

## 運用報告書 (全体版)

### D I A M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 A M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 <sup>※</sup> 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111期 <決算日 2024年7月8日>  
第112期 <決算日 2024年9月6日>  
第113期 <決算日 2024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 A Mパッシブ資産分散ファンド」は、2024年11月6日に第113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 入率	株式先 物率	債券組 入率	債券先 物率	投資信託 受益証券、 投資証券組 入率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率						
第34作成期	99期(2022年7月6日)	円 10,735	円 20	% △0.0	% 16.1	% 0.3	% 65.8	% -	% 13.2	百万円 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
第37作成期	108期(2024年1月9日)	11,620	20	2.7	18.2	0.4	63.2	-	15.0	3,453
	109期(2024年3月6日)	12,287	20	5.9	18.2	0.3	64.6	-	14.6	3,498
	110期(2024年5月7日)	12,331	20	0.5	17.2	0.5	65.6	-	14.5	3,466
第38作成期	111期(2024年7月8日)	13,013	20	5.7	19.5	0.5	63.5	-	15.6	3,601
	112期(2024年9月6日)	12,136	20	△6.6	18.3	0.6	62.8	-	16.2	3,317
	113期(2024年11月6日)	12,750	20	5.2	19.0	0.7	62.1	-	16.5	3,470

(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。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。

(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111期	(期 首) 2024年 5 月 7 日	12,331	—	17.2	0.5	65.6	—	14.5
	5 月 末	12,469	1.1	19.0	0.4	62.6	—	15.6
	6 月 末	12,896	4.6	19.1	0.5	62.7	—	15.6
	(期 末) 2024年 7 月 8 日	13,033	5.7	19.5	0.5	63.5	—	15.6
第112期	(期 首) 2024年 7 月 8 日	13,013	—	19.5	0.5	63.5	—	15.6
	7 月 末	12,571	△3.4	19.3	0.6	62.0	—	15.6
	8 月 末	12,321	△5.3	19.7	0.6	61.5	—	15.9
	(期 末) 2024年 9 月 6 日	12,156	△6.6	18.3	0.6	62.8	—	16.2
第113期	(期 首) 2024年 9 月 6 日	12,136	—	18.3	0.6	62.8	—	16.2
	9 月 末	12,325	1.6	18.9	0.6	62.4	—	16.4
	10 月 末	12,817	5.6	18.8	0.5	62.2	—	16.1
	(期 末) 2024年 11 月 6 日	12,770	5.2	19.0	0.7	62.1	—	16.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

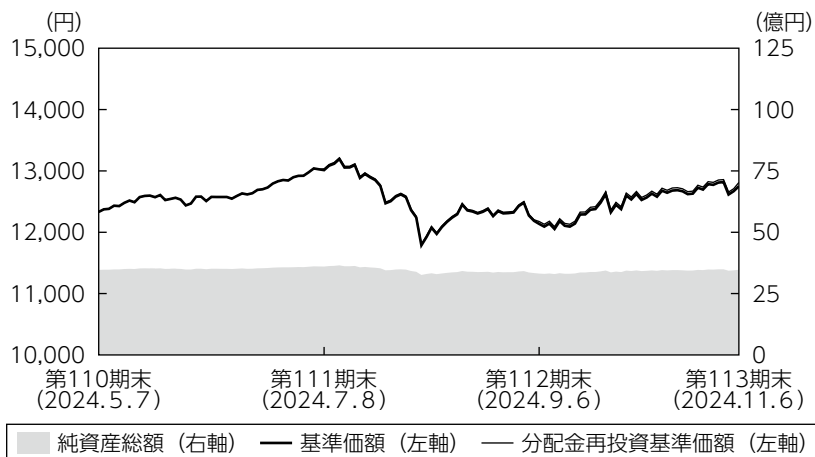
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。なお、不動産投信指数先物を含む場合があります。

(注4) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■第111期～第113期の運用経過（2024年5月8日から2024年11月6日まで）

### 基準価額等の推移



第111期首：12,331円  
 第113期末：12,750円  
 (既払分配金60円)  
 騰落率：3.9%  
 (分配金再投資ベース)

