.35	475	417	66,236	2031/3/18
IRISH TREASURY	—	485	375	59,625	2031/10/18
IRISH TREASURY	0.35	205	158	25,159	2032/10/18
IRISH TREASURY	1.3	285	237	37,691	2033/5/15
IRISH TREASURY	0.4	250	177	28,176	2035/5/15
IRISH TREASURY	1.7	390	308	49,013	2037/5/15
IRISH TREASURY	0.55	185	110	17,607	2041/4/22
IRISH TREASURY	3.0	170	154	24,568	2043/10/18
IRISH TREASURY	2.0	541	399	63,412	2045/2/18
IRISH TREASURY	1.5	499	306	48,704	2050/5/15
ユーロ計				50,370,431	
(イギリス) 国債証券					
UK TREASURY	0.25	1,590	1,502	272,971	2025/1/31
UK TREASURY	5.0	805	806	146,642	2025/3/7
UK TREASURY	0.625	813	762	138,571	2025/6/7
UK TREASURY	3.5	1,200	1,170	212,645	2025/10/22
UK TREASURY	0.125	710	644	117,082	2026/1/30
UK TREASURY	1.5	820	757	137,663	2026/7/22

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
		外貨建金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) 国債証券					
UK TREASURY	0.375	1,260	1,115	202,665	2026/10/22
UK TREASURY	4.125	1,495	1,471	267,446	2027/1/29
UK TREASURY	1.25	840	748	136,017	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	850	842	153,170	2027/12/7
UK TREASURY	0.125	745	621	112,969	2028/1/31
UK TREASURY	4.5	505	503	91,551	2028/6/7
UK TREASURY	1.625	720	632	114,902	2028/10/22
UK TREASURY	6.0	710	760	138,210	2028/12/7
UK TREASURY	0.5	1,055	859	156,266	2029/1/31
UK TREASURY	0.875	856	699	127,071	2029/10/22
UK TREASURY	0.375	920	697	126,724	2030/10/22
UK TREASURY	4.75	945	962	174,928	2030/12/7
UK TREASURY	0.25	1,445	1,047	190,261	2031/7/31
UK TREASURY	1.0	1,645	1,248	226,917	2032/1/31
UK TREASURY	4.25	1,310	1,287	233,922	2032/6/7
UK TREASURY	3.25	1,450	1,303	236,815	2033/1/31
UK TREASURY	0.875	840	594	108,069	2033/7/31
UK TREASURY	4.5	849	835	151,750	2034/9/7
UK TREASURY	0.625	1,097	693	125,947	2035/7/31
UK TREASURY	4.25	970	923	167,795	2036/3/7
UK TREASURY	1.75	1,350	928	168,723	2037/9/7
UK TREASURY	3.75	355	312	56,803	2038/1/29
UK TREASURY	4.75	1,060	1,042	189,377	2038/12/7
UK TREASURY	1.125	300	178	32,394	2039/1/31
UK TREASURY	4.25	850	784	142,641	2039/9/7
UK TREASURY	4.25	935	856	155,686	2040/12/7
UK TREASURY	1.25	1,360	761	138,420	2041/10/22
UK TREASURY	4.5	1,090	1,020	185,438	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	1,175	907	164,970	2044/1/22
UK TREASURY	3.5	1,160	924	167,979	2045/1/22
UK TREASURY	0.875	435	194	35,346	2046/1/31
UK TREASURY	4.25	720	639	116,279	2046/12/7
UK TREASURY	1.5	1,140	583	106,098	2047/7/22
UK TREASURY	1.75	675	359	65,415	2049/1/22
UK TREASURY	4.25	895	789	143,537	2049/12/7
UK TREASURY	0.625	660	234	42,593	2050/10/22
UK TREASURY	1.25	600	263	47,882	2051/7/31
UK TREASURY	3.75	872	702	127,626	2052/7/22
UK TREASURY	1.5	580	266	48,515	2053/7/31
UK TREASURY	3.75	690	552	100,367	2053/10/22
UK TREASURY	1.625	925	436	79,338	2054/10/22
UK TREASURY	4.25	962	846	153,880	2055/12/7
UK TREASURY	1.75	1,075	516	93,826	2057/7/22
UK TREASURY	4.0	751	631	114,815	2060/1/22
UK TREASURY	0.5	1,050	271	49,384	2061/10/22
UK TREASURY	4.0	470	393	71,456	2063/10/22
UK TREASURY	3.5	830	624	113,426	2068/7/22
UK TREASURY	1.625	760	314	57,217	2071/10/22
UK TREASURY	1.125	513	165	29,993	2073/10/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	765	728	132,367	2025/9/7

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	
(イギリス) 国債証券	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
UNITED KINGDOM GILT	2.5	742	429	77,991	2065/7/22
小 計				7,478,778	
(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		
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	4,300	4,234	56,999	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	4,400	4,121	55,474	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,550	3,206	43,153	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,780	3,317	44,653	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.125	2,700	2,183	29,388	2031/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	2.25	1,800	1,697	22,850	2032/6/1
SWEDISH GOVERNMENT	1.75	1,430	1,273	17,135	2033/11/11
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	2,645	2,766	37,230	2039/3/30
小 計				306,887	
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	3,190	3,086	41,332	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	2,400	2,263	30,314	2026/2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,400	2,229	29,850	2027/2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	2,040	1,873	25,090	2028/4/26
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,250	1,989	26,636	2029/9/6
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,950	2,494	33,402	2030/8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.25	2,040	1,662	22,265	2031/9/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.125	2,130	1,837	24,605	2032/5/18
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	1,450	1,327	17,773	2033/8/15
小 計				251,271	
(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		
KINGDOM OF DENMARK	-	1,980	1,910	40,625	2024/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,170	3,080	65,501	2025/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	4,160	3,778	80,330	2027/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	3,130	2,709	57,610	2029/11/15
KINGDOM OF DENMARK	-	1,350	1,061	22,572	2031/11/15
KINGDOM OF DENMARK	2.25	700	646	13,738	2033/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	8,010	9,244	196,537	2039/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,300	584	12,431	2052/11/15
小 計				489,346	
(ポーランド) 国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	2,060	2,003	71,060	2024/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	0.75	1,440	1,350	47,915	2025/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,270	2,197	77,958	2025/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,590	2,411	85,540	2026/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	0.25	1,950	1,686	59,809	2026/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	1,310	1,243	44,093	2027/5/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,140	1,936	68,707	2027/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,160	1,933	68,577	2028/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	7.5	1,320	1,424	50,546	2028/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	555	557	19,793	2029/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,665	2,291	81,289	2029/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.25	2,025	1,524	54,082	2030/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,870	1,369	48,589	2032/4/25

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	
(ポーランド) 国債証券	%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
POLAND GOVERNMENT BOND	6.0	1,070	1,078	38,256	2033/10/25
小 計				816,224	
(オーストラリア) 国債証券		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,391	1,330	125,581	2024/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,060	1,042	98,430	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,050	966	91,183	2025/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	1,000	999	94,371	2026/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5	1,210	1,087	102,642	2026/9/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	1,080	1,097	103,548	2027/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	980	923	87,212	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	700	639	60,407	2028/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	720	667	62,994	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,080	1,019	96,218	2029/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	890	809	76,423	2029/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,220	1,081	102,085	2030/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,010	791	74,733	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	1,283	1,027	97,028	2031/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,485	1,124	106,133	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	1,580	1,201	113,441	2032/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,295	1,015	95,853	2032/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,190	1,172	110,629	2033/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	1,120	967	91,288	2033/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	960	882	83,277	2034/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.5	740	660	62,337	2034/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	530	434	41,019	2035/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	550	489	46,245	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	582	473	44,732	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	790	580	54,787	2041/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	720	514	48,561	2047/3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,020	517	48,823	2051/6/21
小 計				2,219,994	
(ニュージーランド) 国債証券		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	590	566	49,242	2025/4/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.5	215	190	16,572	2026/5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.5	700	683	59,399	2027/4/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	0.25	370	295	25,705	2028/5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.0	680	606	52,737	2029/4/20
NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.5	350	266	23,182	2031/5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.0	190	146	12,718	2032/5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	3.5	430	369	32,131	2033/4/14
NEW ZEALAND GOVERNMENT	4.25	220	198	17,288	2034/5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	380	279	24,279	2037/4/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	1.75	225	128	11,188	2041/5/15
NEW ZEALAND GOVERNMENT	2.75	500	303	26,349	2051/5/15
小 計				350,798	
(シンガポール) 国債証券		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	580	568	62,231	2025/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	0.5	314	295	32,325	2025/11/1

銘柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	千円
(シンガポール) 国債証券				
SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	470	453	2026/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	255	238	2026/11/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	533	534	2027/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	110	108	2027/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	347	337	2028/5/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	60	58	2028/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	415	405	2029/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	490	476	2030/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	300	264	2031/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	170	160	2032/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	335	335	2033/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	451	399	2036/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	220	195	2039/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	352	328	2042/4/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	382	354	2046/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	367	282	2050/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	222	173	2051/10/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	240	238	2072/8/1
小 計			680,052	
(マレーシア) 国債証券				
MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	750	754	2024/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	770	774	2025/3/14
MALAYSIA GOVERNMENT	3.955	1,380	1,392	2025/9/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.906	830	834	2026/7/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.9	1,170	1,178	2026/11/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	1,200	1,205	2027/11/16
MALAYSIA GOVERNMENT	3.519	240	236	2028/4/20
MALAYSIA GOVERNMENT	4.504	200	204	2029/4/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.885	1,320	1,309	2029/8/15
MALAYSIA GOVERNMENT	2.632	985	891	2031/4/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	700	728	2033/11/7
MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	1,100	1,063	2034/7/5
MALAYSIA GOVERNMENT	4.254	960	960	2035/5/31
MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	1,320	1,382	2037/4/7
MALAYSIA GOVERNMENT	4.893	1,080	1,152	2038/6/8
MALAYSIA GOVERNMENT	3.757	1,490	1,373	2040/5/22
MALAYSIA GOVERNMENT	4.696	750	771	2042/10/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	660	692	2043/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	4.736	620	629	2046/3/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.921	510	536	2048/7/6
MALAYSIA GOVERNMENT	4.065	1,460	1,346	2050/6/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.457	580	570	2053/3/31
MALAYSIA GOVERNMENT	4.392	650	659	2026/4/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.502	950	940	2027/5/31
MALAYSIA GOVERNMENT	3.733	1,510	1,499	2028/6/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.498	910	929	2030/4/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.232	1,035	1,041	2031/6/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.844	1,180	1,144	2033/4/15
小 計			822,312	

銘柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千中国人民元	千中国人民元	千円
(中国) 国債証券				
CHINA GOVERNMENT BOND	2.94	32,000	32,244	2024/10/17
CHINA GOVERNMENT BOND	2.26	4,000	3,995	2025/2/24
CHINA GOVERNMENT BOND	1.99	22,000	21,878	2025/4/9
CHINA GOVERNMENT BOND	2.24	14,000	13,976	2025/5/25
CHINA GOVERNMENT BOND	2.18	15,000	14,951	2025/8/25
CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	32,000	32,475	2025/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND	2.46	8,000	8,009	2026/2/15
CHINA GOVERNMENT BOND	3.03	17,000	17,295	2026/3/11
CHINA GOVERNMENT BOND	2.3	3,000	2,992	2026/5/15
CHINA GOVERNMENT BOND	3.25	11,000	11,278	2026/6/6
CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	16,000	16,113	2026/8/12
CHINA GOVERNMENT BOND	3.12	23,000	23,506	2026/12/5
CHINA GOVERNMENT BOND	2.85	24,000	24,307	2027/6/4
CHINA GOVERNMENT BOND	3.28	21,000	21,731	2027/12/3
CHINA GOVERNMENT BOND	2.64	10,000	10,044	2028/1/15
CHINA GOVERNMENT BOND	2.62	11,000	11,036	2028/4/15
CHINA GOVERNMENT BOND	3.01	13,000	13,283	2028/5/13
CHINA GOVERNMENT BOND	2.4	4,000	3,974	2028/7/15
CHINA GOVERNMENT BOND	2.91	22,000	22,354	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8	3,000	3,027	2029/3/24
CHINA GOVERNMENT BOND	3.29	14,000	14,574	2029/5/23
CHINA GOVERNMENT BOND	2.62	24,000	23,970	2029/9/25
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8	5,000	5,036	2030/3/25
CHINA GOVERNMENT BOND	2.68	21,000	20,976	2030/5/21
CHINA GOVERNMENT BOND	2.62	3,000	2,986	2030/6/25
CHINA GOVERNMENT BOND	3.27	11,000	11,501	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	10,000	10,257	2031/5/27
CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	10,000	10,032	2032/2/17
CHINA GOVERNMENT BOND	2.76	9,000	9,037	2032/5/15
CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	9,000	8,980	2032/8/15
CHINA GOVERNMENT BOND	2.6	10,000	9,906	2032/9/1
CHINA GOVERNMENT BOND	2.8	6,000	6,046	2032/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND	2.88	11,000	11,142	2033/2/25
CHINA GOVERNMENT BOND	2.67	12,000	11,959	2033/5/25
CHINA GOVERNMENT BOND	3.81	13,000	14,753	2050/9/14
CHINA GOVERNMENT BOND	3.72	7,000	7,822	2051/4/12
CHINA GOVERNMENT BOND	3.53	10,000	10,858	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	10,000	10,513	2052/4/15
CHINA GOVERNMENT BOND	3.12	8,000	8,110	2052/10/25
CHINA GOVERNMENT BOND	3.19	10,000	10,371	2053/4/15
小 計			10,826,835	
(イスラエル) 国債証券				
ISRAEL FIXED BOND	0.4	800	772	2024/10/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	1,360	1,290	2025/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.75	1,190	1,140	2025/8/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	630	580	2026/2/27
ISRAEL FIXED BOND	6.25	950	1,007	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND	2.0	1,270	1,185	2027/3/31
ISRAEL FIXED BOND	2.25	1,160	1,062	2028/9/28
ISRAEL FIXED BOND	3.75	300	293	2029/2/28

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 貨 建 立 金 額	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,515	1,238	45,771	2030/3/31
ISRAEL FIXED BOND	1.3	530	413	15,272	2032/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,050	702	25,973	2037/5/31
ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,160	1,233	45,590	2042/1/31
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,300	1,050	38,802	2047/3/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 貨 建 立 金 額	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ISRAEL FIXED BOND	2.8	300	192	7,103	2052/11/29
小 計				449,511	
合 計				153,961,084	

(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

(2023年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 153,961,084	% 99.0
コール・ローン等、その他	1,558,813	1.0
投資信託財産総額	155,519,897	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（155,438,909千円）の投資信託財産総額（155,519,897千円）に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=150.28円、1カナダドル=108.83円、1メキシコペソ=8.1868円、1ユーロ=158.70円、1イギリスポンド=181.72円、1スウェーデンクローナ=13.46円、1ノルウェークローネ=13.39円、1デンマーククローネ=21.26円、1ポーランドズロチ=35.4729円、1オーストラリアドル=94.39円、1ニュージーランドドル=86.89円、1シンガポールドル=109.51円、1マレーシアリンギット=31.3798円、1中国人民元=20.5319円、1イスラエルシェケル=36.9505円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	155,585,645,062	
コール・ローン等	241,262,640	
公社債（評価額）	153,961,084,481	
未収入金	65,975,344	
未収利息	1,244,838,700	
前払費用	72,483,897	
(B) 負債	187,234,295	
未払金	65,772,219	
未払解約金	121,462,048	
未払利息	28	
(C) 純資産総額（A－B）	155,398,410,767	
元本	57,315,428,247	
次期繰越損益金	98,082,982,520	
(D) 受益権総口数	57,315,428,247口	
1万口当たり基準価額（C/D）	27,113円	

(注) 当ファンドの期首元本額は57,575,300,165円、期中追加設定元本額は3,716,701,373円、期中一部解約元本額は3,976,573,291円です。

(注) 2023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債券ヘッジなし（DC専用）	18,929,458,764円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	15,280,881,335円
・日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	12,133,636,705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	3,511,904,503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	2,340,604,123円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	891,805,816円
・DCインデックスバランス（株式60）	843,353,485円
・DCインデックスバランス（株式80）	757,207,482円
・DCインデックスバランス（株式40）	595,287,919円
・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	501,546,917円
・DCインデックスバランス（株式20）	426,585,541円
・海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	333,760,847円
・財産3分法（適格機関投資家専用）	316,658,443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）	143,812,763円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	91,903,491円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	86,274,514円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	69,258,250円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	59,299,022円
・Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	1,103,924円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	591,254円
・Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	493,149円

(注) 1口当たり純資産額は2,7113円です。

○損益の状況（2022年10月27日～2023年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,674,136,297	
受取利息	3,674,209,098	
その他収益金	2,289	
支払利息	△ 75,090	
(B) 有価証券売買損益	275,688,672	
売買益	7,385,814,015	
売買損	△ 7,110,125,343	
(C) 保管費用等	△ 27,243,162	
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	3,922,581,807	
(E) 前期繰越損益金	94,698,836,146	
(F) 追加信託差損益金	5,993,907,927	
(G) 解約差損益金	△ 6,532,343,360	
(H) 計（D＋E＋F＋G）	98,082,982,520	
次期繰越損益金（H）	98,082,982,520	

(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

2022年10月27日から2023年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当マザーファンドについて、つみたてNISAの対象商品に係る登録要件に適合させるため、当該マザーファンドにて行なうデリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を明確化するべく、2023年4月11日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。（付表、第12条、第13条、第14条、第19条）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

運用報告書

第24期（決算日 2023年10月26日）
（2022年10月27日～2023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、「TOPIX（東証株価指数）配当込み」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、「TOPIX（東証株価指数）配当込み」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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		TOPIX (東証株価指数) 配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落	騰落率	騰落	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
20期(2019年10月28日)	15,279	5.9	2,510.63	5.9	98.9	1.1	32,975
21期(2020年10月26日)	15,382	0.7	2,525.98	0.6	98.9	1.1	33,867
22期(2021年10月26日)	19,593	27.4	3,215.34	27.3	98.2	1.8	41,752
23期(2022年10月26日)	19,126	△ 2.4	3,137.97	△ 2.4	98.6	1.3	43,751
24期(2023年10月26日)	22,755	19.0	3,731.91	18.9	98.7	1.3	49,957

(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		TOPIX (東証株価指数) 配当込み (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	騰落率	騰落	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2022年10月26日	19,126	—	3,137.97	—	98.6	1.3
10月末	19,239	0.6	3,156.44	0.6	98.6	1.5
11月末	19,805	3.6	3,249.61	3.6	99.0	0.9
12月末	18,901	△ 1.2	3,101.25	△ 1.2	99.2	0.8
2023年1月末	19,737	3.2	3,238.48	3.2	99.7	0.3
2月末	19,925	4.2	3,269.12	4.2	99.6	0.7
3月末	20,265	6.0	3,324.74	6.0	97.9	2.1
4月末	20,812	8.8	3,414.45	8.8	98.6	1.4
5月末	21,566	12.8	3,537.93	12.7	98.5	1.4
6月末	23,197	21.3	3,805.00	21.3	98.5	1.5
7月末	23,543	23.1	3,861.80	23.1	99.5	0.4
8月末	23,644	23.6	3,878.51	23.6	99.5	0.5
9月末	23,769	24.3	3,898.26	24.2	98.7	1.2
(期末)						
2023年10月26日	22,755	19.0	3,731.91	18.9	98.7	1.3

(注) 騰落率は期首比です。

(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。

○運用経過

(2022年10月27日～2023年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め19,126円の基準価額は、期間末に22,755円となり、騰落率は+19.0%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。

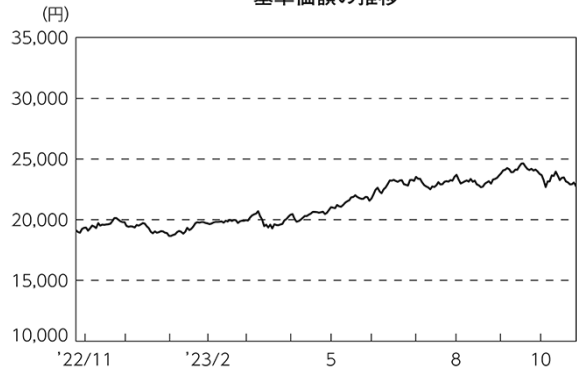
<値上がり要因>

- ・ 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。
- ・ 日銀新総裁が就任会見において金融緩和政策を継続する考えを示したこと。
- ・ 国内企業の概ね堅調な決算内容を受けて投資家心理が改善したことに加え、国内株式市場の相対的な割安感を背景に海外投資家の買いが膨らんだこと。

<値下がり要因>

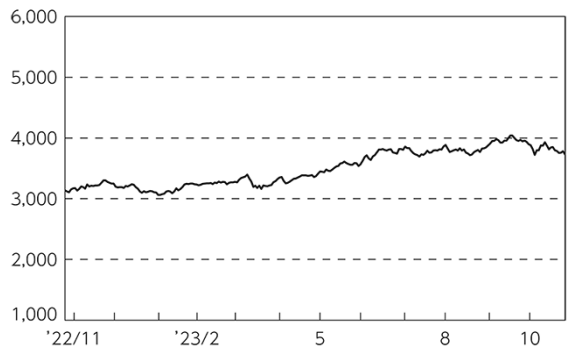
- ・ 欧米の金融機関の経営危機や破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたこと。
- ・ 日銀が金融政策決定会合において長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用の柔軟化を決定したことを背景に国内長期金利が上昇したこと。
- ・ 米国の堅調な経済指標を受けて米国の金融引き締めが懸念されたこと。

基準価額の推移



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2022/10/26	2023/09/19	2023/01/04	2023/10/26
19,126円	24,643円	18,665円	22,755円

TOPIX（東証株価指数）配当込みの推移



（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上昇しました。

期間の初めから2023年9月前半にかけては、欧米の金融機関の経営危機や破綻を契機とした欧米景気の悪化が警戒されたことや、日銀が金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用の柔軟化を決定したことを背景に国内長期金利が上昇したことなどが株価の重しとなりました。しかし、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、米国の金融当局による預金者保護の表明や主要中央銀行による流動性供給など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おいて金融緩和政策を継続する考えを示したこと、国内企業の概ね堅調な決算内容を受けて投資家心理が改善したこと、また、国内株式市場の相対的な割安感を背景に海外投資家の買いが膨らんだことなどが支援材料となり、ＴＯＰＩＸは上昇しました。9月後半から期間末にかけては、米国の堅調な経済指標を受けて米国の金融引き締め長期化が懸念されたことや、中東情勢の緊迫化で投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが影響し、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、「バラ日本株式モデル」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

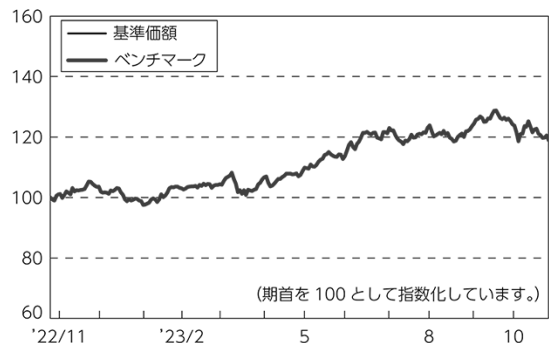
期間中における基準価額は、19.0%の値上がりとなり、ベンチマークである「ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込み」の上昇率18.9%と概ね同水準となりました。

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。

<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「バラ日本株式モデル」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

(2022年10月27日～2023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 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0 (0) (0)	0.001 (0.000) (0.001)	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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	0.001	
期中の平均基準価額は、21,200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10月27日～2023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 1,998 (5,855)	千円 4,235,080 (680)	千株 2,131	千円 5,040,953

(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。

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券 — (1,700)	千円 — (—)	証券 — (1,700)	千円 — (—)	

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は新株予約権の付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 5,137	百万円 5,147	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2022年10月27日～2023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	9,276,034千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	47,043,878千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.19

(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

(2022年10月27日～2023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 1	百万円 8	百万円 152

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10月27日～2023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

(2023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	0.8	0.8	3,000
ニッスイ	22.1	21.9	15,472
マルハニチロ	3.2	3.3	8,187
雪国まいたけ	1.7	1.8	1,593
カネコ種苗	0.7	0.7	975
サカタのタネ	2.6	2.5	9,228
ホクト	1.8	1.9	3,439
ホクリヨウ	0.3	0.2	206
鉱業 (0.4%)			
住石ホールディングス	4.5	2.3	1,161
日鉄鉱業	0.9	0.9	4,009
三井松島ホールディングス	1	1	2,642
INPEX	75.8	80.9	172,923
石油資源開発	2.8	2.5	12,525
K&Oエナジーグループ	0.9	1	2,387
建設業 (2.2%)			
ショーボンドホールディングス	2.8	3	16,812
ミライト・ワン	7.7	7.3	14,070
サンヨーホームズ	0.4	0.3	214
日本アクア	1	0.7	636
ファーストコーポレーション	0.7	0.5	374
ベステラ	0.6	0.4	392
キャンディル	0.5	0.4	220
ダイセキ環境ソリューション	0.5	0.4	396
第一カッター興業	0.6	0.6	716
安藤・間	10.9	12.7	14,465
東急建設	6.5	6.3	4,693
コムシスホールディングス	7.7	7	21,252
ピーアールホールディングス	3.1	3.7	1,328
高松コンストラクショングループ	1.6	1.5	4,173
東建コーポレーション	0.7	0.6	4,602
ソネック	0.3	0.2	192
ヤマウラ	1.1	1.2	1,456
オリエンタル白石	8.3	8.2	2,681
大成建設	15.4	14.3	71,328
大林組	51.3	54.8	69,349

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
清水建設	47.5	43.5	45,109
飛鳥建設	1.6	1.8	2,426
長谷工コーポレーション	14.8	15.8	29,016
松井建設	1.9	1.6	1,198
銭高組	0.2	0.2	751
鹿島建設	37.6	34	81,804
不動テトラ	1.2	1.1	2,141
大末建設	0.6	0.4	567
鉄建建設	1.1	1.1	2,190
西松建設	3.4	2.6	9,061
三井住友建設	12.5	12.6	4,926
大豊建設	0.8	0.7	2,709
ナカノフド一建設	1.5	1	376
奥村組	2.8	2.5	11,162
東鉄工業	2.2	2.1	6,029
イチケン	0.4	0.3	603
富士ビー・エス	0.9	0.7	308
浅沼組	1.3	1.3	4,563
戸田建設	21.2	18.9	15,208
熊谷組	2.8	2.6	9,607
北野建設	0.4	0.2	598
植木組	0.5	0.3	423
矢作建設工業	2.3	2.2	2,681
ビーエス三菱	1.9	2.1	1,656
日本ハウスホールディングス	3	3.5	1,302
新日本建設	2.5	2.2	2,576
東亜道路工業	0.3	0.6	3,198
日本道路	0.5	1.6	3,115
東亜建設工業	1.3	1.3	4,725
日本国土開発	4.4	4.5	2,668
若築建設	0.9	0.7	2,048
東洋建設	6.2	5	6,145
五洋建設	20.4	21.8	18,551
福田組	0.6	0.6	2,841
住友林業	11	13.2	45,922
日本基礎技術	1.5	0.8	352
BAコーポレーション	2.1	1.3	741

