

運用報告書 (全体版)

D I AMパッシブ資産分散ファンド

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12月28日から無期限です。	
運用方針	安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざします。	
主要投資対象	D I AMパッシブ資産分散ファンド	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、インデックス225 マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	海外の公社債を主要投資対象とします。
	インデックス225マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
運用方法	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 [※] を主要投資対象とします。 ※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券
	各マザーファンドへの投資に当たっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（以下、「基本リスクウェイト」といいます。）に基づき算出された資産構成比に従い、配分します。 基本リスクウェイトは、各資産の時価およびボラティリティをもとに、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社が定期的に計測します。計測の結果、原則として、基本リスクウェイトから信託財産におけるいずれかの資産のリスクウェイトが5%以上乖離した場合にはリバランスを行います。 実質組入外貨建資産については、為替ヘッジは行いません。	
組入制限	マザーファンドへの投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。	
分配方針	毎決算時（原則として、奇数月の各6日。休業日の場合は翌営業日。）に、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等のうち、原則として利子・配当等収益の範囲内で行います。また、毎年5月および11月の決算時には、原則として利子・配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。但し、分配対象額が少額の場合には、分配を行わない場合があります。	

愛称 **三木の久**

第105期 <決算日 2023年7月6日>
第106期 <決算日 2023年9月6日>
第107期 <決算日 2023年11月6日>

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「D I AMパッシブ資産分散ファンド」は、2023年11月6日に第107期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<https://www.am-one.co.jp/>

DIAMパッシブ資産分散ファンド

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			株式組 比率	株式 先物 比率	債券 組入 比率	債券 先物 比率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率						
第32作成期	93期(2021年7月6日)	円 10,686	円 20	% 1.8	% 17.8	% 0.6	% 61.9	% -	% 17.4	百万円 3,942
	94期(2021年9月6日)	10,820	20	1.4	17.6	0.6	64.3	-	15.4	3,891
	95期(2021年11月8日)	10,981	20	1.7	17.2	0.4	65.5	-	15.1	3,849
第33作成期	96期(2022年1月6日)	10,920	20	△0.4	16.9	0.3	65.4	-	15.0	3,753
	97期(2022年3月7日)	10,295	20	△5.5	15.9	0.5	66.9	-	15.1	3,523
	98期(2022年5月6日)	10,757	20	4.7	16.8	0.4	66.2	-	14.2	3,606
第34作成期	99期(2022年7月6日)	10,735	20	△0.0	16.1	0.3	65.8	-	13.2	3,557
	100期(2022年9月6日)	10,823	20	1.0	17.0	0.4	67.0	-	13.4	3,541
	101期(2022年11月7日)	10,699	20	△1.0	17.5	0.4	67.6	-	12.5	3,461
第35作成期	102期(2023年1月6日)	10,119	20	△5.2	16.6	0.3	68.6	-	12.4	3,238
	103期(2023年3月6日)	10,405	20	3.0	18.8	0.4	63.3	-	15.1	3,277
	104期(2023年5月8日)	10,671	20	2.7	18.3	0.6	64.4	-	14.1	3,328
第36作成期	105期(2023年7月6日)	11,316	20	6.2	18.7	0.5	63.8	-	14.4	3,497
	106期(2023年9月6日)	11,372	20	0.7	18.8	0.4	64.8	-	13.8	3,472
	107期(2023年11月6日)	11,330	20	△0.2	18.1	0.5	63.9	-	15.3	3,411

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは、外国債券、国内株式及び外国不動産投資信託証券(リート)に投資を行い、安定的なインカムゲインの確保に加え、キャピタルゲインの獲得をめざして運用しております。

上記資産を組合わせた適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

(注6) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株式組入 比 率	株式先物 比 率	債券組入 比 率	債券先物 比 率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		円	騰 落 率					
第105期	(期 首) 2023年 5 月 8 日	10,671	—	18.3	0.6	64.4	—	14.1
	5 月 末	10,855	1.7	18.9	0.5	64.2	—	13.8
	6 月 末	11,397	6.8	19.6	0.4	64.0	—	14.1
	(期 末) 2023年 7 月 6 日	11,336	6.2	18.7	0.5	63.8	—	14.4
第106期	(期 首) 2023年 7 月 6 日	11,316	—	18.7	0.5	63.8	—	14.4
	7 月 末	11,216	△0.9	19.3	0.4	63.5	—	14.5
	8 月 末	11,391	0.7	18.8	0.5	64.8	—	13.8
	(期 末) 2023年 9 月 6 日	11,392	0.7	18.8	0.4	64.8	—	13.8
第107期	(期 首) 2023年 9 月 6 日	11,372	—	18.8	0.4	64.8	—	13.8
	9 月 末	11,123	△2.2	17.9	0.5	63.8	—	15.0
	10 月 末	10,940	△3.8	18.0	0.4	64.7	—	14.6
	(期 末) 2023年 11 月 6 日	11,350	△0.2	18.1	0.5	63.9	—	15.3

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

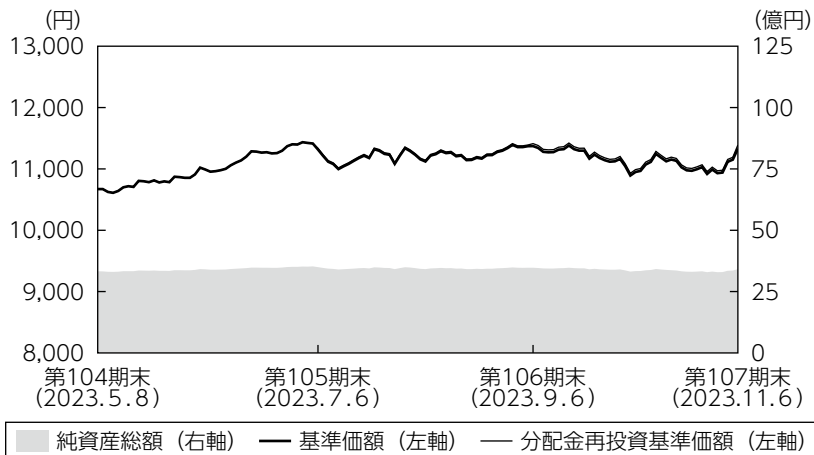
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■第105期～第107期の運用経過（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

インフレの抑制を目的とした主要国の金融引き締め等を背景に主要国の長期金利が上昇したこと等がマイナスに寄与しました。一方、金融政策の方向性の違いが意識されたこと等から主要通貨に対して円安となったこと、企業決算が概ね良好な結果となったことや米国の底堅い景況感等から国内株式市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、当作成期の基準価額は上昇しました。

◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.2%
インデックス225 マザーファンド	14.0%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.3%

投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ国債の利回りはともに上昇（価格は下落）しました。米国債は、米国の堅調な経済指標により米金融引き締め長期化観測が高まったことなどを受けて利回りは上昇しました。ドイツ国債についても、インフレ抑制のためECB（欧州中央銀行）が金融引き締めを継続したことなどから利回りは上昇しました。

国内株式市場は上昇しました。作成期初、海外投資家からの買いが継続したことや円安ドル高の進行が好感されたことなどから、上昇基調でスタートしました。その後、2023年7月に日銀が長短金利操作の運用を柔軟化したことを受け、国内長期金利の上昇懸念が台頭したことから、上値の重い状況へと転じました。10月には、中東情勢の緊迫化などが嫌気され急落する場面もありましたが、作成期末にかけては、米国の経済指標の鈍化傾向を受けた米国追加金融引き締め懸念の後退などが好感され、急反発する展開となりました。

外国リート市場（現地通貨建て）はまちまちの結果となりました。米国リート市場は作成期半ばにコアCPI（消費者物価指数）の伸び鈍化からFRB（米連邦準備理事会）の利上げ継続観測が後退し上昇しましたが、作成期後半にFOMC（米連邦公開市場委員会）で高金利長期化が示唆され下落しました。欧州リート市場は作成期前半に英中央銀行が利上げ幅を再拡大したことなどを背景に下落しました。オーストラリアリート市場は同国の長期金利が米国金利に連れ高し、作成期末にかけて下落しました。

ドル/円相場は、内外金利差の拡大や内外の金融政策の方向性の違いが意識されたこと等を背景に円安ドル高基調の動きとなりました。その他主要通貨に対しても、内外金利差の拡大等を背景に円安現地通貨高となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

マザーファンドへの投資を通じ、外国債券、国内株式、外国リーートの3資産に投資を行いました。各マザーファンドへの投資にあたっては、各資産の信託財産におけるリスク量が均等となる比率（基本リスクウェイト：各々約33%）に基づき算出された資産構成比に従い分散投資を行いました。

【運用状況】

○各資産のリスク量

※1 リスクウェイトはみずほ第一フィナンシャルテクノロジーが計測。

※2 リスクウェイトの乖離につきましては、基本リスクウェイトへ近づけるオペレーションを実施します。

前作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 リスクウェイト	差
外国債券	33.3%	33.3%	33.3%	△0.0%
国内株式	36.2%	33.3%	33.3%	2.8%
外国リート	30.5%	33.3%	33.3%	△2.8%
合計	100.0%	100.0%	100.0%	0.0%



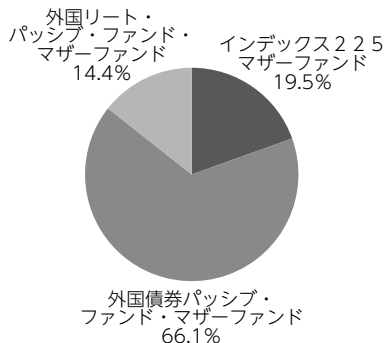
当作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 リスクウェイト	差
外国債券	33.9%	33.3%	33.3%	0.6%
国内株式	32.4%	33.3%	33.3%	△0.9%
外国リート	33.7%	33.3%	33.3%	0.3%
合計	100.0%	100.0%	100.0%	0.0%

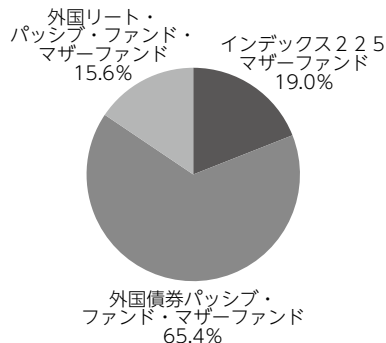
○マザーファンド組入比率

※比率は組入れているマザーファンドの時価評価額の合計に対する割合です。

前作成期末



当作成期末



●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●インデックス225マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入れ替え等にも適宜対応しました。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

分配金

当作成期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	第105期	第106期	第107期
	2023年5月9日 ～2023年7月6日	2023年7月7日 ～2023年9月6日	2023年9月7日 ～2023年11月6日
当期分配金（税引前）	20円	20円	20円
対基準価額比率	0.18%	0.18%	0.18%
当期の収益	20円	20円	20円
当期の収益以外	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	1,368円	1,423円	1,440円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

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

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

今後の運用方針

●当ファンド

今後も各資産のリスク量が均等になるよう、各マザーファンドへの投資を実施します。マザーファンドの組入比率についても、高位を維持する方針です。

●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

●インデックス225マザーファンド

引き続き、財務リスク等を考慮しつつ、日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果をめざします。

●外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしてパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第105期～第107期		項目の概要
	(2023年5月9日 ～2023年11月6日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	61円	0.547%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,124円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(27)	(0.241)	
(販売会社)	(30)	(0.274)	
(受託会社)	(4)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(d) その他費用	1	0.010	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	(1)	(0.008)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	62	0.560	

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

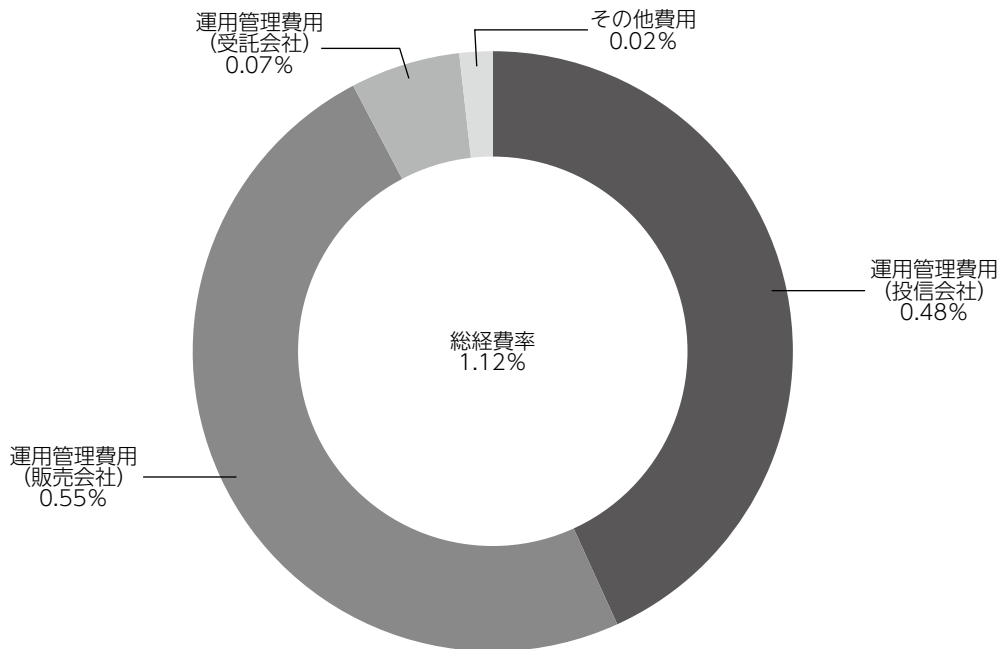
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

◆総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.12%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

	第 105 期 ~ 第 107 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	-	-	41,423	91,000
インデックス225マザーファンド	-	-	31,687	86,000
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	33,944	60,000	14,422	25,000

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第 105 期 ~ 第 107 期
	インデックス225マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	68,712,417千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	142,194,307千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.48

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年5月9日から2023年11月6日まで）

【D I AMパッシブ資産分散ファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第 105 期 ~ 第 107 期
売買委託手数料総額 (A)	49千円
うち利害関係人への支払額 (B)	5千円
(B)/(A)	11.0%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

【インデックス225 マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	第 105 期 ~ 第 107 期			第 105 期 ~ 第 107 期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 40,202	百万円 4,485	% 11.2	百万円 28,509	百万円 142	% 0.5
株 式 先 物 取 引	58,306	58,306	100.0	58,667	58,667	100.0

平均保有割合 0.5%

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

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	第 105 期 ~ 第 107 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 9	百万円 6	百万円 39

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	第 105 期 ~ 第 107 期	
	買 付 額	
株 式	百万円 4	

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

期中の利害関係人との取引等はありません。

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、当作成期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	第 35 作 成 期 末		第 36 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
				千円
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,031,313	989,890	2,205,872	
インデックス 2 2 5 マザーファンド	263,162	231,475	641,208	
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	284,697	304,219	524,657	

■投資信託財産の構成

2023年11月6日現在

項 目	第 36 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,205,872	64.4
インデックス 2 2 5 マザーファンド	641,208	18.7
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	524,657	15.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	52,467	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	3,424,205	100.0

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

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2023年11月6日現在、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは244,096,292千円、99.3%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは72,559,496千円、97.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年11月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.67円、1カナダ・ドル=109.54円、1オーストラリア・ドル=97.50円、1香港・ドル=19.13円、1シンガポール・ドル=110.63円、1ニュージーランド・ドル=89.65円、1イギリス・ポンド=185.07円、1イスラエル・シケル=38.15円、1デンマーク・クローネ=21.50円、1ノルウェー・クローネ=13.55円、1スウェーデン・クローナ=13.74円、1メキシコ・ペソ=8.57円、100韓国・ウォン=11.44円、1オフショア・人民元=20.528円、1マレーシア・リンギット=31.961円、1ポーランド・ズロチ=36.011円、1ユーロ=160.48円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年7月6日)、 (2023年9月6日)、 (2023年11月6日)現在

項 目	第 105 期 末	第 106 期 末	第 107 期 末
(A) 資 産	3,509,562,652円	3,484,566,363円	3,424,205,876円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	53,385,124	44,438,270	52,467,704
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,256,720,240	2,277,759,035	2,205,872,019
インデックス2.2.5マザーファンド(評価額)	673,264,501	667,333,058	641,208,919
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	506,192,787	479,036,000	524,657,234
未 収 入 金	20,000,000	16,000,000	—
(B) 負 債	12,237,143	12,547,685	12,246,028
未 払 収 益 分 配 金	6,180,972	6,106,519	6,022,694
未 払 解 約 金	11	—	407
未 払 信 託 報 酬	6,036,868	6,420,646	6,203,108
そ の 他 未 払 費 用	19,292	20,520	19,819
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	3,497,325,509	3,472,018,678	3,411,959,848
元 本	3,090,486,389	3,053,259,778	3,011,347,056
次 期 繰 越 損 益 金	406,839,120	418,758,900	400,612,792
(D) 受 益 権 総 口 数	3,090,486,389口	3,053,259,778口	3,011,347,056口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	11,316円	11,372円	11,330円

(注) 第104期末における元本額は3,118,925,798円、当作成期間(第105期～第107期)中における追加設定元本額は16,620,662円、同解約元本額は124,199,404円です。

■損益の状況

〔自 2023年5月9日〕
〔至 2023年7月6日〕

〔自 2023年7月7日〕
〔至 2023年9月6日〕

〔自 2023年9月7日〕
〔至 2023年11月6日〕

項 目	第 105 期	第 106 期	第 107 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,341円	△6,108円	△3,585円
受 取 利 息	111	183	141
支 払 利 息	△5,452	△6,291	△3,726
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	210,566,108	29,378,500	△124,359
売 買 益	211,611,856	31,401,653	20,668,425
売 買 損	△1,045,748	△2,023,153	△20,792,784
(C) 信 託 報 酬 等	△6,056,160	△6,441,166	△6,222,927
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	204,504,607	22,931,226	△6,350,871
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	206,122,389	399,423,581	410,400,945
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,393,096	2,510,612	2,585,412
(配 当 等 相 当 額)	(18,510,365)	(18,443,731)	(18,324,686)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△16,117,269)	(△15,933,119)	(△15,739,274)
(G) 合 計(D + E + F)	413,020,092	424,865,419	406,635,486
(H) 収 益 分 配 金	△6,180,972	△6,106,519	△6,022,694
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	406,839,120	418,758,900	400,612,792
追 加 信 託 差 損 益 金	2,393,096	2,510,612	2,585,412
(配 当 等 相 当 額)	(18,516,151)	(18,444,477)	(18,325,575)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△16,123,055)	(△15,933,865)	(△15,740,163)
分 配 準 備 積 立 金	404,446,024	416,248,288	415,336,014
繰 越 損 益 金	—	—	△17,308,634

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (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3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	第 105 期	第 106 期	第 107 期
(a) 経費控除後の配当等収益	13,052,958円	8,766,457円	10,957,763円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	76,864,090	14,164,769	0
(c) 収 益 調 整 金	18,516,151	18,444,477	18,325,575
(d) 分 配 準 備 積 立 金	320,709,948	399,423,581	410,400,945
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	429,143,147	440,799,284	439,684,283
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,388.59	1,443.70	1,460.09
(g) 分 配 金	6,180,972	6,106,519	6,022,694
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	20	20	20

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 105 期	第 106 期	第 107 期
1 万口当たり分配金	20円	20円	20円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第20期（決算日 2023年2月21日）