- (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

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や外国リート市場が上昇したこと、FRB（米連邦準備理事会）やECB（欧州中央銀行）が利下げを開始したこと等から主要国の債券市場が上昇したこと等がプラスに寄与し、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	2.4%
インデックス225 マザーファンド	2.5%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.5%

## 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低下（価格は上昇）しました。米国債は、米国のインフレの鈍化、米雇用者数の伸び鈍化や失業率の悪化などを受けて、F R Bが利下げを開始したことから利回りは低下しました。ドイツ国債についてもヨーロッパの景気悪化懸念を受け、E C Bが利下げを開始し利回りは低下しました。

国内株式市場は上昇しました。2024年7月上旬、早期利下げ期待の高まりを背景とする米国株高の流れを受け、上昇しました。8月上旬には、日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気の先行き懸念などを背景に円高ドル安が急速に進行したことが嫌気され、日経平均株価は歴史的な下落となりました。しかし、作成期末にかけては、円高修正が進んだことから、戻りを試す展開となりました。

外国リート市場は上昇しました。2024年6月以降、米長期金利の低下などが支えとなり外国リート市場は堅調に推移しました。10月以降は堅調な米雇用統計を受けて米長期金利が上昇したことや中東情勢に対する懸念などからリスク回避の動きも見られ上値の重い展開となりました。

為替市場では円は主要通貨に対して値動きの大きい展開となりました。ドル／円相場は、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となった後、日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気後退懸念等から急速に円高ドル安が進みました。その後、米景気後退懸念が和らいだこと等から再び円安ドル高に推移しました。その他主要通貨においても、円安で推移したのち急速に円高が進みましたが、再び円安方向に推移しました。

## 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。

リスクウェイトの乖離が一定以上となったため2024年11月上旬に基本リスクウェイトに近づけるオペレーションを実施していますが、決算日時点ではマザーファンドの売買が未反映のためリスクウェイトの乖離が大きいままとなっています。

## 【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 差
外国債券	39.1%	33.3%	5.8%
国内株式	30.1%	33.3%	△3.2%
外国リート	30.7%	33.3%	△2.6%
合計	100.0%	100.0%	0.0%

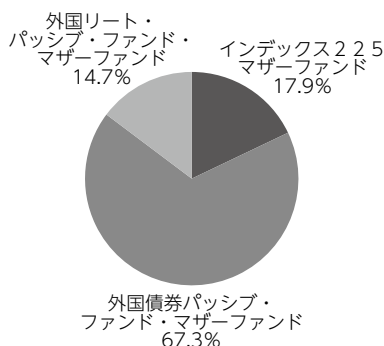
#### 当作成期末

	ファンド リスクウェイト	基本 リスクウェイト	本 差
外国債券	38.6%	33.3%	5.3%
国内株式	29.5%	33.3%	△3.9%
外国リート	31.9%	33.3%	△1.4%
合計	100.0%	100.0%	0.0%

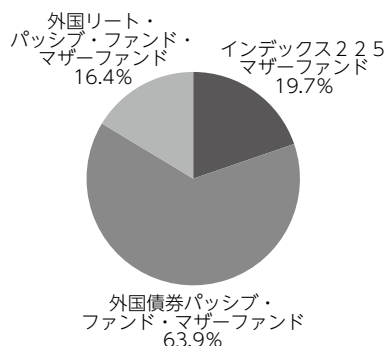
### ○マザーファンド組入比率

※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）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）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111期	第112期	第113期
	2024年5月8日 ～2024年7月8日	2024年7月9日 ～2024年9月6日	2024年9月7日 ～2024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	0.15%	0.16%	0.16%
当期の収益	20円	19円	20円
当期の収益以外	-円	0円	-円
翌期繰越分配対象額	3,064円	3,064円	3,105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111期～第113期		項目の概要
	(2024年5月8日 ～2024年11月6日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	69円	0.552%	(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12,542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)	(30)	(0.243)	
(販売会社)	(35)	(0.276)	
(受託会社)	( 4)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(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)	(0.002)	
(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	2	0.012	(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)	(0.003)	
合計	71	0.567	