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和ハウス工業	43.7	42.3	169,157
ライト工業	3.1	2.9	5,483
積水ハウス	52.4	46.5	133,036
日特建設	1.2	1.6	1,656
北陸電気工事	1.1	1.2	1,167
ユアテック	3.3	3.4	3,182
日本リーテック	1.1	1.4	1,712
四電工	0.6	0.7	2,016
中電工	2.2	2.4	5,755
関電工	9.1	8.4	10,970
きんでん	11.2	10.8	22,663
東京エネシス	1.7	1.6	1,520
トーエネック	0.6	0.5	2,007
住友電設	1.4	1.5	3,957
日本電設工業	2.4	2.6	5,155
エクシオグループ	7.7	7.1	21,243
新日本空調	1.2	0.9	2,043
九電工	3.5	3.7	16,457
三機工業	3.5	3.4	5,712
日揮ホールディングス	15.6	15.2	28,036
中外炬工業	0.5	0.6	1,240
ヤマト	1.4	1	909
太平電業	1	1	3,860
高砂熱学工業	4.3	3.7	10,367
三晃金属工業	0.3	0.1	402
朝日工業社	0.7	0.7	1,652
明星工業	2.9	2.7	2,683
大気社	2.3	1.8	7,803
ダイダン	1.1	2.1	3,028
日比谷総合設備	1.5	1.3	2,906
フィル・カンパニー	0.3	0.4	218
テスホールディングス	1.6	3.4	1,553
インフロニア・ホールディングス	19.3	16.1	24,794
東洋エンジニアリング	2.4	2.2	1,293
レイズネクスト	2.4	2.3	3,247
食料品 (3.5%)			
ニッポン	4.3	4.1	8,880
日清製粉グループ本社	16.6	14.2	25,794
日東富士製粉	0.3	0.3	1,416
昭和産業	1.4	1.3	3,789
鳥越製粉	1.3	0.9	632

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中部飼料	1.8	2.1	2,255
フィード・ワン	2.1	2.2	1,663
東洋精糖	0.3	0.2	377
日本甜菜製糖	0.9	0.9	1,658
DM三井製糖ホールディングス	1.4	1.5	4,450
塩水港精糖	2.2	1.2	289
ウエルネオシュガー	0.8	0.8	1,605
森永製菓	3.6	2.7	14,404
中村屋	0.4	0.4	1,222
江崎グリコ	4.1	4.4	18,510
名糖産業	0.6	0.6	960
井村屋グループ	0.9	0.8	1,838
不二家	1	1.1	2,696
山崎製パン	9.6	10.3	29,741
第一屋製パン	0.3	0.2	97
モロゾフ	0.5	0.5	1,847
亀田製菓	0.9	1	4,020
寿スピリッツ	1.5	8.2	16,031
カルビー	8	7	19,274
森永乳業	2.9	2.8	16,214
六甲バター	1.1	1.1	1,508
ヤクルト本社	11.2	22	77,198
明治ホールディングス	9.7	18.8	69,804
雪印メグミルク	3.9	3.7	8,632
プリマハム	2.2	2.1	4,754
日本ハム	6.2	6	26,130
林兼産業	0.6	0.3	163
丸大食品	1.6	1.6	2,595
S Foods	1.6	1.7	5,270
柿安本店	0.6	0.6	1,468
伊藤ハム米久ホールディングス	11.3	2.3	9,292
サッポロホールディングス	4.7	5.1	25,872
アサヒグループホールディングス	33.3	35.5	188,043
キリンホールディングス	65	64	134,368
宝ホールディングス	9.8	10.5	12,825
オエノンホールディングス	4.3	4.6	1,766
養酒製造	0.5	0.5	925
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	11.3	12	23,256
サントリー食品インターナショナル	10.1	10.8	48,006
ダイドーグループホールディングス	0.9	0.9	5,049
伊藤園	5.4	5.2	24,637

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キーコーヒー	1.6	1.7	3,430
ユニカフェ	0.5	0.3	282
ジャパンフーズ	0.3	0.2	220
日清オイリオグループ	2	2.2	8,811
不二製油グループ本社	3.8	3.6	8,267
J-オイルミルズ	1.7	1.6	2,756
キッコーマン	10.6	10.2	83,140
味の素	35.2	37.1	205,274
ブルドックソース	0.6	0.8	1,624
キュービー	7.7	8.3	21,123
ハウス食品グループ本社	5.5	4.7	14,635
カゴメ	6.7	6.6	20,380
焼津水産化学工業	0.8	0.4	479
アリアケジャパン	1.6	1.4	6,571
ビエトロ	0.2	0.2	360
エバラ食品工業	0.4	0.4	1,165
やまみ	0.2	0.1	226
ニチレイ	6.6	7	22,057
東洋水産	7.9	7.8	50,107
イトーアンドホールディングス	0.7	0.7	1,390
大冷	0.2	0.1	191
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.9	1	974
日清食品ホールディングス	5.7	5.4	67,635
永谷園ホールディングス	0.8	0.8	1,773
一正蒲鉾	0.8	0.4	294
フジッコ	1.7	1.6	3,057
ロック・フィールド	1.8	1.7	2,604
日本たばこ産業	94.7	93.4	322,697
ケンコーマヨネーズ	0.9	1.1	1,652
わらべや日洋ホールディングス	1.1	1.1	3,789
なとり	1	1	1,971
イフジ産業	0.3	0.2	307
ファーマフーズ	2.2	2.2	2,864
ユウグレナ	9.3	9.6	6,940
紀文食品	1.4	1.2	1,357
ピックスホールディングス	0.8	0.9	1,047
ミヨシ油脂	0.6	0.4	497
理研ビタミン	1.3	1.3	2,843
繊維製品 (0.4%)			
片倉工業	1.4	1.4	2,382
グンゼ	1	1.1	4,900

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋紡	6.9	6.8	6,813
ユニチカ	4.7	4.8	912
富士紡ホールディングス	0.7	0.6	2,037
倉敷紡績	1.2	1.2	2,712
シキボウ	0.9	0.6	645
日本毛織	4.2	4.2	5,640
ダイトウボウ	3.1	1.8	156
トーア紡コーポレーション	0.7	0.4	170
ダイドーリミテッド	2.5	1.5	510
帝国繊維	1.6	1.7	3,129
帝人	15.1	15	20,445
東レ	106.9	104.7	74,661
住江織物	0.3	0.2	421
日本フェルト	1	0.6	248
イチカワ	0.2	0.1	155
日東製網	0.2	0.1	140
アツギ	1.2	0.6	249
ダイニック	0.6	0.3	234
セーレン	3.2	3	6,405
ソトー	0.6	0.3	214
東海染工	0.2	0.1	97
小松マテーレ	2.6	2.3	1,633
ワコールホールディングス	3.5	2.8	9,646
ホギメディカル	2.2	2.1	6,825
クラウディアホールディングス	0.4	0.2	81
T S I ホールディングス	5.2	5.2	4,149
マツオカコーポレーション	0.5	0.3	471
ワールド	2.3	2	3,036
三陽商会	0.7	0.4	1,038
ナイガイ	0.7	0.4	110
オンワードホールディングス	9.5	10.2	4,722
ルックホールディングス	0.5	0.3	594
ゴールドウイン	2.9	2.8	26,871
デサント	2.9	2.7	11,191
キング	0.8	0.4	264
ヤマトインターナショナル	1.3	0.8	236
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	0.9	0.7	2,425
王子ホールディングス	66.4	65.1	40,967
日本製紙	7	8.1	10,513
三菱製紙	2.3	1.3	716

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北越コーポレーション	10.3	9.8	10,535
中越パルプ工業	0.7	0.4	515
巴川製紙所	0.5	—	—
大王製紙	7.4	6.9	8,331
阿波製紙	0.4	0.2	90
レンゾー	13.3	14.2	14,036
トーモク	0.8	0.9	2,056
ザ・バック	1.1	1.2	3,912
化学 (5.8%)			
北の達人コーポレーション	6.3	6.5	1,261
クラレ	23.3	22.8	38,668
旭化成	106.7	97.6	88,855
共和レザー	1	0.6	388
巴川製紙所	—	0.3	197
レゾナック・ホールディングス	14.1	15.1	36,240
住友化学	117.6	115.9	45,618
住友精化	0.7	0.7	3,076
日産化学	7.7	7.3	43,800
ラサ工業	0.6	0.6	1,173
クレハ	1.3	1.2	10,452
多木化学	0.6	0.6	1,983
テイカ	1	1	1,665
石原産業	3.1	2.8	3,813
片倉コープアグリ	0.4	0.2	212
日本曹達	1.9	1.7	8,874
東ソー	21.3	20.9	37,745
トクヤマ	5.1	5	10,977
セントラル硝子	2.6	2.5	7,072
東亜合成	7.5	7.8	10,249
大阪ソーダ	1.3	0.9	7,164
関東電化工業	3.2	3	2,247
デンカ	5.8	5.7	15,187
信越化学工業	27.3	129.9	547,528
日本カーバイド工業	0.6	0.4	678
堺化学工業	1.1	1.2	2,398
第一稀元素化学工業	1.5	1.4	1,272
エア・ウォーター	13.8	14.7	26,908
日本酸素ホールディングス	14.2	15.2	55,024
日本化学工業	0.5	0.5	933
東邦アセチレン	0.4	0.2	321
日本パーカライジング	7.3	7.7	8,231

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高圧ガス工業	2.5	2.2	1,639
四国化成ホールディングス	2	2	3,272
戸田工業	0.4	0.4	676
ステラ ケミファ	0.9	0.9	2,776
保土谷化学工業	0.5	0.4	1,182
日本触媒	2.4	2.4	12,988
大日精化工業	1.2	1.1	2,325
カネカ	3.7	3.6	13,266
三菱瓦斯化学	13.4	11.7	22,914
三井化学	13.4	12.9	47,188
J S R	14.8	14.6	57,816
東京応化工業	2.6	2.5	20,695
大阪有機化学工業	1.1	1.3	3,205
三菱ケミカルグループ	107	105.4	88,304
KHネオケム	2.5	2.4	5,287
ダイセル	23.2	21.8	27,598
住友パークライト	2.4	2.3	14,906
積水化学工業	32.9	31.7	63,114
日本ゼオン	12.5	9.4	13,865
アイカ工業	4.1	3.9	12,725
UBE	8.1	8	18,156
積水樹脂	2.4	2.2	5,277
タキロンシーアイ	3.8	3.4	1,941
旭有機材	1	1	3,500
ニチバン	0.9	1	1,790
リケンテクノス	3.5	3.3	2,286
大倉工業	0.7	0.7	1,838
積水化成工業	2.1	2.2	948
群栄化学工業	0.3	0.4	1,252
タイガースポリマー	0.9	0.4	249
ミライアル	0.6	0.3	406
ダイキアクシス	0.6	0.4	289
ダイキョーニシカワ	3.7	3.5	2,593
竹本容器	0.6	0.4	313
森六ホールディングス	0.8	0.8	1,832
恵和	0.5	1.1	1,399
日本化薬	12.1	11.9	14,994
カーリットホールディングス	1.4	1.4	1,297
日本精化	1.1	0.9	2,346
扶桑化学工業	1.4	1.5	5,812
トリケミカル研究所	1.8	2.1	6,384

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ADEKA	6.8	5.4	13,251
日油	5	4.8	28,156
新日本理化	2.5	1.4	287
ハリマ化成グループ	1.1	0.8	634
花王	36.4	35.3	194,397
第一工業製薬	0.6	0.6	988
石原ケミカル	0.8	0.7	1,126
日華化学	0.7	0.4	355
ニイタカ	0.3	0.2	416
三洋化成工業	1	0.9	3,532
有機合成薬品工業	1.2	0.8	228
大日本塗料	2	1.9	1,759
日本ペイントホールディングス	64.7	82.9	81,233
関西ペイント	14.9	12.5	27,706
神東塗料	1.5	0.9	112
中国塗料	3.8	2.5	3,300
日本特殊塗料	1	0.7	835
藤倉化成	2.1	2.1	917
太陽ホールディングス	2.6	2.4	5,601
D I C	5.7	6.1	14,249
サカタインクス	3.3	3.5	4,245
東洋インキSCホールディングス	2.9	3.4	8,306
T&K TOKA	1.4	1.4	1,995
富士フイルムホールディングス	30.9	30	247,320
資生堂	30.6	32.7	161,276
ライオン	17.6	20.5	29,602
高砂香料工業	1	1.1	3,360
マンダム	3.4	3.4	4,712
ミルボン	2.2	2.1	8,389
ファンケル	7.1	6.8	15,510
コーセー	3	3.2	32,864
コタ	1.2	1.4	2,255
ポーラ・オルビスホールディングス	7.5	8	13,456
ノエビアホールディングス	1.3	1.4	7,280
アジュバンホールディングス	0.4	0.3	278
新日本製薬	0.8	0.9	1,317
アクシージア	—	0.8	784
エステー	1.1	1.2	1,796
アグロ カネショウ	0.6	0.6	771
コニシ	2.7	2.6	5,543
長谷川香料	3	3	9,045

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
星光PMC	0.9	0.7	748
小林製薬	4.5	4.6	28,395
荒川化学工業	1.2	1.3	1,294
メック	1.2	1.3	4,355
日本高純度化学	0.4	0.4	1,034
タカラバイオ	4.6	4.2	5,464
J C U	1.8	1.8	5,796
新田ゼラチン	1	0.7	469
OATアグリオ	0.7	0.4	726
デクセリアルズ	4.6	4.3	14,916
アース製薬	1.3	1.4	6,923
北興化学工業	1.5	1.6	1,432
大成ラミック	0.5	0.5	1,474
クミアイ化学工業	5.8	6.2	6,745
日本農薬	3.2	2.8	1,803
アキレス	1.1	1	1,501
有沢製作所	2.4	2.6	2,737
日東電工	10.6	11.4	106,020
レック	2.1	2.2	2,213
三光合成	2	2	1,056
きもと	2.8	1.4	254
藤森工業	1.4	1.2	4,404
前澤化成工業	1	1	1,462
未来工業	0.6	0.6	2,121
ウェーブロックホールディングス	0.7	0.3	183
J S P	1	1.1	2,028
エフビコ	3.2	3	7,896
天馬	1.4	1.3	3,147
信越ポリマー	3.2	2.9	3,651
東リ	4	2.4	775
ニフコ	5.9	5.6	20,552
バルカー	1.4	1.3	4,985
ユニ・チャーム	30.5	32.6	165,901
ショーエイコーポレーション	0.5	0.3	174
医薬品 (5.0%)			
協和キリン	17.7	18.9	44,433
武田薬品工業	138.4	138.5	602,059
アステラス製薬	150.6	147.8	284,367
住友ファーマ	10.9	11.6	5,438
塩野義製薬	20.5	19.7	134,688
わかもと製薬	1.9	1	205

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本新薬	3.8	3.7	20,068
中外製薬	45.9	49	211,925
科研製薬	2.5	2.7	8,958
エーザイ	19.5	19	154,660
ロート製薬	8.4	15.1	53,680
小野薬品工業	34	30.2	78,746
久光製薬	3.7	3.5	16,926
持田製薬	2	1.8	5,859
参天製薬	30.7	28.5	36,622
扶桑薬品工業	0.6	0.5	970
日本ケミファ	0.2	0.1	175
ツムラ	5.1	4.9	12,793
キッセイ薬品工業	2.6	2.3	7,176
生化学工業	3.2	3	2,355
栄研化学	2.7	2.5	3,547
鳥居薬品	0.8	0.8	2,920
JCRファーマ	5	5.3	5,700
東和薬品	2.6	2.4	6,484
富士製薬工業	1	1.1	1,249
ゼリア新薬工業	2.6	2.2	4,318
そーせいグループ	—	5	6,700
第一三共	127.7	136.3	548,607
杏林製薬	3.2	3.4	5,960
大幸薬品	2.8	3.2	1,059
ダイト	1.1	1.2	2,230
大塚ホールディングス	33.6	32.6	161,467
大正製薬ホールディングス	3.3	3.5	20,688
ベプチドリーム	7.1	7.5	9,581
あすか製薬ホールディングス	1.7	1.6	2,691
サワイグループホールディングス	3.4	3.6	16,412
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	15.1	14.1	1,522
ニチレキ	1.9	1.8	3,706
ユシロ化学工業	0.8	0.8	1,148
ビービー・カストロール	0.6	0.4	359
富士石油	3.9	3.3	1,016
MORESCO	0.6	0.3	364
出光興産	17.9	17.3	57,712
ENEOSホールディングス	264.9	265.4	144,589
コスモエネルギーホールディングス	7	6.2	33,616

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴム製品 (0.7%)			
横浜ゴム	8.3	7.9	21,875
TOYO TIRE	8.4	9	20,065
ブリヂストン	46.8	45.8	260,052
住友ゴム工業	14.4	15.3	23,317
藤倉コンポジット	1.4	0.8	893
オカモト	0.8	0.8	4,088
フコク	0.8	0.8	1,155
ニッタ	1.6	1.6	5,360
住友理工	3.4	3.1	3,072
三ツ星ベルト	2.2	2.3	10,005
バンドー化学	2.8	2.3	3,383
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	2.2	1.8	6,579
AGC	14.9	14.6	73,423
日本板硝子	8	7.9	5,142
石塚硝子	0.3	0.2	617
日本山村硝子	0.6	0.4	622
日本電気硝子	6	6.4	17,680
オハラ	0.7	0.7	877
住友大阪セメント	2.6	2.2	7,504
太平洋セメント	10	9.9	24,467
日本ヒューム	1.5	1.4	1,206
日本コンクリート工業	3.2	3	891
三谷セキサン	0.7	0.7	3,031
アジアパイルホールディングス	2.5	2.4	1,620
東海カーボン	12.3	14.4	16,164
日本カーボン	0.9	0.8	3,484
東洋炭素	0.9	1.1	5,417
ノリタケカンパニーリミテド	0.9	0.8	4,584
TOTO	10.6	10.3	37,368
日本碍子	17.3	18.1	31,521
日本特殊陶業	12.3	11.9	37,830
ダントーホールディングス	1.2	0.7	534
MARUWA	0.6	0.6	13,638
品川リフラクトリーズ	0.4	2.1	2,948
黒崎播磨	0.3	0.3	2,757
ヨータイ	1.1	0.8	1,124
東京窯業	1.8	0.9	291
ニッカトール	0.7	0.4	230
フジミインコーポレーテッド	1.3	3.7	10,722

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クニミネ工業	0.6	0.3	297
ユーアンドユーマテリアル	0.3	0.2	213
ニチアス	3.7	3.9	11,388
ニチハ	2.3	2	5,764
鉄鋼 (1.0%)			
日本製鉄	72.7	72.1	229,350
神戸製鋼所	30.4	32.4	56,392
合同製鐵	0.9	0.8	3,300
JFEホールディングス	40.3	44.8	91,996
東京製鐵	5.2	4.6	7,585
共英製鋼	1.8	1.9	3,363
大和工業	2.8	2.7	18,435
東京製鋼	0.7	0.8	2,576
大阪製鐵	1	0.8	1,323
淀川製鋼所	1.9	1.9	6,469
中部鋼板	—	1.4	2,808
丸一鋼管	5.1	4.9	17,836
モリ工業	0.4	0.3	1,267
大同特殊鋼	2.4	2	11,464
日本高周波鋼業	0.8	0.6	369
日本冶金工業	1.2	1.2	4,800
山陽特殊製鋼	1.5	1.6	4,081
愛知製鋼	1	0.9	3,231
日立金属	18.8	—	—
日本金属	0.5	0.3	255
大平洋金属	1.1	1.2	1,406
新日本電工	9.8	8.3	2,332
栗本鐵工所	0.7	0.8	2,245
缸技	0.3	0.2	279
日本鑄鉄管	0.2	0.2	211
三菱製鋼	1.2	1.1	1,511
日亜鋼業	2.2	1.4	418
日本精線	0.3	0.2	963
エンビプロ・ホールディングス	1.2	0.9	566
シンニッタン	2.4	1.5	358
新家工業	0.4	0.3	919
非鉄金属 (0.6%)			
大紀アルミニウム工業所	2.2	2.3	2,711
日本軽金属ホールディングス	4.4	4.3	6,669
三井金属鉱業	4.7	4.7	17,700
東邦亜鉛	0.9	0.9	1,405

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱マテリアル	10.1	10.7	25,054
住友金属鉱山	19.1	18.7	75,978
DOWAホールディングス	4.1	3.6	15,919
古河機械金属	2.7	2.4	4,653
エス・サイエンス	8.4	7	154
大阪チタニウムテクノロジーズ	2	2.4	7,005
東邦チタニウム	3.1	2.9	5,028
UACJ	2.4	2.2	6,388
CKサンエツ	0.3	0.4	1,388
古河電気工業	5	5.3	11,940
住友電気工業	60.8	55.6	88,181
フジクラ	19.4	17.2	18,567
SWCC	1.5	1.8	3,632
タツタ電線	3.1	3.3	2,280
カナレ電気	0.3	0.2	283
平河ヒューテック	1	1	1,450
リョービ	1.6	1.7	4,652
アーレスティ	1.9	1.2	874
AREホールディングス	7	6.5	11,511
金属製品 (0.5%)			
稲葉製作所	0.9	0.8	1,180
宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.9	2,731
トーカロ	4.5	4.3	5,676
アルファC o	0.6	0.4	550
SUMCO	28.7	28.6	52,895
川田テクノロジーズ	0.3	0.4	2,572
RS Technologies	0.5	1.1	2,643
ジェイテックコーポレーション	0.2	0.1	203
信和	1.1	0.6	443
東洋製罐グループホールディングス	8.9	9.6	23,620
ホッカンホールディングス	0.8	0.9	1,391
コロナ	0.8	0.9	812
横河ブリッジホールディングス	2.5	2	4,860
駒井ハルテック	0.3	0.2	412
高田機工	0.2	0.1	314
三和ホールディングス	16.4	14.8	29,163
文化シャッター	5.1	4.6	5,193
三協立山	2.1	1.8	1,378
アルインコ	1.1	1.2	1,132
東洋シャッター	0.4	0.2	132
LIXIL	25.1	23.4	38,340

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本フィルコン	1.1	0.7	332
ノーリツ	2.2	2.7	4,136
長府製作所	1.5	1.6	3,380
リンナイ	3	8.7	23,259
ダイニチ工業	0.9	0.5	354
日東精工	2.2	2.3	1,308
三洋工業	0.2	0.1	208
岡部	2.5	2.9	2,047
ジーテクト	1.9	1.8	3,085
東プレ	2.7	2.8	4,474
高周波熱錬	2.7	2.5	2,482
東京製綱	1.1	1	1,328
サンコール	1.5	0.9	441
モリテック スチール	1.4	0.8	221
バイオラックス	2.3	2.2	4,884
エイチワン	1.5	1.7	1,303
日本発條	14.6	14.2	15,137
中央発條	0.9	1.2	876
アドバネクス	0.2	0.1	95
立川ブラインド工業	0.7	0.8	1,099
三益半導体工業	1.4	1.2	2,894
機械 (5.2%)			
日本ドライケミカル	0.4	0.2	423
日本製鋼所	4.5	4.3	10,569
三浦工業	6.8	6.6	18,777
タクマ	5	4.8	6,768
ツガミ	3.6	3.5	3,825
オークマ	1.7	1.6	10,004
芝浦機械	2	1.6	5,896
アマダ	27.4	25.1	35,867
アイダエンジニアリング	3.8	3.3	2,933
TAKI SAWA	0.5	0.3	777
FUJI	6.9	6.8	15,164
牧野プライス製作所	1.8	1.7	10,285
オーエスジー	7	6.9	11,595
ダイジェット工業	0.2	0.1	89
旭ダイヤモンド工業	4.2	4.4	3,638
DMG森精機	8.9	9.5	23,123
ソディック	4.1	3.9	2,948
ディスコ	2.6	7.6	204,896
日東工器	0.8	0.8	1,497

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日進工具	1.4	1.3	1,389
パンチ工業	1.5	0.9	368
富士ダイス	0.9	0.5	330
豊和工業	0.9	0.6	446
ニデックオーケーケー	0.6	—	—
リケンNPR	—	1.6	2,702
東洋機械金属	1.2	0.7	462
島精機製作所	2.5	2.5	3,897
オプトラン	2.2	2.6	4,472
NCホールディングス	0.5	0.2	336
イワキポンプ	1.1	1	1,773
フリュー	1.5	1.6	2,409
ヤマシンフィルタ	2.6	3.8	1,124
日阪製作所	1.8	1.5	1,396
やまびこ	2.4	2.5	3,455
野村マイクロ・サイエンス	0.5	0.5	3,625
平田機工	0.8	0.8	5,344
PEGASUS	1.8	1.8	1,101
マルマエ	0.7	0.7	969
タツモ	0.8	1	2,872
ナブテスコ	9.2	9.9	26,279
三井海洋開発	1.8	2	3,280
レオン自動車	1.8	1.7	2,167
SMC	5.2	5.1	348,840
ホソカワミクロン	1.1	1	4,070
ユニオンツール	0.6	0.7	2,502
瑞光	—	1.1	1,312
オイレス工業	2.3	2.2	4,129
日精エー・エス・ピー機械	0.7	0.6	2,712
サトーホールディングス	2.3	2.2	4,395
技研製作所	1.5	1.5	2,736
日本エアーテック	0.7	0.8	1,060
カワタ	0.5	0.3	300
日精樹脂工業	1.1	1.2	1,221
オカダアイオン	0.5	0.3	581
ワイエイシイホールディングス	0.7	0.4	923
小松製作所	79.8	73.8	271,436
住友重機械工業	9.4	9.3	32,419
日立建機	7	6.3	25,893
日工	2.1	2.3	1,504
巴工業	0.6	0.6	1,670

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
井関農機	1.4	1.5	1,623
TOWA	1.5	1.6	7,904
丸山製作所	0.3	0.2	413
北川鉄工所	0.7	0.6	835
ローツェ	0.9	0.8	9,112
タカキタ	0.6	0.3	131
クボタ	78.7	82.7	165,854
荏原実業	0.7	0.8	2,092
三菱化工機	0.5	0.5	1,317
月島ホールディングス	2.7	2.1	2,616
帝国電機製作所	1.1	1.1	2,582
新東工業	3.3	3.1	3,152
澁谷工業	1.4	1.5	3,519
アイチ コーポレーション	2.5	2.2	1,993
小森コーポレーション	4	3.6	3,643
鶴見製作所	1.2	1.2	3,750
住友精密工業	0.3	—	—
酒井重工業	0.3	0.2	1,040
荏原製作所	6	6.5	41,912
石井鐵工所	0.2	0.1	290
西島製作所	1.4	1.4	2,532
北越工業	1.5	1.6	2,974
ダイキン工業	19.2	18.8	398,278
オルガノ	2	2.2	10,087
トーヨーカネツ	0.6	0.6	1,941
栗田工業	8.9	8.8	39,318
椿本チエイン	2.3	2.2	8,305
大同工業	0.7	0.4	294
木村化工機	1.3	1.2	829
アネスト岩田	2.7	2.7	2,986
ダイフク	8.3	24.4	60,512
サムコ	0.5	0.4	1,686
加藤製作所	0.8	0.5	589
油研工業	0.3	0.2	449
タダノ	8.5	9	10,048
フジテック	5.4	5.5	17,688
CKD	4.5	4.4	8,404
キトー	1.4	—	—
平和	4.9	5.2	10,894
理想科学工業	1.5	1.3	2,980
SANKYO	3.6	3.1	19,127

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本金銭機械	1.7	1.7	1,628
マースグループホールディングス	1.1	0.9	2,285
フクシマガリレイ	1.1	1.2	5,748
オーイズミ	0.7	0.4	146
ダイコク電機	0.8	0.9	3,847
竹内製作所	2.7	2.9	12,890
アマノ	4.6	4.5	13,990
JUKI	2.3	2.4	1,442
サンデン	2.5	1.6	284
ジャノメ	1.4	1.6	1,105
マックス	2.1	1.9	4,622
グローリー	4.2	3.8	10,482
新晃工業	1.6	1.6	3,400
大和冷機工業	2.2	2.4	3,012
セガサミーホールディングス	15.8	12.7	30,067
日本ピストンリング	0.6	—	—
リケン	0.6	—	—
TPR	1.9	1.8	3,092
ツバキ・ナカシマ	3.6	3.2	2,288
ホシザキ	9.5	9.3	44,677
大豊工業	1.4	1.4	1,134
日本精工	30.1	26.2	21,059
NTN	31.9	31	8,122
ジェイテクト	15	14	17,682
不二越	1.1	1.2	4,392
日本トムソン	4	3.8	2,029
THK	8.5	9.1	24,306
ユーション精機	1.3	1.3	846
前澤給装工業	1.1	1.1	1,401
イーグル工業	1.9	1.8	2,926
前澤工業	1	0.6	534
日本ビラー工業	1.5	1.5	5,482
キッツ	5.4	5.3	5,257
マキタ	19.9	19.6	69,736
三井E&S	6.6	7.7	3,180
日立造船	13.9	12.9	9,920
三菱重工業	25.8	27.6	213,817
IHI	11	9.9	27,883
サノヤスホールディングス	2.1	1.4	182
スター精密	2.8	3	5,382