（計算期間 2022年2月22日～2023年2月21日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	除く日本、円ベース、為替ヘッジなし（ベンチマーク）	騰落率			
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	ポイント 113,733.36	1.7	98.1	—	百万円 197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	—	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	—	137,037
19期（2022年2月21日）	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	—	141,964
20期（2023年2月21日）	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	—	186,822

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

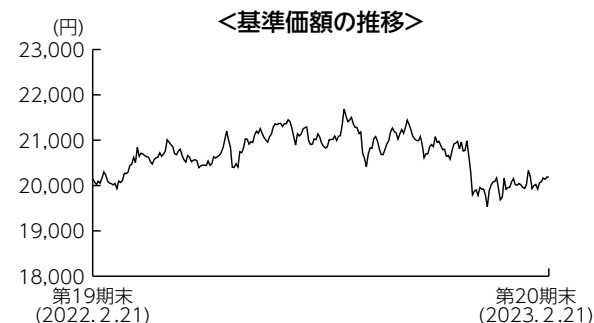
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス (除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022 年 2 月 21 日	円 20,152	% -	ポイント 126,280.23	% -	% 98.9	% -
2 月 末	20,052	△0.5	125,907.80	△0.3	98.8	-
3 月 末	20,713	2.8	129,775.21	2.8	98.3	-
4 月 末	20,758	3.0	129,955.37	2.9	99.0	-
5 月 末	20,634	2.4	129,451.47	2.5	98.7	-
6 月 末	21,122	4.8	132,579.22	5.0	99.0	-
7 月 末	21,267	5.5	133,117.57	5.4	98.9	-
8 月 末	21,015	4.3	131,430.25	4.1	98.7	-
9 月 末	20,830	3.4	130,076.63	3.0	99.0	-
10 月 末	21,443	6.4	134,355.57	6.4	99.0	-
11 月 末	20,802	3.2	130,450.40	3.3	98.7	-
12 月 末	19,782	△1.8	123,946.23	△1.8	98.6	-
2023 年 1 月 末	20,018	△0.7	125,559.33	△0.6	98.8	-
(期 末) 2023 年 2 月 21 日	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月22日から2023年2月21日まで）

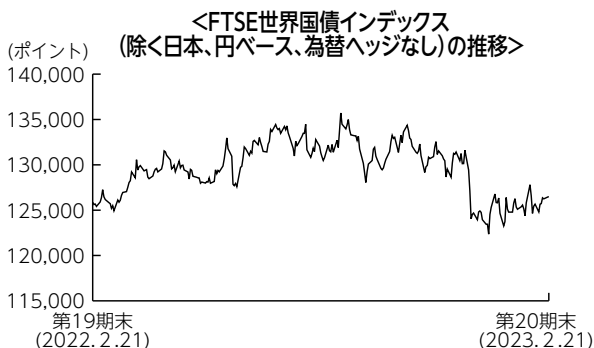


基準価額の推移

当期末の基準価額は20,182円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

FOMC（米連邦公開市場委員会）による複数回の利上げやインフレ加速観測の高まりを背景に米国債、ドイツ債の利回りは上昇（価格は下落）しました。ドル／円についてもFOMCによる複数回の利上げと日銀の金融緩和策を堅持する姿勢から、日米金利差拡大が意識されて円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも大きく為替が円安に動いたことから、基準価額は若干上昇しました。



投資環境

外国債券市場では、米国債およびドイツ債の利回りは上昇しました。米国債は、インフレ率が加速する中でFOMCの複数回の利上げやバランスシートの規模縮小が示されたこと等を受けて利回りは上昇しました。ドイツ債についても米国債の金利上昇やECB（欧州中央銀行）の複数回の利上げを受けて利回りは上昇しました。

為替市場では主要通貨に対して円安となりました。ドル／円は、FOMCにおいて複数回の利上げを実施しましたが、日銀は金融緩和策を堅持する姿勢を示したことで日米金利差拡大が意識されて、円安ドル高となりました。ユーロ／円も同様に金利差拡大が意識されて、円安ユーロ高となりました。

ポートフォリオについて

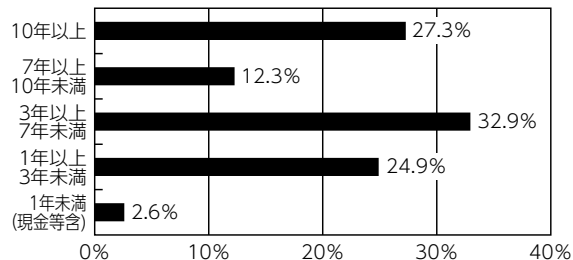
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

【運用状況】

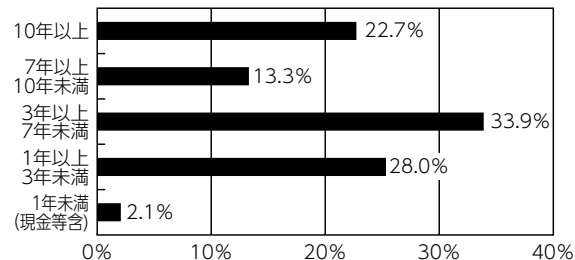
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

○残存別構成比

期首（前期末）



期末



○国別構成比

期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債 インデックス	差
北米			
米国	47.3%	48.0%	△0.7%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	49.3%	50.0%	△0.7%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.7%	△0.0%
計	0.7%	0.7%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	△0.0%
ベルギー	2.2%	2.2%	△0.0%
フィンランド	0.6%	0.6%	△0.0%
フランス	9.7%	9.8%	△0.1%
ドイツ	7.2%	7.2%	△0.0%
アイルランド	0.8%	0.8%	0.0%
イタリア	8.5%	8.7%	△0.2%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.0%
スペイン	5.7%	5.7%	0.0%
ユーロ計	37.8%	38.2%	△0.4%
デンマーク	0.4%	0.4%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	△0.0%
英国	5.8%	5.5%	0.3%
ポーランド	0.5%	0.5%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	△0.0%
計	45.0%	45.1%	△0.1%
アジア・ オセアニア			
オーストラリア	1.5%	1.6%	△0.0%
中国	0.9%	1.2%	△0.3%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.4%	3.7%	△0.3%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	△0.0%
計	0.4%	0.4%	△0.0%
現金など	1.1%	—	—
合計	100.0%	100.0%	—

期末

国	当ファンド	世界国債 インデックス	差
北米			
米国	49.5%	50.0%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.1%	△0.0%
計	51.6%	52.0%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.9%	0.9%	△0.0%
計	0.9%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.9%	1.9%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.4%	8.4%	0.0%
ドイツ	6.5%	6.4%	0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.5%	7.6%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	5.0%	5.0%	△0.0%
ユーロ計	33.1%	33.2%	△0.1%
デンマーク	0.3%	0.3%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.2%	△0.0%
英国	4.8%	4.7%	0.1%
ポーランド	0.4%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	39.0%	39.1%	△0.1%
アジア・ オセアニア			
オーストラリア	1.6%	1.6%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	4.4%	4.8%	△0.4%
シンガポール	0.5%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.6%	△0.0%
計	7.2%	7.6%	△0.4%
中近東			
イスラエル	0.3%	0.3%	△0.0%
計	0.3%	0.3%	△0.0%
現金など	1.0%	—	—
合計	100.0%	100.0%	—

(注) 世界国債インデックスとはF T S E世界国債インデックス（除く日本）です。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で0.2%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	3円	0.016%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保 管 費 用)	(3)	(0.015)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	3	0.016	
期中の平均基準価額は20,688円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■売買及び取引の状況 (2022年2月22日から2023年2月21日まで)

公社債

			買付額	売付額	
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 536,386	千アメリカ・ドル 350,573	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 26,736	千カナダ・ドル 16,227	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 19,961	千オーストラリア・ドル 11,123	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 4,947	千シンガポール・ドル 3,149	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 4,867	千ニュージーランド・ドル -	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 42,306	千イギリス・ポンド 23,277	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 9,417	千イスラエル・シケル 7,354	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 15,932	千デンマーク・クローネ 12,094	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 16,915	千ノルウェー・クローネ 14,888	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 13,712	千スウェーデン・クローナ 12,914	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 111,333	千メキシコ・ペソ 63,692	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 369,093	千オフショア・人民元 18,682	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,418	千マレーシア・リンギット 8,762	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 13,489	千ポーランド・ズロチ 7,291	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 5,238	千ユーロ 3,823
		オランダ	国債証券	15,082	10,731
		ベルギー	国債証券	17,985	11,988
		フランス	国債証券	79,108	52,916
		ドイツ	国債証券	67,768	45,631
		スペイン	国債証券	46,170	31,229
		イタリア	国債証券	74,616	52,932
		フィンランド	国債証券	4,741	3,163
	オーストラリア	国債証券	12,167	8,398	

(注) 金額は受渡代金です(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2月22日から2023年2月21日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0	百万円 0.032	百万円 0.032	% 100.0

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末								
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 774,590	千アメリカ・ドル 689,046	千円 92,552,791	% 49.5	% -	% 21.4	% 18.2	% 9.9	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 41,990	千カナダ・ドル 38,354	千円 3,827,785	2.0	-	1.1	0.6	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 35,405	千オーストラリア・ドル 31,922	千円 2,963,084	1.6	-	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,895	千シンガポール・ドル 8,486	千円 853,411	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 5,560	千ニュージーランド・ドル 4,858	千円 408,149	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 65,284	千イギリス・ポンド 55,908	千円 9,037,014	4.8	-	3.4	0.9	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 17,540	千イスラエル・シケル 16,376	千円 614,774	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 33,220	千デンマーク・クローネ 31,156	千円 600,381	0.3	-	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 29,010	千ノルウェー・クローネ 27,010	千円 354,646	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 29,770	千スウェーデン・クローナ 28,193	千円 366,227	0.2	-	0.1	0.1	-	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 234,607	千メキシコ・ペソ 217,394	千円 1,589,526	0.9	-	0.4	0.3	0.1	
中 国	千オフショア・人民元 419,720	千オフショア・人民元 419,249	千円 8,205,585	4.4	-	1.9	2.0	0.4	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 33,550	千マレーシア・リンギット 34,072	千円 1,032,254	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 32,170	千ポーランド・ズロチ 27,310	千円 826,099	0.4	-	0.1	0.2	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	9,450	8,192	1,175,166	0.6	-	0.4	0.2	0.0	
オランダ	21,490	19,601	2,811,844	1.5	-	0.9	0.5	0.1	
ベルギー	26,630	24,128	3,461,253	1.9	-	1.3	0.4	0.1	
フランス	120,130	109,930	15,769,556	8.4	-	5.2	2.6	0.7	
ドイツ	91,020	84,475	12,118,072	6.5	-	3.4	2.0	1.1	
スペイン	69,860	64,753	9,288,912	5.0	-	2.8	1.5	0.7	
イタリア	106,807	97,750	14,022,270	7.5	-	4.2	2.3	1.0	
フィンランド	7,640	6,508	933,600	0.5	-	0.3	0.2	0.1	
オーストリア	17,370	15,259	2,188,922	1.2	-	0.6	0.4	0.1	
合 計	-	-	千円 185,001,333	99.0	-	50.1	33.3	15.7	

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

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

(B) 個別銘柄開示
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当	期	末	評 価 額			償還年月日		
				種 類	利 率	額 面 金 額		額	
								外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円				
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,460	2,346	315,144	2026/01/31			
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	500	480	64,520	2025/01/31			
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	710	691	92,923	2024/01/31			
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	2,550	2,490	334,501	2024/01/31			
US T N/B 0.875 01/31/24	国債証券	0.8750	200	192	25,837	2024/01/31			
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	4,940	4,463	599,597	2027/01/31			
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	3,969	533,182	2029/01/31			
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	705	94,711	2025/01/31			
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,739	502,279	2028/01/31			
US T N/B 1.125 01/15/25	国債証券	1.1250	4,880	4,570	613,950	2025/01/15			
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	3,700	3,302	443,558	2026/01/31			
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	800	790	106,129	2026/01/15			
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	400	418	56,275	2026/02/15			
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,860	1,635	219,679	2042/02/15			
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,740	1,516	203,634	2043/02/15			
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,770	1,358	182,433	2046/02/15			
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	500	476	64,069	2039/02/15			
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	860	947	127,274	2031/02/15			
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	400	431	57,917	2036/02/15			
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	830	918	123,374	2041/02/15			
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,527	205,189	2044/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,310	2,790	374,852	2049/02/15			
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	4,300	3,071	412,560	2052/02/15			
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	636	85,440	2038/02/15			
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	890	969	130,285	2040/02/15			
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,807	377,043	2042/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	4,920	3,221	432,653	2051/02/15			
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	2,890	2,674	359,252	2026/02/15			
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,310	1,781	239,230	2045/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,960	1,644	220,856	2047/02/15			
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,223	298,606	2048/02/15			
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	2,090	2,043	274,533	2024/02/15			
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,939	260,547	2025/02/15			
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,330	4,011	538,848	2029/02/15			
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	3,370	3,174	426,418	2028/02/15			
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,518	472,624	2027/02/15			
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,650	1,602	215,212	2024/02/29			
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,164	290,721	2026/02/28			
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,891	254,052	2025/02/28			
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	7,890	6,465	868,443	2031/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	4,700	3,401	456,856	2041/02/15			
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,720	2,528	339,658	2050/02/15			
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	7,280	6,208	833,960	2032/02/15			
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	979	131,533	2027/02/28			
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,730	3,194	429,149	2030/02/15			
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	3,610	3,306	444,114	2027/02/28			
US T N/B 0.125 02/15/24	国債証券	0.1250	4,800	4,574	614,488	2024/02/15			
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,782	373,724	2025/02/28			

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,129	554,640	2027/05/15	
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	555	627	84,238	2037/05/15	
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,670	3,379	453,980	2026/05/15	
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	800	770	103,535	2024/05/31	
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	3,870	2,161	290,275	2050/05/15	
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	1,550	1,450	194,825	2026/05/31	
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	9,240	7,821	1,050,585	2031/05/15	
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,515	203,534	2025/05/31	
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,360	451,421	2042/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	6,650	6,155	826,829	2032/05/15	
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,980	1,702	228,647	2027/05/31	
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	3,300	2,867	385,217	2028/05/31	
US T N/B 0.25 05/15/24	国債証券	0.2500	7,500	7,079	950,969	2024/05/15	
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	5,650	4,505	605,229	2030/05/15	
US T N/B 2.5 05/31/24	国債証券	2.5000	4,180	4,052	544,394	2024/05/31	
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	3,410	3,210	431,193	2027/05/31	
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,072	412,678	2029/05/31	
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	3,630	3,243	435,623	2026/05/31	
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	3,890	3,537	475,152	2025/05/31	
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	4,000	3,849	517,090	2025/05/15	
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	290	279	37,531	2024/06/30	
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	999	134,312	2025/06/30	
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	1,880	1,743	234,223	2026/06/30	
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,283	172,381	2024/06/30	
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,384	320,330	2027/06/30	
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,217	432,220	2028/06/30	
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,176	426,615	2025/06/30	
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	3,500	3,379	453,886	2027/06/30	
US T N/B 0.25 06/15/24	国債証券	0.2500	3,780	3,555	477,543	2024/06/15	
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	3,310	2,964	398,176	2026/06/30	
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,000	2,874	386,101	2029/06/30	
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	4,920	4,748	637,776	2025/06/15	
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	380	366	49,207	2024/07/31	
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,123	285,253	2025/07/31	
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,000	1,852	248,827	2026/07/31	
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,903	255,644	2024/07/31	
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	3,770	3,215	431,892	2028/07/31	
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,213	431,669	2027/07/31	
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,437	461,727	2025/07/31	
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	2,570	2,373	318,786	2029/07/31	
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	3,900	3,452	463,687	2026/07/31	
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,611	485,042	2027/07/31	
US T N/B 0.375 07/15/24	国債証券	0.3750	4,000	3,755	504,413	2024/07/15	
US T N/B 3.0 07/31/24	国債証券	3.0000	3,820	3,719	499,593	2024/07/31	
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,094	415,670	2025/07/15	
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	820	794	106,691	2041/08/15	
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,279	171,824	2040/08/15	
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,540	1,267	170,217	2042/08/15	
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,804	242,413	2044/08/15	
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	980	1,051	141,238	2039/08/15	
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,381	185,618	2043/08/15	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,110	3,439	462,016	2051/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,457	195,769	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	4,050	3,831	514,671	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,784	239,650	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	3,040	2,193	294,573	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	3,640	3,067	411,995	2052/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	4,610	4,444	596,962	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,070	1,506	202,297	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	2,810	2,360	317,078	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,922	526,825	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,730	3,404	457,331	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	4,530	4,273	573,981	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,759	236,357	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,960	3,448	463,216	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	820	783	105,289	2024/08/31
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,658	357,068	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	4,930	3,452	463,693	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	3,160	2,013	270,388	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,870	2,799	375,976	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	5,840	5,341	717,415	2032/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,130	6,636	891,362	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,340	5,024	674,950	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	998	134,165	2026/08/31
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,870	2,719	365,229	2024/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,242	435,570	2025/08/31
US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	0.3750	4,100	3,835	515,216	2024/08/15
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,200	429,932	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,611	350,731	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	2,950	2,616	351,465	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,938	394,652	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,957	397,289	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,784	508,341	2027/08/31
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,689	226,869	2025/09/30
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	590	565	75,973	2024/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,310	2,801	376,311	2027/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,417	190,418	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	3,980	3,432	461,003	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,349	449,937	2025/09/30
US T N/B 1.5 09/30/24	国債証券	1.5000	4,310	4,091	549,611	2024/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	2,000	2,002	268,986	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	3,110	2,764	371,360	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,934	394,200	2025/09/15
US T N/B 0.375 09/15/24	国債証券	0.3750	2,000	1,866	250,758	2024/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	3,250	3,230	433,930	2029/09/30
US T N/B 4.25 09/30/24	国債証券	4.2500	2,200	2,181	292,958	2024/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	2,350	2,254	302,779	2024/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,270	1,223	164,362	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	1,710	1,562	209,840	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,082	548,376	2028/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,760	2,614	351,231	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,108	417,485	2027/10/31