(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。

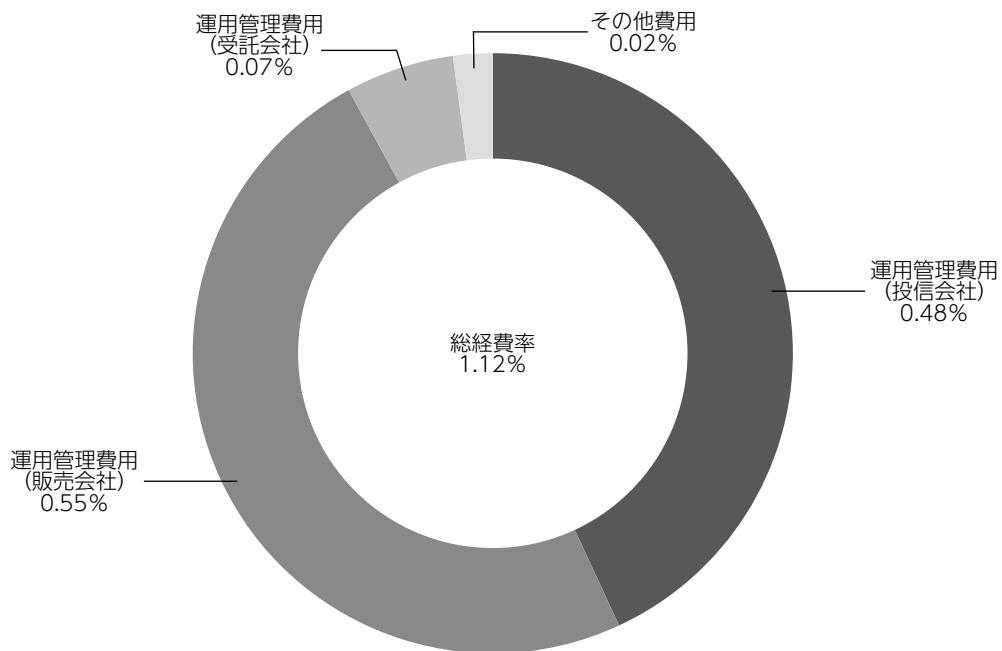
(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## (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（2024年5月8日から2024年11月6日まで）

	第 111 期 ~ 第 113 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	—	—	69,279	166,000
インデックス225マザーファンド	20,588	67,000	6,306	20,000
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	24,078	48,000	33,752	72,000

## ■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 111 期 ~ 第 113 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	62,088,419千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	200,522,503千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.30

(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（2024年5月8日から2024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 111 期 ~ 第 113 期
売買委託手数料総額 (A)	76千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B)/(A)	4.7%

(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

決 算 期 区 分	第 111 期 ~ 第 113 期			第 111 期 ~ 第 113 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 先 物 取 引	百万円 63,200	百万円 63,200	% 100.0	百万円 62,316	百万円 62,316	% 100.0

平均保有割合 0.3%

(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 111 期 ~ 第 113 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	百万円 10	百万円 4	百万円 62

### (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 111 期 ~ 第 113 期	
	買 付 額	
株 式	百万円 145	

## 【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 37 作 成 期 末		第 38 作 成 期 末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
		千□	千□	千円
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	968,512		899,232	2,191,969
インデックス 2 2 5 マザーファンド	184,747		199,029	676,918
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	259,847		250,172	561,012

## ■投資信託財産の構成

2024年11月6日現在

項 目	第 38 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	2,191,969	62.9
インデックス 2 2 5 マザーファンド	676,918	19.4
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	561,012	16.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	52,528	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	3,482,429	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、2024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269,733,238千円、99.7%、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドは95,966,359千円、95.6%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、2024年11月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=152.85円、1カナダ・ドル=110.12円、1オーストラリア・ドル=100.87円、1香港・ドル=19.66円、1シンガポール・ドル=115.73円、1ニュージーランド・ドル=91.28円、1イギリス・ポンド=198.23円、1イスラエル・シケル=40.771円、1デンマーク・クローネ=22.24円、1ノルウェー・クローネ=13.87円、1スウェーデン・クローナ=14.19円、1メキシコ・ペソ=7.527円、100韓国・ウォン=11.04円、1オフショア・人民元=21.419円、1マレーシア・リンギット=35.038円、1ポーランド・ズロチ=38.074円、1ユーロ=165.87円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月8日)、 (2024年9月6日)、 (2024年11月6日)現在