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電気機器 (16.6%)			
日清紡ホールディングス	12	11.8	12,720
イビデン	8.5	9	64,827
コニカミノルタ	35.6	35.1	15,338
ブラザー工業	20	21	49,518
ミネベアミツミ	28	27.4	62,444
日立製作所	84.7	76.6	666,803
東芝	30.8	30.3	139,410
三菱電機	164.3	162.9	281,491
富士電機	9.8	9.6	57,667
東洋電機製造	0.6	0.3	278
安川電機	17.5	18.7	92,583
シンフォニアテクノロジー	1.8	1.8	2,739
明電舎	2.5	2.4	4,776
オリジン	0.4	0.2	249
山洋電気	0.6	0.7	4,284
デンヨー	1.2	1.2	2,492
PHCホールディングス	2.7	2.2	3,099
ソシオネクスト	—	2.3	33,810
東芝テック	1.9	2.3	7,360
芝浦メカトロニクス	0.3	0.9	5,832
マブチモーター	3.7	3.9	16,723
ニデック	39.1	38.3	215,705
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.7	1.2	510
トレックス・セミコンダクター	0.8	0.7	1,337
東光高岳	1	0.9	1,687
ダブル・スコープ	4.8	4.5	3,933
ダイヘン	1.6	1.4	6,475
ヤーマン	2.9	2.8	2,920
JVCケンウッド	14.3	14.3	9,051
ミマキエンジニアリング	1.6	1.6	1,156
I-PEX	0.8	1.1	1,597
日新電機	4.1	—	—
大崎電気工業	3	3.7	2,282
オムロン	14.7	14.4	88,603
日東工業	2.2	2.1	7,098
I D E C	2.2	2.3	6,127
正興電機製作所	0.7	0.4	416
不二電機工業	0.3	0.2	220
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5.3	5.2	12,347
サクサホールディングス	0.4	0.2	435

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	0.4	1,334
テクノメディカ	0.4	0.4	884
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.5	0.6	482
日本電気	20.9	22.3	162,143
富士通	15.8	15.7	263,132
沖電気工業	6.6	7.1	6,397
岩崎通信機	0.8	0.5	388
電気興業	0.8	0.6	1,453
サンケン電気	1.5	1.5	10,875
ナカヨ	0.3	0.2	241
アイホン	0.8	1	2,914
ルネサスエレクトロニクス	96.2	102.9	216,707
セイコーエプソン	19.6	20.2	44,278
ワコム	13.5	12	6,420
アルバック	3.5	3.7	19,450
アクセル	0.7	0.4	728
E I Z O	1.2	1.2	5,706
日本信号	3.8	3.5	3,178
京三製作所	3.4	3.3	1,574
能美防災	2	2.1	3,633
ホーチキ	1.1	1.2	1,920
星和電機	0.7	0.5	243
エレコム	4	3.8	6,441
パナソニック ホールディングス	187.8	186.1	271,985
シャープ	16.7	18.9	17,569
アンリツ	11.1	11.1	10,879
富士通ゼネラル	4.8	4.5	11,821
ソニーグループ	110.3	110.3	1,350,623
T D K	25.5	25	136,125
帝国通信工業	0.8	0.7	1,262
タムラ製作所	6.3	6.7	3,249
アルプスアルパイン	14.4	14	16,660
池上通信機	0.6	0.3	259
日本電波工業	1.8	1.9	2,219
鈴木	0.9	0.9	977
メイコー	1.9	1.7	5,117
日本トリム	0.3	0.4	1,143
ローランド ディー・ジー	0.8	0.9	2,925
フォスター電機	1.6	1.5	1,327
SMK	0.4	0.4	966
ヨコオ	1.2	1.3	1,631

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	3.6	6,296
ヒロセ電機	2.4	2.5	42,262
日本航空電子工業	3.6	3.2	8,745
TOA	1.9	1.8	1,861
マクセル	3.2	3.2	4,956
古野電気	2.1	2.1	3,572
ユニデンホールディングス	0.2	—	—
スミダコーポレーション	1.3	2.2	2,791
アイコム	0.6	0.6	2,061
リオン	0.6	0.7	1,614
横河電機	16.1	17.2	45,932
新電元工業	0.6	0.6	1,733
アズビル	10.2	10.9	47,524
東亜ディーケーケー	0.9	0.5	429
日本光電工業	6.7	7.2	24,919
チノー	0.5	0.7	1,425
共和電業	1.7	1	374
日本電子材料	0.8	1	1,360
堀場製作所	3.3	3	22,362
アドバンテス	13.1	49.2	196,012
小野測器	0.7	0.4	178
エスベック	1.3	1.3	2,780
キーエンス	16	15.6	816,816
日置電機	0.8	0.7	4,445
シスメックス	12.6	13.5	90,720
日本マイクロニクス	2.4	2.8	6,398
メガチップス	1.6	1.3	5,024
OBARA GROUP	0.7	0.8	2,824
澤藤電機	0.2	0.1	125
原田工業	0.8	0.5	404
コーセル	2	1.9	2,133
イリソ電子工業	1.5	1.4	5,005
オブテックスグループ	2.7	2.9	4,747
千代田インテグレ	0.6	0.6	1,650
レーザーテック	7.2	7.2	177,372
スタンレー電気	11.3	11	26,306
岩崎電気	0.6	—	—
ウシオ電機	8.3	7.9	14,508
岡谷電機産業	1.4	0.8	224
ヘリオス テクノ ホールディング	1.5	1.1	404
エノモト	0.5	0.3	488

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本セラミック	1.5	1.3	3,377
遠藤照明	0.9	0.5	578
古河電池	1.3	1.2	1,062
双信電機	0.8	0.5	167
山一電機	1.1	1.3	2,242
図研	1.2	1.4	4,970
日本電子	3.4	3.9	16,680
カシオ計算機	10.9	11.6	13,618
ファナック	15.5	76.1	277,384
日本シイエムケイ	3.1	3.3	2,135
エンプラス	0.4	0.5	4,750
大真空	2.2	1.9	1,352
ローム	7.3	28.8	71,827
浜松トニクス	11.7	12.5	69,900
三井ハイテック	1.5	1.6	10,240
新光電気工業	5.2	5.5	29,909
京セラ	24.8	24.2	175,304
太陽誘電	7.8	7.6	25,809
村田製作所	48	142	353,580
双葉電子工業	3	3	1,512
北陸電気工業	0.7	0.4	526
ニチコン	4.7	3.2	3,920
日本ケミコン	1.7	1.5	1,893
KOA	2.4	2.4	3,415
市光工業	2.1	2.8	1,447
小糸製作所	17.6	18.7	41,102
ミツバ	2.7	2.9	1,983
SCREENホールディングス	2.8	5.3	37,460
キャノン電子	1.6	1.7	3,172
キャノン	80.2	77.8	282,880
リコー	41.8	39.1	47,486
象印マホービン	4.4	4.3	6,467
MUTOHホールディングス	0.2	0.1	195
東京エレクトロン	11.2	33	638,220
イノテック	1	1	1,542
輸送用機器 (8.8%)			
トヨタ紡織	6.1	6.6	16,559
芦森工業	0.3	0.2	402
ユニプレス	2.9	2.8	2,968
豊田自動織機	12.5	11.4	123,006
モリタホールディングス	2.8	2.7	4,093

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三機工業	2.5	2.4	2,066
デンソー	34.5	128.7	292,470
東海理化電機製作所	4.7	4.4	9,732
川崎重工業	11.9	11.8	39,152
名村造船所	4.5	2.7	2,049
日本車輛製造	0.6	0.6	1,189
三菱ロジスネクスト	2.3	2.5	2,787
近畿車輛	0.3	0.2	361
日産自動車	207.6	221.8	129,597
いすゞ自動車	51	45.4	77,679
トヨタ自動車	802.5	856.5	2,222,189
日野自動車	21.9	20.1	10,657
三菱自動車工業	65.1	60.9	30,693
エフテック	1.2	0.8	552
レシップホールディングス	0.7	0.5	254
GMB	0.3	0.2	317
ファルテック	0.3	0.2	110
武蔵精密工業	4	3.8	5,487
日産車体	2.6	2.8	2,318
新明和工業	4.6	4.9	5,801
極東開発工業	2.8	2.6	4,534
トビー工業	1.3	1.3	2,991
ティラド	0.5	0.4	831
タチエス	2.9	2.5	4,022
NOK	6.7	6.1	11,144
フタバ産業	3.9	4.2	2,872
カヤバ	1.5	1.5	6,652
大同メタル工業	3.4	3.1	1,608
プレス工業	7.9	7	4,480
ミクニ	2.1	1.3	556
太平洋工業	3.4	3.6	4,867
河西工業	2.2	—	—
アイシン	12.9	12	64,164
マツダ	51.8	51.6	77,580
今仙電機製作所	1.2	0.7	412
本田技研工業	128.7	380.4	606,357
スズキ	34.9	28.7	165,857
SUBARU	46.3	49.4	130,193
安永	0.7	0.5	360
ヤマハ発動機	23	22.5	83,520
TBK	1.9	1.1	415

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エクセディ	2.6	2.6	6,370
豊田合成	5	4.5	13,245
愛三工業	2.8	2.6	2,922
盟和産業	0.3	0.2	198
日本プラスト	1.4	0.9	390
ヨロズ	1.4	1.5	1,312
エフ・シー・シー	2.9	2.8	4,984
シマノ	6	6.3	133,213
テイ・エス テック	7.4	7.1	11,888
ジャムコ	1	0.6	868
精密機器 (2.3%)			
テルモ	49.8	48	189,360
クリエートメディック	0.5	0.3	271
日機装	3.7	3.6	3,348
日本エム・ディ・エム	1	0.9	634
島津製作所	21	19	67,070
JMS	1.3	1.5	778
長野計器	1.1	1.1	2,481
プイ・テクノロジー	0.8	0.7	1,292
東京計器	1.1	1.2	1,700
愛知時計電機	0.6	0.6	1,166
インターアクション	0.9	0.8	777
オーバル	1.6	0.9	396
東京精密	2.7	3.4	23,936
マニー	6.4	6.2	12,511
ニコン	24.8	22.5	32,130
トプコン	8.3	8.2	13,759
オリンパス	84.3	96.1	185,617
理研計器	1.2	1	5,920
タムロン	1.1	1	4,120
HOYA	33.6	33.1	476,971
シード	0.8	0.5	375
ノーリツ鋼機	1.4	1.5	4,665
A&Dホロンホールディングス	2	2.3	3,415
朝日インテック	19.3	17.4	41,725
シチズン時計	16.1	14.3	12,455
リズム	0.5	0.3	687
大研医器	1.4	0.8	423
メニコン	5.4	5.3	9,081
シンシア	0.2	0.1	52
松風	0.6	0.7	1,629

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セイコーグループ	2.5	2.4	5,616
ニプロ	12.2	12.9	14,428
その他製品 (2.3%)			
KYORITSU	2.6	1.5	253
中本パックス	0.5	0.3	482
スノーピーク	2.5	2.2	2,175
パラマウントベッドホールディングス	3.4	3.6	8,330
トランザクション	1.1	1	1,921
粧美堂	0.4	0.2	93
ニホンフラッシュ	1.4	1.5	1,281
前田工織	1.6	1.3	3,685
永大産業	1.9	1.1	236
アートネイチャー	1.5	1.6	1,299
バンダイナムコホールディングス	14.6	42.8	130,925
アイフィスジャパン	0.5	0.3	180
SHOEI	1.5	3.5	7,101
フランスベッドホールディングス	2.2	1.8	2,122
パイロットコーポレーション	2.3	2.2	11,017
萩原工業	0.9	1	1,689
フジシールインターナショナル	3.6	3.2	5,267
タカラトミー	7.2	7.1	14,263
広済堂ホールディングス	1.1	0.7	1,960
エステールホールディングス	0.4	0.2	124
タカノ	0.6	0.4	320
プロネクサス	1.3	1.3	1,485
ホクシン	1.2	0.7	82
ウッドワン	0.5	0.3	319
大建工業	0.9	0.9	2,691
TOPPANホールディングス	22.9	19.2	64,147
大日本印刷	19.1	17	65,399
共同印刷	0.4	0.4	1,246
NISSHA	2.8	2.7	4,158
光村印刷	0.1	0.1	127
TAKARA & COMPANY	1	1	2,292
アシックス	13.5	13.3	61,964
ツツミ	0.4	0.3	696
ローランド	1.1	1.1	4,675
小松ウオール工業	0.5	0.6	1,732
ヤマハ	10.2	9.8	38,220
河合楽器製作所	0.4	0.4	1,566
クリナップ	1.6	1.7	1,166

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビジョン	9.3	9.9	16,013
兼松サステック	0.1	—	—
キングジム	1.3	1.4	1,241
リンテック	3.4	3.1	7,647
イトーキ	3	3.2	4,377
任天堂	99.4	98.5	602,426
三菱鉛筆	2.1	2.2	4,010
タカラスタンダード	2.8	2.9	5,127
ココヨ	7	6.7	15,369
ナカバヤシ	1.4	1.7	872
グローブライド	1.3	1.3	2,476
オカムラ	5	4.7	9,714
美津濃	1.5	1.5	6,532
電気・ガス業 (1.4%)			
東京電力ホールディングス	131.6	140.6	89,773
中部電力	49.7	57.5	103,787
関西電力	61.5	60.3	119,363
中国電力	25.3	24.8	23,594
北陸電力	15	14.7	11,289
東北電力	38.4	38.1	36,488
四国電力	14.6	13.3	13,725
九州電力	33.7	36	34,311
北海道電力	15.4	15.1	9,778
沖縄電力	3.8	3.7	4,044
電源開発	13	11.7	26,564
エフオン	1.1	1	473
イーレックス	2.3	2.8	2,030
レノバ	3.4	4.2	4,393
東京瓦斯	30.9	33	111,639
大阪瓦斯	29.6	31.6	79,031
東邦瓦斯	6.9	6.1	15,558
北海道瓦斯	0.9	0.9	2,057
広島ガス	3	3.3	1,273
西部ガスホールディングス	1.7	1.5	2,913
静岡ガス	3.3	3.1	3,112
メタウォーター	1.8	1.8	3,222
陸運業 (2.9%)			
SBSホールディングス	1.3	1.4	3,712
東武鉄道	16	17.1	60,841
相鉄ホールディングス	5.2	5.1	13,497
東急	41	43.7	72,279

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京浜急行電鉄	19.6	17.7	22,142
小田急電鉄	22.1	23.6	49,300
京王電鉄	7.7	8.2	36,260
京成電鉄	10.7	10.1	54,358
富士急行	1.8	1.9	8,075
東日本旅客鉄道	26.9	26.5	204,447
西日本旅客鉄道	18.7	19.9	112,534
東海旅客鉄道	12.4	60.1	200,553
西武ホールディングス	21.2	18.9	27,348
鴻池運輸	2.5	2.7	5,127
西日本鉄道	4.2	4.1	9,788
ハマキョウレックス	1.2	1.2	4,446
サカイ引越センター	0.8	1.5	3,763
近鉄グループホールディングス	15.6	15.6	64,833
阪急阪神ホールディングス	19.5	20.8	95,596
南海電気鉄道	7	7.4	20,971
京阪ホールディングス	6.5	8.6	30,650
神戸電鉄	0.4	0.4	1,072
名古屋鉄道	16.1	17.2	35,664
山陽電気鉄道	1.2	1.2	2,467
アルプス物流	1.2	1.2	1,989
ヤマトホールディングス	22.8	19.9	47,650
山九	4	4	20,132
丸運	1	0.5	121
丸全昭和運輸	1.1	1	3,665
センコーグループホールディングス	7.8	8.2	8,429
トナミホールディングス	0.3	0.3	1,279
ニッコンホールディングス	5	5	15,975
日本石油輸送	0.2	0.1	281
福山通運	2.2	1.2	4,746
セイノーホールディングス	9.1	8.7	18,339
エスライングループ本社	0.5	0.3	263
神奈川中央交通	0.4	0.4	1,210
日立物流	3.2	—	—
AZ-COM丸和ホールディングス	2.9	3.8	7,752
C&Fロジホールディングス	1.4	1.5	2,023
九州旅客鉄道	11.2	11	33,220
SGホールディングス	28	29.9	59,829
NIPPON EXPRESSホールディングス	5.4	5.3	39,924
海運業 (0.7%)			
日本郵船	41.9	41.7	156,917

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
商船三井	25.8	27.5	109,147
川崎汽船	15.5	11.7	59,166
NSユニテッド海運	0.8	0.9	3,757
飯野海運	6.9	5.8	5,956
乾汽船	1.2	2.1	2,465
空運業 (0.5%)			
日本航空	35.8	38.3	103,352
ANAホールディングス	39.7	42.4	122,705
バスコ	0.3	0.2	317
倉庫・運輸関連業 (0.1%)			
トランコム	0.5	0.4	2,872
日新	1.2	1.2	3,016
三菱倉庫	4	3.3	12,701
三井倉庫ホールディングス	1.6	1.5	6,247
住友倉庫	4.9	4.2	9,924
澁澤倉庫	0.8	0.6	1,733
東陽倉庫	2.5	0.2	276
日本トランスシティ	2.9	3.1	1,987
ケイヒン	0.3	0.2	365
中央倉庫	0.9	0.8	857
川西倉庫	0.3	0.2	205
安田倉庫	1.1	1.1	1,181
ファイブホールディングス	0.4	0.2	199
東洋埠頭	0.5	0.3	410
上組	7.9	7.5	22,567
サンリツ	0.4	0.3	215
キムラユニティ	0.9	0.5	607
キューソー流通システム	0.9	0.5	474
東海運	1	0.7	196
エーアイテイ	1	1	1,600
内外トランスライン	0.5	0.6	1,393
日本コンセプト	0.5	0.6	1,015
情報・通信業 (8.0%)			
NECネットエスアイ	5.7	5.2	10,072
クロスキャット	0.9	0.9	887
システナ	24.7	26.4	6,494
デジタルアーツ	0.9	1	4,100
日鉄ソリューションズ	3	2.7	11,097
キューブシステム	0.9	1	1,043
コア	0.7	0.7	1,131
手間いらず	0.3	0.3	590

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ラクーンホールディングス	1.5	1.4	975
ソリトンシステムズ	0.7	0.8	846
ソフトクリエイトホールディングス	0.8	1.3	2,165
T I S	15.1	17.1	52,753
テクミラホールディングス	0.9	0.5	206
グリー	7.9	4.3	2,433
GMOベバボ	0.2	0.2	236
コーエーテクモホールディングス	11	9.8	18,992
三菱総合研究所	0.7	0.8	3,776
ボルテージ	0.5	0.4	106
電算	0.2	0.1	157
AGS	0.7	0.5	335
ファインデックス	1.2	1.3	1,012
ブレインパッド	1.5	—	—
KL a b	2.7	3	804
ポータルトゥウィンホールディングス	2.5	2.8	1,271
ネクソン	37.9	34.9	86,133
アイスタイル	4.5	4.7	1,955
エムアップホールディングス	2	1.9	2,226
エイチーム	1.1	1	588
エニグモ	1.8	2.1	648
テクノスジャパン	1.4	0.9	627
e n i s h	1.3	0.9	148
コロブラ	5.7	6.1	3,519
ブロードリーフ	8.6	7.4	3,848
クロス・マーケティンググループ	0.7	0.7	458
デジタルハーツホールディングス	0.8	1	882
システム情報	1.3	1.3	1,207
メディアドゥ	0.6	0.7	882
じげん	4.9	4.6	2,180
ブイキューブ	1.8	2	686
エンカレッジ・テクノロジー	0.4	0.3	145
サイバーリンクス	0.6	0.4	290
フィックスターズ	1.7	1.8	1,758
CARTA HOLDINGS	0.7	0.8	932
オブティム	1.2	1.3	1,037
セレス	0.6	0.7	636
SHIFT	1.1	1	25,050
ティーガイア	1.5	1.7	2,969
セック	0.3	0.2	688
テクマトリックス	2.9	2.9	4,161

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
プロシップ	0.6	0.7	909
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4.5	4.1	9,343
GMOペイメントゲートウェイ	3.3	3.1	19,080
ザッパラス	0.6	0.3	127
システムリサーチ	0.5	0.5	1,515
インターネットイニシアティブ	9.2	8.5	20,098
さくらインターネット	1.8	1.8	1,816
ヴェンクス	0.5	0.3	353
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.5	0.5	1,234
SRAホールディングス	0.8	0.8	2,600
システムインテグレータ	0.6	0.4	160
朝日ネット	1.6	1.7	1,018
eBASE	2.1	2.2	1,375
アバントグループ	1.9	2	2,380
アドソル日進	0.6	0.7	1,067
ODKソリューションズ	0.4	0.3	167
フリービット	0.9	0.9	900
コムチュア	1.9	2.1	4,315
サイバーコム	0.3	0.2	243
アステリア	1.2	1.3	861
アイル	0.8	0.8	2,876
マークライنز	0.8	0.9	2,448
メディカル・データ・ビジョン	2.2	1.9	1,238
g u m i	2.4	2.4	1,012
ショーケース	0.4	0.3	90
モバイルファクトリー	0.4	0.3	211
テラスカイ	0.6	0.7	1,023
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.8	0.9	1,395
P C Iホールディングス	0.7	0.4	404
アイビーシー	0.3	0.2	101
ネオジャパン	0.5	0.6	568
P R T I M E S	0.4	0.4	620
ラクス	7.9	7.4	13,242
ランドコンピュータ	0.4	0.3	401
ダブルスタンダード	0.5	0.6	846
オープンドア	1	1.1	798
マイネット	0.6	0.4	124
アカツキ	0.8	0.8	1,628
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	114
U b i c o mホールディングス	0.4	0.5	534
カナミックネットワーク	2.1	1.8	815

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ノムラシステムコーポレーション	1.6	1.4	147
チェンジホールディングス	3.6	3.8	5,483
シンクロ・フード	0.9	0.7	363
オークネット	0.8	0.6	1,005
キャピタル・アセット・プランニング	0.3	0.2	149
エイトレッド	0.2	0.2	253
マクロミル	3.4	3.1	2,030
ビーグリー	0.3	0.2	213
オロ	0.4	0.6	1,210
ユーザーローカル	0.5	0.6	913
テモナ	0.3	0.3	74
マネーフォワード	3.5	3.5	11,987
サインポスト	0.6	0.5	229
Sun Asterisk	—	1.1	1,252
プラスアルファ・コンサルティング	—	0.6	1,411
電算システムホールディングス	0.7	0.7	1,845
Appier Group	—	5.3	6,625
ソルクシーズ	1.3	0.9	365
フェイス	0.5	0.3	145
プロトコーポレーション	1.8	2	2,244
ハイマックス	0.5	0.5	673
野村総合研究所	30	31.2	114,472
サイバネットシステム	1.2	1.2	916
CEホールディングス	0.8	0.6	318
日本システム技術	0.6	0.5	1,058
インテージホールディングス	2	1.8	2,971
東邦システムサイエンス	0.5	0.5	608
ソースネクスト	7.5	8	1,408
インフォコム	1.9	2	5,030
シンプレクス・ホールディングス	2.7	2.7	6,966
HEROZ	0.5	0.6	822
ラクスル	2.1	3.8	4,476
メルカリ	6.6	9.5	28,105
I P S	0.5	0.5	1,165
F I G	1.9	1.3	418
システムサポート	0.6	0.6	1,110
イーソル	1	1.2	793
アルテリア・ネットワークス	1.7	—	—
東海ソフト	0.3	0.2	217
ウイングアーク1st	1.3	1.6	4,307
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.4	0.5	598

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サーバーワークス	0.3	0.3	910
東名	0.1	0.1	153
ヴィッツ	0.2	0.1	94
トピラシステムズ	0.4	0.3	263
S a n s a n	5.5	5.1	5,791
L i n k - U	0.3	0.3	213
ギフティ	1.6	1.4	1,786
メドレー	—	2.1	8,851
ベース	0.5	0.5	2,050
J M D C	2.3	2.6	11,081
フォーカスシステムズ	1.1	1.2	1,140
クレスコ	1.2	1.2	1,904
フジ・メディア・ホールディングス	15.3	15	22,350
オービック	5.4	5.2	109,304
ジャストシステム	2.5	2.3	6,099
T D C ソフト	1.4	1.3	1,950
L I N E ヤフー	249.2	222.6	83,853
トレンドマイクロ	8.5	7.4	40,840
I Dホールディングス	1.1	1.1	1,590
日本オラクル	2.8	3	30,660
アルファシステムズ	0.5	0.5	1,342
フューチャー	3.6	3.4	5,494
C A C H o l d i n g s	0.9	0.8	1,382
S Bテクノロジー	0.8	0.7	1,465
トーセ	0.5	0.3	210
オービックビジネスコンサルタント	1.7	3.1	18,941
伊藤忠テクノソリューションズ	7.9	4.2	18,156
アイティフォー	2.1	2.1	2,184
東計電算	0.2	0.2	1,208
エックスネット	0.3	0.2	206
大塚商会	8.3	7.8	45,364
サイボウズ	2	2.2	3,832
電通国際情報サービス	1.8	1.9	9,433
A C C E S S	2	1.9	1,387
デジタルガレージ	2.9	2.8	8,290
EMシステムズ	2.5	2.6	1,827
ウェザーニューズ	0.5	0.5	2,845
C I J	1.3	2.6	1,344
ビジネスエンジニアリング	0.4	0.2	655
日本エンタープライズ	1.9	1.3	152
WOWOW	0.7	1.2	1,302

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スカラ	1.4	1.5	1,119
インテリジェント ウェイブ	0.9	0.6	531
ANYCOLOR	—	0.5	1,605
WOW WORLD GROUP	0.3	—	—
IMAGICA GROUP	1.2	1.4	798
ネットワンシステムズ	6.4	5.8	15,109
システムソフト	5.5	5.9	371
アルゴグラフィックス	1.3	1.4	4,235
マーベラス	2.7	2.5	1,707
エイベックス	3	2.7	3,593
BIPROGY	5.4	5.7	20,377
兼松エレクトロニクス	0.9	—	—
都築電気	0.8	0.8	1,683
TBSホールディングス	8.4	8	19,240
日本テレビホールディングス	14.4	13.8	20,134
朝日放送グループホールディングス	1.4	1.5	985
テレビ朝日ホールディングス	4.1	3.8	6,045
スカパーJ SATホールディングス	14.7	13.8	9,370
テレビ東京ホールディングス	1.1	1.1	3,063
日本BS放送	0.6	0.4	353
ビジョン	1.9	2.4	3,110
スマートバリュー	0.4	0.3	111
USEN-NEXT HOLDINGS	1.3	1.8	5,940
コネクシオ	1.2	—	—
日本通信	14.4	14.8	2,930
クロップス	0.3	0.2	194
日本電信電話	193.6	5,011.8	869,547
KDDI	125.9	120.9	538,730
ソフトバンク	261.7	251.6	423,065
光通信	2	1.8	36,891
エムティーアイ	1.3	1.1	622
GMOインターネットグループ	5.4	5.8	12,452
ファイバークー	0.7	0.7	766
アイトマーケティングコミュニケーション	0.4	0.3	70
KADOKAWA	9.3	8.3	24,040
学研ホールディングス	2.5	2.6	2,134
ゼンリン	2.8	2.7	2,448
昭文社ホールディングス	0.7	0.5	182
インプレスホールディングス	1.6	1.1	193
アイネット	0.8	1	1,645
松竹	1	0.9	8,110