銘柄	当	期				末		
		種	利	額	評		償	
					面			価
類	率	金額	額	額	額	額		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	3,390	3,034	407,622	2026/10/31		
US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	0.6250	4,000	3,739	502,314	2024/10/15		
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,000	2,003	269,059	2029/10/31		
US T N/B 4.375 10/31/24	国債証券	4.3750	2,070	2,056	276,239	2024/10/31		
US T N/B 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,940	3,947	530,223	2027/10/31		
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,587	481,831	2025/10/31		
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	2,800	2,789	374,678	2025/10/15		
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	903	121,383	2028/11/15		
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	200	217	29,227	2027/11/15		
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,560	1,317	177,027	2044/11/15		
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	600	623	83,803	2040/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,277	171,593	2042/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	899	120,822	2041/11/15		
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,396	187,573	2043/11/15		
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,801	241,941	2047/11/15		
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	4,780	2,935	394,308	2050/11/15		
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	4,670	3,041	408,512	2051/11/15		
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	2,460	2,519	338,378	2052/11/15		
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	860	724	97,267	2045/11/15		
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	886	119,135	2046/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	3,080	2,954	396,785	2024/11/15		
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	1,057	142,106	2039/11/15		
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,200	2,883	387,345	2048/11/15		
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,290	2,438	327,498	2049/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	3,620	3,423	459,875	2025/11/15		
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,380	4,180	561,571	2028/11/15		
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,830	2,616	351,452	2026/11/15		
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,015	405,100	2027/11/15		
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	1,780	1,702	228,629	2024/11/30		
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	1,360	1,307	175,567	2025/11/30		
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	1,200	1,196	160,705	2042/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	3,190	2,120	284,839	2040/11/15		
US T N/B 1.5 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	3,102	416,683	2041/11/15		
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,651	221,798	2026/11/30		
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	4,500	4,605	618,606	2032/11/15		
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,050	1,797	241,409	2029/11/15		
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	7,990	6,549	879,702	2031/11/15		
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	8,280	6,665	895,296	2030/11/15		
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,324	446,539	2027/11/30		
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	3,700	3,322	446,256	2026/11/30		
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	4,000	3,484	468,084	2028/11/30		
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	3,190	2,862	384,544	2025/11/30		
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,300	2,286	307,149	2029/11/30		
US T N/B 0.75 11/15/24	国債証券	0.7500	2,610	2,438	327,486	2024/11/15		
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,000	2,978	400,016	2027/11/30		
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,581	481,011	2025/11/15		
US T N/B 4.5 11/30/24	国債証券	4.5000	4,200	4,183	561,929	2024/11/30		
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	1,000	955	128,317	2025/12/31		
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	2,871	385,645	2024/12/31		
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,931	259,380	2026/12/31		
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,488	468,519	2026/12/31		

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,990	1,887	253,493	2024/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,500	3,888	522,344	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	3,000	2,688	361,168	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	3,320	2,823	379,294	2027/12/31
US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	1.0000	4,610	4,314	579,498	2024/12/15
US T N/B 4.0 12/15/25	国債証券	4.0000	4,140	4,104	551,371	2025/12/15
小計	—	—	774,590	689,046	92,552,791	—
(カナダ)		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 0.75 02/01/24	国債証券	0.7500	200	193	19,261	2024/02/01
CANADA 3.75 02/01/25	国債証券	3.7500	1,160	1,151	114,920	2025/02/01
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	420	410	40,980	2024/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	662	66,097	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	1,410	1,271	126,871	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27	国債証券	1.2500	1,210	1,108	110,592	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28	国債証券	3.5000	480	482	48,142	2028/03/01
CANADA 0.25 04/01/24	国債証券	0.2500	1,500	1,432	142,914	2024/04/01
CANADA 1.5 04/01/25	国債証券	1.5000	1,100	1,043	104,188	2025/04/01
CANADA 1.5 05/01/24	国債証券	1.5000	940	907	90,610	2024/05/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	700	655	65,387	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	740	842	84,063	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	610	737	73,611	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	280	332	33,171	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	970	947	94,560	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	570	621	62,003	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	850	797	79,553	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,320	1,273	127,124	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	550	498	49,729	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	430	405	40,463	2029/06/01
CANADA 1.5 06/01/30	国債証券	1.2500	1,850	1,608	160,516	2030/06/01
CANADA 1.5 06/01/31	国債証券	1.5000	2,470	2,151	214,768	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32	国債証券	2.0000	1,940	1,741	173,827	2032/06/01
CANADA 2.75 08/01/24	国債証券	2.7500	590	576	57,579	2024/08/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	440	422	42,143	2024/09/01
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	1,910	1,755	175,177	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27	国債証券	2.7500	850	825	82,361	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26	国債証券	1.0000	1,270	1,161	115,930	2026/09/01
CANADA 0.75 10/01/24	国債証券	0.7500	810	766	76,518	2024/10/01
CANADA 3.0 10/01/25	国債証券	3.0000	500	489	48,838	2025/10/01
CANADA 3.0 11/01/24	国債証券	3.0000	860	842	84,120	2024/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	700	719	71,803	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	630	571	57,018	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	2,820	2,152	214,810	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53	国債証券	1.7500	2,200	1,560	155,691	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	390	345	34,442	2064/12/01
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,800	1,458	145,555	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31	国債証券	1.5000	2,020	1,746	174,312	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000	1,300	1,215	121,266	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29	国債証券	2.2500	500	469	46,853	2029/12/01
小計	—	—	41,990	38,354	3,827,785	—
(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	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	880	719	66,774	2047/03/21

銘柄	当	期				末										
		種	類	利	率		額	面	金	額		償	還	年	月	日
										外	貨					
(オーストラリア)																
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国	債	証	券	%	千	オーストラリア・ドル	千	オーストラリア・ドル	千	円					2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国	債	証	券	3.2500	1,380		1,372	127,357							2027/04/21
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国	債	証	券	4.7500	840		877	81,455							2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国	債	証	券	2.7500	970		959	89,073							2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国	債	証	券	4.2500	1,200		1,225	113,742							2026/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国	債	証	券	3.2500	1,500		1,466	136,143							2029/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国	債	証	券	4.5000	1,230		1,301	120,771							2033/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国	債	証	券	3.7500	830		804	74,696							2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国	債	証	券	2.2500	880		822	76,347							2028/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国	債	証	券	2.5000	1,810		1,671	155,113							2030/05/21
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国	債	証	券	2.7500	900		736	68,400							2041/05/21
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国	債	証	券	1.2500	1,890		1,517	140,866							2032/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国	債	証	券	3.7500	1,200		1,187	110,260							2034/05/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国	債	証	券	3.2500	820		735	68,266							2039/06/21
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国	債	証	券	1.5000	1,610		1,350	125,353							2031/06/21
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国	債	証	券	2.7500	650		574	53,337							2035/06/21
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国	債	証	券	1.7500	1,200		716	66,507							2051/06/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国	債	証	券	0.5000	1,815		1,629	151,265							2026/09/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国	債	証	券	2.7500	960		916	85,049							2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国	債	証	券	2.7500	1,230		1,183	109,875							2027/11/21
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国	債	証	券	2.7500	1,400		1,320	122,592							2029/11/21
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国	債	証	券	3.0000	1,170		1,084	100,627							2033/11/21
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国	債	証	券	1.7500	1,850		1,542	143,147							2032/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国	債	証	券	1.0000	2,170		1,722	159,897							2031/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国	債	証	券	0.2500	1,360		1,244	115,518							2025/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国	債	証	券	0.2500	1,990		1,878	174,356							2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国	債	証	券	1.0000	1,670		1,360	126,286							2030/12/21
小計	-	-	-	-	-	35,405		31,922	2,963,084							-
(シンガポール)																
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国	債	証	券	%	千	シンガポール・ドル	千	シンガポール・ドル	千	円					2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国	債	証	券	2.0000	280		276	27,762							2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国	債	証	券	3.5000	800		810	81,493							2027/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国	債	証	券	2.7500	500		482	48,469							2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国	債	証	券	1.8750	490		402	40,454							2050/03/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国	債	証	券	2.7500	340		325	32,749							2042/04/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国	債	証	券	2.6250	420		410	41,263							2028/05/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国	債	証	券	2.3750	780		764	76,828							2025/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国	債	証	券	2.1250	370		357	35,923							2026/06/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国	債	証	券	2.8750	590		580	58,381							2029/07/01
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国	債	証	券	2.3750	190		169	17,081							2039/07/01
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国	債	証	券	1.6250	350		310	31,180							2031/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国	債	証	券	3.0000	125		133	13,468							2072/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国	債	証	券	2.2500	590		528	53,119							2036/08/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国	債	証	券	3.0000	720		717	72,120							2024/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国	債	証	券	2.8750	620		606	61,025							2030/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国	債	証	券	3.3750	330		335	33,709							2033/09/01
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国	債	証	券	2.8750	200		198	19,950							2027/09/01
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国	債	証	券	1.8750	410		342	34,462							2051/10/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国	債	証	券	1.2500	410		382	38,467							2026/11/01
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国	債	証	券	0.5000	380		353	35,499							2025/11/01
小計	-	-	-	-	-	8,895		8,486	853,411							-
(ニュージーランド)																
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	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	千	円					2027/04/15
NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	国	債	証	券	4.5000	700		704	59,147							2027/04/15

銘柄	柄	当期				末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)			%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	350	326	27,388	2033/04/14	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	330	269	22,671	2037/04/15	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	570	548	46,062	2025/04/15	
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	350	325	27,343	2029/04/20	
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	440	320	26,955	2051/05/15	
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	261	21,933	2041/05/15	
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	580	467	39,248	2031/05/15	
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	128	10,762	2034/05/15	
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	350	288	24,274	2032/05/15	
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	350	284	23,880	2028/05/15	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/24	国債証券	0.5000	650	616	51,759	2024/05/15	
NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	国債証券	0.5000	360	318	26,719	2026/05/15	
小計	—	—	5,560	4,858	408,149	—	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	1,140	1,024	165,561	2044/01/22	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,450	1,349	218,056	2045/01/22	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	900	935	151,164	2060/01/22	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	630	407	65,817	2049/01/22	
UK TREASURY 3.75 01/29/38	国債証券	3.7500	400	393	63,654	2038/01/29	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	1,670	895	144,822	2046/01/31	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	国債証券	1.1250	760	511	82,633	2039/01/31	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	国債証券	1.0000	2,370	1,911	308,921	2032/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	1,800	1,739	281,174	2024/01/31	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	国債証券	0.5000	680	571	92,378	2029/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,040	886	143,227	2028/01/31	
UK TREASURY 0.25 01/31/25	国債証券	0.2500	2,400	2,245	362,991	2025/01/31	
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,150	1,048	169,427	2026/01/30	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	国債証券	4.1250	800	815	131,800	2027/01/29	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,095	1,127	182,246	2025/03/07	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,700	1,782	288,153	2036/03/07	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	950	920	148,822	2024/04/22	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,440	1,527	246,876	2032/06/07	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,060	996	161,098	2025/06/07	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	1,000	616	99,579	2047/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	国債証券	1.2500	1,630	889	143,790	2051/07/31	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	970	940	152,076	2052/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	国債証券	1.5000	1,110	638	103,220	2053/07/31	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	1,130	685	110,865	2057/07/22	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	1,250	922	149,098	2065/07/22	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	930	882	142,612	2068/07/22	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	1,100	1,033	167,081	2026/07/22	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,600	1,461	236,203	2027/07/22	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	国債証券	0.8750	900	686	111,006	2033/07/31	
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	1,770	1,352	218,668	2031/07/31	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	1,350	936	151,303	2035/07/31	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	1,260	1,311	211,965	2039/09/07	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	810	798	129,072	2024/09/07	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	1,190	1,150	185,901	2025/09/07	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	900	971	157,087	2034/09/07	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,390	1,066	172,392	2037/09/07	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	870	515	83,279	2054/10/22	

銘	柄	当 期				末	
		種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 0.5	10/22/61	国債証券	0.5000	1,460	511	82,741	2061/10/22
UK TREASURY 1.625	10/22/71	国債証券	1.6250	830	451	72,904	2071/10/22
UK TREASURY 1.125	10/22/73	国債証券	1.1250	740	317	51,393	2073/10/22
UK TREASURY 1.25	10/22/41	国債証券	1.2500	1,600	1,036	167,567	2041/10/22
UK TREASURY 0.625	10/22/50	国債証券	0.6250	450	202	32,747	2050/10/22
UK TREASURY 1.625	10/22/28	国債証券	1.6250	1,130	1,028	166,269	2028/10/22
UK TREASURY 0.875	10/22/29	国債証券	0.8750	2,260	1,922	310,711	2029/10/22
UK TREASURY 0.375	10/22/30	国債証券	0.3750	1,220	969	156,774	2030/10/22
UK TREASURY 0.375	10/22/26	国債証券	0.3750	1,390	1,244	201,133	2026/10/22
UK TREASURY 6.0	12/07/28	国債証券	6.0000	680	770	124,599	2028/12/07
UK TREASURY 4.75	12/07/38	国債証券	4.7500	980	1,080	174,681	2038/12/07
UK TREASURY 4.5	12/07/42	国債証券	4.5000	1,265	1,362	220,223	2042/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/46	国債証券	4.2500	1,080	1,122	181,458	2046/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/55	国債証券	4.2500	1,212	1,294	209,168	2055/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/27	国債証券	4.2500	910	944	152,599	2027/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/40	国債証券	4.2500	1,070	1,113	179,988	2040/12/07
UK TREASURY 4.75	12/07/30	国債証券	4.7500	1,395	1,521	245,866	2030/12/07
UK TREASURY 4.25	12/07/49	国債証券	4.2500	1,017	1,065	172,151	2049/12/07
小	計	—	—	65,284	55,908	9,037,014	—
(イスラエル)			%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5	01/31/42	国債証券	5.5000	1,090	1,342	50,386	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5	02/27/26	国債証券	0.5000	310	280	10,514	2026/02/27
ISRAEL FIXED BOND 3.75	03/31/47	国債証券	3.7500	2,090	2,078	78,013	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0	03/31/27	国債証券	2.0000	2,230	2,076	77,940	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75	03/31/24	国債証券	3.7500	1,320	1,311	49,247	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0	03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,380	89,364	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 0.5	04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,749	65,680	2025/04/30
ISRAEL FIXED BOND 1.5	05/31/37	国債証券	1.5000	1,450	1,096	41,155	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75	08/31/25	国債証券	1.7500	2,300	2,176	81,698	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 2.25	09/28/28	国債証券	2.2500	1,460	1,347	50,569	2028/09/28
ISRAEL FIXED BOND 6.25	10/30/26	国債証券	6.2500	220	237	8,917	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND 0.4	10/31/24	国債証券	0.4000	320	300	11,286	2024/10/31
小	計	—	—	17,540	16,376	614,774	—
(デンマーク)			%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25	11/15/52	国債証券	0.2500	3,760	2,037	39,256	2052/11/15
DENMARK 4.5	11/15/39	国債証券	4.5000	7,860	9,812	189,081	2039/11/15
DENMARK 1.75	11/15/25	国債証券	1.7500	4,040	3,926	75,669	2025/11/15
DENMARK 0.5	11/15/27	国債証券	0.5000	6,350	5,749	110,795	2027/11/15
DENMARK 0.5	11/15/29	国債証券	0.5000	4,830	4,202	80,975	2029/11/15
DENMARK 0.0	11/15/31	国債証券	0.0000	4,180	3,337	64,317	2031/11/15
DENMARK 0.0	11/15/24	国債証券	0.0000	2,200	2,090	40,284	2024/11/15
小	計	—	—	33,220	31,156	600,381	—
(ノルウェー)			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5	02/19/26	国債証券	1.5000	4,480	4,252	55,831	2026/02/19
NORWAY 1.75	02/17/27	国債証券	1.7500	2,400	2,266	29,760	2027/02/17
NORWAY 3.0	03/14/24	国債証券	3.0000	2,370	2,358	30,962	2024/03/14
NORWAY 1.75	03/13/25	国債証券	1.7500	6,130	5,931	77,883	2025/03/13
NORWAY 2.0	04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,950	25,605	2028/04/26
NORWAY 2.125	05/18/32	国債証券	2.1250	1,980	1,805	23,710	2032/05/18
NORWAY 1.375	08/19/30	国債証券	1.3750	4,310	3,788	49,745	2030/08/19
NORWAY 1.75	09/06/29	国債証券	1.7500	2,620	2,396	31,459	2029/09/06

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,650	2,260	29,686	2031/09/17
小 計	—	—	29,010	27,010	354,646	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,420	3,860	50,146	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	2,890	2,632	34,192	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,120	6,057	78,681	2025/05/12
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	5,420	4,469	58,060	2031/05/12
SWEDEN 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	2,700	2,654	34,482	2032/06/01
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	6,210	5,833	75,777	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,010	2,685	34,885	2029/11/12
小 計	—	—	29,770	28,193	366,227	—
(メキシコ)		%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	29,842	26,541	194,062	2026/03/05
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	10,580	9,121	66,691	2027/03/04
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	9,180	8,225	60,143	2025/03/06
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	20,159	19,594	143,272	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,648	28,407	207,710	2031/05/29
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	5,790	5,244	38,343	2033/05/26
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	24,746	23,052	168,555	2027/06/03
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	6,290	5,645	41,276	2053/07/31
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	22,070	21,098	154,263	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	17,277	15,096	110,380	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	16,161	14,508	106,083	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,807	108,271	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,931	43,367	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	4,835	4,411	32,257	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	15,902	15,707	114,846	2024/12/05
小 計	—	—	234,607	217,394	1,589,526	—
(中国)		%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	国債証券	2.7500	20,000	19,779	387,117	2032/02/17
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	34,500	34,380	672,902	2025/02/24
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	5,100	5,167	101,145	2050/03/16
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	10,997	215,235	2029/03/24
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	国債証券	2.2800	12,000	12,005	234,970	2024/03/17
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	14,320	14,442	282,676	2052/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	2,100	2,255	44,148	2051/04/12
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	30,100	29,875	584,732	2027/04/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	1,000	1,013	19,830	2031/05/27
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	3,000	2,969	58,114	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	6,600	6,522	127,660	2030/05/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,452	165,436	2025/05/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	7,500	7,549	147,767	2027/06/04
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	20,000	19,904	389,565	2029/06/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	450	460	9,015	2026/06/06
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	国債証券	2.1800	4,200	4,193	82,076	2024/06/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,256	396,471	2027/07/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	13,000	12,764	249,819	2032/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	30,000	29,770	582,671	2025/08/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	国債証券	2.6900	26,600	26,675	522,102	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27	国債証券	3.5900	5,000	5,236	102,489	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	国債証券	2.6000	7,300	7,120	139,358	2032/09/01