項 目	第 111 期 末	第 112 期 末	第 113 期 末
<b>(A) 資 産</b>	<b>3,616,169,251円</b>	<b>3,333,976,814円</b>	<b>3,482,429,443円</b>
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	49,279,970	43,295,228	52,528,849
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,280,335,778	2,106,632,045	2,191,969,212
インデックス2.2.5マザーファンド(評価額)	716,498,461	620,016,249	676,918,742
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	570,055,042	544,033,292	561,012,640
未 収 入 金	—	20,000,000	—
<b>(B) 負 債</b>	<b>14,687,890</b>	<b>16,404,170</b>	<b>12,339,343</b>
未 払 収 益 分 配 金	5,535,291	5,467,496	5,443,431
未 払 解 約 金	2,544,139	4,688,597	617,918
未 払 信 託 報 酬	6,587,417	6,228,180	6,258,001
そ の 他 未 払 費 用	21,043	19,897	19,993
<b>(C) 純 資 産 総 額(A－B)</b>	<b>3,601,481,361</b>	<b>3,317,572,644</b>	<b>3,470,090,100</b>
元 本	2,767,645,838	2,733,748,153	2,721,715,768
次 期 繰 越 損 益 金	833,835,523	583,824,491	748,374,332
<b>(D) 受 益 権 総 口 数</b>	<b>2,767,645,838口</b>	<b>2,733,748,153口</b>	<b>2,721,715,768口</b>
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,013円	12,136円	12,750円

(注) 第110期末における元本額は2,811,163,198円、当作成期間(第111期～第113期)中における追加設定元本額は6,653,128円、同解約元本額は96,100,558円です。

## ■損益の状況

[自 2024年5月8日]  
至 2024年7月8日]

[自 2024年7月9日]  
至 2024年9月6日]

[自 2024年9月7日]  
至 2024年11月6日]

項 目	第 111 期	第 112 期	第 113 期
(A) 配 当 等 収 益	5,622円	13,052円	16,032円
受 取 利 息	5,622	13,052	16,032
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	200,876,221	△228,005,157	178,761,500
売 買 益	202,011,104	3,832,987	179,219,371
売 買 損	△1,134,883	△231,838,144	△457,871
(C) 信 託 報 酬 等	△6,608,460	△6,248,077	△6,277,994
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	194,273,383	△234,240,182	172,499,538
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	641,012,221	818,488,693	575,839,718
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,085,210	5,043,476	5,478,507
(配 当 等 相 当 額)	(18,461,366)	(19,334,792)	(19,810,086)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△14,376,156)	(△14,291,316)	(△14,331,579)
(G) 合 計(D + E + F)	839,370,814	589,291,987	753,817,763
(H) 収 益 分 配 金	△5,535,291	△5,467,496	△5,443,431
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	833,835,523	583,824,491	748,374,332
追 加 信 託 差 損 益 金	4,085,210	5,043,476	5,478,507
(配 当 等 相 当 額)	(18,462,078)	(19,338,390)	(19,813,292)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△14,376,868)	(△14,294,914)	(△14,334,785)
分 配 準 備 積 立 金	829,750,313	818,344,380	825,305,554
繰 越 損 益 金	-	△239,563,365	△82,409,729

(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 111 期	第 112 期	第 113 期
(a) 経費控除後の配当等収益	14,798,802円	5,323,183円	16,563,327円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	179,474,581	0	0
(c) 収 益 調 整 金	18,462,078	19,338,390	19,813,292
(d) 分 配 準 備 積 立 金	641,012,221	818,488,693	814,185,658
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	853,747,682	843,150,266	850,562,277
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	3,084.74	3,084.23	3,125.10
(g) 分 配 金	5,535,291	5,467,496	5,443,431
(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 111 期	第 112 期	第 113 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21期（決算日 2024年2月21日）

（計算期間 2023年2月22日～2024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21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 (除く日本、円ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入率	債券先物率	純資産額
	期中騰落率	騰落率	期中騰落率	騰落率			
17期 (2020年2月21日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
18期 (2021年2月22日)	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
19期 (2022年2月21日)	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037
20期 (2023年2月21日)	20,152	1.6	126,280.23	1.7	98.9	-	141,964
21期 (2024年2月21日)	20,182	0.1	126,494.96	0.2	99.0	-	186,822
	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-	260,393