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東宝	10.2	9.8	48,039
東映	0.5	0.4	6,944
NTTデータグループ	46	49.1	86,563
ピー・シー・エー	1	0.9	940
ビジネスブレイン太田昭和	0.6	0.7	1,410
DTS	3.2	3.3	9,982
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8	7.9	39,665
シーイーシー	1.9	2.2	3,344
カブコン	16	15.5	81,886
アイ・エス・ピー	0.7	0.8	1,027
ジャステック	0.9	1	1,510
SCSK	12	12.8	31,225
NSW	0.7	0.6	1,593
アイネス	1.5	1.1	1,741
TKC	2.6	2.5	8,587
富士ソフト	1.7	3.1	16,740
NSD	5.4	5.6	14,588
コナミグループ	6.3	6.7	53,258
福井コンピュータホールディングス	0.8	1.1	2,792
JBCホールディングス	1.2	1.2	3,382
ミロク情報サービス	1.5	1.4	2,123
ソフトバンクグループ	103.6	77.2	466,596
卸売業 (6.9%)			
高千穂交易	0.6	0.4	1,256
オルパヘルスケアホールディングス	0.3	0.2	378
伊藤忠食品	0.4	0.4	2,628
エレマテック	1.4	1.5	2,571
あらた	1.3	1.3	6,994
トーマンデバイス	0.3	0.2	956
東京エレクトロン デバイス	0.5	1.8	7,011
円谷フィールズホールディングス	1.6	2.9	4,686
双日	17.8	16.5	50,919
アルフレッサ ホールディングス	18	16.6	39,167
横浜冷凍	4.3	4.5	5,161
神栄	0.3	0.2	304
ラサ商事	0.8	0.5	845
アルコニックス	2.3	2.2	2,952
神戸物産	12	12.8	46,617
ハイパー	0.4	0.3	96
あい ホールディングス	2.5	2.7	6,115
ディーブイエックス	0.7	0.3	313

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダイワボウホールディングス	7.4	6.8	18,815
マクニカホールディングス	4.2	3.9	27,066
ラクト・ジャパン	0.6	0.6	1,158
グリムス	0.8	0.7	1,378
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.9	2.1	2,064
八洲電機	1.3	1.3	1,591
メディアスホールディングス	1.1	1.1	810
レスターホールディングス	1.7	1.6	3,942
ジオリープグループ	0.4	0.3	354
大光	0.9	0.5	332
OCHIホールディングス	0.4	0.3	412
TOKAIホールディングス	8.5	8.2	7,757
黒谷	0.6	0.4	231
Cominix	0.4	0.3	242
三洋貿易	1.7	1.9	2,437
ビューティガレージ	0.3	0.3	1,315
ウイン・パートナーズ	1.3	1.2	1,298
ミタチ産業	0.5	0.3	296
シップヘルスケアホールディングス	5	5.9	12,982
明治電機工業	0.6	0.6	813
デリカフーズホールディングス	0.8	0.5	304
スターティアホールディングス	0.5	0.2	290
コメダホールディングス	3.8	4.1	10,934
ピーバンドットコム	0.3	0.2	78
アセンテック	0.7	0.6	298
富士興産	0.5	0.3	505
協栄産業	0.2	0.1	233
フルサト・マルカホールディングス	1.5	1.5	4,008
ヤマエグループホールディングス	1	1	3,310
小野建	1.6	1.7	2,777
南陽	0.4	0.2	406
佐島電機	1.1	0.7	1,284
エコートレーディング	0.4	0.2	268
伯東	1	1	4,995
コンドーテック	1.3	1.3	1,445
中山福	1.2	0.7	247
ナガイレーベン	2	2.1	4,250
三菱食品	1.7	1.5	5,895
松田産業	1.2	1.3	3,276
第一興商	3.3	6.4	14,016
メディバルホールディングス	16.1	15.8	39,018

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SPK	0.7	0.7	1,288
萩原電気ホールディングス	0.6	0.7	2,891
アズワン	2.5	2.4	11,335
スズデン	0.6	0.6	1,264
シモジマ	1.1	1.2	1,339
ドウシシャ	1.7	1.7	3,648
小津産業	0.4	0.3	471
高速	1	0.9	1,817
たけびし	0.6	0.7	1,246
リックス	0.4	0.2	625
丸文	1.4	1.5	1,644
ハビネット	1.4	1.4	3,575
橋本総業ホールディングス	0.6	0.7	818
日本ライフライン	5	4.9	5,390
タカショー	1.4	1.5	907
IDOM	5.3	5	4,445
進和	1	1	2,389
エスケイジャパン	0.5	0.3	221
ダイトロン	0.6	0.7	1,990
シークス	2.2	2.4	3,264
田中商事	0.7	0.4	262
オーハシテクニカ	0.9	0.8	1,335
白銅	0.6	0.6	1,264
ダイコー通産	0.2	0.1	111
伊藤忠商事	101.3	100.1	534,834
丸紅	150.3	127.8	279,243
高島	0.3	0.8	712
長瀬産業	8	7.6	17,100
蝶理	1	0.9	2,559
豊田通商	15.5	14.5	114,448
三共生興	2.3	2.3	1,821
兼松	6	6.4	12,505
ツカモトコーポレーション	0.4	0.2	243
三井物産	121.9	115.5	615,384
日本紙パルプ商事	0.8	0.9	4,113
カメイ	1.9	1.8	2,619
東都水産	0.1	0.1	653
OUGホールディングス	0.3	0.2	467
スターゼン	1.2	1.3	3,224
山善	6.3	4.5	5,364
椿本興業	0.3	0.3	1,399

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友商事	102.6	99.9	293,256
内田洋行	0.7	0.7	4,641
三菱商事	113.7	100.6	694,944
第一実業	0.7	1.8	3,420
キャノンマーケティングジャパン	3.6	3.8	13,866
西華産業	0.8	0.7	1,480
佐藤商事	1.2	1.2	1,710
菱洋エレクトロ	1	1.4	4,928
東京産業	1.5	1.5	1,212
ユアサ商事	1.4	1.4	5,593
神鋼商事	0.4	0.4	2,128
トルク	1.2	0.6	163
阪和興業	3	3	13,245
正栄食品工業	1.1	1.1	4,790
カナデン	1.5	1.1	1,611
RYODEN	1.4	1.4	3,227
岩谷産業	3.9	3.8	26,786
ナイス	0.6	0.3	425
ニチモウ	0.2	0.1	384
極東貿易	1	1	1,739
アステナホールディングス	2.8	3.1	1,627
三愛オプリー	3.9	4.4	6,969
稲畑産業	3.5	3.3	9,966
G S I クレオス	0.9	1	1,986
明和産業	1.7	2.2	1,403
クワザワホールディングス	0.8	0.4	209
ワキタ	3.2	3.1	4,578
東邦ホールディングス	4.7	4.1	13,382
サンゲツ	4.3	4.2	11,844
ミツウロコグループホールディングス	2.1	2.2	2,725
シナネンホールディングス	0.6	0.5	2,010
伊藤忠エネクス	3.9	4.1	6,002
サンリオ	4.9	4.7	30,239
サンワテクノス	0.9	0.8	1,627
リョーサン	1.8	1.8	8,532
新光商事	2.4	2.3	2,635
トーホー	0.7	0.7	1,992
三信電気	0.7	0.7	1,533
東陽テクニカ	1.7	1.7	2,145
モスフードサービス	2.3	2.4	7,764
加賀電子	1.4	1.3	7,761

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソーダニッカ	1.5	0.8	777
立花エレクトック	1.2	1.2	3,164
フォーバル	0.7	0.7	763
PALTAC	2.4	2.6	11,824
三谷産業	2.9	3	957
太平洋興発	0.7	0.4	302
西本Wismettacホールディングス	0.4	0.4	2,324
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.2	0.1	209
コア商事ホールディングス	1.2	1	720
KPPグループホールディングス	3.3	3.9	2,425
ヤマタネ	0.8	0.7	1,537
丸紅建材リース	0.2	0.1	251
日鉄物産	1.1	—	—
泉州電業	0.4	0.8	2,548
トラスコ中山	3.3	3.5	7,934
オートバックスセブン	5.5	5.8	8,781
モリト	1.2	1.2	1,534
加藤産業	1.9	2.1	8,484
北恵	0.5	0.3	274
イエローハット	2.7	3	5,349
J Kホールディングス	1.3	1.3	1,206
日伝	1.2	1	2,526
北沢産業	1.2	0.7	181
杉本商事	0.8	0.7	1,477
因幡電機産業	4.3	4.3	13,179
東テック	0.5	0.6	2,871
ミスミグループ本社	21.8	24.9	56,535
アルテック	1.2	0.6	157
タキヒヨー	0.5	0.3	303
蔵王産業	0.4	0.2	480
スズケン	6.2	4.8	21,499
ジェコス	1.3	1	943
グローセル	2	1.4	655
小売業 (4.4%)			
ローソン	3.8	4.1	28,818
サンエー	1.2	1.3	6,077
カワチ薬品	1.4	1.3	3,200
エービーシー・マート	2.7	7.2	16,945
ハードオフコーポレーション	0.8	0.5	719
アスクル	3.7	3.4	6,874
ゲオホールディングス	2.1	1.6	3,564

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アダストリア	1.9	2	6,310
ジーフット	1.1	0.9	247
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.4	0.2	134
くら寿司	1.8	1.9	6,412
キャンドゥ	0.6	0.6	1,473
I Kホールディングス	0.7	0.4	145
バルグループホールディングス	1.5	3.3	6,220
エディオン	8	6.5	9,574
サーラコーポレーション	3.3	3.5	2,523
ワッツ	0.9	0.6	337
ハローズ	0.8	0.8	3,208
フジオフードグループ本社	1.3	1.9	2,633
あみやき亭	0.4	0.4	1,432
ひらまつ	3.8	2.5	612
大黒天物産	0.6	0.5	3,140
ハニーズホールディングス	1.4	1.3	1,966
ファーマライズホールディングス	0.4	0.3	194
アルベン	1.3	1.4	2,703
ハブ	0.6	0.4	288
クオールホールディングス	2.2	2.3	3,880
ジンスホールディングス	0.9	1	4,235
ビックカメラ	10.3	8.8	9,750
DCMホールディングス	10.3	9.6	11,088
ベッパーフードサービス	3.3	3.7	403
Monotaro	21.9	23.4	28,173
東京一番フーズ	0.4	0.3	150
アークランドサービスホールディングス	1.3	—	—
J. フロント リテイリング	19.2	20.5	28,659
ドトール・日レスホールディングス	2.8	3	6,552
マツキヨココカラ&カンパニー	10.2	30	77,490
ブロンコビリー	0.8	1	3,020
ZOZO	11.9	10.9	29,582
トレジャー・ファクトリー	0.5	0.7	781
物語コーポレーション	0.9	2.8	10,850
三越伊勢丹ホールディングス	26	27.8	45,230
Hamee	0.7	0.6	553
マーケットエンタープライズ	0.2	0.1	140
ウエルシアホールディングス	9.2	8.6	21,151
クリエイトSDホールディングス	2.6	2.7	8,599
丸善CHIホールディングス	2.1	1.4	452
ミサワ	0.4	0.2	123

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティーライフ	0.3	0.2	270
チムニー	—	0.4	560
シュッピン	1.4	1.3	1,279
オイシックス・ラ・大地	2.5	2.3	2,688
ネクスステージ	3.5	3.8	8,132
ジョイフル本田	5	4.8	8,352
鳥貴族ホールディングス	0.6	0.6	1,743
ホットランド	1.2	1.3	2,520
すかいらくホールディングス	21.1	22.6	48,477
SFPホールディングス	0.9	0.9	1,997
綿半ホールディングス	1.2	1.3	1,703
ヨシックスホールディングス	0.4	0.2	554
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5.1	5.4	5,707
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.7	0.8	536
BEENOS	0.9	0.7	966
あさひ	1.5	1.4	1,765
日本調剤	1.1	1.1	1,500
コスモス薬品	1.7	1.6	24,016
トーエル	0.8	0.5	364
セブン&アイ・ホールディングス	58.1	56.9	308,056
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11.7	12.4	12,300
ツルハホールディングス	3.8	3.5	37,170
サンマルクホールディングス	1.4	1.4	2,629
フェリシモ	0.4	0.3	278
トリドールホールディングス	4.3	4.1	14,432
TOKYO BASE	1.8	1.8	511
ウイルプラスホールディングス	0.4	0.2	233
JMホールディングス	1.3	1.3	2,575
サツドラホールディングス	0.9	0.5	381
アレンザホールディングス	1.2	1.3	1,287
串カツ田中ホールディングス	0.4	0.5	829
パロックジャパンリミテッド	1.2	1.1	854
クスリのアオキホールディングス	1.6	1.5	14,227
力の源ホールディングス	1	0.6	1,087
FOOD & LIFE COMPANIES	8.9	8.8	21,494
メディカルシステムネットワーク	1.6	1.5	657
一家ホールディングス	0.4	0.3	200
ジャパンクラフトホールディングス	0.6	0.8	168
はるやまホールディングス	0.9	0.5	269
ノジマ	5.7	5.4	7,095
カッパ・クリエイト	2.5	2.6	4,022

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライトオン	1.3	0.9	401
良品計画	20	18	36,117
バリミキホールディングス	2.4	1.4	473
アドヴァングループ	1.5	1.6	1,603
アルビス	0.5	0.6	1,443
コナカ	2	1.3	501
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.2	321
G-7ホールディングス	2	2.1	2,431
イオン北海道	2.3	2.5	2,135
コジマ	3	2.8	1,806
ヒマラヤ	0.6	0.4	369
コーナン商事	2.5	2.2	8,239
エコス	0.6	0.6	1,267
ワタミ	2.1	2	2,296
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	34.7	33.4	94,572
西松屋チェーン	3.4	3.7	6,996
ゼンショーホールディングス	8.5	9	68,013
幸楽苑ホールディングス	1	—	—
ハークスレイ	0.8	0.4	274
サイゼリヤ	2.6	2.4	14,568
VTホールディングス	6.6	6.4	3,206
魚力	0.5	0.5	1,059
フジ・コーポレーション	0.9	0.8	1,323
ユナイテッドアローズ	1.8	1.8	3,403
ハイデイ日高	2.5	2.5	6,587
YU-WA Creation Holdings	1.3	0.8	129
コロワイド	7.1	7.6	17,358
ピーシーデポコーポレーション	2.2	—	—
老番屋	1.2	1.3	6,825
PLANT	0.4	0.3	381
スギホールディングス	3.5	3.3	18,958
薬王堂ホールディングス	0.9	0.9	2,429
スクロール	2.7	2.5	2,642
ヨンドシーホールディングス	1.5	1.5	2,820
木曾路	2.3	2.5	6,375
SRSホールディングス	2.6	2.8	2,895
千趣会	2.9	3.1	1,233
リテールパートナーズ	2.3	2.5	4,275
ケーヨー	3.2	2.7	3,504
上新電機	1.7	1.5	3,540
日本瓦斯	8.3	8.8	19,602

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ロイヤルホールディングス	3	2.9	7,163
東天紅	0.2	0.1	81
いなげや	1.7	1.6	2,553
チヨダ	1.5	1.6	1,320
ライフコーポレーション	1.4	1.5	5,257
リンガーハット	2	2.1	4,773
MrMaxHD	2.2	2.4	1,454
AOKIホールディングス	3.4	3.1	2,969
オークワ	2.5	2.7	2,262
コメリ	2.7	2.6	7,771
青山商事	3.3	3.6	5,310
しまむら	2	1.9	28,110
はせがわ	1	0.6	198
高島屋	11.7	12.5	25,031
松屋	2.9	2.8	2,452
エイチ・ツー・オー リテイリング	7.5	8	12,736
近鉄百貨店	0.5	0.7	1,960
丸井グループ	12.5	12.2	28,450
アクシアル リテイリング	1.2	1.1	4,097
イオン	57.2	56	173,376
イズミ	2.7	2.5	9,510
平和堂	2.6	2.8	6,745
フジ	3.8	2.6	4,765
ヤオコー	2	1.9	14,384
ゼビオホールディングス	2.4	2.3	2,191
ケーズホールディングス	14.8	11.7	16,175
Olympicグループ	0.8	0.5	252
日産東京販売ホールディングス	2.6	1.5	672
シルバライフ	0.4	0.3	308
Genky DrugStores	0.8	0.7	3,689
ナルミヤ・インターナショナル	0.4	0.2	232
ブックオフグループホールディングス	1	0.8	816
ギフトホールディングス	0.3	0.7	1,489
アインホールディングス	2.1	2.3	9,618
元気寿司	0.5	0.5	2,535
ヤマダホールディングス	61.4	67.7	31,338
アークランズ	2.7	5	7,800
ニトリホールディングス	6.9	6.7	107,133
愛眼	1.4	1	167
ケーユーホールディングス	0.9	1	1,079
吉野家ホールディングス	6.1	6.5	21,846

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松屋フーズホールディングス	0.8	0.8	3,352
サガミホールディングス	2.5	2.7	3,550
関西フードマーケット	1.4	1.5	1,993
王将フードサービス	1.2	1.1	7,546
ブレナス	2	—	—
ミニストップ	1.3	1.2	1,789
アークス	3.1	3	8,373
パローホールディングス	3.6	3.2	7,200
ベルク	0.8	0.8	5,584
大庄	0.9	0.6	735
ファーストリテイリング	2.3	7.4	245,236
サンドラッグ	6.5	6.3	25,294
サックスパー ホールディングス	1.7	1.6	1,355
ヤマザワ	0.4	0.2	250
やまや	0.4	0.2	573
ペルーナ	3.8	4	2,472
銀行業 (7.3%)			
いよぎんホールディングス	19.4	18.3	19,086
しずおかフィナンシャルグループ	35.8	34.1	42,147
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12.2	12.9	14,615
楽天銀行	—	5.3	12,905
京都フィナンシャルグループ	—	4.9	42,385
島根銀行	0.6	0.4	205
じもとホールディングス	1.2	0.9	361
めぶきフィナンシャルグループ	71.4	76.2	33,086
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2	2	8,410
九州フィナンシャルグループ	30.4	27	23,997
ゆうちょ銀行	40.9	42.2	56,442
富山第一銀行	3.9	4.9	4,620
コンコルディア・フィナンシャルグループ	85.9	82.4	56,303
西日本フィナンシャルホールディングス	9.2	9.5	16,159
三十三フィナンシャルグループ	1.4	1.4	2,569
第四北越フィナンシャルグループ	2.5	2.4	8,988
ひろぎんホールディングス	22.2	20	18,754
おきなわフィナンシャルグループ	1.5	1.4	3,362
十六フィナンシャルグループ	2	2	7,730
北國フィナンシャルホールディングス	1.4	1.6	8,128
ブロッレアホールディングス	1.8	1.9	3,625
あいちフィナンシャルグループ	2.1	2.2	5,077
SBI新生銀行	11.3	—	—
あおぞら銀行	9.7	9.7	28,270

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,016.3	962.2	1,180,138
りそなホールディングス	183.7	193.1	150,849
三井住友トラスト・ホールディングス	28.8	27.4	152,289
三井住友フィナンシャルグループ	112.7	109.2	777,176
千葉銀行	49	42.8	46,181
群馬銀行	27.9	29.8	20,445
武蔵野銀行	2.2	2	5,422
千葉興業銀行	3.7	2.4	2,181
筑波銀行	6.8	6.7	1,862
七十七銀行	4.6	4.9	15,851
秋田銀行	1	1	2,018
山形銀行	1.6	1.7	1,936
岩手銀行	1.1	1.1	2,972
東邦銀行	12.5	12	3,288
東北銀行	0.8	0.5	556
ふくおかフィナンシャルグループ	12.5	12.3	46,592
スルガ銀行	15.2	13.5	8,424
八十二銀行	32.2	32.4	26,888
山梨中央銀行	1.8	1.6	2,833
大垣共立銀行	3	2.9	5,785
福井銀行	1.4	1.4	2,154
清水銀行	0.6	0.6	967
富山銀行	0.3	0.2	346
滋賀銀行	2.8	2.6	9,594
南都銀行	2.3	2.3	5,924
百五銀行	14.5	14.5	7,786
京都銀行	5.4	—	—
紀陽銀行	5.2	5.5	8,074
ほくほくフィナンシャルグループ	9.8	9.8	15,920
山陰合同銀行	9.7	9.6	9,513
鳥取銀行	0.6	0.3	392
百十四銀行	1.6	1.4	3,778
四国銀行	2.3	2.4	2,445
阿波銀行	2.3	2.2	5,176
大分銀行	0.9	0.9	2,397
宮崎銀行	0.9	1	2,760
佐賀銀行	0.9	0.9	1,748
琉球銀行	3.8	3.5	4,144
セブン銀行	51.5	55	16,093
みずほフィナンシャルグループ	208.2	222.2	555,944
高知銀行	0.6	0.3	302

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山口フィナンシャルグループ	17.3	15	19,642
長野銀行	0.5	—	—
名古屋銀行	1.1	1	5,540
北洋銀行	21.7	23.3	8,621
大光銀行	0.5	0.3	422
愛媛銀行	2.3	2	2,136
トマト銀行	0.6	0.3	342
京葉銀行	7.3	7	4,571
栃木銀行	7.8	7	2,310
北日本銀行	0.5	0.5	1,098
東和銀行	2.9	2.8	1,806
福島銀行	1.9	1.1	277
大東銀行	0.8	0.4	304
トモニホールディングス	12.6	12.5	5,850
フィデアホールディングス	1.6	1.6	2,494
池田泉州ホールディングス	18.5	19.8	6,553
証券・商品先物取引業 (0.8%)			
F P G	5.9	5.2	6,713
ジャパンインベストメントアドバイザー	1.2	1.3	2,051
マーキュリアホールディングス	1	0.5	373
S B Iホールディングス	21.4	22.4	68,947
ジャフコ グループ	6	5.1	7,950
大和証券グループ本社	111.5	109.8	92,188
野村ホールディングス	265.2	277	156,117
岡三証券グループ	12.6	13.5	9,247
丸三証券	5.2	5.1	4,054
東洋証券	5.3	5.1	1,560
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17.3	16.7	8,132
光世証券	0.4	0.2	98
水戸証券	4.2	4.1	1,804
いちよし証券	2.9	2.8	1,948
松井証券	8.6	9.1	6,797
マネックスグループ	14.7	16.5	10,890
極東証券	2	1.9	1,900
岩井コスモホールディングス	1.7	1.8	3,056
アイザワ証券グループ	2.4	2.2	2,448
マネーパートナーズグループ	1.9	1.1	312
スパークス・グループ	1.6	1.7	2,374
保険業 (2.5%)			
かんぽ生命保険	17.5	17.8	49,110
S O M P Oホールディングス	24.7	26.4	168,405

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アニコム ホールディングス	5.3	5.2	2,834
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	35.7	31.3	169,677
第一生命ホールディングス	84.6	75.1	229,580
東京海上ホールディングス	144.9	151.8	506,404
T & Dホールディングス	38.6	41.2	102,897
アドバンスクリエイト	0.8	0.8	758
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	4.1	4	19,128
あんしん保証	0.7	0.4	110
ジェイリース	0.6	0.3	546
イントラスト	0.8	0.4	343
日本モーゲージサービス	1	0.5	259
C a s a	0.6	0.4	326
アルヒ	2.6	1.9	1,552
プレミアグループ	2.7	2.6	3,697
ネットプロテクションズホールディングス	5.3	5.1	1,351
クレディセゾン	10.1	9.7	20,990
芙蓉総合リース	1.5	1.4	16,338
みずほリース	2.2	2.3	10,557
東京センチュリー	2.7	2.9	16,370
日本証券金融	6.8	5.7	8,082
アイフル	29.1	25.5	9,486
リコーリース	1.5	1.5	6,540
イオンフィナンシャルサービス	9.4	8.8	10,736
アコム	34.2	27.5	9,605
ジャックス	1.7	1.6	8,080
オリエントコーポレーション	4.6	4	4,376
オリックス	103.2	100.9	268,091
三菱HCキャピタル	56.1	59.9	57,665
九州リースサービス	0.8	0.5	459
日本取引所グループ	40.4	43.2	125,150
イー・ギャランティ	2.6	2.5	4,275
アサックス	0.9	0.4	262
NECキャピタルソリューション	0.7	0.7	2,177
不動産業 (1.9%)			
大東建託	5.7	5.6	85,344
いちご	19.7	18.2	5,987
日本駐車場開発	17.8	16.8	3,511
スター・マイカ・ホールディングス	0.7	2.1	1,241
S R Eホールディングス	0.5	0.8	1,676
A Dワークスグループ	4.7	3.3	821

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヒューリック	33.6	35.9	47,423
三栄建築設計	0.8	—	—
野村不動産ホールディングス	9	9.6	34,848
三重交通グループホールディングス	3.8	3.4	1,832
サムティ	2.3	2.5	6,040
ディア・ライフ	2.3	2.7	1,962
コーセーアールイー	0.7	0.4	379
地主	1.2	1.2	2,359
プレサンスコーポレーション	2	2.5	3,962
THEグローバル社	1.5	0.8	287
ハウスコム	0.5	0.3	253
JPMC	0.8	1	1,121
サンセイランディック	0.6	0.4	400
エストラスト	0.4	0.4	251
フージャースホールディングス	2.4	2.4	2,479
オープンハウスグループ	5.3	5.7	27,149
東急不動産ホールディングス	47.3	46.3	39,827
飯田グループホールディングス	14.2	13.1	29,638
イーグランド	0.3	0.2	290
ムゲンエステート	1.3	0.9	876
ビーロット	1.3	0.9	702
ファーストブラザーズ	0.5	0.3	325
And Doホールディングス	1	1	956
シーアールイー	0.7	1	1,522
プロバティエージェント	0.3	—	—
ケイアイスター不動産	0.8	0.8	3,376
アグレ都市デザイン	0.4	0.2	293
グッドコムアセット	0.7	1.5	1,384
ジェイ・エス・ビー	0.4	0.4	1,794
ロードスターキャピタル	0.7	1	1,813
テンポイノベーション	0.6	0.4	442
グローバル・リンク・マネジメント	0.5	0.3	532
フェイスネットワーク	0.3	0.4	514
パーク24	11.3	10	17,120
バラカ	0.6	0.6	1,153
ミガロホールディングス	—	0.2	228
三井不動産	67.8	65.6	209,723
三菱地所	98.9	92.8	175,902
平和不動産	2.8	2.5	9,612
東京建物	13.8	13.5	26,507
京阪神ビルディング	2.4	2.7	3,704

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友不動産	31.3	27.8	101,108
テオオーシー	2.8	2.9	1,809
東京楽天地	0.3	0.3	1,239
スタートゥコーポレーション	2.4	2.3	6,345
フジ住宅	2.2	2.3	1,616
空港施設	1.9	2.1	1,188
明和地所	1	0.6	673
ゴールドクレスト	1.4	1.5	3,333
エスリード	0.7	0.8	2,337
日神グループホールディングス	3.1	2.8	1,416
日本エスコン	3.4	3.1	2,697
MIRARTHホールディングス	7.6	8	3,672
AVANTIA	1	0.8	664
イオンモール	8.8	8	13,592
毎日コムネット	0.8	0.5	361
ファースト住建	0.8	0.5	576
カチタス	4.3	4.2	8,295
トーセイ	2.5	2.6	4,466
サンフロンティア不動産	2.5	2.6	3,660
FJネクストホールディングス	1.8	1.7	1,749
インテリックス	0.6	0.5	254
ランドビジネス	1.1	0.9	253
グランディハウス	1.4	1.1	676
日本空港ビルデング	5.6	5.5	33,924
サービス業 (4.6%)			
明豊ファシリティワークス	0.8	0.5	383
日本工営	1.1	—	—
LIFULL	5	5.5	1,193
MIXI	3.8	3.7	8,343
ジェイエイシーリクルートメント	1.4	1.4	3,281
日本M&Aセンターホールディングス	27.6	27.5	17,883
メンバーズ	0.4	0.5	559
中広	0.3	0.1	40
UTグループ	2.4	2.4	4,538
アイティメディア	0.8	0.6	609
E・Jホールディングス	1	0.9	1,388
オープンアップグループ	5.5	4.8	8,534
コシダカホールディングス	4.5	4.8	5,064
アルトナー	0.4	0.3	505
パソナグループ	1.8	2	2,708
CDS	0.4	0.3	507