銘	柄	当期					末
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	国債証券	2.4700	15,300	15,328	300,017	2024/09/02	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	国債証券	2.6200	17,500	17,269	338,002	2029/09/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	国債証券	1.9900	10,000	9,952	194,784	2024/09/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	国債証券	3.5300	18,950	19,723	386,034	2051/10/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	国債証券	2.9100	15,600	15,727	307,828	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	国債証券	2.4400	11,000	10,892	213,183	2027/10/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	国債証券	2.8000	17,300	17,178	336,224	2032/11/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	国債証券	2.8900	4,100	4,107	80,384	2031/11/18	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25	国債証券	2.2800	14,800	14,705	287,825	2025/11/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29	国債証券	2.7900	9,000	8,959	175,359	2029/12/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	国債証券	3.2800	3,500	3,608	70,632	2027/12/03	
小計	—	—	419,720	419,249	8,205,585	—	
(マレーシア)			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	600	606	18,376	2027/03/15	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	300	316	9,589	2046/03/15	
MALAYSIA 3.882 03/14/25	国債証券	3.8820	300	302	9,173	2025/03/14	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	1,050	1,077	32,645	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,200	1,253	37,974	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,660	1,632	49,455	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,700	1,806	54,730	2037/04/07	
MALAYSIA 2.632 04/15/31	国債証券	2.6320	1,000	913	27,676	2031/04/15	
MALAYSIA 4.504 04/30/29	国債証券	4.5040	300	312	9,471	2029/04/30	
MALAYSIA 3.502 05/31/27	国債証券	3.5020	650	646	19,599	2027/05/31	
MALAYSIA 3.757 05/22/40	国債証券	3.7570	1,500	1,413	42,811	2040/05/22	
MALAYSIA 4.254 05/31/35	国債証券	4.2540	600	608	18,440	2035/05/31	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,004	60,726	2028/06/15	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	670	683	20,720	2031/06/30	
MALAYSIA 4.893 06/08/38	国債証券	4.8930	620	672	20,372	2038/06/08	
MALAYSIA 3.478 06/14/24	国債証券	3.4780	1,000	1,003	30,395	2024/06/14	
MALAYSIA 4.065 06/15/50	国債証券	4.0650	400	377	11,430	2050/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	1,030	1,041	31,556	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	1,990	2,145	65,000	2048/07/06	
MALAYSIA 3.906 07/15/26	国債証券	3.9060	920	931	28,222	2026/07/15	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	1,820	1,778	53,865	2034/07/05	
MALAYSIA 3.582 07/15/32	国債証券	3.5820	1,400	1,366	41,392	2032/07/15	
MALAYSIA 3.885 08/15/29	国債証券	3.8850	700	702	21,286	2029/08/15	
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	2,400	2,429	73,614	2025/09/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	1,600	1,725	52,286	2043/09/30	
MALAYSIA 4.059 09/30/24	国債証券	4.0590	900	909	27,561	2024/09/30	
MALAYSIA 4.696 10/15/42	国債証券	4.6960	1,200	1,272	38,537	2042/10/15	
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	1,660	1,683	51,001	2026/11/30	
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	1,430	1,447	43,851	2027/11/16	
MALAYSIA 4.642 11/07/33	国債証券	4.6420	950	1,006	30,484	2033/11/07	
小計	—	—	33,550	34,072	1,032,254	—	
(ポーランド)			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,391	42,100	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,480	2,923	88,426	2028/04/25	
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	2,370	1,609	48,679	2032/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	780	748	22,634	2024/04/25	
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	3,370	2,995	90,600	2025/04/25	
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	1,450	1,303	39,438	2027/05/25	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				期		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,790	2,456	74,295	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	3,830	3,562	107,763	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,007	60,709	2027/07/25
POLAND 07/25/24	国債証券	0.0000	1,710	1,571	47,534	2024/07/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	630	504	15,259	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	2,150	2,015	60,979	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	3,930	2,716	82,172	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,504	45,504	2026/10/25
小計	—	—	32,170	27,310	826,099	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	840	678	97,320	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	360	321	46,147	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	240	241	34,614	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	850	893	128,106	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	159	22,810	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	580	402	57,806	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	390	331	47,564	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	590	574	82,454	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	610	555	79,654	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	659	94,564	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	950	899	129,077	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	350	292	41,922	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	270	38,782	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	520	467	67,011	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	870	679	97,428	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	400	314	45,125	2032/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	550	451	64,775	2030/10/18
小計	—	—	9,450	8,192	1,175,166	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,320	1,510	216,714	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,540	1,567	224,837	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,000	488	70,076	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	780	881	126,470	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,280	1,454	208,697	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,110	1,087	156,000	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	550	364	52,258	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,110	775	111,308	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	360	313	44,992	2054/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,110	948	136,123	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,080	972	139,514	2027/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	640	590	84,697	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,420	1,317	189,022	2026/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	1,140	1,124	161,327	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,490	1,402	201,127	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,240	1,121	160,908	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,160	1,068	153,227	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,060	911	130,746	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	575	82,581	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,200	960	137,748	2031/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	200	163	23,462	2032/07/15
小計	—	—	21,490	19,601	2,811,844	—

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,570	1,769	253,826	2028/03/28	
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,440	206,696	2041/03/28	
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,122	161,070	2026/03/28	
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	630	678	97,342	2032/03/28	
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,220	1,440	206,598	2035/03/28	
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	810	684	98,207	2033/04/22	
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	220	205	29,452	2039/04/22	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	740	787	112,920	2045/06/22	
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	780	556	79,875	2047/06/22	
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	980	697	100,014	2050/06/22	
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	710	453	65,042	2053/06/22	
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	307	44,168	2057/06/22	
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	342	49,111	2066/06/22	
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	670	275	39,451	2071/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,030	971	139,373	2026/06/22	
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	840	834	119,770	2024/06/22	
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,348	193,449	2031/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	1,010	909	130,468	2028/06/22	
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	450	278	40,016	2040/06/22	
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,430	1,272	182,594	2029/06/22	
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	680	670	96,134	2034/06/22	
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	510	73,245	2038/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,980	1,888	270,861	2025/06/22	
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	960	881	126,503	2027/06/22	
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	380	302	43,460	2037/06/22	
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,300	1,066	153,048	2030/06/22	
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	600	471	67,607	2032/06/22	
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	750	720	103,373	2024/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	940	728	104,517	2031/10/22	
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	580	509	73,051	2027/10/22	
小計	-	-	26,630	24,128	3,461,253	-	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	国債証券	0.0000	2,450	2,192	314,456	2027/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	2,910	2,672	383,300	2026/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	国債証券	0.0000	1,220	1,183	169,796	2024/02/25	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	国債証券	0.0000	1,990	1,876	269,117	2025/02/25	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	1,980	1,789	256,749	2028/02/25	
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	3,020	2,923	419,317	2024/03/25	
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	3,320	3,122	447,954	2025/03/25	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,000	3,058	438,763	2026/04/25	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,640	3,099	444,621	2041/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,756	252,027	2055/04/25	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,170	1,372	196,903	2060/04/25	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,880	4,463	640,344	2029/04/25	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,930	2,252	323,055	2035/04/25	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,470	2,486	356,634	2045/05/25	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,548	222,122	2048/05/25	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	2,470	1,719	246,634	2050/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	2,040	1,112	159,652	2052/05/25	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国債証券	0.7500	1,950	1,038	148,975	2053/05/25	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	990	678	97,377	2066/05/25	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	790	303	43,504	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	2,500	2,475	355,131	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	4,550	4,467	640,891	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	5,110	4,602	660,267	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,480	3,152	452,258	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	4,230	4,008	574,961	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	3,590	3,123	448,037	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,860	2,380	341,450	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	3,460	3,210	460,508	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	2,360	2,191	314,327	2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	1,650	1,065	152,893	2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	3,190	2,551	365,992	2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国債証券	1.2500	500	384	55,135	2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国債証券	2.5000	250	222	31,949	2043/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国債証券	0.0000	2,290	1,757	252,091	2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	2,070	1,706	244,852	2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国債証券	0.5000	1,150	680	97,578	2044/06/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	2,170	2,340	335,802	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	3,890	3,882	556,952	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,940	2,134	306,132	2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,510	3,108	445,887	2032/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,380	2,330	334,287	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,740	2,606	373,927	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	2,620	2,382	341,795	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	3,400	3,033	435,169	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国債証券	0.0000	3,270	2,556	366,670	2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	3,780	3,048	437,298	2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国債証券	2.0000	1,600	1,476	211,757	2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,890	2,399	344,241	2029/11/25
小計	-	-	120,130	109,930	15,769,556	-
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,310	1,493	214,254	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	780	965	138,430	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,520	1,847	265,041	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,830	2,144	307,667	2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,900	1,815	260,429	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	2,660	2,496	358,117	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	2,080	1,828	262,241	2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,940	1,761	252,687	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,430	1,413	202,749	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	2,120	1,937	277,926	2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	1,840	1,521	218,263	2031/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国債証券	0.0000	2,900	2,340	335,782	2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	2,620	2,215	317,775	2030/02/15
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	国債証券	0.0000	1,500	1,455	208,741	2024/03/15
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,260	1,220	175,013	2024/04/05
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,590	1,498	214,963	2025/04/11
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国債証券	0.0000	2,110	1,943	278,846	2026/04/10
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	1,360	1,224	175,662	2027/04/16
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,520	1,493	214,299	2024/05/15
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,660	1,223	175,440	2035/05/15

銘柄	柄	当期				期末	
		種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	350	282	40,482	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,580	1,133	162,637	2036/05/15	
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	国債証券	0.2000	1,250	1,206	173,032	2024/06/14	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	850	985	141,339	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	560	622	89,277	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,700	2,093	300,283	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,480	212,336	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,070	2,084	298,951	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,410	1,847	265,047	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,820	2,227	319,477	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,170	2,205	316,314	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	1,040	525	75,360	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	500	434	62,328	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,430	1,914	274,671	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,317	332,464	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	1,910	1,749	250,924	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,980	1,810	259,750	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,770	1,570	225,347	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,820	1,770	253,925	2024/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,990	1,702	244,286	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	2,230	1,182	169,652	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	1,430	1,342	192,628	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,190	1,789	256,743	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	710	376	54,038	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,430	2,032	291,544	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	590	494	70,887	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	800	654	93,934	2031/08/15	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	国債証券	0.4000	900	865	124,202	2024/09/13	
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,590	1,516	217,554	2024/10/18	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	1,360	1,238	177,641	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,750	1,630	233,851	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,880	1,780	255,344	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	450	419	60,243	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,440	206,670	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,060	1,792	257,198	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	800	781	112,076	2029/11/15	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	国債証券	2.2000	1,350	1,333	191,285	2024/12/12	
小計	-	-	91,020	84,475	12,118,072	-	
(ユーロ…スペイン)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,460	1,682	241,329	2029/01/31	
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,200	1,219	174,885	2024/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,400	1,480	212,407	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	2,050	1,932	277,228	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,610	1,426	204,579	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,160	996	142,881	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,960	1,789	256,768	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,580	226,690	2025/04/30	
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,470	1,483	212,736	2024/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	2,210	2,073	297,511	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,330	1,284	184,311	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,170	1,073	153,970	2028/04/30	

銘柄	当			期		末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,400	1,266	181,616	2029/04/30
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,550	1,226	176,010	2032/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,500	1,242	178,240	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,380	1,066	153,023	2031/04/30
SPAIN 0.0 05/31/24	国債証券	0.0000	1,110	1,068	153,206	2024/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	670	624	89,589	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,630	1,778	255,064	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,290	1,477	211,882	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,630	1,834	263,149	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,020	146,328	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,135	1,176	168,776	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,620	232,436	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,815	2,167	310,970	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,470	1,325	190,206	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	250	236	33,860	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,510	1,380	198,013	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,840	1,521	218,249	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	1,080	1,037	148,864	2024/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	600	408	58,668	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	336	48,220	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,750	1,580	226,787	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	700	603	86,557	2029/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	2,190	2,180	312,749	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,830	2,014	288,987	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,458	209,176	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,026	147,252	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,190	983	141,024	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	670	439	63,062	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	410	196	28,229	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,590	846	121,393	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	2,010	1,964	281,833	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,560	1,448	207,740	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,730	1,625	233,239	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,530	1,295	185,780	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	1,640	1,294	185,709	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,597	229,206	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,260	845	121,305	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,750	1,514	217,197	2030/10/31
小計	-	-	69,860	64,753	9,288,912	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,310	1,181	169,475	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	300	300	43,125	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,460	1,635	234,590	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	2,170	2,094	300,422	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,350	1,249	179,236	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,800	1,697	243,575	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,475	211,666	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,500	1,231	176,723	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,090	825	118,364	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,190	1,025	147,101	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,710	1,729	248,084	2024/03/01

銘柄	当			期			末
	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	700	485	69,607	2067/03/01	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	209	30,091	2072/03/01	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	560	577	82,809	2025/03/01	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,910	1,963	281,716	2026/03/01	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	1,790	1,466	210,341	2032/03/01	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	2,350	1,981	284,218	2040/03/01	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,020	922	132,392	2035/03/01	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,870	1,828	262,352	2030/03/01	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,120	805	115,517	2036/03/01	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	1,150	785	112,672	2041/03/01	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	1,080	705	101,182	2037/03/01	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	国債証券	3.2500	600	522	74,992	2038/03/01	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	国債証券	0.2500	1,460	1,229	176,429	2028/03/15	
ITALY BTPS 4.0 04/30/35	国債証券	4.0000	660	637	91,495	2035/04/30	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	国債証券	1.5000	810	486	69,716	2045/04/30	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,550	1,306	187,389	2030/04/01	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,610	1,268	181,937	2031/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	国債証券	0.0000	1,400	1,348	193,479	2024/04/15	
ITALY BTPS 3.4 04/01/28	国債証券	3.4000	550	540	77,564	2028/04/01	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	国債証券	0.0000	1,520	1,363	195,585	2026/04/01	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	国債証券	1.1000	1,100	996	142,922	2027/04/01	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	2,480	2,836	406,842	2031/05/01	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	990	972	139,517	2024/05/15	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,280	1,228	176,239	2025/05/15	
ITALY BTPS 4.4 05/01/33	国債証券	4.4000	200	201	28,948	2033/05/01	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,350	1,271	182,328	2026/06/01	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,460	1,400	200,836	2025/06/01	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	1,290	1,219	175,002	2027/06/01	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	国債証券	0.9500	1,380	1,048	150,371	2032/06/01	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	国債証券	2.8000	1,200	1,129	162,052	2029/06/15	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,290	1,231	176,614	2026/07/15	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,174	168,428	2024/07/01	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	国債証券	0.5000	1,100	927	133,115	2028/07/15	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	1,240	1,196	171,670	2025/07/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,660	1,757	252,057	2034/08/01	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,170	1,246	178,813	2039/08/01	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	1,500	1,404	201,465	2027/08/01	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,610	1,535	220,254	2029/08/01	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	国債証券	0.6000	1,520	1,150	165,069	2031/08/01	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,350	1,090	156,378	2030/08/01	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	国債証券	0.0000	1,460	1,389	199,277	2024/08/15	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	国債証券	1.2000	1,360	1,287	184,674	2025/08/15	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	国債証券	0.0000	1,250	1,108	159,050	2026/08/01	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	1,810	1,525	218,828	2038/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	1,110	1,156	165,911	2044/09/01	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	1,180	986	141,559	2046/09/01	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,680	1,765	253,286	2028/09/01	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,250	1,337	191,918	2040/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	1,150	806	115,658	2050/09/01	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	1,020	595	85,400	2051/09/01	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,330	1,126	161,584	2033/09/01	

銘柄	種類	当	利率	額面金額	期		末	
					評価額			償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)								
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	国債証券		2.1500	千ユーロ 510	千ユーロ 326	千円 46,792	2052/09/01	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券		3.7500	1,620	1,628	233,638	2024/09/01	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券		3.8500	850	776	111,363	2049/09/01	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券		2.2500	860	680	97,558	2036/09/01	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券		0.9500	1,680	1,493	214,269	2027/09/15	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券		7.2500	350	395	56,749	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券		6.5000	1,510	1,698	243,685	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券		5.2500	2,140	2,329	334,212	2029/11/01	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券		1.4500	680	658	94,459	2024/11/15	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券		2.5000	1,350	1,317	188,940	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券		2.0000	1,660	1,596	228,985	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券		1.2500	1,530	1,406	201,823	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券		2.5000	1,637	1,613	231,494	2024/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券		2.8000	1,740	1,656	237,564	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券		0.9500	1,700	1,312	188,276	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券		1.6500	1,740	1,470	210,955	2030/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券		2.5000	1,340	1,161	166,670	2032/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券		3.8500	800	795	114,082	2029/12/15	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	国債証券		0.0000	1,360	1,279	183,569	2024/12/15	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券		2.6500	1,220	1,165	167,238	2027/12/01	
小計	—	—	—	106,807	97,750	14,022,270	—	
(ユーロ…フィンランド)								
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券		0.1250	千ユーロ 320	千ユーロ 148	千円 21,335	2052/04/15	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券		2.0000	370	366	52,545	2024/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券		0.7500	200	168	24,206	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券		1.3750	390	286	41,101	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券		0.5000	460	429	61,648	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券		1.1250	480	392	56,370	2034/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券		0.5000	380	235	33,842	2043/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券		0.1250	290	197	28,384	2036/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券		1.3750	110	103	14,905	2027/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券		4.0000	410	422	60,548	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券		2.7500	490	488	70,016	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券		2.6250	430	404	57,984	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券		0.5000	300	257	36,986	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券		0.8750	350	333	47,855	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券		0.5000	550	483	69,295	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券		0.5000	420	379	54,371	2027/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券		0.2500	290	178	25,651	2040/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券		1.5000	50	43	6,298	2032/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券		0.1250	300	236	33,990	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券		0.0000	210	168	24,221	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/24	国債証券		0.0000	410	392	56,286	2024/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券		0.0000	430	388	55,752	2026/09/15	
小計	—	—	—	7,640	6,508	933,600	—	
(ユーロ…オーストリア)								
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券		3.8000	千ユーロ 240	千ユーロ 279	千円 40,061	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券		1.5000	640	471	67,598	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券		0.5000	920	799	114,719	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券		0.7500	835	754	108,210	2028/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券		0.0000	710	561	80,597	2031/02/20	

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ・オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000	900	751	107,806	2032/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000	930	759	108,894	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500	710	753	108,052	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	990	1,106	158,759	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500	590	340	48,873	2051/03/20
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	210	94	13,571	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,070	974	139,748	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/25	国債証券	0.0000	580	544	78,164	2025/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	770	720	103,422	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	290	228	32,749	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	127	18,336	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	540	545	78,195	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	415	472	67,713	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/24	国債証券	0.0000	520	499	71,615	2024/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	160	155	22,342	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	285	40,901	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	930	910	130,642	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,190	1,104	158,454	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	940	902	129,412	2025/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	380	259	37,176	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	258	37,104	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	570	484	69,568	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	16,225	2086/11/02
小 計	—	—	17,370	15,259	2,188,922	—
合 計	—	—	—	—	185,001,333	—

■投資信託財産の構成

2023年2月21日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 185,001,333	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,186,068	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	188,187,402	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、186,640,391千円、99.2%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=134.32円、1カナダ・ドル=99.80円、1オーストラリア・ドル=92.82円、1シンガポール・ドル=100.56円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=161.64円、1イスラエル・シェケル=37.54円、1デンマーク・クローネ=19.27円、1ノルウェー・クローネ=13.13円、1スウェーデン・クローナ=12.99円、1メキシコ・ペソ=7.311円、1オフショア・人民元=19.572円、1マレーシア・リンギット=30.295円、1ポーランド・ズロチ=30.248円、1ユーロ=143.45円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産 等	188,187,402,199円
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,927,378,048
公 社 債(評価額)	185,001,333,837
未 収 利 息	1,090,149,276
前 払 費 用	168,541,038
(B) 負 債	1,365,031,536
未 払 金	1,352,244,536
未 払 解 約 金	12,787,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	186,822,370,663
元 本	92,568,430,085
次 期 繰 越 損 益	94,253,940,578
(D) 受 益 権 総 額	92,568,430,085円
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	20,182円

(注1) 期首元本額 70,448,298,510円
 追加設定元本額 63,457,547,851円
 一部解約元本額 41,337,416,276円

(注2) 期末における元本の内訳

D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,063,618,127円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,664,534円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	25,013,145円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	61,798,332円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	61,093,331円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,637,226円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	48,023,427円
たわらノーロード 先進国債券	17,008,425,615円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	245,317,778円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,489,017,308円
たわらノーロード バランス (堅実型)	65,360,184円
たわらノーロード バランス (標準型)	335,170,560円
たわらノーロード バランス (積極型)	71,793,070円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	16,208,215円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	982,389,497円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	1,586,938,015円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	725,563,344円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	429,869,427円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	2,046,942円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,848,744円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	179,191,650円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	14,908,588円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	24,576,579円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,613,575,783円
One DC 先進国債券インデックスファンド	837,273,305円
Oneグローバルバランス	18,428,191円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	743,440,279円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,368,236,637円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,625,122,028円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	419,973,327円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	846,255,978円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	741,934,563円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	14,015,594円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	512,673,651円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	36,330,259円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	146,595,885円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	150,866,647円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	231,293,861円
グループコントロール	895,480,870円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	600,448,211円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	610,839,468円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,820,147円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	318,874,880円