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リンクアンドモチベーション	4.3	4.6	1,794
エス・エム・エス	5.7	6.1	13,813
サニーサイドアップグループ	0.6	0.3	234
パーソルホールディングス	16.8	176.8	38,365
リニカル	0.9	0.6	338
クックパッド	4.1	4.5	495
エスクリ	0.8	0.5	142
アイ・ケイ・ケイホールディングス	0.8	0.5	345
学情	0.7	0.8	1,311
スタジオアリス	0.8	0.8	1,631
シミックホールディングス	0.8	0.8	1,334
エプロ	0.4	0.3	234
N J S	0.3	0.4	1,096
総合警備保障	6.1	29.8	25,645
カカココム	12.3	11.8	16,667
アイロムグループ	0.6	0.6	1,005
セントケア・ホールディング	1.1	1	819
サイネックス	0.3	0.2	173
ルネサンス	1.1	1.2	1,027
ディップ	3	2.8	8,215
デジタルホールディングス	1.2	0.9	917
新日本科学	2	1.7	2,713
キャリアデザインセンター	0.4	0.2	363
ベネフィット・ワン	6.1	7.4	7,696
エムスリー	29.7	31.7	72,244
ツカダ・グローバルホールディング	1	0.7	271
プラス	0.2	0.1	60
アウトソーシング	8.9	10.3	11,072
ウェルネット	1.4	0.8	432
ワールドホールディングス	0.7	0.7	1,577
ディー・エヌ・エー	6.4	6.4	9,315
博報堂DYホールディングス	21.3	20.4	24,133
ぐるなび	2.4	3	780
タカミヤ	2	2.2	1,029
ジャパンベストレスキューシステム	0.9	0.8	474
ファンココミュニケーションズ	2.9	2.3	917
ライク	0.5	0.6	804
A o b a - B B T	0.7	0.4	153
エスプール	4.3	4.6	1,550
WDBホールディングス	0.8	0.8	1,660
ティア	1	0.6	271

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
CDG	0.2	0.1	118
アドウエイズ	2.1	2.2	1,155
バリュエコマース	1.1	1.4	1,647
インフォマート	15.7	16.7	5,911
J Pホールディングス	4.3	4.6	1,564
エコナックホールディングス	3.1	1	135
C Lホールディングス	0.4	0.4	320
プレステージ・インターナショナル	6.3	6.8	4,080
アミューズ	0.9	0.9	1,317
ドリームインキュベータ	0.5	0.5	1,462
クイック	1	1.2	2,395
T A C	0.9	0.5	99
電通グループ	15.8	15.8	67,118
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.8	0.4	359
びあ	0.5	0.5	1,697
イオンファンタジー	0.6	0.7	1,801
シーティーエス	1.9	1.8	1,177
ネクシィーズグループ	0.5	0.3	250
H. U. グループホールディングス	4.4	4.7	11,547
アルプス技研	1.3	1.5	3,738
ダイオーズ	0.3	—	—
日本空調サービス	1.7	1.7	1,286
オリエンタルランド	17.9	84.9	395,634
ダスキン	3.6	3.6	11,707
明光ネットワークジャパン	1.9	2	1,416
ファルコホールディングス	0.7	0.7	1,367
秀英予備校	0.4	0.2	80
ラウンドワン	14.1	13.4	7,088
リゾートトラスト	7.1	6.3	13,280
ビー・エム・エル	2.2	2	5,628
りらいあコミュニケーションズ	2.5	—	—
リソー教育	7.7	7.2	1,828
早稲田アカデミー	0.9	0.9	1,242
ユー・エス・エス	18.8	16.5	41,522
東京個別指導学院	1.5	2	996
サイバーエージェント	35.9	35.4	27,211
楽天グループ	69.4	137.3	76,270
クリーク・アンド・リバー社	0.9	0.9	1,620
S B I グローバルアセットマネジメント	2.9	2.6	1,352
テー・オー・ダブリュ	3.1	3.2	988
山田コンサルティンググループ	0.8	0.8	1,215

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セントラルスポーツ	0.6	0.6	1,418
フルキャストホールディングス	1.4	1.6	2,716
エン・ジャパン	3	2.9	6,043
リソルホールディングス	0.2	0.1	494
テクノプロ・ホールディングス	10.1	9.5	27,160
アトラグループ	0.4	0.3	61
インターワークス	0.5	—	—
アイ・アールジャパンホールディングス	0.8	0.8	1,070
Keeper 技研	1.1	1	5,560
ファーストロジック	0.3	0.2	96
三機サービス	0.3	0.2	224
Gunosy	0.9	1.3	893
デザインワン・ジャパン	0.5	0.2	31
イー・ガーディアン	0.6	0.6	992
リブセンス	0.8	0.5	140
ジャパンマテリアル	5.2	4.9	10,667
ベクトル	2.4	2.5	2,690
ウチヤマホールディングス	0.9	0.4	136
チャーム・ケア・コーポレーション	1.2	1.3	1,380
キャリアリンク	0.6	0.6	1,427
IBJ	0.9	1.2	750
アサンテ	0.7	0.8	1,263
バリューHR	1.3	1.4	1,696
M&Aキャピタルパートナーズ	1.4	1.3	3,169
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.7	0.6	609
ERIホールディングス	0.5	0.3	485
アピスト	0.3	0.2	612
シグマクシス・ホールディングス	2	2.4	3,326
ウィルグループ	1.2	1.3	1,388
エスクロー・エージェント・ジャパン	1.9	1.1	151
メドピア	1.2	1.4	1,209
レアジョブ	0.3	0.2	183
リクルートホールディングス	120.5	118.7	500,914
エラン	2	2.1	1,530
土木管理総合試験所	0.7	0.5	162
ネットマーケティング	0.8	—	—
日本郵政	183.8	193	250,031
ベルシステム24ホールディングス	2.4	2.2	3,264
鎌倉新書	1.9	1.8	1,035
SMN	0.4	0.2	73
一歳	0.2	0.1	57

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
グローバルキッズCOMPANY	0.3	0.2	125
エアトリ	1	1.2	2,126
アトラエ	1.2	1	976
ストライク	0.7	0.7	2,156
ソラスト	4.1	4.5	2,488
セラク	0.6	0.5	577
インソース	1.9	3.4	2,856
ペイカレント・コンサルティング	1.2	12.7	49,022
Orchestra Holdings	0.3	0.3	272
アイモバイル	0.8	0.7	945
キャリアインデックス	0.6	0.3	76
MS-Japan	0.7	0.3	332
船場	0.3	0.2	180
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5.3	5.7	11,126
フルテック	0.3	0.2	231
グリーンズ	0.6	0.4	587
ツナググループ・ホールディングス	0.5	0.3	213
GameWith	0.5	0.3	86
MS&Consulting	0.2	0.1	64
ウエルビー	1.1	1.1	676
エル・ティー・エス	0.2	0.2	613
ミダックホールディングス	0.8	1	1,636
日総工産	1.3	—	—
キュービーネットホールディングス	0.8	0.8	1,293
RPAホールディングス	2.4	2.2	635
スプリックス	0.6	0.3	237
マネジメントソリューションズ	0.8	0.7	1,651
プロレド・パートナーズ	0.4	0.4	162
and factory	0.5	0.3	108
テノ・ホールディングス	0.2	0.1	50
フロンティア・マネジメント	0.5	0.4	612
ピアラ	0.3	0.2	77
コプロ・ホールディングス	0.3	0.4	436
ギークス	0.3	0.1	62
アンビスホールディングス	—	1.7	4,080
カーブスホールディングス	4.6	4.4	2,736
フォーラムエンジニアリング	1	0.9	1,155
Fast Fitness Japan	0.3	0.6	698
ダイレクトマーケティングミックス	1.7	1.7	617
ポピンズ	0.2	0.2	237
LITALICO	1.4	1.3	2,398

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アドバンテッジリスクマネジメント	0.8	0.5	204
リログループ	9.2	8.9	12,962
東祥	1.3	1.1	1,064
ID&Eホールディングス	—	1	3,305
ビーウィズ	0.5	0.4	744
TREホールディングス	3.1	3.4	3,838
人・夢・技術グループ	0.7	0.6	962
NISSOホールディングス	—	1.2	873
大栄環境	—	4.1	8,552
日本管財ホールディングス	—	1.7	4,222
M&A総研ホールディングス	—	0.8	2,214
エイチ・アイ・エス	3.9	4.7	7,764
ラックランド	0.5	0.7	1,985
共立メンテナンス	3	2.7	15,217
イチネンホールディングス	1.7	1.7	2,276
建設技術研究所	0.8	0.8	3,504
スペース	1.1	1.1	977
燦ホールディングス	0.7	1.4	1,422
スバル興業	0.1	0.1	1,246
東京テアトル	0.6	0.4	423
タナベコンサルティンググループ	0.6	0.4	428
ナガワ	0.5	0.4	2,548
東京都競馬	1.3	1.3	4,946
常磐興産	0.6	0.4	502
カナモト	2.7	2.5	5,970
ニシオホールディングス	1.4	1.5	4,830

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
トランス・コスモス	2.1	2	6,110	
乃村工藝社	7.2	7	5,838	
藤田観光	0.7	0.6	2,415	
KNT-CTホールディングス	1	1	1,239	
日本管財	1.8	—	—	
トーカイ	1.3	1.4	2,602	
白洋舎	0.2	0.2	490	
セコム	16.6	16.3	165,119	
セントラル警備保障	0.8	0.9	2,292	
丹青社	3.2	3.1	2,529	
メイテックグループホールディングス	6	6.2	15,645	
応用地質	1.5	1.5	3,322	
船井総研ホールディングス	3.2	3.3	7,969	
進学会ホールディングス	0.6	0.3	84	
オオバ	1	0.7	620	
いであ	0.4	0.3	483	
学究社	0.5	0.6	1,198	
ベネッセホールディングス	5.6	6	10,512	
イオンディライト	1.9	1.8	5,868	
ナック	0.8	0.7	663	
ダイセキ	3.1	3.3	13,150	
ステップ	0.6	0.6	1,032	
計	株数・金額	18,053	23,776	49,297,077
	銘柄数<比率>	2,115	2,102	<98.7%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX先物	
		百万円	百万円
		667	—

○投資信託財産の構成

(2023年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	49,297,077	98.6
コール・ローン等、その他	697,572	1.4
投資信託財産総額	49,994,649	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10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	50,663,705,174	
コール・ローン等	199,216,513	
株式(評価額)	49,297,077,010	
未収配当金	475,719,551	
差入委託証拠金	691,692,100	
(B) 負債	706,230,040	
未払金	31,293,600	
未払解約金	5,851,369	
未払利息	71	
差入委託証拠金代用有価証券	669,085,000	
(C) 純資産総額(A-B)	49,957,475,134	
元本	21,954,159,010	
次期繰越損益金	28,003,316,124	
(D) 受益権総口数	21,954,159,010口	
1万口当たり基準価額(C/D)	22,755円	

(注) 当ファンドの期首元本額は22,875,362,128円、期中追加設定元本額は1,794,794,202円、期中一部解約元本額は2,715,997,320円です。

(注) 2023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)	5,228,953,333円
・DCインデックスバランス(株式60)	4,402,676,540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	2,707,551,045円
・DCインデックスバランス(株式40)	2,067,436,177円
・インデックスファンド日本株式(DC専用)	1,811,645,166円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,753,076,468円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	969,098,203円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	961,323,653円
・DCインデックスバランス(株式20)	745,167,154円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	604,003,733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)	493,098,615円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	208,302,656円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	922,892円
・Niつみインデックススラップ世界10指数(均等型)	580,795円
・Niつみインデックススラップ世界10指数(安定成長型)	322,580円

(注) 1口当たり純資産額は2,2755円です。

(注) 2023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	702,225千円
-----	-----------

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 (2022年10月27日～2023年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	1,212,872,141	
受取配当金	1,212,110,958	
その他収益金	852,418	
支払利息	△ 91,235	
(B) 有価証券売買損益	6,946,048,662	
売買益	8,582,455,277	
売買損	△ 1,636,406,615	
(C) 先物取引等取引損益	100,923,500	
取引益	158,010,400	
取引損	△ 57,086,900	
(D) 保管費用等	△ 151	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	8,259,844,152	
(F) 前期繰越損益金	20,875,798,115	
(G) 追加信託差損益金	2,020,354,695	
(H) 解約差損益金	△ 3,152,680,838	
(I) 計(E+F+G+H)	28,003,316,124	
次期繰越損益金(I)	28,003,316,124	

(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

2022年10月27日から2023年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当マザーファンドについて、つみたてNISAの対象商品に係る登録要件に適合させるため、当該マザーファンドにて行なうデリバティブ取引の利用目的を明確化するべく、2023年2月8日付けにて信託約款の一部に所要の変更を行ないました。(付表、第15条、第16条、第17条)
- 当ファンドについて、2023年6月20日付けにて運用目標とするベンチマークを「東証株価指数」から「TOPIX（東証株価指数）配当込み」に変更いたしました。
当ファンドに関して、実際の運用においては保有資産から配当を受け取るため、当ファンドの基準価額は「配当込み」の値動きとなる一方で、運用目標とするベンチマークを構成する指数については、一般に広く認知されている指数が配当を含まないものであったことなどを理由として、「配当抜き」の値動きとなる指数を採用して参りました。こうしたことが要因の一つとなって、当ファンドの基準価額とベンチマークの値動きに乖離が生じておりました。このたび、当該乖離を是正することが受益者にとってより適切な投資判断につながるとの考えから、運用実態に則して当ファンドのベンチマークを「配当込み」の指数へ変更いたしました。(付表)

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24期（決算日 2023年10月26日）
（2022年10月27日～2023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（税引後配当込み、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（税引後配当込み、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。

【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 (税引後配当込み、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	率	(ベンチマーク) 騰落	率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
20期(2019年10月28日)	26,268	9.9	250.26	9.6	95.7	2.0	2.8	185,690
21期(2020年10月26日)	28,388	8.1	269.16	7.6	96.4	1.3	2.3	231,675
22期(2021年10月26日)	41,177	45.1	389.33	44.6	96.5	1.3	2.3	254,055
23期(2022年10月26日)	44,171	7.3	415.95	6.8	96.2	1.9	2.2	258,049
24期(2023年10月26日)	49,637	12.4	466.22	12.1	97.1	1.0	1.9	300,888

(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2023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 (税引後配当込み、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) 2022年10月26日	円	%		%	%	%	%
10月末	44,171	—	415.95	—	96.2	1.9	2.2
11月末	44,648	1.1	420.20	1.0	95.9	2.0	2.2
12月末	43,324	△ 1.9	407.98	△ 1.9	96.0	1.7	2.3
2023年1月末	40,668	△ 7.9	382.74	△ 8.0	95.5	2.3	2.2
2月末	42,201	△ 4.5	397.39	△ 4.5	95.8	2.0	2.3
3月末	43,694	△ 1.1	410.88	△ 1.2	96.3	1.7	2.2
4月末	43,473	△ 1.6	408.73	△ 1.7	95.9	2.0	2.1
5月末	44,667	1.1	419.66	0.9	96.6	1.3	2.1
6月末	46,762	5.9	439.36	5.6	95.8	1.6	2.0
7月末	50,451	14.2	474.05	14.0	96.6	1.3	2.0
8月末	51,222	16.0	481.24	15.7	96.6	1.5	2.0
9月末	52,120	18.0	489.41	17.7	96.3	1.6	2.0
(期末) 2023年10月26日	50,871	15.2	477.47	14.8	96.3	1.9	1.9
	49,637	12.4	466.22	12.1	97.1	1.0	1.9

(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

(2022年10月27日～2023年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め44,171円の基準価額は、期間末に49,637円となり、騰落率は+12.4%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。

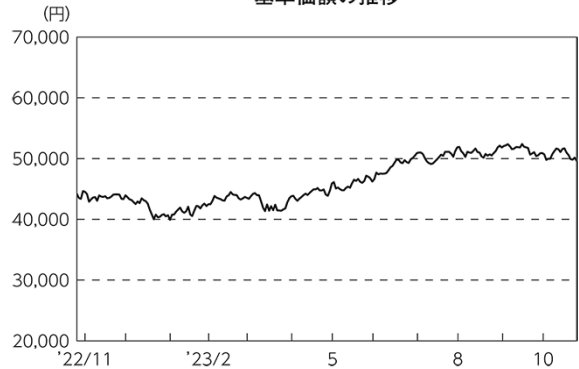
<値上がり要因>

- ・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。
- ・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。
- ・公表された米国の2023年4～6月期の企業業績が概ね良好な内容となったこと。
- ・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>

- ・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。
- ・米国の金融引き締めが長期化するとの見方が改めて広がり、欧米の長期金利が上昇したこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2022/10/26	2023/09/15	2023/01/04	2023/10/26
44,171円	52,389円	39,934円	49,637円

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）（指数化）の推移



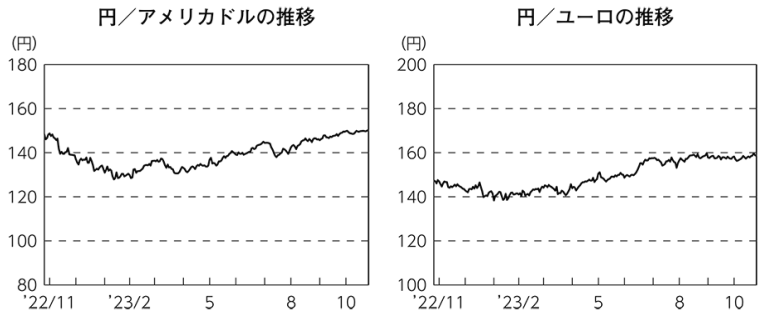
（海外株式市況）

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概して上昇しました。

期間の初めから、2023年7月下旬にかけては、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、ユーロ圏の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、公表された米国の2023年4－6月期の企業業績が概ね良好な内容となったことなどを背景に、欧米各国の株価は総じて上昇しました。8月上旬から期間末にかけては、米国連邦公開市場委員会（FOMC）の結果を受けて、米国の金融引き締めが長期化するとの見方が改めて広がり、欧米の長期金利が上昇したことや、イスラエルとイスラム組織ハマスの戦闘激化による地政学的リスクの高まりなどが重しとなり、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、12.4%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（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率12.1%を概ね0.3%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>

- ・現物株式の組入れに基づく要因が寄与したこと。

<マイナス要因>

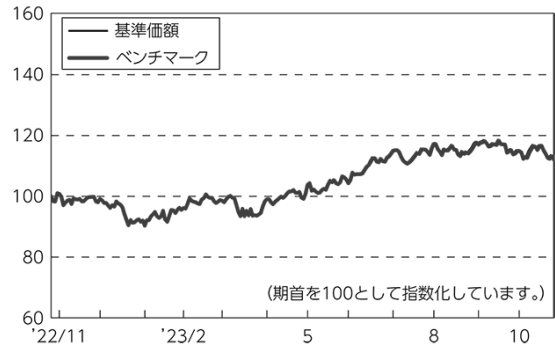
- ・株式先物の組入れに基づく要因が影響したこと。
- ・海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

○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

(2022年10月27日～2023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 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	1 (1) (0) (0)	0.003 (0.002) (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.004 (0.004) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、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)	9 (9) (0)	0.020 (0.020) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 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	12	0.027	
期中の平均基準価額は、46,175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10月27日～2023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 18,006 (1,159)	千アメリカドル 166,737 (1,302)	百株 8,701 (762)	千アメリカドル 74,600 (6,451)
	カナダ	1,382 (256)	千カナダドル 8,728 (616)	543 (187)	千カナダドル 1,928 (1,297)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	853 (-)	4,773 (△ 135)	232	1,396
	イタリア	1,059 (-)	506 (△ 0.624)	629	882
	フランス	1,067 (-)	6,833 (△ 25)	955	4,136
	オランダ	902 (533)	3,888 (404)	614	1,496
	スペイン	969 (4,955)	1,101 (△ 310)	5,576 (110)	995 (124)
	ベルギー	10	78	56	55
	オーストリア	15	38	-	-
	ルクセンブルク	36	67	359	35
	フィンランド	477 (196)	727 (81)	211 (-)	143 (81)
	アイルランド	1,388	877	404 (300)	161 (1,074)
	ポルトガル	218	129	-	-
	スイス	- (-)	- (△ 12)	-	-
	イギリス	9,460 (300)	千イギリスポンド 7,268 (935)	4,389 (-)	千イギリスポンド 4,075 (177)
	スイス	1,066 (1,376)	千スイスフラン 6,653 (1,115)	2,804 (166)	千スイスフラン 3,726 (1,229)
	スウェーデン	1,776 (194)	千スウェーデンクローナ 23,241 (602)	1,894 (81)	千スウェーデンクローナ 20,380 (458)
ノルウェー	155 (-)	千ノルウェークローネ 3,828 (△ 14)	12	千ノルウェークローネ 398	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 135 (1,311)	千デンマーククローネ 11,708 (54,016)	百株 81 (655)	千デンマーククローネ 5,587 (54,016)
	オーストラリア	4,344	千オーストラリアドル 6,934	2,463	千オーストラリアドル 3,220
	ニュージーランド	311	千ニュージーランドドル 397	—	千ニュージーランドドル —
国	香港	1,976	千香港ドル 8,069	2,202	千香港ドル 4,003
	シンガポール	14,033 (10,191)	千シンガポールドル 1,299 (0,059)	8,089 (7)	千シンガポールドル 357 (13)
	イスラエル	461	千イスラエルシケル 858	1,072	千イスラエルシケル 1,011

(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
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	1,220	158	—	—
PROLOGIS INC	4,480	532	1,700	211
AMERICAN TOWER CORP	2,250	463	790	154
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	930	30	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	3,290	61	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,870	305	1,300	231
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,110	115	—	—
CROWN CASTLE INC	4,110	486	3,820	433
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,750	277	1,690	178
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	2,110	129	—	—
EQUINIX INC	560	391	200	148
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,840	561	—	—
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	1,970	98	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,810	75	—	—
WELLTOWER INC	7,140	530	3,530	262
INVITATION HOMES INC	10,700	367	7,810	263
IRON MOUNTAIN INC	6,270	367	3,800	202
KIMCO REALTY CORP	1,930	39	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	23,470	193
PUBLIC STORAGE	540	154	140	40
REALTY INCOME CORP	5,980	364	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	145	41	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,280	153	—	—
VENTAS INC	2,130	96	—	—
VICI PROPERTIES INC	5,760	181	2,250	74
VORNADO REALTY TRUST	—	—	6,851	173
WEYERHAEUSER CO	4,850	139	2,610	81
WP CAREY INC	1,300	95	—	—
小計	82,325	6,218	59,961	2,649
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
KLEPIERRE	—	—	—	—
	(—)	(△ 7)	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	830	43	—	—
小計	830	43	—	—
	(—)	(△ 7)	—	—
ベルギー				
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,570	67	—	—
小計	2,570	67	—	—
ユーロ計	3,400	110	—	—
	(—)	(△ 7)	—	—
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND COMPANY PLC	—	—	30,601	99
小計	—	—	30,601	99
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
GOODMAN GROUP	11,500	218	4,440	84
MIRVAC GROUP	24,800	51	—	—
STOCKLAND	68,900	308	48,800	212
小計	105,200	577	53,240	297

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	9,500	530	(-)	(96)
	LINK REIT(N)	(17,360)	(863)	-	-
	LINK REIT-RTS	(17,360)	(96)	(17,360)	(96)
	LINK REIT-RTS(N)	(17,360)	(96)	(17,360)	(96)
	小 計	9,500 (52,080)	530 (1,055)	- (34,720)	- (288)
国	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	(-)	(△ 1)	(-)	(1)
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	-	-	5,986	6
	CAPITALAND ASCOTT TRUST(N)	(5,986)	(5)	-	-
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	(-)	(△0.733)	-	-
	KEPPEL REIT(N)	(13,712)	(8)	-	-
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	(-)	(△0.901)	-	-
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	(-)	(△ 5)	-	-
		小 計	(19,698)	(4)	5,986 (-)

(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 39,130	百万円 41,527	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

(2022年10月27日～2023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	44,895,252千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	269,517,980千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

(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10月27日～2023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 (2022年10月27日～2023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

(2023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	207	215	1,925	289,438	資本財
ABBVIE INC	657	703	10,212	1,534,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	653	695	6,506	977,794	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	236	253	7,407	1,113,145	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	158	166	3,598	540,725	保険
ADVANCE AUTO PARTS INC	21	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
AES CORP	251	279	410	61,678	公益事業
AECOM	—	49	375	56,469	資本財
AERCAP HOLDINGS NV	48	69	409	61,485	資本財
AFLAC INC	229	234	1,833	275,487	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	112	127	1,318	198,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	82	91	2,501	375,983	素材
ALLSTATE CORP	102	105	1,316	197,786	保険
ALTRIA GROUP INC	677	710	3,042	457,193	食品・飲料・タバコ
ALLIANT ENERGY CORP	88	121	601	90,455	公益事業
ALBEMARLE CORP	43	47	642	96,595	素材
ALLEGION PLC	33	33	322	48,446	資本財
ALLY FINANCIAL INC	122	122	286	43,116	金融サービス
ALCOA CORP	67	—	—	—	素材
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	—	102	223	33,643	生活必需品流通・小売り
AMPHENOL CORP-CL A	220	233	1,860	279,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	41	42	1,297	195,013	金融サービス
AMEREN CORPORATION	95	101	780	117,245	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	295	303	1,849	277,992	保険
AMERICAN EXPRESS CO	238	253	3,633	545,977	金融サービス
AMETEK INC	85	90	1,261	189,585	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	189	203	1,533	230,443	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	67	77	897	134,896	公益事業
CENCORA INC	57	70	1,326	199,344	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	26	26	288	43,356	保険
AMCOR PLC	546	656	561	84,387	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	194	—	—	—	メディア・娯楽
U-HAUL HOLDING CO	—	33	164	24,715	運輸
AON PLC	79	80	2,581	387,994	保険
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	150	158	1,286	193,278	金融サービス
ESSENTIAL UTILITIES INC	91	112	370	55,626	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	210	221	1,573	236,429	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	25	25	276	41,604	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	79	86	1,989	299,022	保険
ARAMARK	88	88	233	35,110	消費者サービス
HOWMET AEROSPACE INC	137	179	775	116,568	資本財
ARISTA NETWORKS INC	87	104	1,939	291,401	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARES MANAGEMENT CORP-A	—	71	724	108,814	金融サービス
ASSURANT INC	19	19	292	43,887	保険
AT&T INC	2,670	2,872	4,363	655,736	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	47	53	575	86,461	公益事業
AUTOZONE INC	7	7	1,758	264,324	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	30	30	511	76,901	素材
AVANTOR INC	227	271	524	78,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EQUITABLE HOLDINGS INC	144	144	377	56,733	金融サービス
BALL CORP	117	125	568	85,396	素材