D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,051,013,220円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	259,574,682円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	265,741,005円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	128,786,227円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	162,358,218円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	256,453,982円
インカム重視マルチアセット運用ファンド I I 2021-04 (適格機関投資家限定)	618,270,983円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	198,620,020円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	231,445,712円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	208,546,866円
D I A M海替フルレンジ外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	5,554,465,372円
D I A M外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	2,585,064,790円
外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,555,775,823円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,282,640,293円
A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	81,242,436円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	49,166,703円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	442,107,851円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	362,944,405円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	238,451,787円
D I A M国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,931,845円
D I A M国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	29,911,489円
D I A M国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,822,125円
D I A M国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	49,876円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	14,713,798円
D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	43,966,666円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,620,938,828円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,399,685,001円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,546,932,927円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	65,747,358円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	124,222,256円
D I A Mアクアグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,489,912,024円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	300,752,649円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	163,842円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	305,817,896円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	273,773,162円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	379,947,236円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	46,662,175円
動的パッケージファンド<DC年金>	56,505,520円
コア資産形成ファンド	37,769,335円
M H A M外国債券インデックスファンド (ファンドラップ)	756,300,586円
M H A M外国債券インデックスファンド<海替ヘッジあり> (ファンドラップ)	514,130,947円
M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	7,052,612,220円
M H A M外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,364,933,377円
期末元本合計	92,568,430,085円

■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,630,658,528	円
	受取利息	3,630,482,398	
	その他の収益	573,045	
	支払利息	△396,915	
(B)	有価証券売買損益	△4,048,984,550	
	売買益	22,763,661,538	
	売買損	△26,812,646,088	
(C)	その他の費用	△27,916,414	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△446,242,436	
(E)	前期繰越損益金	71,516,620,489	
(F)	解約差損益金	△44,647,207,624	
(G)	追加信託差損益金	67,830,770,149	
(H)	計(D+E+F+G)	94,253,940,578	
	次期繰越損益金(H)	94,253,940,578	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

インデックス225 マザーファンド

運用報告書

第17期 (決算日 2023年2月20日)

(計算期間 2022年2月22日～2023年2月20日)

インデックス225 マザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限です。
運用方針	日経平均株価（225種・東証）の動きに連動する投資成果をめざした運用を行います。
主要投資対象	主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、原則として、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄の中から200銘柄以上に同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行います。
主な組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価(225)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(ベンチマーク)	期騰落率			
13期(2019年2月20日)	円	%	円	%	%	%	百万円
	16,485	△0.3	21,431.49	△2.3	97.4	5.3	34,447
14期(2020年2月20日)	18,448	11.9	23,479.15	9.6	93.3	6.6	25,144
15期(2021年2月22日)	24,143	30.9	30,156.03	28.4	97.8	2.2	89,076
16期(2022年2月21日)	21,886	△9.3	26,910.87	△10.8	98.3	1.6	127,373
17期(2023年2月20日)	22,882	4.6	27,531.94	2.3	97.4	2.6	130,473

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

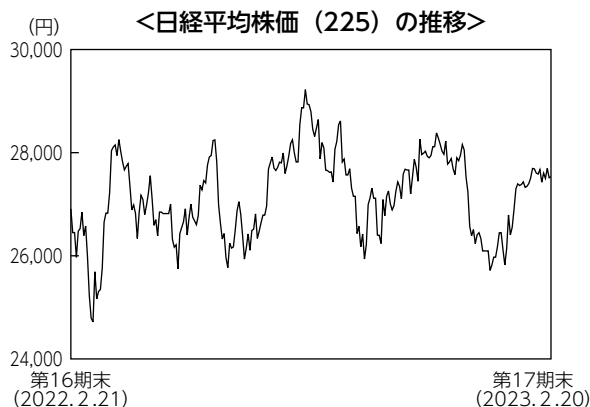
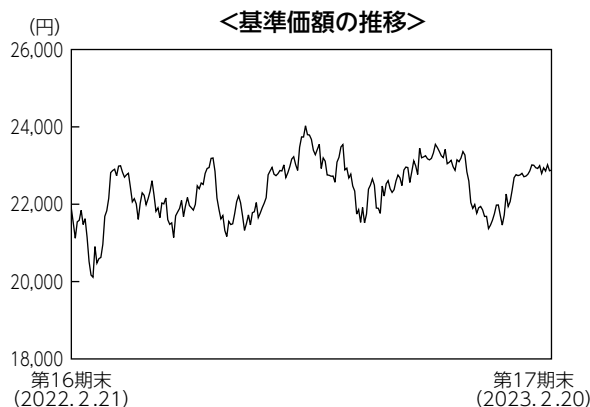
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率 %	円	騰 落 率 %		
(期 首) 2022年 2 月 21 日	21,886	—	26,910.87	—	98.3	1.6
2 月 末	21,585	△1.4	26,526.82	△1.4	97.9	2.1
3 月 末	22,827	4.3	27,821.43	3.4	97.2	2.7
4 月 末	22,031	0.7	26,847.90	△0.2	97.5	2.3
5 月 末	22,401	2.4	27,279.80	1.4	96.9	2.6
6 月 末	21,702	△0.8	26,393.04	△1.9	97.6	2.4
7 月 末	22,860	4.5	27,801.64	3.3	98.4	1.5
8 月 末	23,112	5.6	28,091.53	4.4	97.9	2.1
9 月 末	21,517	△1.7	25,937.21	△3.6	97.3	2.7
10 月 末	22,884	4.6	27,587.46	2.5	97.5	2.5
11 月 末	23,206	6.0	27,968.99	3.9	98.1	1.9
12 月 末	21,686	△0.9	26,094.50	△3.0	97.5	2.5
2023年 1 月 末	22,711	3.8	27,327.11	1.5	98.4	1.5
(期 末) 2023年 2 月 20 日	22,882	4.6	27,531.94	2.3	97.4	2.6

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年2月22日から2023年2月20日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は22,882円（1万口あたり）となり、前期末比で4.6%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2022年3月中旬にかけ、新型コロナウイルス新規感染者数の拡大、世界的な金融引き締めへの警戒感やロシアのウクライナ侵攻などを受けて下落基調で推移しました。その後、円安ドル高の進行により上昇に転じる場面もありましたが、高インフレを背景とした世界的な金融引き締めの動きが重しとなり、一進一退の展開となりました。期末にかけては、インフレ鈍化期待の高まりを受けた米株高を好感し、国内株も戻り歩調を辿りました。

ポートフォリオについて

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.3%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.3%程度上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因によるものです。

今後の運用方針

今後の運用につきましても、財務リスク等を考慮しつつ、日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) そ の 他 費 用 (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、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は22,398円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年2月22日から2023年2月20日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		6,595.8 (390.8)	28,219,567 (-)	7,397	30,404,016

(注1) 金額は受渡代金です。

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 73,572	百万円 72,474	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	58,623,583千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	123,633,591千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.47

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年2月22日から2023年2月20日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 28,219	百万円 -	% -	百万円 30,404	百万円 36	% 0.1
株 式 先 物 取 引	73,572	73,572	100.0	72,474	72,474	100.0
金 銭 信 託	0.193939	0.193939	100.0	0.193939	0.193939	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 5	百万円 6	百万円 33

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	1,778千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1,778千円
(B) / (A)	100.0%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
水産・農林業 (0.1%)				
ニッスイ	164	158	85,952	
マルハニチロ	16.4	—	—	
鉱業 (0.1%)				
INPEX	65.6	63.2	90,123	
建設業 (1.7%)				
コムシスホールディングス	164	158	392,788	
大成建設	32.8	31.6	138,250	
大林組	164	158	154,524	
清水建設	164	158	115,814	
長谷工コーポレーション	32.8	31.6	48,632	
鹿島建設	82	79	126,953	
大和ハウス工業	164	158	492,012	
積水ハウス	164	158	402,189	
日揮ホールディングス	164	158	277,764	
食料品 (3.5%)				
日清製粉グループ本社	164	158	246,638	
明治ホールディングス	32.8	31.6	202,872	
日本ハム	82	79	297,830	
サッポロホールディングス	32.8	31.6	99,066	
アサヒグループホールディングス	164	158	744,338	
キリンホールディングス	164	158	317,027	
宝ホールディングス	164	158	168,586	
キッコーマン	164	158	1,030,160	
味の素	164	158	651,434	
ニチレイ	82	79	214,880	
日本たばこ産業	164	158	440,583	
繊維製品 (0.1%)				
東洋紡	16.4	15.8	16,542	
ユニチカ	16.4	—	—	
帝人	32.8	31.6	45,788	
東レ	164	158	126,700	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	164	158	85,004	
日本製紙	16.4	15.8	15,910	
化学 (7.1%)				
クラレ	164	158	191,022	
旭化成	164	158	150,747	
レゾナック・ホールディングス	16.4	15.8	36,482	
住友化学	164	158	75,366	
日産化学	164	158	930,620	
東ソー	82	79	141,094	
トクヤマ	32.8	31.6	66,865	
デンカ	32.8	31.6	93,030	
信越化学工業	164	158	3,035,180	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
三井化学	32.8	31.6	102,700	
三菱ケミカルグループ	82	79	64,187	
UBE	16.4	15.8	32,690	
花王	164	158	808,328	
DIC	16.4	15.8	38,378	
富士フィルムホールディングス	164	158	1,014,202	
資生堂	164	158	972,174	
日東電工	164	158	1,325,620	
医薬品 (7.4%)				
協和キリン	164	158	464,994	
武田薬品工業	164	158	673,554	
アステラス製薬	820	790	1,489,940	
住友ファーマ	164	158	137,144	
塩野義製薬	164	158	973,280	
中外製薬	492	474	1,692,180	
エーザイ	164	158	1,234,138	
第一三共	492	474	2,027,298	
大塚ホールディングス	164	158	657,912	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	65.6	63.2	194,340	
ENEOSホールディングス	164	158	73,090	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	82	79	192,839	
ブリヂストン	164	158	825,076	
ガラス・土石製品 (1.0%)				
AGC	32.8	31.6	157,368	
日本板硝子	16.4	15.8	10,996	
日本電気硝子	49.2	47.4	117,978	
住友大阪セメント	16.4	15.8	60,514	
太平洋セメント	16.4	15.8	38,868	
東海カーボン	164	158	205,084	
TOTO	82	79	361,030	
日本碍子	164	158	283,452	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	16.4	15.8	48,932	
神戸製鋼所	16.4	15.8	14,062	
JFEホールディングス	16.4	15.8	27,571	
大平洋金属	16.4	15.8	31,394	
非鉄金属 (0.9%)				
日本軽金属ホールディングス	16.4	15.8	22,878	
三井金属鉱業	16.4	15.8	53,483	
東邦亜鉛	16.4	15.8	32,927	
三菱マテリアル	16.4	15.8	33,843	
住友金属鉱山	82	79	411,037	
DOWAホールディングス	32.8	31.6	142,674	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
古河電気工業	16.4	15.8	38,346	
住友電気工業	164	158	263,781	
フジクラ	164	158	152,628	
金属製品 (0.0%)				
SUMCO	16.4	15.8	29,593	
機械 (5.7%)				
日本製鋼所	32.8	31.6	82,950	
オークマ	32.8	31.6	165,584	
アマダ	164	158	189,442	
SMC	-	15.8	1,057,652	
小松製作所	164	158	522,506	
住友重機械工業	32.8	31.6	93,093	
日立建機	164	158	492,170	
クボタ	164	158	329,588	
荏原製作所	32.8	31.6	176,644	
ダイキン工業	164	158	3,689,300	
日本精工	164	158	117,868	
NTN	164	158	53,404	
ジェイテクト	164	158	160,844	
三井E&Sホールディングス	16.4	15.8	6,746	
日立造船	32.8	31.6	28,313	
三菱重工業	16.4	15.8	79,726	
IHI	16.4	15.8	57,354	
電気機器 (23.5%)				
コニカミノルタ	164	158	95,116	
ミネベアミツミ	164	158	376,198	
日立製作所	32.8	31.6	222,780	
三菱電機	164	158	244,821	
富士電機	32.8	31.6	165,268	
安川電機	164	158	813,700	
日本電産	-	126.4	876,204	
オムロン	164	158	1,143,762	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32.8	31.6	78,336	
日本電気	16.4	15.8	75,524	
富士通	16.4	15.8	276,658	
沖電気工業	16.4	-	-	
セイコーエプソン	328	316	591,868	
パナソニック ホールディングス	164	158	186,519	
シャープ	164	158	154,366	
ソニーグループ	164	158	1,807,520	
TDK	492	474	2,156,700	
アルプスアルパイン	164	158	225,150	
横河電機	164	158	327,218	
アドバンテスト	328	316	3,182,120	
キーエンス	16.4	15.8	920,350	
カシオ計算機	164	158	213,616	
ファナック	164	158	3,586,600	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
京セラ	328	316	2,113,724	
太陽誘電	164	158	661,230	
村田製作所	131.2	126.4	935,739	
SCREENホールディングス	32.8	31.6	326,428	
キャノン	246	237	701,638	
リコー	164	158	168,428	
東京エレクトロン	164	158	7,185,840	
輸送用機器 (4.6%)				
デンソー	164	158	1,166,988	
川崎重工業	16.4	15.8	47,795	
日産自動車	164	158	82,823	
いすゞ自動車	82	79	129,639	
トヨタ自動車	820	790	1,502,975	
日野自動車	164	158	90,376	
三菱自動車工業	16.4	15.8	8,405	
マツダ	32.8	31.6	36,972	
本田技研工業	328	316	1,093,360	
スズキ	164	158	754,766	
SUBARU	164	158	347,284	
ヤマハ発動機	164	158	533,250	
精密機器 (4.1%)				
テルモ	656	632	2,341,560	
ニコン	164	158	204,452	
オリンパス	656	632	1,450,440	
HOYA	-	79	1,059,390	
シチズン時計	164	158	131,930	
その他製品 (2.7%)				
パンダイナムコホールディングス	164	158	1,354,850	
凸版印刷	82	79	189,758	
大日本印刷	82	79	287,560	
ヤマハ	164	158	782,890	
任天堂	16.4	158	863,312	
電気・ガス業 (0.2%)				
東京電力ホールディングス	16.4	15.8	7,584	
中部電力	16.4	15.8	22,910	
関西電力	16.4	15.8	20,903	
東京瓦斯	32.8	31.6	84,719	
大阪瓦斯	32.8	31.6	67,845	
陸運業 (1.4%)				
東武鉄道	32.8	31.6	94,958	
東急	82	79	128,849	
小田急電鉄	82	79	129,481	
京王電鉄	32.8	31.6	148,520	
京成電鉄	82	79	305,730	
東日本旅客鉄道	16.4	15.8	109,099	
西日本旅客鉄道	16.4	15.8	83,424	
東海旅客鉄道	16.4	15.8	241,740	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
ヤマトホールディングス	164	158	368,298	
NIPPON EXPRESSホールディングス	16.4	15.8	121,028	
海運業 (0.4%)				
日本郵船	16.4	47.4	157,794	
商船三井	16.4	47.4	162,108	
川崎汽船	16.4	47.4	154,050	
空運業 (0.0%)				
ANAホールディングス	16.4	15.8	44,445	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	82	79	246,085	
情報・通信業 (11.3%)				
ネクソン	328	316	970,120	
Zホールディングス	65.6	63.2	24,205	
トレンドマイクロ	164	158	1,027,000	
日本電信電話	65.6	63.2	251,030	
KDDI	984	948	3,828,972	
ソフトバンク	164	158	242,135	
東宝	16.4	15.8	74,734	
エヌ・ティ・ティ・データ	820	790	1,487,570	
コナミグループ	164	158	989,080	
ソフトバンクグループ	984	948	5,431,092	
卸売業 (2.8%)				
双日	16.4	15.8	40,700	
伊藤忠商事	164	158	649,064	
丸紅	164	158	277,843	
豊田通商	164	158	881,640	
三井物産	164	158	617,464	
住友商事	164	158	373,117	
三菱商事	164	158	738,650	
小売業 (12.0%)				
J. フロント リテイリング	82	79	101,436	
三越伊勢丹ホールディングス	164	158	222,938	
セブン&アイ・ホールディングス	164	158	969,172	
高島屋	82	79	150,416	
丸井グループ	164	158	326,428	
イオン	164	158	412,933	
ファーストリテイリング	164	158	13,061,860	
銀行業 (0.7%)				
しずおかフィナンシャルグループ	-	158	175,222	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	164	158	90,376	
SBI新生銀行	16.4	-	-	
あおぞら銀行	16.4	15.8	41,885	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	164	158	157,731	
りそなホールディングス	16.4	15.8	11,911	
三井住友トラスト・ホールディングス	16.4	15.8	78,383	
三井住友フィナンシャルグループ	16.4	15.8	94,800	
千葉銀行	164	158	156,420	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	
ふくおかフィナンシャルグループ	32.8	31.6	97,802	
静岡銀行	164	-	-	
みずほフィナンシャルグループ	16.4	15.8	33,891	
証券・商品先物取引業 (0.3%)				
大和証券グループ本社	164	158	101,752	
野村ホールディングス	164	158	89,396	
松井証券	164	158	127,190	
保険業 (0.9%)				
SOMPOホールディングス	32.8	31.6	183,153	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	49.2	47.4	211,261	
第一生命ホールディングス	16.4	15.8	46,831	
東京海上ホールディングス	82	237	679,360	
T&Dホールディングス	32.8	31.6	68,414	
その他金融業 (0.8%)				
クレディセゾン	164	158	288,192	
オリックス	-	158	383,387	
日本取引所グループ	164	158	310,707	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	164	158	100,962	
三井不動産	164	158	392,709	
三菱地所	164	158	258,804	
東京建物	82	79	125,847	
住友不動産	164	158	489,800	
サービス業 (4.4%)				
エムスリー	393.6	379.2	1,253,256	
ディー・エヌ・エー	49.2	47.4	85,177	
電通グループ	164	158	688,880	
サイバーエージェント	131.2	126.4	151,680	
楽天グループ	164	158	109,178	
リクルートホールディングス	492	474	1,805,466	
日本郵政	164	158	192,681	
セコム	164	158	1,244,250	
合 計	株 数 ・ 金 額	30,651.6	30,241.2	127,034,597
	銘柄数 < 比率 >	225銘柄	225銘柄	< 97.4% >

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	日 経 平 均	百万円 3,412		百万円 -

■投資信託財産の構成

2023年2月20日現在

項 目		当 期		末
		評 価 額	比 率	
株 式		千円 127,034,597		% 97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		3,762,330		2.9
投 資 信 託 財 産 総 額		130,796,928		100.0

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年2月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	130,787,855,289円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,382,768,689
株 式(評価額)	127,034,597,520
未 収 入 金	12,409,080
未 収 配 当 金	211,880,000
差 入 委 託 証 拠 金	146,200,000
(B) 負 債	314,059,000
未 払 解 約 金	314,059,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	130,473,796,289
元 本	57,021,132,315
次 期 繰 越 損 益 金	73,452,663,974
(D) 受 益 権 総 口 数	57,021,132,315口
1万口当たり基準価額(C/D)	22,882円