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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
BANK OF AMERICA CORP	2,703	2,878	7,355	1,105,432	銀行	
BAXTER INTERNATIONAL INC	187	194	625	93,948	ヘルスケア機器・サービス	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	286	306	1,281	192,525	金融サービス	
BAKER HUGHES CO	371	406	1,381	207,645	エネルギー	
TRUIST FINANCIAL CORP	497	532	1,488	223,621	銀行	
BECTON DICKINSON AND CO	106	113	2,910	437,341	ヘルスケア機器・サービス	
BEST BUY CO INC	73	78	528	79,370	一般消費財・サービス流通・小売り	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	480	518	17,459	2,623,865	金融サービス	
BIO-RAD LABORATORIES-A	8	9	275	41,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BILL HOLDINGS INC	36	39	361	54,264	ソフトウェア・サービス	
BLACKROCK INC	56	60	3,667	551,121	金融サービス	
BLACK KNIGHT INC	58	-	-	-	ソフトウェア・サービス	
BLACKSTONE INC	262	284	2,615	393,096	金融サービス	
BORGWARNER INC	91	91	347	52,259	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	532	577	2,884	433,531	ヘルスケア機器・サービス	
BOEING CO/THE	209	229	4,081	613,298	資本財	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	50	50	605	90,980	商業・専門サービス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	793	835	4,730	710,831	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	44	44	747	112,402	商業・専門サービス	
BROWN & BROWN INC	90	90	627	94,284	保険	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	116	127	714	107,410	食品・飲料・タバコ	
BUNGE LTD	55	58	597	89,784	食品・飲料・タバコ	
BURLINGTON STORES INC	25	25	310	46,651	一般消費財・サービス流通・小売り	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	-	52	556	83,644	資本財	
CARMAX INC	59	59	360	54,114	一般消費財・サービス流通・小売り	
CARDINAL HEALTH INC	103	103	963	144,843	ヘルスケア機器・サービス	
CATERPILLAR INC	198	205	5,039	757,393	資本財	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	146	154	1,373	206,372	金融サービス	
CARNIVAL CORP	350	387	437	65,691	消費者サービス	
COTERRA ENERGY INC	301	324	916	137,708	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	78	78	322	48,464	食品・飲料・タバコ	
CARLISLE COS INC	19	22	533	80,187	資本財	
CATALENT INC	65	65	257	38,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CABLE ONE INC	2	-	-	-	メディア・娯楽	
CARRIER GLOBAL CORP	316	330	1,556	233,904	資本財	
CBRE GROUP INC - A	120	125	825	124,123	不動産管理・開発	
CENTENE CORP	218	223	1,536	230,955	ヘルスケア機器・サービス	
CELANESE CORP	40	40	461	69,418	素材	
CENTERPOINT ENERGY INC	222	239	658	98,924	公益事業	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	343	-	-	-	電気通信サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	52	52	344	51,703	商業・専門サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	78	78	632	95,049	素材	
CHURCH & DWIGHT CO INC	90	103	950	142,915	家庭用品・パーソナル用品	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	10	1,961	294,787	消費者サービス	
CHEVRON CORP	696	723	11,283	1,695,697	エネルギー	
CHARLES RIVER LABORATORIES	19	19	329	49,568	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	48	81	12,321	一般消費財・サービス流通・小売り	
CITIGROUP INC	719	784	3,029	455,289	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	176	193	453	68,107	銀行	
CIGNA GROUP/THE	118	117	3,573	537,062	ヘルスケア機器・サービス	
CLEVELAND-CLIFFS INC	191	211	334	50,314	素材	
CLOROX COMPANY	46	52	642	96,523	家庭用品・パーソナル用品	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	97	107	606	91,175	ソフトウェア・サービス	
CLARIVATE PLC	108	142	92	13,898	商業・専門サービス	
CMS ENERGY CORP	105	110	603	90,746	公益事業	
COLGATE-PALMOLIVE CO	294	304	2,234	335,815	家庭用品・パーソナル用品	
CONOCOPHILLIPS	482	481	5,794	870,850	エネルギー	
CONAGRA BRANDS INC	180	206	572	86,074	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
COCA-COLA CO/THE	1,538	1,648	9,251	1,390,314	食品・飲料・タバコ	
CONSOLIDATED EDISON INC	128	142	1,257	188,929	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	61	65	1,535	230,705	食品・飲料・タバコ	
CORNING INC	298	335	897	134,893	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	77	77	453	68,105	食品・飲料・タバコ	
CORTEVA INC	272	281	1,370	205,884	素材	
CROWN HOLDINGS INC	45	45	361	54,381	素材	
CSX CORP	805	816	2,417	363,287	運輸	
CUMMINS INC	51	55	1,209	181,814	資本財	
CVS HEALTH CORP	489	516	3,539	531,906	ヘルスケア機器・サービス	
DAVITA INC	21	21	165	24,899	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	45	48	690	103,707	消費者サービス	
DANAHER CORP	257	280	5,399	811,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DARLING INGREDIENTS INC	—	58	238	35,867	食品・飲料・タバコ	
DEVON ENERGY CORPORATION	235	252	1,208	181,642	エネルギー	
DEERE & CO	108	110	4,126	620,106	資本財	
DELL TECHNOLOGIES -C	101	110	731	109,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA AIR LINES INC	55	57	179	26,929	運輸	
APTIV PLC	101	110	990	148,810	自動車・自動車部品	
DECKERS OUTDOOR CORP	—	9	487	73,257	耐久消費財・アパレル	
DICK'S SPORTING GOODS INC	—	22	243	36,583	一般消費財・サービス流通・小売り	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	104	107	866	130,210	金融サービス	
DOMINO'S PIZZA INC	13	13	481	72,303	消費者サービス	
DOMINION ENERGY INC	302	333	1,351	203,064	公益事業	
DOLLAR GENERAL CORP	84	87	1,042	156,648	生活必需品流通・小売り	
DOVER CORP	53	53	695	104,584	資本財	
DUPONT DE NEMOURS INC	191	191	1,372	206,299	素材	
DOW INC	273	280	1,332	200,219	素材	
DOORDASH INC - A	69	100	724	108,839	消費者サービス	
DR HORTON INC	124	128	1,298	195,080	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	71	83	814	122,427	公益事業	
DUKE ENERGY CORP	287	307	2,714	407,960	公益事業	
DYNATRACE INC	75	98	439	65,989	ソフトウェア・サービス	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	48	48	332	49,949	素材	
EATON CORP PLC	149	159	3,122	469,309	資本財	
ECOLAB INC	95	102	1,618	243,218	素材	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	231	241	1,648	247,715	ヘルスケア機器・サービス	
EDISON INTERNATIONAL	144	163	1,033	155,333	公益事業	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	165	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EMERSON ELECTRIC CO	220	224	1,997	300,227	資本財	
ENTERGY CORP	75	79	737	110,820	公益事業	
EOG RESOURCES INC	218	234	3,045	457,605	エネルギー	
EPAM SYSTEMS INC	21	22	489	73,509	ソフトウェア・サービス	
EQUIFAX INC	45	50	824	123,949	商業・専門サービス	
EQT CORP	126	126	531	79,944	エネルギー	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	85	92	1,237	186,025	家庭用品・パーソナル用品	
EVEREST GROUP LTD	14	14	582	87,573	保険	
EVERGY INC	87	87	426	64,080	公益事業	
EXXON MOBIL CORP	1,571	1,615	17,539	2,635,845	エネルギー	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14	15	674	101,355	金融サービス	
FAIR ISAAC CORP	9	9	800	120,276	ソフトウェア・サービス	
FEDEX CORP	92	94	2,222	333,961	運輸	
FERGUSON PLC	—	84	1,284	193,032	資本財	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	67	—	—	—	銀行	
FISERV INC	—	248	2,839	426,759	金融サービス	
FIRSTENERGY CORP	202	232	833	125,187	公益事業	
FIRST HORIZON CORP	—	198	205	30,915	銀行	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	226	241	1,182	177,641	金融サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	26	28	664	99,930	金融サービス
FMC CORP	48	48	269	40,564	素材
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	95	110	413	62,174	保険
FORD MOTOR COMPANY	1,479	1,592	1,837	276,098	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	50	50	278	41,914	資本財
FORTIVE CORP	126	148	959	144,203	資本財
NEXTERA ENERGY INC	734	809	4,572	687,184	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	103	117	261	39,323	金融サービス
FREEPORT-MCMORAN INC	535	563	1,906	286,505	素材
INGERSOLL-RAND INC	151	163	973	146,280	資本財
GENERAL MOTORS CORP	518	527	1,530	230,035	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	53	57	738	110,996	一般消費財・サービス流通・小売り
GENERAL ELECTRIC CO	407	433	4,817	724,043	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	88	93	2,277	342,312	資本財
GENERAL MILLS INC	225	230	1,513	227,497	食品・飲料・タバコ
GENERAC HOLDINGS INC	24	24	207	31,212	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	105	109	1,160	174,407	金融サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	127	133	3,970	596,619	金融サービス
GODADDY INC-CLASS A	60	60	438	65,933	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	16	18	1,251	188,026	資本財
GRACO INC	—	63	440	66,189	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	123	123	890	133,770	保険
HALLIBURTON CO	338	376	1,518	228,210	エネルギー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	72	77	1,361	204,679	資本財
HCA HEALTHCARE INC	88	81	1,845	277,371	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	53	59	1,156	173,742	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	102	108	1,678	252,219	エネルギー
HP INC	393	344	897	134,937	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	482	501	758	114,000	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEICO CORP	18	18	288	43,402	資本財
HEICO CORP-CLASS A	24	31	400	60,217	資本財
HF SINCLAIR CORP	—	59	319	48,034	エネルギー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	104	106	1,605	241,272	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	254	267	4,766	716,348	資本財
HOME DEPOT INC	383	401	11,266	1,693,159	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	115	115	369	55,510	食品・飲料・タバコ
HUBBELL INC	—	23	649	97,583	資本財
HUMANA INC	47	50	2,642	397,130	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	15	15	329	49,448	資本財
HUBSPOT INC	17	18	776	116,622	ソフトウェア・サービス
HYATT HOTELS CORP - CL A	—	16	170	25,590	消費者サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	336	363	4,981	748,659	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	28	28	538	80,934	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	114	121	2,751	413,448	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	96	106	705	106,040	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	150	150	418	62,818	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	206	227	2,427	364,735	金融サービス
INVESCO LTD	135	135	170	25,593	金融サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	127	136	452	68,039	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	86	90	1,671	251,260	資本財
JABIL INC	—	49	607	91,322	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACOBS SOLUTIONS INC	48	48	648	97,391	商業・専門サービス
JM SMUCKER CO/THE	41	41	469	70,548	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	982	965	14,626	2,198,093	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	1,095	1,168	16,409	2,466,087	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	119	134	336	50,603	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KEYCORP	346	361	354	53,232	銀行

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		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		
KELLANOVA	93	110	565	84,991	食品・飲料・タバコ	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	67	71	862	129,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KENVUE INC	—	600	1,183	177,901	家庭用品・パーソナル用品	
KIMBERLY-CLARK CORP	125	136	1,622	243,888	家庭用品・パーソナル用品	
KINDER MORGAN INC	754	814	1,368	205,615	エネルギー	
KKR & CO INC -A	210	247	1,359	204,369	金融サービス	
KROGER CO	259	268	1,190	178,910	生活必需品流通・小売り	
LAS VEGAS SANDS CORP	129	143	679	102,071	消費者サービス	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	34	34	675	101,455	ヘルスケア機器・サービス	
LAMB WESTON HOLDING INC	—	61	546	82,080	食品・飲料・タバコ	
LENNAR CORP-CL A	94	100	1,034	155,513	耐久消費財・アパレル	
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	13	469	70,621	資本財	
LEAR CORP	22	22	296	44,628	自動車・自動車部品	
ELI LILLY & CO	301	322	18,924	2,843,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	64	64	498	74,964	メディア・娯楽	
LINCOLN NATIONAL CORP	64	—	—	—	保険	
BATH & BODY WORKS INC	92	92	260	39,173	一般消費財・サービス流通・小売り	
LINDE PLC	187	—	—	—	素材	
LINDE PLC	—	195	7,138	1,072,729	素材	
LOCKHEED MARTIN CORP	89	91	4,099	616,005	資本財	
LOWE'S COS INC	239	234	4,371	656,967	一般消費財・サービス流通・小売り	
LOEWS CORP	71	71	455	68,505	保険	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	97	105	943	141,754	素材	
M & T BANK CORP	67	69	771	116,001	銀行	
MARATHON OIL CORP	266	283	798	119,930	エネルギー	
MASTERCARD INC - A	324	338	13,082	1,966,021	金融サービス	
MARSH & MCLENNAN COS	187	199	3,762	565,370	保険	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23	27	1,116	167,731	素材	
MASCO CORP	84	98	476	71,533	資本財	
MARKEL GROUP INC	5	5	774	116,415	保険	
MARATHON PETROLEUM CORP	202	176	2,606	391,767	エネルギー	
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	92	104	670	100,813	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	276	292	7,547	1,134,258	消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	129	131	4,603	691,780	金融サービス	
MCKESSON CORP	54	54	2,463	370,269	ヘルスケア機器・サービス	
METLIFE INC	257	263	1,552	233,341	保険	
MERCK & CO. INC.	942	1,011	10,486	1,575,930	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDTRONIC PLC	497	535	3,821	574,355	ヘルスケア機器・サービス	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	8	867	130,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	129	129	446	67,134	消費者サービス	
MICRON TECHNOLOGY INC	417	441	2,936	441,288	半導体・半導体製造装置	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	66	75	436	65,617	食品・飲料・タバコ	
MOHAWK INDUSTRIES INC	18	18	146	22,072	耐久消費財・アパレル	
MOSAIC CO/THE	135	135	453	68,081	素材	
MORGAN STANLEY	490	504	3,598	540,823	金融サービス	
MOODY'S CORP	61	65	2,043	307,069	金融サービス	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	62	66	1,854	278,644	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOLINA HEALTHCARE INC	21	26	893	134,241	ヘルスケア機器・サービス	
MSCI INC	30	31	1,522	228,850	金融サービス	
NEWMONT CORP	295	458	1,686	253,410	素材	
NEWELL BRANDS INC	146	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
NIKE INC -CL B	474	492	5,097	765,987	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	156	156	395	59,373	公益事業	
NORTHROP GRUMMAN CORP	55	57	2,795	420,059	資本財	
NORFOLK SOUTHERN CORP	88	89	1,656	248,911	運輸	
EVERSOURCE ENERGY	126	143	775	116,600	公益事業	
NRG ENERGY INC	87	87	366	55,067	公益事業	
NUCOR CORP	99	99	1,440	216,413	素材	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	351	283	1,793	269,567	エネルギー
OMNICOM GROUP	78	74	556	83,587	メディア・娯楽
ONEOK INC	168	224	1,487	223,481	エネルギー
ORACLE CORP	598	651	6,606	992,815	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	156	171	1,292	194,214	資本財
OVINTIV INC	—	94	458	68,837	エネルギー
OWENS CORNING	35	35	392	59,004	資本財
P G & E CORP	558	732	1,184	178,048	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	47	52	1,934	290,790	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	35	35	532	80,097	素材
PAYCOM SOFTWARE INC	19	19	482	72,512	商業・専門サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	610	728	1,134	170,560	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	516	552	8,963	1,347,035	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	59	69	396	59,654	資本財
REVVITY INC	47	49	489	73,558	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,091	2,260	6,947	1,044,061	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	579	623	5,614	843,820	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	178	188	2,088	313,785	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	85	91	2,238	336,373	エネルギー
PINTEREST INC- CLASS A	209	221	564	84,889	メディア・娯楽
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	154	162	1,802	270,939	銀行
PPL CORP	269	303	739	111,153	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	87	93	1,141	171,496	素材
PROCTER & GAMBLE CO	895	944	14,217	2,136,680	家庭用品・パーソナル用品
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	95	95	636	95,682	保険
PROGRESSIVE CORP	218	233	3,651	548,683	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	139	149	1,336	200,812	保険
PULTE GROUP INC	88	88	628	94,455	耐久消費財・アパレル
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	187	198	1,205	181,089	公益事業
QUANTA SERVICES INC	53	57	960	144,357	資本財
QUEST DIAGNOSTICS	43	43	550	82,700	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	70	74	1,347	202,564	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	70	84	777	116,887	金融サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	351	358	503	75,736	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	81	89	1,316	197,830	商業・専門サービス
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—	22	546	82,089	素材
RESMED INC	53	58	819	123,096	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	29	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	43	46	1,216	182,742	資本財
ROBERT HALF INC	39	44	324	48,806	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	39	42	2,021	303,728	ソフトウェア・サービス
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	87	93	769	115,627	消費者サービス
WESTROCK CO	99	99	345	51,984	素材
ROLLINS INC	82	82	283	42,640	商業・専門サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	126	191	594	89,408	メディア・娯楽
RPM INTERNATIONAL INC	49	49	445	66,980	素材
SALESFORCE INC	370	390	7,690	1,155,722	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	49	49	452	68,068	商業・専門サービス
SCHLUMBERGER LTD	523	569	3,222	484,332	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	539	605	2,989	449,188	金融サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	56	64	221	33,227	資本財
SEALED AIR CORP	57	57	177	26,604	素材
SEMPRA	117	248	1,744	262,194	公益事業
SERVICENOW INC	74	81	4,307	647,350	ソフトウェア・サービス
SEA LTD-ADR	133	144	636	95,615	メディア・娯楽
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	91	96	2,296	345,172	素材
SMITH (A. O.) CORP	50	50	327	49,179	資本財
SNAP-ON INC	19	19	494	74,260	資本財

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	当 期		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		
SNAP INC - A	404	453	416	62,562	メディア・娯楽	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	83	104	1,493	224,484	ソフトウェア・サービス	
SOUTHWEST AIRLINES CO	54	54	129	19,399	運輸	
SOUTHERN CO	394	434	2,896	435,291	公益事業	
BLOCK INC	194	214	894	134,484	金融サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	58	58	448	67,402	資本財	
STRYKER CORP	127	136	3,547	533,089	ヘルスケア機器・サービス	
STATE STREET CORP	137	129	828	124,562	金融サービス	
STERIS PLC	37	42	903	135,720	ヘルスケア機器・サービス	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	56	61	303	45,628	運輸	
SYSCO CORP	192	199	1,314	197,548	生活必需品流通・小売り	
SYNCHRONY FINANCIAL	190	190	526	79,133	金融サービス	
TARGET CORP	173	179	1,984	298,196	生活必需品流通・小売り	
TARGA RESOURCES CORP	81	81	698	104,919	エネルギー	
TEXTRON INC	79	79	591	88,906	資本財	
TERADYNE INC	61	61	544	81,776	半導体・半導体製造装置	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	435	435	357	53,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELADOC HEALTH INC	66	-	-	-	ヘルスケア機器・サービス	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	17	20	754	113,314	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELEFLEX INC	17	18	337	50,700	ヘルスケア機器・サービス	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2	2	455	68,446	エネルギー	
THE WALT DISNEY CO.	677	734	5,917	889,218	メディア・娯楽	
COOPER COS INC/THE	17	20	638	95,926	ヘルスケア機器・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	145	154	6,677	1,003,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TJX COMPANIES INC	436	458	4,078	612,975	一般消費財・サービス流通・小売り	
GLOBE LIFE INC	35	35	401	60,373	保険	
TORO CO	-	38	312	46,971	資本財	
TOAST INC-CLASS A	-	127	211	31,755	金融サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	88	88	1,464	220,052	保険	
TRANSDIGM GROUP INC	19	21	1,783	268,077	資本財	
TRANSUNION	72	79	367	55,162	商業・専門サービス	
TWITTER INC	240	-	-	-	メディア・娯楽	
TWILIO INC - A	64	72	369	55,602	ソフトウェア・サービス	
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	18	670	100,830	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	109	109	494	74,359	食品・飲料・タバコ	
TE CONNECTIVITY LTD	119	129	1,513	227,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	258	274	1,321	198,667	資本財	
UBER TECHNOLOGIES INC	543	725	3,072	461,734	運輸	
UGI CORP	77	-	-	-	公益事業	
UIPATH INC - CLASS A	-	179	272	40,886	ソフトウェア・サービス	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	274	291	4,282	643,584	運輸	
RTX CORP	555	587	4,607	692,348	資本財	
UNION PACIFIC CORP	234	244	5,012	753,309	運輸	
UNITEDHEALTH GROUP INC	350	371	19,715	2,962,899	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	24	19	234	35,262	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED RENTALS INC	26	28	1,119	168,255	資本財	
UNITY SOFTWARE INC	67	96	247	37,255	ソフトウェア・サービス	
US BANCORP	526	597	1,870	281,105	銀行	
VF CORP	121	121	218	32,828	耐久消費財・アパレル	
VALERO ENERGY CORP	152	146	1,862	279,905	エネルギー	
VAIL RESORTS INC	15	15	318	47,925	消費者サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,566	1,681	5,665	851,468	電気通信サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	52	57	1,127	169,482	ヘルスケア機器・サービス	
VERALTO CORP	-	93	661	99,393	商業・専門サービス	
VISA INC-CLASS A SHARES	614	647	15,338	2,305,126	金融サービス	
VISTRA CORP	147	147	482	72,513	公益事業	
VMWARE INC-CLASS A	76	95	1,410	212,043	ソフトウェア・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	49	55	1,131	170,018	素材	

銘柄	株数	期末(前期末)				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		
WALMART INC	565	591	9,629	1,447,077	生活必需品流通・小売り	
WATERS CORP	22	23	564	84,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WASTE MANAGEMENT INC	155	165	2,709	407,176	商業・専門サービス	
WABTEC CORP	64	71	741	111,499	資本財	
WASTE CONNECTIONS INC	95	106	1,457	219,013	商業・専門サービス	
WAYFAIR INC- CLASS A	28	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
WATSCO INC	—	12	422	63,453	資本財	
WESTLAKE CORP	13	13	153	23,133	素材	
WESTERN UNION CO	145	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
WELLS FARGO & CO	1,412	1,482	5,786	869,608	銀行	
ELEVANCE HEALTH INC	90	94	4,246	638,218	ヘルスケア機器・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	27	29	1,059	159,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEBSTER FINANCIAL CORP	63	63	235	35,381	銀行	
WHIRLPOOL CORP	20	20	261	39,244	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	449	473	1,630	245,074	エネルギー	
WEC ENERGY GROUP INC	117	122	1,005	151,174	公益事業	
WORKDAY INC-CLASS A	73	79	1,655	248,804	ソフトウェア・サービス	
WOLFSPEED INC	—	50	155	23,345	半導体・半導体製造装置	
WR BERKLEY CORP	80	80	542	81,539	保険	
XCEL ENERGY INC	203	221	1,318	198,172	公益事業	
XYLEM INC	66	94	830	124,869	資本財	
YUM! BRANDS INC	105	113	1,370	206,005	消費者サービス	
ZENDESK INC	47	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	76	84	871	131,017	ヘルスケア機器・サービス	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	29	—	—	—	運輸	
ZOETIS INC	175	185	3,031	455,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHENIERE ENERGY INC	86	95	1,595	239,775	エネルギー	
NVR INC	1	1	795	119,598	耐久消費財・アパレル	
ABIOMED INC	16	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	289	—	—	—	メディア・娯楽	
ADOBE INC	176	181	9,481	1,424,898	ソフトウェア・サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	601	643	6,176	928,237	半導体・半導体製造装置	
AFFIRM HOLDINGS INC	66	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ATRBNB INC-CLASS A	140	163	1,936	290,985	消費者サービス	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	60	60	618	92,974	ソフトウェア・サービス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	45	50	803	120,799	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	28	30	776	116,661	ヘルスケア機器・サービス	
AMAZON.COM INC	3,415	3,697	44,883	6,745,160	一般消費財・サービス流通・小売り	
AMGEN INC	199	212	5,778	868,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMERCO	3	—	—	—	運輸	
ANALOG DEVICES INC	194	200	3,211	482,594	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	32	35	951	143,014	ソフトウェア・サービス	
APA CORP	127	127	523	78,597	エネルギー	
APPLE INC	6,037	6,297	107,757	16,193,835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	323	337	4,389	659,579	半導体・半導体製造装置	
APPROVIN CORP-CLASS A	39	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	140	145	1,213	182,368	保険	
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	13	229	34,554	ソフトウェア・サービス	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	—	60	1,075	161,567	ソフトウェア・サービス	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	157	165	3,607	542,064	商業・専門サービス	
AUTODESK INC	81	87	1,745	262,363	ソフトウェア・サービス	
AXON ENTERPRISE INC	—	25	527	79,346	資本財	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	75	75	368	55,335	ソフトウェア・サービス	
BIOGEN INC	55	56	1,392	209,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	71	83	685	102,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADCOM INC	150	165	14,044	2,110,590	半導体・半導体製造装置	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	49	49	407	61,293	運輸	
CADENCE DESIGN SYS INC	102	105	2,441	366,981	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	
CARLYLE GROUP INC/THE	76	76	210	31,684	金融サービス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	79	79	307	46,160	消費者サービス
PARAMOUNT GLOBAL	228	228	249	37,522	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	50	58	1,171	176,028	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	38	38	513	77,097	ソフトウェア・サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	37	324	48,831	エネルギー
CHARTER COMMUNICATION-A	43	39	1,663	250,000	メディア・娯楽
CINTAS CORP	34	35	1,801	270,717	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,548	1,624	8,514	1,279,555	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	56	58	578	86,941	保険
CME GROUP INC	134	145	3,106	466,814	金融サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,663	1,665	7,121	1,070,213	メディア・娯楽
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	192	203	1,302	195,691	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION ENERGY	122	131	1,475	221,694	公益事業
COSTCO WHOLESALE CORP	165	176	9,715	1,459,973	生活必需品流通・小売り
COPART INC	78	351	1,533	230,403	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	149	168	1,191	179,026	不動産管理・開発
COGNEX CORP	64	64	226	34,073	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COUPA SOFTWARE INC	28	—	—	—	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	42	69	536	80,662	金融サービス
CONFLUENT INC-CLASS A	—	68	182	27,483	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	74	89	1,576	236,941	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	16	16	261	39,346	ソフトウェア・サービス
DATADOG INC-CLASS A	82	99	808	121,509	ソフトウェア・サービス
DEXCOM INC	146	155	1,307	196,479	ヘルスケア機器・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	82	82	261	39,304	ヘルスケア機器・サービス
DISH NETWORK CORP-A	92	—	—	—	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	63	65	1,077	161,852	エネルギー
DOLLAR TREE INC	84	89	973	146,250	生活必需品流通・小売り
DOCUSIGN INC	74	83	327	49,250	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	291	397	1,155	173,613	食品・飲料・タバコ
DROPBOX INC-CLASS A	116	116	306	46,102	ソフトウェア・サービス
EBAY INC	207	218	860	129,323	一般消費財・サービス流通・小売り
PAYPAL HOLDINGS INC	407	422	2,176	327,058	金融サービス
ELECTRONIC ARTS INC	104	108	1,362	204,688	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	50	54	513	77,133	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	50	56	490	73,720	半導体・半導体製造装置
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	9	276	41,579	保険
ETSY INC	48	48	302	45,415	一般消費財・サービス流通・小売り
EXPEDIA GROUP INC	56	60	578	86,995	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	61	64	704	105,816	運輸
EXELON CORP	367	397	1,548	232,713	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	65	73	455	68,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
F5 INC	23	23	361	54,364	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
META PLATFORMS INC-CLASS A	855	885	26,526	3,986,383	メディア・娯楽
FASTENAL CO	216	227	1,301	195,543	資本財
FISERV INC	229	—	—	—	金融サービス
FIRST SOLAR INC	—	42	644	96,899	半導体・半導体製造装置
FIFTH THIRD BANCORP	255	264	609	91,573	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	4	4	585	88,026	銀行
FORTINET INC	255	269	1,508	226,685	ソフトウェア・サービス
FOX CORP- CLASS B	54	54	152	22,860	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS A	114	130	395	59,479	メディア・娯楽
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	25	25	140	21,061	金融サービス
GARMIN LTD	58	58	596	89,672	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	—	30	1,011	152,017	ソフトウェア・サービス
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	30	167	1,077	161,947	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	467	499	3,915	588,480	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	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		
GLOBAL-E ONLINE LTD	—	30	102	15,391	一般消費財・サービス流通・小売り	
ALPHABET INC-CL A	2,244	2,380	29,897	4,493,025	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL C	2,103	2,115	26,797	4,027,058	メディア・娯楽	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	381	770	246	37,028	運輸	
HASBRO INC	47	51	284	42,685	耐久消費財・アパレル	
HENRY SCHEIN INC	52	52	357	53,774	ヘルスケア機器・サービス	
HOLOGIC INC	92	98	656	98,694	ヘルスケア機器・サービス	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	79	—	—	—	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	31	31	533	80,238	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	537	537	508	76,451	銀行	
IAC INC	30	—	—	—	メディア・娯楽	
IDEXX LABORATORIES INC	31	33	1,386	208,378	ヘルスケア機器・サービス	
ILLUMINA INC	59	62	714	107,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTUIT INC	100	112	5,429	815,981	ソフトウェア・サービス	
INTEL CORP	1,524	1,674	5,496	826,057	半導体・半導体製造装置	
INTUITIVE SURGICAL INC	133	140	3,741	562,328	ヘルスケア機器・サービス	
INCYTE CORP	71	76	416	62,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INSULET CORP	26	27	383	57,604	ヘルスケア機器・サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	24	318	47,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	26	32	454	68,267	金融サービス	
KLA CORP	55	54	2,496	375,191	半導体・半導体製造装置	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	519	542	3,561	535,262	食品・飲料・タバコ	
KRAFT HEINZ CO/THE	271	329	1,055	158,663	食品・飲料・タバコ	
LAM RESEARCH CORP	51	51	3,151	473,562	半導体・半導体製造装置	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	—	51	354	53,278	半導体・半導体製造装置	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	111	103	173	26,033	電気通信サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	54	—	—	—	電気通信サービス	
LIBERTY BROADBAND-C	48	48	423	63,578	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	33	—	—	—	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	57	57	140	21,039	メディア・娯楽	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	71	77	508	76,370	メディア・娯楽	
LKQ CORP	102	102	481	72,344	一般消費財・サービス流通・小売り	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	30	31	688	103,487	金融サービス	
LULULEMON ATHLETICA INC	43	47	1,868	280,791	耐久消費財・アパレル	
LUCID GROUP INC	165	363	151	22,785	自動車・自動車部品	
LYFT INC-A	105	—	—	—	運輸	
MASIMO CORP	20	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	104	106	2,011	302,230	消費者サービス	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14	15	330	49,705	金融サービス	
MATCH GROUP INC	98	109	381	57,296	メディア・娯楽	
MARVELL TECHNOLOGY INC	320	336	1,598	240,199	半導体・半導体製造装置	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	—	23	453	68,180	ソフトウェア・サービス	
T-MOBILE US INC	234	219	3,093	464,843	電気通信サービス	
MERCADOLIBRE INC	16	17	2,131	320,375	一般消費財・サービス流通・小売り	
MICROSOFT CORP	2,650	2,828	96,346	14,478,913	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	207	220	1,572	236,294	半導体・半導体製造装置	
MONSTER BEVERAGE CORP	148	318	1,596	239,929	食品・飲料・タバコ	
MONGODB INC	25	28	928	139,566	ソフトウェア・サービス	
MODERNA INC	125	128	988	148,519	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	17	18	727	109,329	半導体・半導体製造装置	
MONDAY.COM LTD	—	9	126	18,948	ソフトウェア・サービス	
NASDAQ INC	129	117	580	87,203	金融サービス	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	36	36	392	59,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NETAPP INC	822	82	597	89,817	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	165	178	7,320	1,100,087	メディア・娯楽	
NEWS CORP - CLASS A	147	147	303	45,551	メディア・娯楽	
DRAFTKINGS INC-CL A	—	158	432	64,940	消費者サービス	
NORTHERN TRUST CORP	73	76	484	72,875	金融サービス	