■損益の状況

当期 自2022年2月22日 至2023年2月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,714,728,243円
受 取 配 当 金	2,715,532,360
受 取 利 息	22,555
そ の 他 収 益	147,965
支 払 利 息	△974,637
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,998,126,587
売 買 益	10,721,704,842
売 買 損	△6,723,578,255
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	212,471,960
取 引 益	1,292,525,900
取 引 損	△1,080,053,940
(D) そ の 他 費 用	△1
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	6,925,326,789
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	69,175,399,253
(G) 解 約 差 損 益 金	△25,608,265,777
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	22,960,203,709
(I) 合 計(E+F+G+H)	73,452,663,974
次 期 繰 越 損 益 金(I)	73,452,663,974

(注1) 期首元本額 58,198,132,946円
追加設定元本額 18,933,637,291円
一部解約元本額 20,110,637,922円

(注2) 期末における元本の内訳

(適格機関投資家私募) インデックス225 (3ヵ月決算型)	3,051,800,365円
(適格機関投資家私募) インデックス225 マルチアセット・アロケーション戦略ファンド (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募)	1,207,871,918円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII (為替バリアブルヘッジ型) (適格機関投資家限定)	371,181,703円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII (為替バリアブルヘッジ型) (適格機関投資家限定)	35,830,501円
日米資産配分戦略ファンド (為替ヘッジ比率 調整型) 2017-03 (適格機関投資家限定)	59,695,443円
たわらノーロード 日経225	34,491,819,139円
DIAMバランス・インカム・オープン (毎月分配型)	18,989,535円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	269,442,807円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建 日本政府保証償活用型) (適格機関投資家限定)	195,131,369円
低リスク・損失抑制型マルチアセット 戦略ファンド (適格機関投資家限定)	41,460,248円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド 2021-09 (適格機関投資家限定)	41,715,826円
DIAM日経225インデックスファンドVA	836,293,603円
国内株式パッシブ・ファクター日経 225型一 (適格機関投資家向け)	4,343,100,287円
DIAM日経225型パッシブ・ファンド (適格機関投資家向け)	3,483,947,801円
日米独マルチアセットアロケーション ファンド (適格機関投資家限定)	36,634,615円
日米英独マルチアセットアロケーション ファンド (適格機関投資家限定)	30,625,965円
日米資産配分戦略ファンド (TIPS活用型) (為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家限定)	67,600,610円
MHAM日経225インデックスファンド [適格機関投資家限定]	6,017,605,205円
MHAMインデックス225 [適格機関投資家限定]	2,420,385,375円
期末元本合計	57,021,132,315円

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

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

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

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■第22条（信託業務の委託等）の付表「I.外国での保管会社」を削除しました。

(2023年2月11日)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第16期（決算日 2023年6月22日）

（対象期間 2022年6月23日～2023年6月22日）

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2007年4月11日から無期限です。
運用方針	S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P 先進国 REIT インデックス （除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	円	期中騰落率	ポイント	期中騰落率		
12期(2019年6月24日)	13,060	9.0	131,885.51	9.8	99.2	百万円 47,410
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	34,753
14期(2021年6月22日)	15,336	40.4	157,949.66	42.0	99.4	78,959
15期(2022年6月22日)	16,673	8.7	172,787.99	9.4	99.3	56,003
16期(2023年6月22日)	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4	81,199

（注1）ベンチマークはS & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注2）S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS & P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。本商品は、SPDJ、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません（以下同じ）。

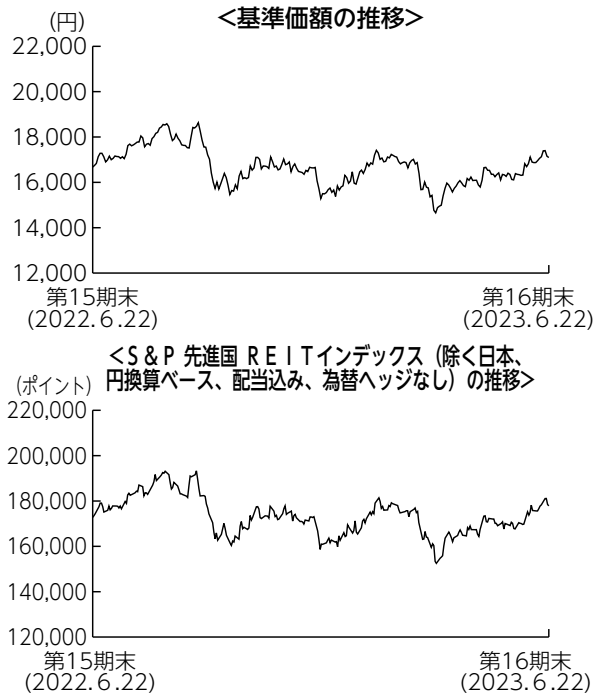
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 REIT インデックス (除く日本、円換算ベース、 配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	期 騰 落	中 率	
(期 首) 2022年 6 月 22 日	円 16,673	% -	ポイント 172,787.99	% -	% 99.3
6 月 末	17,127	2.7	177,552.22	2.8	102.6
7 月 末	18,045	8.2	187,036.58	8.2	99.6
8 月 末	17,654	5.9	183,143.17	6.0	99.4
9 月 末	15,704	△5.8	162,709.12	△5.8	99.2
10 月 末	17,102	2.6	177,452.85	2.7	100.8
11 月 末	16,704	0.2	173,502.90	0.4	99.7
12 月 末	15,662	△6.1	162,761.28	△5.8	99.2
2023年 1 月 末	16,716	0.3	173,922.95	0.7	99.6
2 月 末	16,899	1.4	175,688.04	1.7	99.6
3 月 末	15,731	△5.6	163,587.88	△5.3	99.2
4 月 末	16,096	△3.5	167,414.44	△3.1	99.6
5 月 末	16,341	△2.0	170,042.31	△1.6	99.7
(期 末) 2023年 6 月 22 日	17,096	2.5	177,832.19	2.9	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2022年6月23日から2023年6月22日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は17,096円となり、前期末比で2.5%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

外国リート市場は利上げが続くことへの警戒感などから欧州リート市場が軒並み下落しマイナスの影響となったものの、利上げサイクルが終盤に近付いていると見られる米国リート市場やオーストラリアリート市場は上昇しプラスの寄与となりました。為替市場で日銀が金融緩和姿勢を継続したことを背景に多くの通貨に対して円安となったこともプラスの寄与となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

米国リート市場は小幅に上昇しました。期前半はインフレ指標を受け大きく変動しましたが、2022年10月以降はインフレ鈍化を好感して反発しました。その後は米地銀破綻に端を発した金融システム不安から下落し、期末にかけては持ち直しました。欧州リート市場はECB（欧州中央銀行）が大幅利上げを行ったことや、英国の経済対策への懸念に伴う金利急騰などを背景に下落しました。オーストラリアリート市場は利上げサイクルの終了が近いとの見方から上昇しました。

為替市場では日銀の金融緩和解除に対する思惑が広がったものの、各国との金融政策の方向性の違いから多くの通貨に対して円安となりました。米ドルはFRB（米連邦準備理事会）の金融引き締めを受け米ドル高が進みましたが、インフレの鈍化から長期金利が低下すると米ドル安基調となりました。年明け以降はFRBのタカ派姿勢を受けて再び米ドル高が進み、期を通じては米ドル高円安となりました。ユーロはECBのタカ派姿勢からユーロ高円安が進みました。

ポートフォリオについて

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

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.9%上昇しました。
当ファンドの騰落率はベンチマークを0.4%下回りました。配当金に対する課税等の影響を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

今後の運用方針

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

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (投資信託受益証券) (投資証券)	3円 (1) (3)	0.019% (0.003) (0.015)	(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資証券)	7 (1) (7)	0.044 (0.003) (0.041)	(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) (1)	0.057 (0.053) (0.004)	(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、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	20	0.120	
期中の平均基準価額は16,690円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年6月23日から2023年6月22日まで)

投資信託受益証券、投資証券

	買		付		売		付	
	口	数	金	額	口	数	金	額
アメリカ		千口		千アメリカ・ドル		千口		千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		72.842		10,247		47.748		6,445
		(-)		(-)		(-)		(-)
ALEXANDER'S INC.		0.624		139		0.264		54
		(-)		(-)		(-)		(-)
BOSTON PROPERTIES INC		63.931		4,438		44.28		2,798
		(-)		(-)		(-)		(-)
CEDAR REALTY TRUST INC		1.301		37		5.082		48
		(-)		(-)		(-)		(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		102.766		2,940		70.287		2,033
		(-)		(-)		(-)		(-)
APARTMENT INVNT & MGMT CO-A		51.797		379		36.542		285
		(-)		(-)		(-)		(-)
AGREE REALTY CORP		44.258		3,103		25.648		1,784
		(-)		(-)		(-)		(-)
BRT APARTMENTS CORP		4.203		84		2.264		44
		(-)		(-)		(-)		(-)
SL GREEN		23.666		851		15.316		485
		(-)		(-)		(-)		(-)
EPR PROPERTIES		31.674		1,304		20.836		836
		(-)		(-)		(-)		(-)
PROLOGIS INC		400.494		47,797		268.34		31,801
		(54.791)		(-)		(-)		(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC		64.999		11,537		44.2		7,890
		(-)		(-)		(-)		(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LXP INDUSTRIAL TRUST	124.7	1,290	80.461	801
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	48.34	5,629	33.306	3,804
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	29.001	442	20.686	297
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	41.915	27,961	27.945	18,739
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	78.81	3,474	50.82	2,205
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROWTH INC	6.122	115	2.34	47
	(3.716)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	65.41	1,625	43.182	989
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12.216	214	7.882	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	73.922	957	47.074	581
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	55.173	674	17.982	164
	(△19.409)	(△112)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	34.61	1,968	38.193	2,076
	(△115.35)	(-)	(-)	(-)
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	-	3.185	29
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	29.746	6,859	21.108	4,823
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	156.299	10,070	108.88	6,976
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	35.705	3,589	24.358	2,354
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	59.533	3,002	40.803	2,066
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	244.285	5,866	166.041	3,815
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	45.749	1,106	31.471	722
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11.251	309	-	-
	(△56.675)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49.569	1,361	33.628	844
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	59.525	518	37.697	312
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	226.642	16,445	143.012	10,271
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	20.618	3,302	13.156	2,105
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	273.196	5,567	187.177	3,644
	(-)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	46.442	1,875	31.673	1,166
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
LTC PROPERTIES INC	15.961	584	9.01	332
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57.263	53	36.971	59
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	65.34	430	36.173	216
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	139.638	7,171	97.875	4,971
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	92.234	986	61.366	611
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	77.159	5,190	52.414	3,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	34.535	507	17.036	235
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	310.15	5,243	212.64	3,491
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	52.713	8,400	36.012	5,622
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.425	90	5.022	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	18.158	1,010	12.793	706
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	5.745	373	4.164	261
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.41	122	2.887	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	-	1.938	7
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	19.02	622	12.038	403
	(-)	(-)	(-)	(-)
PS BUSINESS PARKS	1.353	253	7.546	1,375
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	32.419	321	16.968	152
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	304.999	19,566	187.637	11,896
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	68.99	4,227	47.956	2,842
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	136.309	5,749	90.309	3,756
	(-)	(-)	(-)	(-)
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	47.5	1,204	31.57	774
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	4.099	175	3.246	126
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	148.93	16,599	103.043	10,919
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	37.442	4,429	25.406	3,055
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	72.478	21,903	48.383	14,330
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
SUN COMMUNITIES INC	57.042	8,238	38.506	5,446
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER FACTORY OUTLET	44.377	783	29.5	507
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	25.296	415	12.756	198
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	13.936	225	8.241	109
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5.398	275	3.028	138
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	184.117	8,456	127.952	5,784
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	70.609	1,550	47.773	950
	(-)	(-)	(-)	(-)
ELME COMMUNITIES	35.978	682	21.081	385
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	11.032	714	54.098	3,541
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	97.304	1,972	64.964	1,284
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	61.89	10,151	42.661	7,030
	(-)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20.374	48	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80.037	820	53.08	530
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	99.36	4,394	68.127	3,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	132.225	14,163	88.89	9,413
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	84.648	725	57.491	471
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	265.438	3,028	183.617	1,932
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	84.385	1,351	62.359	929
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	51.408	755	32.857	465
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	42.678	431	22.065	203
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43.526	323	24.375	171
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	32.065	1,944	22.438	1,353
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	21.165	546	14.359	321
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	65.667	736	45.748	494
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	120	3,404	81.325	2,315
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	50.231	767	35.352	523
	(-)	(-)	(-)	(-)
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	18.849	284	11.357	157
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	9.39	115	3.736	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	98.795	1,266	65.472	811
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	8.935	85	5.719	48
	(-)	(-)	(-)	(-)
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	47.682	491	33.367	342
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	81.108	2,657	55.526	1,783
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	99.36	7,882	62.628	4,890
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	29.287	551	17.433	316
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	15.157	286	8.777	148
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	161.973	3,387	119.299	2,452
	(56.675)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24.236	2,100	16.11	1,376
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27.571	338	18.027	211
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	65.011	2,599	42.843	1,698
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	105.527	1,617	66.519	1,007
	(-)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	91.388	5,257	52.165	3,019
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	140.037	4,581	90.657	2,927
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	96.164	1,713	63.082	1,090
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	12.725	1,165	8.239	700
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	36.942	720	26.894	492
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	52.881	359	25.969	163
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	271.124	8,879	198.6	6,606
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	389	195	224.6	111
	(-)	(△6)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	43.312	309	28.056	185
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	14.515	289	10.977	220
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
SAFEHOLD INC	6.458	197	4.015	115
	(△7.428)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	64.005	1,512	37.703	884
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	12.441	94	7.363	43
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	121.811	6,131	76.249	3,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132.258	2,856	88.148	1,844
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12.663	59	10.153	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	217.8	112	60	32
	(-)	(△5)	(-)	(-)
POSTAL REALTY TRUST INC	1.889	29	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	6.172	106	2.105	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	28.479	690	19.868	455
	(-)	(-)	(-)	(-)
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	-	-	4.068	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	2.56	66	1.39	37
	(△9.507)	(△247)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	22.818	288	9.008	96
	(-)	(-)	(-)	(-)
CITY OFFICE REIT INC	14.622	127	12.785	100
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	28.876	241	17.489	128
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	25.528	485	12.169	227
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	41.764	794	27.189	521
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	1.891	120	2.1	136
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	49.566	1,612	31.798	998
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK HOMES TRUST INC	-	-	-	-
	(1.188)	(16)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	68.664	2,600	49.503	1,856
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	83.494	1,486	51.751	897
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAR HOLDINGS	-	-	-	-
	(5.322)	(112)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	10.61	268	6.315	162
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	89.7	61	49.3	34
	(-)	(△2)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
STORE CAPITAL CORP	62.982 (-)	1,904 (-)	140.748 (-)	4,486 (-)
PARAMOUNT GROUP INC	64.095 (-)	370 (-)	40.652 (-)	225 (-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26.797 (-)	267 (-)	18.197 (-)	161 (-)
URBAN EDGE PROPERTIES	50.559 (-)	753 (-)	32.044 (-)	463 (-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	31.428 (-)	499 (-)	18.136 (-)	273 (-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	41.788 (-)	604 (-)	27.269 (-)	382 (-)
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8.434 (-)	423 (-)	5.313 (-)	242 (-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	35.545 (-)	1,534 (-)	24.383 (-)	1,022 (-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9.548 (-)	350 (-)	6.217 (-)	218 (-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91.151 (-)	1,455 (-)	60.79 (-)	926 (-)
GLOBAL NET LEASE INC	35.909 (-)	486 (-)	18.858 (-)	242 (-)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	14.638 (-)	179 (-)	- (-)	- (-)
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	842.4 (-)	290 (△2)	529.7 (-)	175 (-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	94.933 (-)	1,248 (-)	71.108 (-)	907 (-)
VICI PROPERTIES INC	462.717 (-)	14,884 (-)	307.756 (-)	9,914 (-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	39.174 (-)	1,041 (-)	23.16 (-)	618 (-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	32.342 (-)	877 (-)	22.51 (-)	599 (-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	42.562 (-)	1,959 (-)	31.627 (-)	1,453 (-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51.894 (-)	642 (-)	36.568 (-)	442 (-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	48.237 (-)	777 (-)	33.91 (-)	533 (-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	69.863 (-)	1,443 (-)	50.288 (-)	1,011 (-)
ALLIED PROPERTIES REIT	27.336 (-)	776 (-)	17.809 (-)	483 (-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10.822 (-)	166 (-)	10.502 (-)	158 (-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7.441 (-)	391 (-)	5.249 (-)	284 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.677 (-)	167 (-)	10.602 (-)	91 (-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	22.644 (-)	350 (-)	14.744 (-)	221 (-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	29.499 (-)	388 (-)	19.784 (-)	253 (-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	54.186 (-)	541 (-)	31.563 (-)	313 (-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2.247 (-)	40 (-)	- (-)	- (-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	57.905 (-)	759 (-)	37.374 (-)	489 (-)
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	24.603 (-)	465 (-)	52.136 (-)	521 (-)
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14.218 (-)	1,121 (-)	10.069 (-)	802 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10.425 (-)	64 (-)	5.794 (-)	32 (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	78.323 (-)	1,106 (-)	55.181 (-)	772 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.878 (-)	172 (-)	7.797 (-)	109 (-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23.52 (-)	374 (-)	15.579 (-)	242 (-)
PLAZA RETAIL REIT	- (-)	- (-)	16.376 (-)	65 (-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7.76 (-)	27 (-)	- (-)	- (-)
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.769 (-)	102 (-)	- (-)	- (-)
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13.322 (-)	276 (-)	5.218 (-)	101 (-)
SLATE GROCERY REIT	15.919 (-)	226 (-)	11.822 (-)	161 (-)
NEXUS INDUSTRIAL REIT	17.694 (-)	173 (-)	10.697 (-)	97 (-)
PRIMARIS REIT	18.413 (-)	256 (-)	10.359 (-)	137 (-)
SLATE OFFICE REIT	8.835 (-)	41 (-)	6.752 (-)	29 (-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3.521 (-)	41 (-)	2.665 (-)	34 (-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21.082 (-)	361 (-)	14.043 (-)	238 (-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	197.973 (-)	776 (-)	133.395 (-)	513 (-)
MIRVAC GROUP	1,853.463 (-)	3,976 (-)	1,294.797 (-)	2,746 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
CROMWELL PROPERTY GROUP	529.883 (-)	353 (-)	364.294 (-)	233 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	221.455 (-)	867 (-)	149.106 (-)	572 (-)
GPT GROUP	860.435 (-)	3,779 (-)	598.664 (-)	2,541 (-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	255.065 (-)	452 (-)	142.322 (-)	245 (-)
ABACUS PROPERTY GROUP	161.194 (-)	433 (-)	92.044 (-)	241 (-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	120.864 (-)	394 (-)	58.558 (-)	180 (-)
STOCKLAND	1,111.398 (-)	4,244 (-)	776.907 (-)	2,914 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	147.838 (-)	606 (-)	95.082 (-)	372 (-)
DEXUS	486.473 (-)	4,002 (-)	339.622 (-)	2,713 (-)
GOODMAN GROUP	793.35 (-)	14,901 (-)	547.239 (-)	10,238 (-)
VICINITY CENTRES	1,719.112 (-)	3,382 (-)	1,153.673 (-)	2,222 (-)
CHARTER HALL GROUP	196.126 (-)	2,421 (-)	128.874 (-)	1,545 (-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	121.253 (-)	390 (-)	92.022 (-)	288 (-)
REGION RE LTD	526.897 (-)	1,374 (-)	352.981 (-)	872 (-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	211.007 (-)	655 (-)	133.287 (-)	402 (-)
ARENA REIT	134.203 (-)	526 (-)	72.751 (-)	280 (-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	310.383 (-)	1,360 (-)	197.223 (-)	849 (-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	71.755 (-)	207 (-)	44.504 (-)	122 (-)
NATIONAL STORAGE REIT	542.744 (-)	1,322 (-)	333.186 (-)	813 (-)
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62.468 (-)	209 (-)	42.272 (-)	138 (-)
GDI PROPERTY GROUP	180.531 (-)	140 (-)	137.075 (-)	100 (-)
RURAL FUNDS GROUP	138.817 (-)	318 (-)	91.137 (-)	196 (-)
IRONGATE GROUP	32.043 (-)	60 (-)	213.237 (-)	405 (-)
SCENTRE GROUP	2,407.532 (-)	6,824 (-)	1,674.489 (-)	4,670 (-)
HMC CAPITAL LTD	98.428 (-)	441 (-)	43.001 (-)	175 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
HOMECO DAILY NEEDS REIT	615.8 (-)	776 (-)	345.471 (-)	422 (-)
HEALTHCO REIT	130.128 (-)	184 (-)	18.996 (-)	33 (-)
CENTURIA OFFICE REIT	185.682 (-)	290 (-)	102.641 (-)	149 (-)
WAYPOINT REIT LTD	281.739 (-)	741 (-)	194.093 (-)	492 (-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT DUMMY	156.3 (-)	8,084 (-)	- (-)	- (-)
LINK REIT	1,035.3 (-)	56,476 (13)	694.9 (-)	36,819 (-)
PROSPERITY REIT	527 (-)	1,131 (-)	342 (-)	666 (-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,068 (-)	2,420 (-)	765 (-)	1,519 (-)
CHAMPION REIT	611 (-)	2,011 (-)	347 (-)	1,144 (-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338 (-)	1,111 (-)	235 (-)	761 (-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	629 (-)	3,979 (-)	387 (-)	2,469 (-)
LINK REIT-RTS	- (225.244)	- (△13)	225.244 (-)	900 (-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,344.8 (-)	4,700 (△2)	1,672.1 (-)	3,283 (-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,543.1 (-)	4,297 (△50)	1,075.5 (-)	2,989 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	980.7 (-)	1,428 (△7)	643.9 (-)	945 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,486.3 (-)	2,469 (△51)	1,003.1 (-)	1,660 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	531.2 (-)	292 (-)	328.7 (-)	174 (-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	908.2 (-)	935 (△15)	500.5 (-)	509 (-)
KEPPEL REIT	838.6 (-)	799 (-)	546.8 (-)	510 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	478 (-)	1,058 (-)	323.9 (-)	720 (-)
ESR LOGOS REIT	2,856.3 (-)	1,013 (△7)	1,512.7 (-)	522 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	346.6 (-)	419 (△1)	229.2 (-)	274 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	456.5 (-)	513 (△23)	246.2 (-)	265 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	544.5 (-)	143 (△6)	334.1 (-)	87 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	151.3 (-)	201 (△7)	86.5 (-)	116 (-)
PARKWAY LIFE REIT	166.2 (-)	693 (△5)	110.4 (-)	448 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	907.6 (-)	2,161 (△0.82883)	592.6 (-)	1,405 (-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,014.3 (-)	1,776 (△6)	648.6 (-)	1,135 (-)
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	- (-)	- (△0.67549)	124.4 (-)	148 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	451.3 (-)	278 (-)	273.7 (-)	164 (-)
PARAGON REIT	481.5 (-)	447 (-)	300.7 (-)	279 (-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	149.5 (-)	112 (-)	84.1 (-)	61 (-)
OUÉ COMMERCIAL REIT	930.2 (-)	320 (△2)	679 (-)	227 (-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	763.4 (-)	547 (-)	489.2 (-)	358 (-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	319.9 (-)	197 (△9)	197.1 (-)	115 (-)
IREIT GLOBAL	- (-)	- (△2)	168.6 (-)	85 (-)
KEPPEL DC REIT	584.4 (-)	1,133 (△12)	393.5 (-)	771 (-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,328.8 (-)	1,677 (△20)	918.7 (-)	1,178 (-)
ニュージーランド	千□	千ニュージーランド・ドル	千□	千ニュージーランド・ドル
PRECINCT PROPERTIES	509.611 (-)	653 (-)	290.797 (-)	368 (-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	222.906 (-)	551 (-)	155.612 (-)	378 (-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	516.012 (-)	1,075 (-)	357.07 (-)	742 (-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	721.983 (-)	671 (-)	478.656 (-)	436 (-)
ARGOSY PROPERTY LTD	275.903 (-)	319 (-)	189.331 (-)	218 (-)
STRIDE STAPLED GROUP	370.694 (-)	604 (-)	137.344 (-)	194 (-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	434.208 (-)	1,815 (-)	305.397 (-)	1,197 (-)
DERWENT LONDON PLC	52.718 (-)	1,297 (-)	37.483 (-)	873 (-)
BIG YELLOW GROUP PLC	75.861 (-)	922 (-)	50.084 (-)	583 (-)
HAMMERSON PLC	1,508.537 (-)	373 (-)	706.246 (-)	164 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	366.408	2,381	257.226	1,562
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	53.606	271	34.927	163
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	187.678	1,831	132.727	1,245
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	554.181	643	361.233	411
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY PLC	78.702	337	35.621	141
(△131.131)	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRE PLC	570.257	4,819	390.076	3,137
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	104.225	571	67.641	344
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	1,245.215	695	829.528	441
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	167.963	108	99.031	56
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	173.703	84	78.272	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
HELICAL PLC	48.089	132	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	216.96	173	148.03	117
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	352.394	212	212.48	119
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	97.634	973	65.858	626
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	451.633	887	310.201	579
	(-)	(-)	(-)	(-)
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	307.731	287	195.694	173
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	615.951	748	440.359	520
(440.075)	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSE REIT PLC	287.7	370	103.341	108
	(-)	(-)	(-)	(-)
NEWRIVER REIT PLC	120.548	99	85.737	68
	(-)	(-)	(-)	(-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	274.289	177	163.453	100
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRS REIT PLC/THE	196.87	179	128.075	113
	(-)	(-)	(-)	(-)
CLS HOLDINGS PLC	83.611	125	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	89.136	70	41.253	31
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	508.013	518	336.62	324
	(-)	(-)	(-)	(-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	819.933	1,267	551.355	789
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
CUSTODIAN REIT PLC	193.557	180	132.181	119
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOME REIT PLC	174.692	185	74.149	71
	(-)	(-)	(-)	(-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	240.146	209	150.055	130
	(-)	(-)	(-)	(-)
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	165.764	116	61.787	37
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEW UK REIT PLC	89.174	87	68.854	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXI REIT PLC	1,111.121	1,377	620.948	719
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGIONAL REIT LTD	167.475	101	137.217	79
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	330.767	504	109.087	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	119.991	120	70.745	67
	(-)	(-)	(-)	(-)
イスラエル	千□	千イスラエル・シケル	千□	千イスラエル・シケル
REIT 1 LTD	69.118	1,166	43.431	746
	(-)	(-)	(-)	(-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	80.834	689	52.096	426
	(-)	(-)	(-)	(-)
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314.331	606	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	34.658	146,210	24.14	102,277
	(-)	(-)	(-)	(-)
KOREA ASSET IN TRUST CO LTD	20.195	69,188	20.195	65,850
	(-)	(-)	(-)	(-)
E KOCREF CR-REIT CO LTD	17.156	94,585	6.021	33,257
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	15.023	104,263	4.736	37,583
	(-)	(-)	(-)	(-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	14.759	70,762	7.437	33,005
	(-)	(-)	(-)	(-)
LOTTE REIT CO LTD	59.659	244,534	43.308	178,793
	(-)	(-)	(-)	(-)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	28.054	146,125	18.676	92,921
	(-)	(-)	(-)	(-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	5.728	29,587	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
JR REIT XXVII	60.111	268,849	38.919	171,125
	(-)	(19)	(-)	(-)
SK REITS CO LTD	33.006	168,861	18.906	94,584
	(-)	(△768)	(-)	(-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	-	-	5.465	1,066
	(5.465)	(-)	(-)	(-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	70.841	295,417	40.489	169,257
	(-)	(△2,206)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
韓国	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
D&D PLATFORM REIT CO LTD	24.986	98,366	13.214	52,217
	(-)	(△417)	(-)	(-)
SK REITS CO LTD-RTS	-	-	4.739	222
	(4.739)	(△3)	(-)	(-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	17.936	70,562	8.211	34,740
	(-)	(△542)	(-)	(-)
JR GLOBAL REIT-RTS	-	-	10.483	-
	(10.483)	(△19)	(-)	(-)
ユーロ (シンガポール)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	152.8	266	91.5	159
	(-)	(△1)	(-)	(-)
ユーロ (アイルランド)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	176.964	204	104.581	114
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
VASTNED RETAIL	7.516	163	4.729	95
	(-)	(-)	(-)	(-)
WERELDHAVE NV	15.224	207	10.227	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
NSI NV	8.003	194	5.165	115
	(-)	(-)	(-)	(-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18.992	424	11.788	259
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ベルギー)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
BEFIMMO	1.948	92	9.279	438
	(-)	(-)	(-)	(-)
COFINIMMO SA	12.196	1,096	7.486	650
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL ESTATES	3.74	243	1.986	122
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9.762	206	4.114	85
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	74.256	2,085	48.101	1,309
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	6.113	482	3.163	247
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	19.056	1,553	12.573	982
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	17.34	265	10.177	154
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	-	-	10.525	6
	(10.525)	(-)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	9.298	287	6.001	189
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	24.441	2,397	16.79	1,571
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	13.296	585	8.653	380
	(-)	(△11)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
ALTAREA	1.833	234	0.998	121
	(-)	(-)	(-)	(-)
KLEPIERRE	87.765	1,895	61.026	1,303
	(-)	(-)	(-)	(-)
COVIVIO	19.493	1,111	13.199	721
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	34.454	319	16.738	148
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	25.9	367	12.842	177
	(-)	(△30)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	82	3.061	137
	(49.493)	(-)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48.794	2,559	35.157	1,783
	(△49.493)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (ドイツ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	23.841	178	14.982	112
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4.046	42	3.777	26
	(-)	(△25)	(-)	(-)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	129.781	785	78.618	448
	(-)	(△17)	(-)	(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19.613	95	12.25	59
	(-)	(△11)	(-)	(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	144.464	1,266	98.211	817
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (イタリア)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	12.141	39	5.946	16
	(-)	(-)	(-)	(-)
COIMA RES SPA	-	-	7.596	75
	(-)	(-)	(-)	(-)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