銘柄	株数	当期	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		
NORDSON CORP	18	23	494	74,255	資本財	
NOVOCURE LTD	34	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
NVIDIA CORP	933	988	41,311	6,208,228	半導体・半導体製造装置	
NXP SEMICONDUCTORS NV	98	104	1,838	276,221	半導体・半導体製造装置	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24	24	2,117	318,188	一般消費財・サービス流通・小売り	
OKTA INC	56	63	427	64,236	ソフトウェア・サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	36	39	1,467	220,512	運輸	
ON SEMICONDUCTOR CORP	161	173	1,407	211,491	半導体・半導体製造装置	
PACCAR INC	129	207	1,750	263,031	資本財	
PAYCHEX INC	120	130	1,466	220,392	商業・専門サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	110	122	2,987	448,985	ソフトウェア・サービス	
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	17	307	46,170	商業・専門サービス	
PLUG POWER INC	192	—	—	—	資本財	
POOL CORP	15	15	491	73,842	一般消費財・サービス流通・小売り	
BOOKING HOLDINGS INC	15	14	4,213	633,242	消費者サービス	
PTC INC	41	41	573	86,253	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	38	42	365	54,925	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	418	448	4,694	705,467	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	40	43	3,435	516,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REPLIGEN CORP	—	22	279	42,070	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	272	463	69,596	自動車・自動車部品	
ROSS STORES INC	131	137	1,590	238,954	一般消費財・サービス流通・小売り	
ROKU INC	47	47	274	41,319	メディア・娯楽	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	130	143	391	58,790	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	—	178	160	24,168	金融サービス	
SEI INVESTMENTS COMPANY	41	43	238	35,766	金融サービス	
SEAGEN INC	53	56	1,217	182,968	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	77	77	522	78,593	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	302	302	132	19,840	メディア・娯楽	
SIGNATURE BANK	23	—	—	—	銀行	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	59	64	570	85,718	半導体・半導体製造装置	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	20	23	187	28,132	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	61	61	902	135,648	ソフトウェア・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	84	84	418	62,828	商業・専門サービス	
STEEL DYNAMICS INC	71	60	600	90,173	素材	
STARBUCKS CORP	428	461	4,335	651,562	消費者サービス	
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	17	454	68,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SVB FINANCIAL GROUP	21	—	—	—	銀行	
GEN DIGITAL INC	222	243	402	60,415	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSIS INC	57	60	2,768	416,108	ソフトウェア・サービス	
T ROWE PRICE GROUP INC	81	86	810	121,854	金融サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	59	72	992	149,135	メディア・娯楽	
TESLA INC	985	1,142	24,276	3,648,260	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	344	364	5,171	777,152	半導体・半導体製造装置	
BIO-TECHNE CORP	14	67	412	61,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRIMBLE INC	95	95	449	67,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	42	45	897	134,839	一般消費財・サービス流通・小売り	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	42	42	350	52,633	金融サービス	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	165	175	1,254	188,484	メディア・娯楽	
ULTA BEAUTY INC	19	21	793	119,285	一般消費財・サービス流通・小売り	
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	19	426	64,101	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISIGN INC	36	36	761	114,494	ソフトウェア・サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	95	103	3,750	563,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISK ANALYTICS INC	58	58	1,325	199,186	商業・専門サービス	
VIATRIS INC	458	458	410	61,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	270	307	667	100,243	生活必需品流通・小売り	
WARNER BROS DISCOVERY INC	867	948	923	138,750	メディア・娯楽	
WESTERN DIGITAL CORP	118	116	492	74,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	株数	期 末			業 種 等
		株数	評 価		
			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	
WIX.COM LTD	22	22	186	28,014	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41	41	872	131,058	保険
WYNN RESORTS LTD	41	41	371	55,869	消費者サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	19	20	412	62,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - C	63	63	243	36,558	不動産管理・開発
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	85	96	581	87,338	ソフトウェア・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	98	98	154	23,246	メディア・娯楽
ZSCALER INC	31	36	572	85,978	ソフトウェア・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	405	405	125	18,867	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	57	65	264	39,740	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	39	39	639	96,169	金融サービス
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	127,008 598	136,710 604	1,449,589 <72.4%>	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	168	214	1,448	157,606	素材
AIR CANADA	71	71	116	12,660	運輸
ALTAGAS LTD	111	111	281	30,633	公益事業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	270	270	187	20,452	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	310	308	2,277	247,890	生活必需品流通・小売り
ARC RESOURCES LTD	255	255	564	61,410	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	667	696	1,592	173,290	素材
BANK OF MONTREAL	252	276	2,894	315,051	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	444	475	2,660	289,570	銀行
BCE INC	30	30	153	16,722	電気通信サービス
BROOKFIELD CORP	528	572	2,351	255,953	金融サービス
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	54	54	179	19,566	公益事業
BRP INC/CA- SUB VOTING	—	15	147	16,091	耐久消費財・アパレル
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	—	138	569	62,005	金融サービス
CAE INC	123	123	351	38,206	資本財
CAMECO CORP	149	163	885	96,382	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	337	377	1,818	197,928	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	427	440	3,906	425,167	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	218	224	3,288	357,913	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	19	22	306	33,360	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD-A	45	45	131	14,307	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	57	57	316	34,467	素材
CENOVUS ENERGY INC	498	572	1,563	170,169	エネルギー
CGI INC	80	80	1,060	115,434	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	8	2,252	245,178	ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	348	375	3,612	393,138	運輸
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	—	37	367	40,018	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	103	129	1,247	135,800	一般消費財・サービス流通・小売り
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	138	260	28,339	金融サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	69	69	264	28,757	生活必需品流通・小売り
EMERA INC	104	104	478	52,091	公益事業
ENBRIDGE INC	759	810	3,608	392,673	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	9	1,010	109,987	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	226	226	650	70,794	素材
FIRSTSERVICE CORP	15	15	285	31,036	不動産管理・開発
FORTIS INC	171	190	1,038	112,978	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	71	81	1,540	167,687	素材
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	74	74	300	32,749	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	70	70	275	29,972	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFE CO INC	89	113	426	46,461	保険
HYDRO ONE LTD	132	132	463	50,494	公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	40	40	323	35,159	保険
IGM FINANCIAL INC	33	33	102	11,142	金融サービス
IMPERIAL OIL LTD	89	89	721	78,503	エネルギー

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		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
INTACT FINANCIAL CORP	65	72	1,399	152,299	保険	
IVANHOE MINES LTD-CL A	245	245	251	27,421	素材	
KEYERA CORP	84	84	273	29,747	エネルギー	
KINROSS GOLD CORP	460	460	337	36,765	素材	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	43	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
LOBLAW COMPANIES LTD	55	63	707	76,948	生活必需品流通・小売り	
LUNDIN MINING CORP	250	250	215	23,489	素材	
MANULIFE FINANCIAL CORP	719	719	1,717	186,912	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	106	106	734	79,946	自動車・自動車部品	
METRO INC	87	95	672	73,134	生活必需品流通・小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	126	137	1,172	127,554	銀行	
NORTHLAND POWER INC	86	86	179	19,523	公益事業	
NUTRIEN LTD	204	209	1,616	175,958	素材	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	22	22	43	4,728	金融サービス	
ONEX CORPORATION	27	27	210	22,869	金融サービス	
OPEN TEXT CORP	96	111	511	55,617	ソフトウェア・サービス	
PAN AMERICAN SILVER CORP	76	128	266	28,956	素材	
PARKLAND CORP	61	61	254	27,725	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	204	235	994	108,242	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	204	204	667	72,612	保険	
QUEBECOR INC -CL B	61	61	168	18,326	電気通信サービス	
BLACKBERRY LTD	222	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	109	109	1,020	111,109	消費者サービス	
RB GLOBAL INC	40	75	655	71,349	商業・専門サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	138	138	721	78,520	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	527	549	5,993	652,251	銀行	
SAPUTO INC	96	96	259	28,236	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS-A	423	477	3,196	347,873	ソフトウェア・サービス	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	174	—	—	—	メディア・娯楽	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	168	191	1,148	125,018	素材	
STANTEC INC	—	41	343	37,423	資本財	
SUN LIFE FINANCIAL INC	215	247	1,554	169,156	保険	
SUNCOR ENERGY INC	534	534	2,449	266,611	エネルギー	
TELUS CORP	126	126	282	30,701	電気通信サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	179	179	871	94,876	素材	
TFI INTERNATIONAL INC	32	32	481	52,401	運輸	
THOMSON REUTERS CORP	65	63	1,059	115,306	商業・専門サービス	
TMX GROUP LTD	21	108	317	34,585	金融サービス	
TOURMALINE OIL CORP	112	120	862	93,897	エネルギー	
TORONTO-DOMINION BANK	680	731	5,629	612,604	銀行	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	32	32	338	36,809	資本財	
TC ENERGY CORP	366	416	1,974	214,874	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	24	24	218	23,778	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	28	28	411	44,833	生活必需品流通・小売り	
WSP GLOBAL INC	45	45	823	89,575	資本財	
小 計	株数・金額	15,196	16,104	91,296	9,935,782	
	銘柄数<比率>	84	86	—	<3.3%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG	64	65	1,126	178,843	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE-REG	151	162	3,573	567,145	保険	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	123	133	1,220	193,674	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	22	22	186	29,671	自動車・自動車部品	
BASF SE	334	370	1,503	238,600	素材	
BAYER AG-REG	367	390	1,602	254,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIERSDORF AG	38	43	544	86,337	家庭用品・パーソナル用品	
BECHTLE AG	30	30	126	20,024	ソフトウェア・サービス	
BRENTNAG SE	56	68	468	74,324	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	16	16	121	19,260	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
COMMERZBANK AG	404	404	407	64,649	銀行
CONTINENTAL AG	43	43	261	41,531	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	74	74	361	57,328	素材
MERCEDES-BENZ GROUP AG	299	342	2,099	333,161	自動車・自動車部品
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	167	181	544	86,468	資本財
DEUTSCHE BOERSE AG	70	76	1,184	187,913	金融サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	757	809	831	132,014	金融サービス
DEUTSCHE POST AG-REG	367	398	1,464	232,446	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,199	1,287	2,637	418,646	電気通信サービス
VONOVIA SE	271	271	548	87,022	不動産管理・開発
DELIVERY HERO SE	66	66	155	24,734	消費者サービス
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	35	43	378	60,140	自動車・自動車部品
E.ON SE	826	909	1,010	160,301	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	82	82	131	20,858	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	76	76	242	38,420	ヘルスケア機器・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	156	156	392	62,220	ヘルスケア機器・サービス
GEA GROUP AG	60	60	193	30,734	資本財
HANNOVER RUECK SE-REG	22	22	480	76,324	保険
HEIDELBERG MATERIALS AG	57	57	387	61,528	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	67	67	461	73,285	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL AG & CO KGAA	34	45	268	42,680	家庭用品・パーソナル用品
HELLOFRESH SE	60	60	147	23,446	生活必需品流通・小売り
INFINEON TECHNOLOGIES AG	475	517	1,489	236,353	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG	28	—	—	—	資本財
KNORR-BREMSE AG	29	29	159	25,367	資本財
LEG IMMOBILIEN SE	24	30	165	26,205	不動産管理・開発
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	238	238	161	25,607	運輸
MERCK KGAA	48	51	744	118,182	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	360	57,190	資本財
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	51	56	2,151	341,513	保険
NEMETSCHEK SE	23	23	160	25,546	ソフトウェア・サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	56	56	244	38,863	自動車・自動車部品
PUMA SE	42	42	230	36,606	耐久消費財・アパレル
QIAGEN N.V.	83	103	363	57,743	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RATIONAL AG	2	2	125	19,856	資本財
RHEINMETALL AG	17	17	461	73,222	資本財
RWE AG	236	258	912	144,771	公益事業
SAP SE	388	419	5,245	832,421	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	9	12	276	43,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCOUT24 SE	29	29	173	27,497	メディア・娯楽
SIEMENS HEALTHINEERS AG	106	106	508	80,764	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS AG-REG	284	305	3,881	616,062	資本財
SIEMENS ENERGY AG	158	213	227	36,072	資本財
SYMRISE AG	49	57	544	86,484	素材
TALANX AG	—	25	151	24,082	保険
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	464	464	73	11,663	電気通信サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	40	—	—	—	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG	11	11	126	20,111	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD	67	80	813	129,143	自動車・自動車部品
ZALANDO SE	82	82	180	28,576	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	株 数	金 額			
	9,478	10,100	45,002	7,141,870	
	銘柄 数 < 比率 >	59	58	—	< 2.4% >
(ユーロ…イタリア)					
AMPLIFON SPA	48	48	131	20,918	ヘルスケア機器・サービス
ATLANTIA SPA	187	—	—	—	運輸
DIASORIN ITALIA SPA	9	9	76	12,217	ヘルスケア機器・サービス
ENEL SPA	3,009	3,097	1,781	282,741	公益事業
ENI SPA	924	894	1,379	218,961	エネルギー

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
	株 数	株 数	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	
FINECOBANK SPA	235	235	257	40,869	銀行
ASSICURAZIONI GENERALI	422	422	776	123,233	保険
INTESA SANPAOLO	6,137	6,580	1,550	246,059	銀行
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	151	151	155	24,664	電気通信サービス
MEDIOBANCA SPA	205	195	214	34,107	銀行
MONCLER SPA	80	80	430	68,320	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	212	212	115	18,397	金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	195	195	177	28,247	保険
PRYSMIAN SPA	95	95	323	51,367	資本財
RECORDATI SPA	37	37	163	25,958	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA	724	911	400	63,511	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	4,005	4,005	95	15,191	電気通信サービス
TERNA SPA	536	536	389	61,872	公益事業
UNICREDIT SPA	793	732	1,647	261,520	銀行
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	18,012	18,442	10,070	1,598,160	
	銘柄 数	銘柄 数	< 比 率 >	< 比 率 >	
	19	18	—	< 0.5% >	
(ユーロ…フランス)					
ACCOR SA	60	60	182	28,919	消費者サービス
ADP	10	10	112	17,869	運輸
AIR LIQUIDE SA	195	208	3,274	519,606	素材
ALSTOM	116	116	138	22,009	資本財
AMUNDI SA	21	21	106	16,912	金融サービス
ARKEMA	22	22	185	29,387	素材
AXA SA	695	757	2,089	331,682	保険
BIOMERIEUX	16	16	148	23,516	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS	411	442	2,485	394,451	銀行
BOLLORE SE	335	335	172	27,377	メディア・娯楽
BOUYGUES SA	84	84	264	41,983	資本財
BUREAU VERITAS SA	109	109	247	39,200	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	61	65	1,074	170,493	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	226	226	353	56,086	生活必需品流通・小売り
CREDIT AGRICOLE SA	440	496	559	88,759	銀行
DANONE	236	257	1,415	224,610	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SE	246	274	1,034	164,238	ソフトウェア・サービス
DASSAULT AVIATION SA	9	9	170	27,109	資本財
EDENRED	96	96	490	77,818	金融サービス
EIFFAGE	32	32	268	42,654	資本財
EDF	213	—	—	—	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	107	115	1,939	307,800	ヘルスケア機器・サービス
EURAZEO SE	14	14	76	12,094	金融サービス
ORANGE S. A.	743	728	791	125,684	電気通信サービス
ENGIE	683	718	1,067	169,430	公益事業
GETLINK	173	173	251	39,901	運輸
HERMES INTERNATIONAL	11	12	2,259	358,595	耐久消費財・アパレル
IPSEN	13	16	191	30,368	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	103	110	7,527	1,194,557	耐久消費財・アパレル
L'OREAL	90	96	3,852	611,420	家庭用品・パーソナル用品
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	39	39	118	18,827	消費者サービス
LEGRAND SA	100	111	901	143,082	資本財
MICHELIN (CGDE)	252	247	673	106,960	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	77	82	1,407	223,422	食品・飲料・タバコ
KERING	27	30	1,182	187,687	耐久消費財・アパレル
PUBLICIS GROUPE	86	93	677	107,444	メディア・娯楽
RENAULT SA	68	82	268	42,594	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	8	8	100	15,894	食品・飲料・タバコ
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10	10	179	28,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAFRAN SA	127	130	1,942	308,214	資本財
SANOFI	421	456	4,615	732,432	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株		千ユーロ	千円	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	184	191		953	151,318	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	200	219		3,068	486,904	資本財
SEB SA	9	9		85	13,580	耐久消費財・アパレル
SODEXO	32	32		315	50,030	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	298	309		646	102,544	銀行
TELEPERFORMANCE	22	22		243	38,641	商業・専門サービス
THALES SA	40	40		570	90,511	資本財
TOTALENERGIES SE	926	904		5,623	892,518	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	35	—		—	—	メディア・娯楽
VALEO SA	74	74		91	14,466	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	247	255		648	102,951	公益事業
VINCI SA	198	206		2,075	329,406	資本財
VIVENDI SE	260	260		219	34,811	メディア・娯楽
WENDEL	10	10		71	11,331	金融サービス
WORLDDLINE SA	89	89		84	13,374	金融サービス
小計	株数	金額				
	銘柄数	比率				
	56	54		59,495	9,441,945	
(ユーロ…オランダ)						
ABN AMRO BANK NV-CVA	151	151		192	30,562	銀行
ADYEN NV	8	8		558	88,707	金融サービス
AEGON LTD	696	—		—	—	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	384	400		1,114	176,915	生活必需品流通・小売り
AKZO NOBEL	69	69		426	67,617	素材
ARGENX SE	19	23		1,033	164,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASM INTERNATIONAL NV	17	19		742	117,797	半導体・半導体製造装置
ASML HOLDING NV	151	161		9,067	1,439,034	半導体・半導体製造装置
ASR NEDERLAND NV	—	58		202	32,193	保険
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	—	28		253	40,208	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	395	395		418	66,339	資本財
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	198	198		219	34,841	食品・飲料・タバコ
AIRBUS GROUP SE	218	235		2,950	468,275	資本財
EURONEXT NV	34	34		227	36,070	金融サービス
EXOR NV	41	41		338	53,659	金融サービス
FERRARI NV	44	50		1,427	226,608	自動車・自動車部品
FERROVIAL SE	—	178		492	78,103	資本財
STELLANTIS NV	832	907		1,614	256,168	自動車・自動車部品
HEINEKEN NV	96	113		970	153,947	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	36	48		355	56,359	食品・飲料・タバコ
IMCD NV	21	21		236	37,563	資本財
ING GROEP NV-CVA	1,469	1,469		1,769	280,783	銀行
JDE PEET'S NV	40	62		164	26,033	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	63	—		—	—	素材
KONINKLIJKE KPN NV	1,240	1,229		388	61,602	電気通信サービス
NN GROUP NV	102	102		302	48,080	保険
OCI NV	35	48		107	17,068	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV	325	367		639	101,471	ヘルスケア機器・サービス
PROSUS NV	307	627		1,655	262,787	一般消費財・サービス流通・小売り
RANDSTAD NV	46	46		227	36,176	商業・専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	—	272		1,012	160,744	半導体・半導体製造装置
JUST EAT TAKEAWAY	64	—		—	—	消費者サービス
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	277	314		801	127,214	メディア・娯楽
WOLTERS KLUWER	96	100		1,208	191,749	商業・専門サービス
小計	株数	金額				
	銘柄数	比率				
	30	31		31,119	4,938,690	
(ユーロ…スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	80	78		256	40,634	資本財
ACCIONA SA	8	8		96	15,253	公益事業
AENA SA	28	28		388	61,624	運輸

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
	株 数	株 数	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	
AMADEUS IT GROUP SA	170	183	991	157,372	消費者サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,505	2,417	1,796	285,072	銀行
BANCO SANTANDER SA	6,315	6,623	2,292	363,824	銀行
CELLNEX TELECOM SA	197	216	583	92,604	電気通信サービス
CAIXABANK S.A	1,630	1,630	592	93,981	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	110	111	163	25,963	公益事業
ENDESA SA	120	120	216	34,316	公益事業
ENAGAS SA	86	86	138	22,026	公益事業
FERROVIAL SA	184	—	—	—	資本財
NATURGY ENERGY GROUP SA	62	45	121	19,204	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	88	—	—	—	資本財
GRIFOLS SA	120	120	121	19,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA	2,204	2,445	2,574	408,606	公益事業
INDITEX	401	439	1,497	237,599	一般消費財・サービス流通・小売り
REDEIA CORP SA	155	155	236	37,471	公益事業
REPSOL SA	548	548	792	125,780	エネルギー
TELEFONICA SA	1,956	1,956	699	110,959	電気通信サービス
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 < 比 率 >	金 額 < 比 率 >	
	16,977	17,216	13,557	2,151,526	
(ユーロ…ベルギー)					
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	324	332	1,697	269,408	食品・飲料・タバコ
PROXIMUS	56	—	—	—	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV	13	13	122	19,486	公益事業
AGEAS	59	59	213	33,957	保険
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	34	34	237	37,690	金融サービス
KBC GROEP NV	97	97	499	79,341	銀行
D' IETEREN GROUP	8	10	144	22,995	一般消費財・サービス流通・小売り
SOLVAY SA	28	28	269	42,817	素材
SOFINA	6	6	114	18,159	金融サービス
UCB SA	49	49	355	56,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE	79	79	176	28,082	素材
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 < 比 率 >	金 額 < 比 率 >	
	756	710	3,833	608,310	
(ユーロ…オーストリア)					
ERSTE GROUP BANK AG	114	130	426	67,639	銀行
VERBUND AG	27	27	230	36,552	公益事業
OMV AG	54	54	223	35,517	エネルギー
VOESTALPINE AG	42	42	97	15,441	素材
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 < 比 率 >	金 額 < 比 率 >	
	239	255	977	155,151	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
AROUNDTOWN SA	359	—	—	—	不動産管理・開発
ARCELORMITTAL	191	205	429	68,167	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	50	50	230	36,657	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA	156	178	274	43,564	エネルギー
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 < 比 率 >	金 額 < 比 率 >	
	757	434	935	148,389	
(ユーロ…フィンランド)					
ELISA OYJ	54	60	241	38,310	電気通信サービス
FORTUM OYJ	167	167	183	29,142	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	109	109	165	26,261	生活必需品流通・小売り
KONE OYJ-B	122	136	537	85,341	資本財
METSO CORPORATION	—	242	214	34,019	資本財
NESTE OYJ	155	163	478	75,957	エネルギー
NOKIA OYJ	2,038	2,133	650	103,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORION OYJ-CLASS B	36	45	163	25,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ-A SHS	177	196	745	118,247	保険
STORA ENSO OYJ-R SHS	197	253	279	44,279	素材

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	195	210	672	106,775	素材
WARTSILA OYJ ABP	181	181	175	27,911	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	3,438	4,508	715,455	
	銘柄 数 < 比 率 >	11	12	< 0.2% >	
(ユーロ…アイルランド)					
AIB GROUP PLC	—	510	205	32,536	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	447	384	61,016	銀行
CRH PLC	284	—	—	—	素材
KERRY GROUP PLC-A	59	64	487	77,320	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	59	59	366	58,089	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	63	68	1,012	160,632	消費者サービス
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	90	90	270	42,871	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	556	2,725	432,467	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	6	< 0.1% >	
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,058	1,261	479	76,104	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	187	187	269	42,726	エネルギー
JERONIMO MARTINS	90	105	211	33,546	生活必需品流通・小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	1,336	960	152,377	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	< 0.1% >	
(ユーロ…スイス)					
DSM-FIRMENICH AG	—	75	576	91,421	素材
STMICROELECTRONICS NV	252	—	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	252	576	91,421	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	< 0.0% >	
(ユーロ…バミューダ)					
AEGON LTD	—	696	313	49,694	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	—	313	49,694	
	銘柄 数 < 比 率 >	—	1	< 0.0% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	68,728	174,073	27,625,461	
	銘柄 数 < 比 率 >	223	219	< 9.2% >	
(イギリス)			千イギリスポンド		
3I GROUP PLC	368	406	811	147,439	金融サービス
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	131	131	258	46,902	食品・飲料・タバコ
ADMIRAL GROUP PLC	67	67	168	30,548	保険
ANGLO AMERICAN PLC	466	540	1,122	203,975	素材
ANTOFAGASTA PLC	143	143	192	35,063	素材
ASTRAZENECA PLC	577	617	6,512	1,183,427	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHTED GROUP PLC	161	177	837	152,190	資本財
AUTO TRADER GROUP PLC	364	364	221	40,331	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC	45	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC	1,016	945	373	67,900	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	801	846	2,085	378,994	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,173	1,242	1,360	247,319	資本財
BARCLAYS PLC	6,134	6,397	852	154,875	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	407	407	163	29,687	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	45	45	178	32,465	耐久消費財・アパレル
BP PLC	7,209	7,036	3,762	683,704	エネルギー
BT GROUP PLC	2,677	2,677	298	54,324	電気通信サービス
BUNZL PLC	128	128	367	66,788	資本財
BURBERRY GROUP PLC	155	155	266	48,473	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	—	2,092	329	59,836	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI	76	76	165	30,142	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	666	722	1,478	268,691	消費者サービス
CRH PLC	—	300	1,340	243,518	素材
CRODA INTERNATIONAL PLC	50	61	253	46,135	素材
DCC PLC	38	38	169	30,723	資本財
DIAGEO PLC	850	904	2,844	516,923	食品・飲料・タバコ