■利害関係人との取引状況等 (2022年6月23日から2023年6月22日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0	百万円 0.012	百万円 0.012	% 100.0

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

■組入資産の明細

外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		比率
		数	数	外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
不動産ファンド (アメリカ)						
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		227.5	391.9	121	17,247	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0	0.0
PRIME US REIT		159.8	317.6	65	9,243	0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		104.2	144.6	67	9,648	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		526.3	839	144	20,487	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		45,455	70,549	7,986	1,133,893	1.4
ALEXANDER'S INC.		0.661	1.021	186	26,411	0.0
BOSTON PROPERTIES INC		44.04	63.691	3,450	489,907	0.6
CEDAR REALTY TRUST INC		3.781	—	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		72.072	104.551	3,213	456,277	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		50.727	65.982	533	75,689	0.1
AGREE REALTY CORP		23.151	41.761	2,722	386,499	0.5
BRT APARTMENTS CORP		4.22	6.159	121	17,304	0.0
SL GREEN		19.707	28.057	729	103,564	0.1
EPR PROPERTIES		23.004	33.842	1,501	213,225	0.3
PROLOGIS INC		227.981	414.926	50,077	7,109,491	8.8
AVALONBAY COMMUNITIES INC		43.06	63.859	12,093	1,716,930	2.1
LXP INDUSTRIAL TRUST		86.864	131.103	1,301	184,824	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		32.805	47.839	5,307	753,539	0.9
VERIS RESIDENTIAL INC		26.897	35.212	588	83,584	0.1
EQUINIX INC		28.058	42.028	32,277	4,582,437	5.6
NNN REIT INC		54.298	82.288	3,437	487,974	0.6
CTO REALTY GROUTH INC		1.858	9.356	155	22,075	0.0
COUSINS PROPERTIES INC		45.843	68.071	1,463	207,776	0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		9.712	14.046	288	40,919	0.1
SITE CENTERS CORP		54.965	81.813	1,053	149,601	0.2
SAFEHOLD INC		—	17.782	412	58,619	0.1
DUKE REALTY TRUST		118.933	—	—	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		15.107	11.922	42	6,008	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		20.121	28.759	6,691	950,012	1.2
EQUITY RESIDENTIAL		105.387	152.806	10,010	1,421,165	1.8
FEDERAL REALTY INVS TRUST		21.871	33.218	3,068	435,613	0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		40.254	58.984	3,090	438,711	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		166.168	244.412	4,856	689,472	0.8
EQUITY COMMONWEALTH		34.761	49.039	1,017	144,462	0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		45.424	—	—	—	—
HIGHWOODS PROPERTIES INC		32.282	48.223	1,075	152,670	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST		55.097	76.925	661	93,920	0.1
WELLTOWER INC		139.809	223.439	17,649	2,505,691	3.1
EAST GROUP		12.57	20.032	3,458	490,949	0.6
KIMCO REALTY		191.008	277.027	5,291	751,193	0.9

銘 柄	期 首(前期末)	当 期			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
KILROY REALTY CORP	32.424	47.193	1,417	201,267	0.2
LTC PROPERTIES INC	11.949	18.9	627	89,137	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80.9	101.192	197	28,014	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	52.781	81.948	358	50,957	0.1
IRON MOUNTAIN INC	89.485	131.248	7,290	1,035,078	1.3
THE MACERICH COMPANY	65.088	95.956	1,048	148,898	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53.477	78.222	5,310	753,930	0.9
ACADIA REALTY TRUST	26.852	44.351	624	88,654	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	221.191	318.701	5,303	752,893	0.9
MID AMERICA	35.548	52.249	7,926	1,125,353	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.122	13.525	80	11,367	0.0
NATIONAL HEALTH INVS INC	14.064	19.429	1,029	146,219	0.2
CENTERSPACE	5.041	6.622	404	57,441	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5.609	8.132	170	24,267	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1.938	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	13.2	20.182	675	95,928	0.1
PS BUSINESS PARKS	6.193	—	—	—	—
RPT REALTY	25.143	40.594	397	56,421	0.1
REALTY INCOME CORP	185.275	302.637	18,040	2,561,165	3.2
REGENCY CENTERS CORP	47.683	68.717	4,098	581,833	0.7
UDR INC	92.65	138.65	5,885	835,591	1.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	34.498	50.428	1,202	170,676	0.2
SAUL CENTERS INC	4.594	5.447	195	27,723	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	101.12	147.007	16,278	2,310,999	2.8
LIFE STORAGE INC	25.982	38.018	4,956	703,715	0.9
PUBLIC STORAGE	47.03	71.125	20,466	2,905,690	3.6
SUN COMMUNITIES INC	37.453	55.989	7,392	1,049,474	1.3
TANGER FACTORY OUTLET	31.61	46.487	989	140,508	0.2
UMH PROPERTIES INC	13.569	26.109	419	59,529	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11.025	16.72	204	29,054	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3.781	6.151	289	41,147	0.1
VENTAS INC	123.095	179.26	8,059	1,144,211	1.4
VORNADO REALTY TRUST	49.038	71.874	1,113	158,059	0.2
ELME COMMUNITIES	25.835	40.732	645	91,656	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	43.066	—	—	—	—
KITE REALTY GROUP TRUST	67.449	99.789	2,096	297,649	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	41.354	60.583	8,845	1,255,827	1.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33.176	53.55	75	10,719	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67.157	94.114	922	130,941	0.2
CUBESMART	69.12	100.353	4,521	641,975	0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	87.671	131.006	13,669	1,940,611	2.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	64.291	91.448	717	101,915	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	184.696	266.517	2,379	337,888	0.4
DOUGLAS EMMETT INC	54.064	76.09	955	135,679	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	37.066	55.617	738	104,858	0.1

銘 柄	期 首(前期末)	当 期			末
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	37.982	58.595	407	57,815	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31.732	50.883	317	45,004	0.1
TERRENO REALTY CORP	23.266	32.893	1,914	271,736	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16.216	23.022	439	62,427	0.1
RLJ LODGING TRUST	50.885	70.804	705	100,218	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	82.511	121.186	3,868	549,176	0.7
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40.287	55.166	707	100,405	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	16.172	23.664	185	26,339	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	17.214	22.868	213	30,258	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70.265	103.588	1,215	172,505	0.2
WHITESTONE REIT	16.382	19.598	188	26,710	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	46.744	61.059	290	41,175	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	54.404	79.986	2,847	404,259	0.5
WP CAREY INC	59.552	96.284	6,571	932,939	1.1
ALEXANDER & BALDWIN INC	21.978	33.832	617	87,657	0.1
GLADSTONE LAND CORP	9.216	15.596	254	36,090	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	70.549	169.898	3,166	449,604	0.6
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16.978	25.104	2,331	331,061	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	20.128	29.672	353	50,171	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41.363	63.531	2,480	352,121	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	67.816	106.824	1,481	210,349	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	50.822	90.045	4,775	678,046	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT	91.409	140.789	4,917	698,174	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	68.065	101.147	1,826	259,338	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES	8.362	12.848	951	135,069	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	33.048	43.096	643	91,346	0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	36.884	63.796	421	59,776	0.1
INVITATION HOMES INC	187.961	260.485	8,903	1,264,012	1.6
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47.245	62.501	434	61,669	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13.541	17.079	384	54,555	0.1
SAFEHOLD INC	4.985	—	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS	40.391	66.693	1,589	225,632	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	21.803	26.881	76	10,876	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN	72.71	118.272	5,761	817,893	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	92.007	136.117	2,902	411,998	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20.173	22.683	88	12,591	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC	5.42	7.309	106	15,129	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.685	6.752	108	15,471	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20.754	29.365	661	93,843	0.1
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST	4.068	—	—	—	—
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	8.337	—	—	—	—
FARMLAND PARTNERS INC	9.907	23.717	278	39,563	0.0
CITY OFFICE REIT INC	15.394	17.231	92	13,063	0.0
ORION OFFICE REIT INC	16.725	28.112	183	26,061	0.0
NETSTREIT CORP	14.759	28.118	504	71,694	0.1

銘	柄	期首(前期末)		当		期		末	
		□	数	□	数	外貨建金額	邦貨換算金額	比	率
(アメリカ)			千□		千□	千アメリカ・ドル	千円		%
CARETRUST REIT INC			29.882		44.457	864	122,759		0.2
INDUS REALTY TRUST INC			2.312		2.103	140	19,952		0.0
PHILLIPS EDISON & CO INC			34.925		52.693	1,732	245,894		0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC			-		1.188	18	2,653		0.0
APARTMENT INCOME REIT CORP			48.505		67.666	2,419	343,433		0.4
BROADSTONE NET LEASE INC			52.141		83.884	1,312	186,376		0.2
STAR HOLDINGS			-		5.322	73	10,494		0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC			7.54		11.835	267	37,922		0.0
STORE CAPITAL CORP			77.766		-	-	-		-
PARAMOUNT GROUP INC			55.259		78.702	346	49,162		0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC			17.822		26.422	248	35,260		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES			33.994		52.509	779	110,702		0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I			29.19		42.482	610	86,728		0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC			35.217		49.736	606	86,073		0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC			6.895		10.016	454	64,585		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS			25.232		36.394	1,270	180,426		0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC			6.99		10.321	340	48,397		0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC			65.286		95.647	1,409	200,154		0.2
GLOBAL NET LEASE INC			31.417		48.468	490	69,566		0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE			-		14.638	167	23,794		0.0
CLIPPER REALTY INC			5.086		5.086	27	3,891		0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC			72.797		96.622	1,214	172,428		0.2
VICI PROPERTIES INC			296.576		451.537	14,060	1,996,220		2.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC			23.62		39.634	1,011	143,653		0.2
小計	□	数	金額	7,979.351	11,681.835	440,278	62,506.354		-
	銘	柄	数<比率>	151銘柄<76.0%>	145銘柄<77.0%>	-	-		77.0
(カナダ)			千□		千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT			21.535		31.367	756	81,683		0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT			26.099		37.034	1,789	193,120		0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT			42.878		58.204	593	64,070		0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST			32.504		46.831	675	72,929		0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST			46.43		66.005	1,258	135,769		0.2
ALLIED PROPERTIES REIT			19.099		28.626	612	66,111		0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU			8.213		8.533	109	11,833		0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST			7.546		9.738	589	63,570		0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU			17.493		24.568	168	18,161		0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV			16.748		24.648	339	36,681		0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST			22.588		32.303	405	43,751		0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES			33.05		55.673	380	41,096		0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT			6.458		8.705	139	15,049		0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT			4.643		4.643	15	1,653		0.0
DREAM INDUSTRIAL REIT			36.406		56.937	757	81,723		0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			15.423		15.423	47	5,076		0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT			27.533		-	-	-		-
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T			9.835		13.984	1,046	112,929		0.1

銘 柄	期 首(前期末)		当 期		末	
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比	率
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	16.803	21.434	51	5,505		0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	48.913	72.055	955	103,112		0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	5.26	9.341	134	14,465		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.147	25.088	362	39,069		0.0
PLAZA RETAIL REIT	16.376	—	—	—		—
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	10.116	17.876	50	5,459		0.0
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	15.769	82	8,934		0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	8.104	132	14,343		0.0
SLATE GROCERY REIT	7.969	12.066	154	16,706		0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	7.458	14.455	119	12,869		0.0
PRIMARIS REIT	13.944	21.998	274	29,627		0.0
SLATE OFFICE REIT	15.735	17.818	36	3,922		0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	7.481	8.337	93	10,094		0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	17.944	24.983	430	46,481		0.1
小 計	□ 数 ・ 金 額	579.627	792.546	12,563	1,355,806	—
	銘 柄 数<比 率>	30銘柄<1.9%>	30銘柄<1.7%>	—	—	1.7
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%
BWP TRUST	144.478	209.056	773	74,651		0.1
MIRVAC GROUP	1,217.477	1,776.143	4,138	399,398		0.5
CROMWELL PROPERTY GROUP	466.932	632.521	338	32,658		0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT	157.855	230.204	849	81,980		0.1
GPT GROUP	591.472	853.243	3,617	349,149		0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	189.484	302.227	513	49,585		0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	126.389	195.539	527	50,952		0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	98.14	160.446	482	46,608		0.1
STOCKLAND	737.402	1,071.893	4,544	438,621		0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	109.543	162.299	655	63,280		0.1
DEXUS	332.461	479.312	3,925	378,856		0.5
GOODMAN GROUP	523.576	769.687	15,755	1,520,562		1.9
VICINITY CENTRES	1,193.493	1,758.932	3,350	323,382		0.4
CHARTER HALL GROUP	145.638	212.89	2,356	227,444		0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	96.915	126.146	370	35,792		0.0
REGION RE LTD	341.231	515.147	1,200	115,840		0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	162.422	240.142	756	73,004		0.1
ARENA REIT	103.753	165.205	642	62,021		0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	186.309	299.469	1,260	121,676		0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	63.933	91.184	245	23,672		0.0
NATIONAL STORAGE REIT	329.249	538.807	1,287	124,280		0.2
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	65.661	85.857	285	27,509		0.0
GDI PROPERTY GROUP	178.986	222.442	151	14,598		0.0
RURAL FUNDS GROUP	126.29	173.97	300	28,962		0.0
IRONGATE GROUP	181.194	—	—	—		—
SCENTRE GROUP	1,606.393	2,339.436	6,269	605,087		0.7
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	140.343	140.343	95	9,210		0.0
HMC CAPITAL LTD	53.607	109.034	541	52,298		0.1

銘柄	期首(前期末)		当期		末
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%
HOMECO DAILY NEEDS REIT	439,583	709,912	841	81,188	0.1
HEALTHCO REIT	71,487	182,619	257	24,850	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	127.89	210,931	302	29,212	0.0
WAYPOINT REIT LTD	212,662	300,308	837	80,861	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	10,522,248 32銘柄<6.4%>	15,265,344 31銘柄<6.8%>	57,477 5,547,201	- -
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	648.62	1,145.32	51,825	940,636	1.2
PROSPERITY REIT	353	538	914	16,599	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	682	985	1,654	30,034	0.0
CHAMPION REIT	632.07	896.07	2,455	44,562	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	342	445	1,303	23,664	0.0
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	436	678	3,823	69,404	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	3,093.69 6銘柄<1.6%>	4,687.39 6銘柄<1.4%>	61,978 1,124,903	- -
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,573,909	2,246,609	4,448	471,162	0.6
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,037.96	1,505.56	4,140	438,539	0.5
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	668.49	1,005.29	1,306	138,424	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	985.82	1,469.02	2,482	262,961	0.3
STARHILL GLOBAL REIT	412.4	614.9	310	32,890	0.0
CAPITALAND ASCOTT TRUST	588.116	995.816	1,095	116,024	0.1
KEPPEL REIT	598.9	890.7	792	83,965	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	326.6	480.7	1,076	114,051	0.1
ESR LOGOS REIT	1,558.24	2,901.84	972	102,966	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	277.1	394.5	477	50,560	0.1
CAPITALAND CHINA TRUST	338.18	548.48	553	58,675	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	327.7	538.1	139	14,818	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	163,795	228,595	278	29,539	0.0
PARKWAY LIFE REIT	117.4	173.2	654	69,345	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	597.62	912.62	2,053	217,495	0.3
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	673.1	1,038.8	1,734	183,749	0.2
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	124.4	-	-	-	-
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	303.8	481.4	291	30,848	0.0
PARAGON REIT	313	493.8	469	49,688	0.1
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	112.4	112.4	35	3,809	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	194.5	259.9	184	19,545	0.0
OUE COMMERCIAL REIT	787,955	1,039,155	348	36,872	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	573	847.2	563	59,674	0.1
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	103.9	226.7	137	14,527	0.0
IREIT GLOBAL	168.6	-	-	-	-
KEPPEL DC REIT	403.5	594.4	1,230	130,324	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	894,764	1,304,864	1,657	175,528	0.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	14,225,149 27銘柄<3.5%>	21,304,549 25銘柄<3.6%>	27,435 2,905,990	- -

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	率
(ニュージーランド)	千□	千□	千ニュージーランド・ドル	千円		%
PRECINCT PROPERTIES	391.694	610.508	775	68,331		0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	142.269	209.563	490	43,216		0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	317.48	476.422	1,026	90,482		0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	467.188	710.515	646	56,982		0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	289.87	376.442	419	36,991		0.0
STRIDE STAPLED GROUP	—	233.35	324	28,585		0.0
小計	□ 数・金額 銘柄数<比率>	1,608.501 5銘柄<0.4%>	2,616.8 6銘柄<0.4%>	3,683 —	324,588 —	— 0.4
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%
BRITISH LAND CO PLC	288.115	416.926	1,372	248,755		0.3
DERWENT LONDON PLC	34.55	49.785	1,037	188,040		0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	53.044	78.821	848	153,855		0.2
HAMMERSON PLC	1,047.969	1,850.26	475	86,182		0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	230.251	339.433	1,940	351,764		0.4
WORKSPACE GROUP PLC	41.816	60.495	294	53,373		0.1
INTU PROPERTIES PLC	231.04	231.04	0	0		0.0
UNITE GROUP PLC	123.179	178.13	1,595	289,105		0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	407.879	600.827	581	105,409		0.1
SHAFTESBURY PLC	88.05	—	—	—		—
SEGRO PLC	370.318	550.499	4,037	731,731		0.9
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	77.506	114.09	495	89,823		0.1
ASSURA PLC	903.196	1,318.883	610	110,672		0.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	115.909	184.841	91	16,649		0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT HELICAL PLC	160.85 —	256.281 48.089	113 129	20,483 23,532		0.0 0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	179.543	248.473	187	34,000		0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	256.076	395.99	205	37,319		0.0
SAFESTORE HOLDINGS LTD	64.657	96.433	829	150,306		0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	300.333	441.765	753	136,591		0.2
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU	239.019	351.056	252	45,810		0.1
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	259.531	875.198	1,054	191,138		0.2
WAREHOUSE REIT PLC	—	184.359	151	27,499		0.0
NEWRIVER REIT PLC	113.346	148.157	128	23,200		0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	182.937	293.773	233	42,328		0.1
PRS REIT PLC/THE	181.169	249.964	197	35,835		0.0
CLS HOLDINGS PLC	—	83.611	112	20,396		0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT	105.686	153.569	78	14,250		0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	381.587	552.98	416	75,567		0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	575.519	844.097	1,109	201,021		0.2
CUSTODIAN REIT PLC	128.872	190.248	165	29,963		0.0
HOME REIT PLC	186.078	286.621	108	19,739		0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	197.945	288.036	252	45,730		0.1
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO P	—	103.977	63	11,419		0.0
AEW UK REIT PLC	58.66	78.98	78	14,314		0.0
LXI REIT PLC	277.287	767.46	681	123,515		0.2

銘柄	期首(前期末)	当期			末	
		□数	□数	外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円	%	
REGIONAL REIT LTD	150.233	180.491	84	15,309	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	-	221.68	264	47,971	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	136.07	185.316	168	30,463	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	8,148.22 34銘柄<5.5%>	13,500.634 38銘柄<4.7%>	21,204 -	3,843,073 -	- 4.7
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シェケル	千円	%	
REIT 1 LTD	61.727	87.414	1,429	56,044	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	63.623	92.361	730	28,662	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	-	314.331	539	21,139	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	125.35 2銘柄<0.1%>	494.106 3銘柄<0.1%>	2,699 -	105,846 -	- 0.1
(韓国)	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%	
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	28.835	39.353	169,021	18,643	0.0	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	-	11.135	59,572	6,570	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19.52	29.807	181,822	20,055	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11.032	18.354	86,080	9,494	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	39.603	55.954	217,101	23,946	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11.152	20.53	111,683	12,318	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	4.123	9.851	36,005	3,971	0.0	
JR REIT XXVII	45.194	66.386	301,060	33,206	0.0	
SK REITS CO LTD	17.691	31.791	164,041	18,093	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	43.616	73.968	308,076	33,980	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	14.329	26.101	86,394	9,529	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	11.162	20.887	75,610	8,339	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	246.257 11銘柄<0.3%>	404.117 12銘柄<0.2%>	1,796,470 -	198,150 -	- 0.2
(ユーロ…シンガポール)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CROMWELL REIT EUR	101.34	162.64	256	40,087	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	101.34 1銘柄<0.1%>	162.64 1銘柄<0.0%>	256 -	40,087 -	- 0.0
(ユーロ…アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	125.78	198.163	191	29,800	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	125.78 1銘柄<0.0%>	198.163 1銘柄<0.0%>	191 -	29,800 -	- 0.0
(ユーロ…オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	5.188	7.975	157	24,633	0.0	
WERELDHAVE NV	13.152	18.149	250	39,014	0.0	
NSI NV	5.696	8.534	168	26,359	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11.992	19.196	390	60,849	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	36.028 4銘柄<0.2%>	53.854 4銘柄<0.2%>	967 -	150,857 -	- 0.2
(ユーロ…ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
BEFIMMO	7.331	-	-	-	-	
COFINIMMO SA	9.07	13.78	979	152,842	0.2	
RETAIL ESTATES	3.376	5.13	324	50,577	0.1	

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率
(ユーロ…ベルギー)	千□		千□	千ユー□	千円	%
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6.965		12.613	188	29,357	0.0
WAREHOUSES DE PAUW	43.839		69.994	1,777	277,344	0.3
MONTEA SCA	3.06		6.01	441	68,816	0.1
AEDIFICA	11.176		17.659	1,079	168,456	0.2
CARE PROPERTY INVEST NV	8.849		16.012	199	31,123	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV	6.95		10.247	293	45,797	0.1
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	100.616	151.445	5,284	824,315	-
		9銘柄<1.3%>	8銘柄<1.0%>	-	-	1.0
(ユーロ…フランス)	千□		千□	千ユー□	千円	%
GECINA SA	16.786		24.437	2,360	368,255	0.5
ICADE	9.819		14.462	568	88,753	0.1
ALTAREA	1.248		2.083	213	33,339	0.0
KLEPIERRE	60.076		86.815	1,924	300,251	0.4
COVIVIO	14.518		20.812	918	143,308	0.2
MERCIALYS	17.947		35.663	291	45,453	0.1
CARMILA SA	13.198		26.256	364	56,933	0.1
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	-		48.183	2,236	348,918	0.4
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	35.856		-	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	169.448	258.711	8,879	1,385,213	-
		8銘柄<1.7%>	8銘柄<1.7%>	-	-	1.7
(ユーロ…ドイツ)	千□		千□	千ユー□	千円	%
HAMBORNER REIT AG	23.534		32.393	217	33,857	0.0
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3.67		3.939	20	3,133	0.0
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	27.204	36.332	237	36,991	-
		2銘柄<0.1%>	2銘柄<0.0%>	-	-	0.0
(ユーロ…スペイン)	千□		千□	千ユー□	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	82.605		133.768	742	115,816	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	18.955		26.318	144	22,539	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	102.599		148.852	1,155	180,194	0.2
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	204.159	308.938	2,041	318,550	-
		3銘柄<0.4%>	3銘柄<0.4%>	-	-	0.4
(ユーロ…イタリア)	千□		千□	千ユー□	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	14.36		20.555	51	8,064	0.0
COIMA RES SPA	7.596		-	-	-	-
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	21.956	20.555	51	8,064	-
		2銘柄<0.0%>	1銘柄<0.0%>	-	-	0.0
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	47,314.924	71,937.959	-	80,705,796	-
		328銘柄<99.3%>	324銘柄<99.4%>	-	-	99.4

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

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

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

■投資信託財産の構成

2023年6月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券、投資証券	80,705,796 千円	99.0 %
コール・ローン等、その他	810,337	1.0
投資信託財産総額	81,516,134	100.0

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

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、81,117,389千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年6月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=141.97円、1カナダ・ドル=107.92円、1オーストラリア・ドル=96.51円、1香港・ドル=18.15円、1シンガポール・ドル=105.92円、1ニュージーランド・ドル=88.13円、1イギリス・ポンド=181.24円、1イスラエル・シケル=39.213円、100韓国・ウォン=11.03円、1ユーロ=156.00円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年6月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	81,532,357,135円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	493,052,220
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	8,619,311,186
投 資 資 証 券(評価額)	72,086,485,439
未 収 入 金	18,624,711
未 収 配 当 金	314,883,579
(B) 負 債	333,262,325
未 払 金	211,605,325
未 払 解 約 金	121,657,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	81,199,094,810
元 本	47,496,039,171
次 期 繰 越 損 益 金	33,703,055,639
(D) 受 益 権 総 口 数	47,496,039,171口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	17,096円

(注1) 期首元本額 33,589,773,063円
 追加設定元本額 48,627,104,040円
 一部解約元本額 34,720,837,932円

(注2) 期末における元本の内訳
 D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ) 2,361,712,742円
 D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ) 35,315,437円
 M I T O ラップ型ファンド (安定型) 3,799,837円
 M I T O ラップ型ファンド (中立型) 16,993,360円
 M I T O ラップ型ファンド (積極型) 42,801,843円
 グローバル8資産ラップファンド (安定型) 53,631,948円
 グローバル8資産ラップファンド (中立型) 39,861,110円
 グローバル8資産ラップファンド (積極型) 42,915,263円
 たわらノーロード 先進国リート 15,013,942,860円
 たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け> 1,566,109,485円
 たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり> 331,123,558円
 たわらノーロード バランス (8資産均等型) 3,467,723,278円
 たわらノーロード バランス (堅実型) 28,608,263円
 たわらノーロード バランス (標準型) 563,881,175円
 たわらノーロード バランス (積極型) 1,170,685,116円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型) 48,387,380円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型) 499,698,074円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型) 506,479,071円
 たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型) 890,805,367円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定型) 623,293円
 たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型) 33,617,966円
 たわらノーロード 最適化バランス (成長型) 6,202,351円
 たわらノーロード 最適化バランス (積極型) 25,151,182円
 O n e D C先進国リートインデックスファンド 1,662,663,729円
 マネックス資産設計ファンド (隔月分配型) 18,491,200円
 マネックス資産設計ファンド (育成型) 690,947,972円
 マネックス資産設計ファンド エポリューション 57,534,103円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10) 214,120,117円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20) 312,458,906円
 D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30) 567,875,975円

投資のソムリエ 9,045,210,186円
 投資のソムリエ<DC年金> 720,615,046円
 D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金> 240,510,446円
 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 670,367,293円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド 2,618,196,372円
 ワールドアセットバランス (基本コース) 347,351,219円
 ワールドアセットバランス (リスク抑制コース) 1,009,390,261円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 42,415,971円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 20,915,842円
 リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC) 4,844,141円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 100,031,740円
 9資産分散投資・スタンダード<DC年金> 176,001,936円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 50,035,961円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 23,020,391円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 14,147,630円
 投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065) 3,342,049円
 O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け> 86,386,655円
 D I A Mパッシブ資産分散ファンド 284,697,856円
 D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金> 328,891,728円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) 217,802円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定) 647,540円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定) 125,270円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定) 285,547円
 インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04 (適格機関投資家限定) 711,941円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定) 506,310円
 投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定) 244,380,951円
 A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定) 1,243,561円
 インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) 572,716円
 リスクコントロール世界8資産バランスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用) 3,700,623円
 D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け) 54,518,708円
 D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定) 184,149,001円
 D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定) 944,444,517円
 期末元本合計 47,496,039,171円

■損益の状況

当期 自2022年6月23日 至2023年6月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,018,423,361円	
	受取配当金	3,005,881,073	
	受取利息	11,524,314	
	その他の収益	1,180,907	
	支払利息	△162,933	
(B)	有価証券売買損益	△1,857,706,305	
	売買益	7,975,013,780	
	売買損	△9,832,720,085	
(C)	その他の費用	△39,826,167	
(D)	当期損益金(A+B+C)	1,120,890,889	
(E)	前期繰越損益金	22,413,304,632	
(F)	解約差損益金	△21,875,935,842	
(G)	追加信託差損益金	32,044,795,960	
(H)	計(D+E+F+G)	33,703,055,639	
	次期繰越損益金(H)	33,703,055,639	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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