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			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		
ENDEAVOUR MINING PLC	—	64	111	20,249	素材	
EXPERIAN PLC	339	374	907	164,914	商業・専門サービス	
GLENCORE PLC	3,676	4,178	1,837	333,910	素材	
GSK PLC	1,513	1,632	2,421	440,029	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ENTAIN PLC	214	248	230	41,814	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	130	130	90	16,391	金融サービス	
HALMA PLC	146	146	268	48,864	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HALEON PLC	1,946	2,182	730	132,684	家庭用品・パーソナル用品	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	57	112	20,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HSBC HOLDINGS PLC	7,492	7,890	4,853	881,980	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	331	387	673	122,410	食品・飲料・タバコ	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	64	74	442	80,393	消費者サービス	
INTERTEK GROUP PLC	60	60	240	43,674	商業・専門サービス	
INFORMA PLC	565	565	399	72,547	メディア・娯楽	
JD SPORTS FASHION PLC	973	973	122	22,325	一般消費財・サービス流通・小売り	
JOHNSON MATTHEY PLC	73	73	106	19,291	素材	
KINGFISHER PLC	781	781	157	28,639	一般消費財・サービス流通・小売り	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,256	2,256	466	84,757	保険	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	25,535	26,499	1,098	199,649	銀行	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	124	162	1,347	244,878	金融サービス	
M&G PLC	995	995	191	34,777	金融サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,629	504	235	42,789	資本財	
MONDI PLC	183	183	234	42,528	素材	
NATIONAL GRID PLC	1,349	1,405	1,372	249,340	公益事業	
NEXT PLC	46	56	388	70,685	一般消費財・サービス流通・小売り	
NMC HEALTH PLC	80	80	0	0	ヘルスケア機器・サービス	
OCADO GROUP PLC	226	226	104	18,950	生活必需品流通・小売り	
PERSIMMON PLC	124	124	119	21,710	耐久消費財・アパレル	
PEARSON PLC	260	260	240	43,711	消費者サービス	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	302	302	134	24,434	保険	
PRUDENTIAL PLC	1,017	1,107	921	167,492	保険	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	265	286	1,624	295,148	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	715	764	2,187	397,438	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	859	1,153	524	95,249	商業・専門サービス	
RIO TINTO PLC	420	447	2,306	419,131	素材	
NATWEST GROUP PLC	1,929	2,040	421	76,601	銀行	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,210	3,530	716	130,230	資本財	
SAINSBURY (J) PLC	706	706	178	32,369	生活必需品流通・小売り	
SAGE GROUP PLC/THE	388	388	374	68,095	ソフトウェア・サービス	
SCHRODERS PLC	302	303	109	19,899	金融サービス	
SSE PLC	398	436	702	127,597	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	90	90	232	42,188	公益事業	
SHELL PLC-NEW	2,780	2,709	7,363	1,338,148	エネルギー	
SMITHS GROUP PLC	136	136	212	38,525	資本財	
SMITH & NEPHEW PLC	315	339	311	56,549	ヘルスケア機器・サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	28	28	232	42,318	資本財	
ST JAMES'S PLACE PLC	205	205	125	22,798	金融サービス	
ABRDN PLC	885	885	134	24,457	金融サービス	
STANDARD CHARTERED PLC	954	954	681	123,805	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,240	1,240	132	23,992	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	2,778	2,880	784	142,537	生活必需品流通・小売り	
UNILEVER PLC	953	1,007	4,044	734,963	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	261	261	272	49,596	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	9,965	9,965	736	133,824	電気通信サービス	
WHITBREAD PLC	69	81	267	48,574	消費者サービス	
WISE PLC - A	—	214	143	26,055	金融サービス	
FERGUSON PLC	79	—	—	—	資本財	

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	金額	株数	金額	
(イギリス)	百株	百株	株数	金額	株数	金額	
WPP PLC	411	411	284	51,663	284	51,663	メディア・娯楽
小計	106,610	111,982	72,080	13,098,450	72,080	13,098,450	
	銘柄数 < 比率 >	80	82	< 4.4% >			
(スイス)			千スイスフラン				
ABB LTD-REG	612	612	1,825	305,781	1,825	305,781	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	55	68	229	38,471	229	38,471	商業・専門サービス
ALCON INC	186	195	1,263	211,599	1,263	211,599	ヘルスケア機器・サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	17	17	223	37,384	223	37,384	保険
CLARIANT AG-REG	79	79	98	16,510	98	16,510	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	987	—	—	—	—	—	金融サービス
DUFREY AG-REG	—	34	108	18,100	108	18,100	一般消費財・サービス流通・小売り
GEBERIT AG-REG	13	14	620	103,898	620	103,898	資本財
GIVAUDAN-REG	3	3	1,078	180,531	1,078	180,531	素材
HOLCIM LTD	206	222	1,239	207,545	1,239	207,545	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	84	84	449	75,351	449	75,351	金融サービス
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19	21	519	86,955	519	86,955	運輸
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.05	499	83,562	499	83,562	食品・飲料・タバコ
LONZA GROUP AG-REG	27	29	936	156,825	936	156,825	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG	1,051	1,071	10,561	1,768,646	10,561	1,768,646	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG	806	822	7,058	1,181,948	7,058	1,181,948	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	9	859	143,962	859	143,962	金融サービス
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	195	205	2,199	368,380	2,199	368,380	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	261	282	6,699	1,121,918	6,699	1,121,918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SANDOZ GROUP AG	—	164	423	70,966	423	70,966	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	13	14	268	44,958	268	44,958	資本財
SGS SA-REG	2	59	443	74,290	443	74,290	商業・専門サービス
SIKA AG-REG	55	56	1,203	201,471	1,203	201,471	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	20	20	435	72,916	435	72,916	ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11	12	730	122,354	730	122,354	保険
SWISSCOM AG-REG	9	10	546	91,569	546	91,569	電気通信サービス
SWISS RE AG	113	122	1,200	201,017	1,200	201,017	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	11	11	258	43,236	258	43,236	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	1,301	1,325	2,841	475,763	2,841	475,763	金融サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	56	60	2,563	429,215	2,563	429,215	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	175	29,323	175	29,323	食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	15	152	25,539	152	25,539	銀行
BACHEM HOLDING AG	14	14	89	15,016	89	15,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BKW AG	—	8	129	21,732	129	21,732	公益事業
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2	2	162	27,128	162	27,128	素材
HELVETIA HOLDING AG-REG	—	13	158	26,503	158	26,503	保険
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.4	0.4	400	67,050	400	67,050	食品・飲料・タバコ
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	66	66	464	77,846	464	77,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	10	12	324	54,315	324	54,315	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	10	10	186	31,303	186	31,303	資本財
SIG GROUP AG	109	109	212	35,520	212	35,520	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	40	43	491	82,290	491	82,290	ヘルスケア機器・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	27	34	284	47,683	284	47,683	不動産管理・開発
TEMENOS AG	22	22	146	24,481	146	24,481	ソフトウェア・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	18	19	85	14,237	85	14,237	耐久消費財・アパレル
VAT GROUP AG	10	10	329	55,189	329	55,189	資本財
小計	6,547	6,018	51,178	8,570,298	51,178	8,570,298	
	銘柄数 < 比率 >	41	45	—	< 2.8% >		
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ				
ALFA LAVAL AB	107	107	3,764	50,671	3,764	50,671	資本財
ASSA ABLOY AB-B	374	429	10,013	134,783	10,013	134,783	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,029	1,113	15,962	214,851	15,962	214,851	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	534	568	7,088	95,415	7,088	95,415	資本財
BEIJER REF AB	—	154	1,569	21,127	1,569	21,127	資本財

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	金額		評価額	
						外貨建金額
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
BOLIDEN AB	102	102	2,868	38,614	素材	
ELECTROLUX AB-B	80	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
EMBRACER GROUP AB	239	—	—	—	メディア・娯楽	
EPIROC AB-A	249	315	6,071	81,722	資本財	
EPIROC AB-B	154	154	2,515	33,855	資本財	
EQT AB	106	144	2,916	39,249	金融サービス	
ERICSSON LM-B SHS	1,076	1,149	5,693	76,634	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	236	236	5,629	75,778	家庭用品・パーソナル用品	
EVOLUTION AB	67	71	7,522	101,255	消費者サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	232	232	1,015	13,664	不動産管理・開発	
GETINGE AB-B SHS	76	94	1,867	25,136	ヘルスケア機器・サービス	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	278	278	4,149	55,850	一般消費財・サービス流通・小売り	
HEXAGON AB-B SHS	719	809	7,656	103,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLMEN AB-B SHARES	35	35	1,440	19,382	素材	
HUSQVARNA AB-B SHS	150	150	1,068	14,387	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	59	59	1,672	22,513	金融サービス	
INVESTOR AB-B SHS	693	693	14,008	188,557	金融サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	49	49	1,400	18,850	金融サービス	
INVESTOR AB-A SHS	191	—	—	—	金融サービス	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	68	68	1,261	16,978	資本財	
INDUTRADE AB	101	101	1,908	25,684	資本財	
KINNEVIK AB - B	82	—	—	—	金融サービス	
LIFCO AB-B SHS	84	84	1,633	21,991	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	22	35	1,602	21,575	金融サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	564	630	3,971	53,456	資本財	
NORDEA BANK ABP	1,260	1,311	15,408	207,391	銀行	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	624	624	7,703	103,685	銀行	
SANDVIK AB	389	408	7,673	103,278	資本財	
SAAB AB-B	—	27	1,594	21,455	資本財	
SAGAX AB-B	79	79	1,507	20,292	不動産管理・開発	
SECURITAS AB-B SHS	94	177	1,617	21,768	商業・専門サービス	
SECURITAS AB-B SHS(N)	83	—	—	—	商業・専門サービス	
SKANSKA AB-B SHS	143	143	2,294	30,883	資本財	
SKF AB-B SHARES-B	140	140	2,471	33,267	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	226	226	3,372	45,394	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	534	601	5,773	77,717	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	345	345	6,619	89,102	銀行	
SWEDISH MATCH AB	567	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	71	81	1,756	23,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELE2 AB-B SHS	232	232	1,819	24,485	電気通信サービス	
TELIA CO AB	942	1,185	2,825	38,034	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS-B	566	584	12,761	171,764	資本財	
VOLVO AB-A SHS	71	95	2,119	28,528	資本財	
VOLVO CAR AB-B	204	204	862	11,606	自動車・自動車部品	
小計	株数	金額	14,348	14,343	194,454	2,617,352
銘柄数 < 比率 >	47	43	—	—	< 0.9% >	—
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
ADEVINTA ASA	114	114	1,087	14,562	メディア・娯楽	
AKER BP ASA	121	121	3,759	50,339	エネルギー	
DNB BANK ASA	358	358	7,169	95,992	銀行	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	74	74	1,213	16,242	保険	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	39	1,863	24,951	資本財	
MOWI ASA	163	163	2,894	38,762	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO A S	506	506	3,036	40,659	素材	
ORKLA ASA	259	322	2,620	35,090	食品・飲料・タバコ	
SALMAR ASA	21	35	1,819	24,361	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	364	390	14,437	193,313	エネルギー	
TELENOR ASA	239	239	2,772	37,129	電気通信サービス	

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	
(ノルウェー)	百株	百株		千ノルウェークローネ	千円	
YARA INTERNATIONAL ASA	66	66		2,402	32,169	素材
小 計	株数・金額	2,288	2,431	45,076	603,575	
	銘柄数<比率>	11	12		<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	1	1		2,252	47,882	運輸
AP MOELLER - MAERSK A/S - A	1	1		1,302	27,700	運輸
CARLSBERG AS-B	36	39		3,398	72,253	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	38	38		1,625	34,557	素材
COLOPLAST-B	44	50		3,668	78,002	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	266	266		4,143	88,081	銀行
ORSTED A/S	70	75		2,517	53,511	公益事業
DSV A/S	69	78		7,691	163,514	運輸
GENMAB A/S	24	25		5,252	111,676	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	-		-	-	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	617	1,311		90,808	1,930,583	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	72	81		2,268	48,222	素材
PANDORA A/S	33	33		2,692	57,239	耐久消費財・アパレル
ROCKWOOL A/S-B SHS	3	3		482	10,266	資本財
TRYG A/S	139	139		1,913	40,690	保険
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	382	414		6,127	130,269	資本財
DEMANT A/S	36	36		961	20,437	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株数・金額	1,888	2,597	137,106	2,914,890	
	銘柄数<比率>	17	16		<1.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	1,103	1,207		3,001	283,345	銀行
APA GROUP	458	458		369	34,900	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	220	235		949	89,623	消費者サービス
ASX LTD	71	71		395	37,287	金融サービス
BHP GROUP LTD	1,892	2,035		9,104	859,365	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	183	183		338	31,955	素材
BRAMBLES LTD	547	547		783	73,965	商業・専門サービス
AMPOL LTD	87	87		289	27,283	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	639	671		6,533	616,729	銀行
COCHLEAR LTD	25	29		720	68,006	ヘルスケア機器・サービス
COMPUTERSHARE LTD	209	209		526	49,717	商業・専門サービス
COLES GROUP LTD	492	579		865	81,739	生活必需品流通・小売り
CSL LTD	179	192		4,534	428,057	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	-		-	-	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	504	504		251	23,720	生活必需品流通・小売り
EVOLUTION MINING LTD	690	-		-	-	素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD	640	659		1,451	137,002	素材
IDP EDUCATION LTD	72	101		214	20,215	消費者サービス
IGO LTD	-	243		263	24,886	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	951	951		538	50,820	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	169	169		663	62,590	素材
LOTTERY CORP LTD/THE	855	855		382	36,097	消費者サービス
MACQUARIE GROUP LTD	136	146		2,387	225,324	金融サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,084	1,084		378	35,719	保険
MINERAL RESOURCES LTD	62	73		439	41,518	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,194	1,241		3,516	331,956	銀行
NEWCREST MINING LTD	323	-		-	-	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	421	421		510	48,186	素材
ORIGIN ENERGY LTD	683	683		621	58,683	公益事業
ORICA LIMITED	176	176		260	24,591	素材
PILBARA MINERALS LTD	-	1,145		444	41,944	素材
QANTAS AIRWAYS LTD	350	350		169	15,970	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	552	552		849	80,201	保険
AURIZON HOLDINGS LTD	735	735		253	23,888	運輸

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	71	71	351	33,203	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	18	18	278	26,318	メディア・娯楽	
REECE LTD	102	102	179	16,906	資本財	
RIO TINTO LTD	140	148	1,727	163,062	素材	
SANTOS LTD	1,216	1,216	945	89,226	エネルギー	
SEEK LTD	128	128	273	25,855	メディア・娯楽	
SONIC HEALTHCARE LTD	176	176	508	47,957	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	1,698	2,077	675	63,742	素材	
SUNCORP GROUP LTD	442	440	594	56,113	保険	
TELSTRA GROUP LTD	—	1,642	635	60,011	電気通信サービス	
TELSTRA GROUP LTD	1,449	—	—	—	電気通信サービス	
TRANSURBAN GROUP	1,136	1,299	1,554	146,753	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	279	279	333	31,476	食品・飲料・タバコ	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	83	83	285	26,908	金融サービス	
WESTPAC BANKING CORP	1,313	1,406	2,925	276,141	銀行	
WESFARMERS LTD	409	478	2,431	229,555	一般消費財・サービス流通・小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	59	59	354	33,499	ソフトウェア・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	439	491	1,749	165,135	生活必需品流通・小売り	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	712	759	2,649	250,110	エネルギー	
XERO LTD	49	59	646	61,010	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	25,662	27,543	61,111	5,768,282	
	銘柄 数 < 比 率 >	51	50	—	< 1.9% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	471	471	357	31,023	運輸	
EBOS GROUP LTD	—	56	196	17,106	ヘルスケア機器・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	231	231	476	41,401	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	459	578	280	24,395	公益事業	
MERCURY NZ LTD	204	341	200	17,392	公益事業	
SPARK NEW ZEALAND LTD	765	765	381	33,169	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,132	2,444	1,893	164,488	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	< 0.1% >	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	4,491	4,603	30,846	592,554	保険	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,345	1,480	3,048	58,567	銀行	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	679	992	19,069	食品・飲料・タバコ	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	250	250	910	17,481	公益事業	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	977	1,032	4,050	77,818	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	730	805	3,132	60,183	不動産管理・開発	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	570	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
CLP HOLDINGS LTD	595	630	3,543	68,075	公益事業	
ESR GROUP LTD	758	758	804	15,463	不動産管理・開発	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	810	910	3,999	76,829	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	780	801	15,403	不動産管理・開発	
HANG SENG BANK LTD	291	291	2,589	49,751	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	579	579	1,184	22,746	不動産管理・開発	
HKT TRUST AND HKT LTD	1,500	1,500	1,215	23,340	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS	495	580	2,160	41,503	公益事業	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	950	—	—	—	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	4,032	4,562	2,495	47,940	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	446	483	13,437	258,125	金融サービス	
MTR CORP	575	625	1,862	35,778	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	616	616	876	16,845	不動産管理・開発	
SANDS CHINA LTD	966	966	2,057	39,526	消費者サービス	
SINO LAND CO	1,230	1,230	1,071	20,588	不動産管理・開発	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	520	520	619	11,907	運輸	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	524	604	4,808	92,364	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	175	175	857	16,471	不動産管理・開発	
SWIRE PROPERTIES LTD	416	416	614	11,795	不動産管理・開発	

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	
(香港)	百株	百株		千香港ドル	千円	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	525	525		3,693	70,949	資本財
WH GROUP LTD	2,998	2,998		1,301	25,002	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	638	638		1,764	33,887	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	710	710		638	12,261	資本財
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,175	29,949	95,379	1,832,233	
		30	28	—	<0.6%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	1,050	1,050		316	34,610	不動産管理・開発
CITY DEVELOPMENTS LTD	173	173		107	11,802	不動産管理・開発
DBS GROUP HOLDINGS LTD	673	711		2,360	258,456	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	2,111	2,111		180	19,765	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	533	685		425	46,624	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,240	1,342		1,723	188,755	銀行
SEATRUM LTD	—	14,881		169	18,578	資本財
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	—	302		138	15,180	公益事業
SINGAPORE AIRLINES LTD	539	539		333	36,478	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	252	425		402	44,121	金融サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,047	3,544		843	92,389	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	633	633		238	26,064	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	418	499		1,383	151,477	銀行
UOL GROUP LTD	155	155		89	9,757	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	99	—		—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD	739	739		255	27,942	食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,665	27,793	8,967	982,005	
		14	15	—	<0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
AZRIELI GROUP LTD	17	17		307	11,352	不動産管理・開発
BANK LEUMI LE-ISRAEL	625	625		1,562	57,725	銀行
BANK HAPOALIM BM	411	504		1,434	53,007	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	687	—		—	—	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	10	10		770	28,463	資本財
ICL GROUP LTD	260	260		516	19,078	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	483	483		827	30,591	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	49	69		810	29,932	銀行
NICE LTD	24	24		1,565	57,837	ソフトウェア・サービス
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	37	—		—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,606	1,996	7,793	287,988	
		10	8	—	<0.1%>	
合 計	株数・金額 銘柄数<比率>	414,859	451,878	—	292,245,103	
		1,211	1,214	—	<97.1%>	

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

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

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	5,690	6,910	635	95,525	0.0	
PROLOGIS INC	34,365	37,145	3,667	551,181	0.2	
AMERICAN TOWER CORP	17,089	18,549	3,003	451,386	0.2	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11,180	12,110	395	59,510	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,557	18,847	284	42,683	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,220	5,790	956	143,726	0.0	
BOSTON PROPERTIES INC	5,717	5,717	298	44,813	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	4,810	440	66,133	0.0	
CROWN CASTLE INC	16,040	16,330	1,424	214,142	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,635	11,695	1,367	205,560	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	6,550	422	63,420	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,340	15,450	861	129,441	0.0	
EQUINIX INC	3,368	3,728	2,543	382,220	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	2,480	521	78,362	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,960	8,800	907	136,319	0.0	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,370	11,340	511	76,875	0.0	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	20,375	334	50,216	0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,000	14,810	214	32,227	0.0	
WELLTOWER INC	16,750	20,360	1,683	252,945	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	27,179	423	63,717	0.0	
INVITATION HOMES INC	22,810	25,700	779	117,101	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	10,895	13,365	780	117,235	0.0	
KIMCO REALTY CORP	21,830	23,760	389	58,487	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	—	—	—	—	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	4,300	547	82,313	0.0	
PUBLIC STORAGE	5,919	6,319	1,503	225,999	0.1	
REALTY INCOME CORP	22,221	28,201	1,389	208,850	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	6,005	6,005	347	52,178	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,030	4,175	817	122,792	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	12,114	13,394	1,406	211,309	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	4,640	4,640	477	71,800	0.0	
UDR INC	12,100	12,100	411	61,807	0.0	
VENTAS INC	14,895	17,025	703	105,717	0.0	
VICI PROPERTIES INC	35,610	39,120	1,078	162,023	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	6,851	—	—	—	—	
WEYERHAEUSER CO	27,758	29,998	858	128,976	0.0	
WP CAREY INC	7,310	8,610	452	67,943	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	483,323	505,687	32,838	4,934,949	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	35	—	< 1.6% >	
(カナダ)			千カナダドル			
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	2,800	116	12,646	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,800	2,800	116	12,646	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
COVIVIO	1,925	1,925	71	11,376	0.0	
GECINA SA	1,950	1,950	173	27,573	0.0	
KLEPIERRE	8,402	8,402	185	29,414	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	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,160	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	4,990	212	33,687	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	16,437 4	17,267 4	643 —	102,052 <0.0%>
(ユーロ…ベルギー)					
WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	7,730	175	27,798	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	5,160 1	7,730 1	175 —	27,798 <0.0%>
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	21,597 5	24,997 5	818 —	129,850 <0.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	26,624	148	27,064	0.0
SEGRO PLC	45,033	45,033	308	56,089	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	102,258 3	71,657 2	457 —	83,153 <0.0%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	154,902	154,902	266	25,148	0.0
DEXUS/AU	42,067	42,067	281	26,603	0.0
GOODMAN GROUP	63,582	70,642	1,464	138,225	0.0
GPT GROUP	71,335	71,335	258	24,441	0.0
LENLEASE GROUP	23,367	23,367	147	13,917	0.0
MIRVAC GROUP	135,075	159,875	310	29,351	0.0
SCENTRE GROUP	198,271	198,271	481	45,476	0.0
STOCKLAND	82,300	102,400	373	35,279	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	770,899 8	822,859 8	3,585 —	338,444 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	77,300	104,160	3,739	71,832	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	77,300 1	104,160 1	3,739 —	71,832 <0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	138,243	346	37,998	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	209,556	356	39,012	0.0
KEPPEL REIT(N)	—	13,712	10	1,186	0.0
MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	106,000	137	15,090	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	144,556	212	23,270	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	598,355 4	612,067 5	1,064 —	116,558 <0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,056,532 59	2,144,227 57	—	5,687,435 <1.9%>

(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	491	—
		SP EMINI	2,530	—

(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

(2023年10月26日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
	千円	%
株式	292,245,103	96.5
投資証券	5,687,435	1.9
コール・ローン等、その他	4,915,984	1.6
投資信託財産総額	302,848,522	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（298,846,128千円）の投資信託財産総額（302,848,522千円）に対する比率は98.7%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=150.28円、1カナダドル=108.83円、1ユーロ=158.70円、1イギリスポンド=181.72円、1スイスフラン=167.46円、1スウェーデンクローナ=13.46円、1ノルウェークローネ=13.39円、1デンマーククローネ=21.26円、1オーストラリアドル=94.39円、1ニュージーランドドル=86.89円、1香港ドル=19.21円、1シンガポールドル=109.51円、1イスラエルシェケル=36.9505円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	305,331,567,564	
コール・ローン等	4,147,078,572	
株式(評価額)	292,245,103,382	
投資証券(評価額)	5,687,435,505	
未収入金	2,623,471,915	
未取配当金	214,263,884	
差入委託証拠金	414,214,306	
(B) 負債	4,443,283,441	
未払金	2,566,255,389	
未払解約金	1,877,026,677	
未払利息	1,375	
(C) 純資産総額(A-B)	300,888,284,123	
元本	60,617,205,489	
次期繰越損益金	240,271,078,634	
(D) 受益権総口数	60,617,205,489口	
1万口当たり基準価額(C/D)	49,637円	

(注) 当ファンドの期首元本額は58,419,890,528円、期中追加設定元本額は10,020,807,446円、期中一部解約元本額は7,823,492,485円です。

(注) 2023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)	33,033,504,086円
・グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	8,685,455,095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)	5,869,865,622円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,205,726,915円
・日興五大陸株式ファンド	3,477,499,117円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,338,394,962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	1,254,888,146円
・DCインデックスバランス(株式80)	811,294,314円
・DCインデックスバランス(株式60)	674,344,956円
・DCインデックスバランス(株式40)	313,862,875円
・Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス(全世界株式)	300,017,123円
・インデックスファンドMSCIオール・カンントリー(全世界株式)	233,610,327円
・DCインデックスバランス(株式20)	113,435,960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)	75,144,450円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	73,782,515円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	73,311,676円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	46,137,440円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	15,811,296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)	13,258,596円
・Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	7,448,649円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	263,039円
・Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	148,330円

(注) 1口当たり純資産額は4,9637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し処理しています。

○損益の状況（2022年10月27日～2023年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	5,585,318,199	
受取配当金	5,537,318,611	
受取利息	59,800	
その他収益金	48,859,809	
支払利息	△ 920,021	
(B) 有価証券売買損益	27,644,050,037	
売買益	45,676,623,662	
売買損	△ 18,032,573,625	
(C) 先物取引等取引損益	465,462,880	
取引益	962,836,644	
取引損	△ 497,373,764	
(D) 保管費用等	△ 56,022,234	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	33,638,808,882	
(F) 前期繰越損益金	199,629,511,096	
(G) 追加信託差損益金	35,603,058,528	
(H) 解約差損益金	△ 28,600,299,872	
(I) 計(E+F+G+H)	240,271,078,634	
次期繰越損益金(I)	240,271,078,634	

(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。

〇お知らせ

約款変更について

2022年10月27日から2023年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、2023年4月26日付けにて運用目標とするベンチマークを「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」から「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）」に変更いたしました。

当ファンドに関して、実際の運用においては保有資産から配当を受け取るため、当ファンドの基準価額は「配当込み」の値動きとなる一方で、運用目標とするベンチマークを構成する指数については、一般に広く認知されている指数が配当を含まないものであったことなどを理由として、「配当抜き」の値動きとなる指数を採用して参りました。こうしたことが要因の一つとなって、当ファンドの基準価額とベンチマークの値動きに乖離が生じておりました。このたび、当該乖離を是正することが受益者にとってより適切な投資判断につながるとの考えから、運用実態に則して当ファンドのベンチマークを「配当込み」の指数へ変更いたしました。

なお、投資する海外資産から配当を受け取る際に税金が控除されることから、運用実態に則して「税引後配当込み」の指数へ変更いたしました。（付表）