(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）。



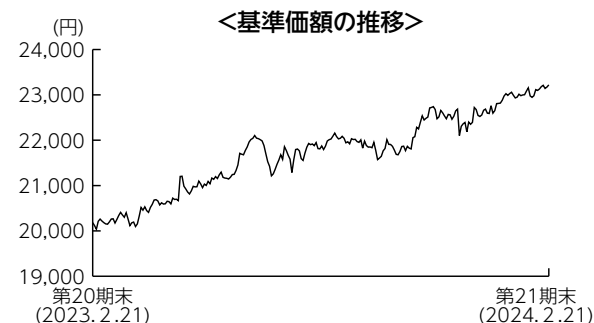
## ■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023 年 2 月 21 日	円 20,182	% -	ポイント 126,494.96	% -	% 99.0	% -
2 月 末	20,261	0.4	126,903.56	0.3	98.9	-
3 月 末	20,517	1.7	128,532.24	1.6	98.7	-
4 月 末	20,668	2.4	129,370.99	2.3	98.6	-
5 月 末	21,198	5.0	132,828.99	5.0	98.8	-
6 月 末	22,045	9.2	138,284.08	9.3	98.7	-
7 月 末	21,569	6.9	135,227.94	6.9	98.7	-
8 月 末	22,157	9.8	138,880.03	9.8	98.9	-
9 月 末	21,834	8.2	136,810.50	8.2	98.6	-
10 月 末	21,807	8.1	136,724.14	8.1	98.7	-
11 月 末	22,569	11.8	141,488.31	11.9	98.5	-
12 月 末	22,596	12.0	141,801.08	12.1	98.5	-
2024 年 1 月 末	22,998	14.0	144,118.59	13.9	99.4	-
(期 末) 2024 年 2 月 21 日	23,220	15.1	145,648.68	15.1	98.7	-

(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（2023年2月22日から2024年2月21日まで）

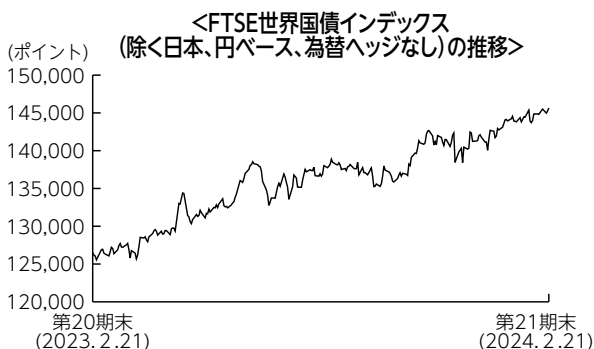


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は23,220円となり、前期末比で15.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは、上昇（価格は下落）しました。米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下（価格は上昇）したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドル／円については日銀が金融緩和を継続する中、F R B（米連邦準備理事会）が金融引き締めを継続したことを受け、日米金利差が意識され円安ドル高になりました。債券の価格下落よりも為替が円安に動いたことから、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

外国債券市場では、米国債利回りは上昇、ドイツ債の利回りは低下しました。米国債は、米銀破綻による金融機関への懸念などを巡り利回りは低下したのち、金融引き締め長期化観測が高まったことから利回りは上昇しました。ドイツ債については、金融引き締め長期化観測が高まり上昇したのちに、ユーロ圏の景気懸念やインフレの鈍化などから利回りは低下しました。

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、F R Bが金融引き締めを継続する中、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

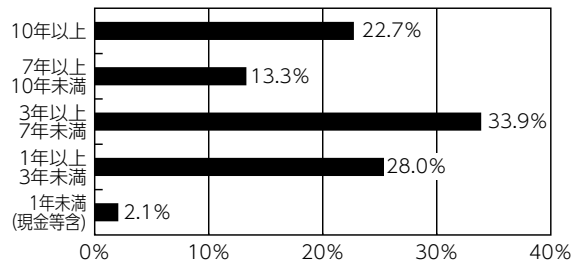
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

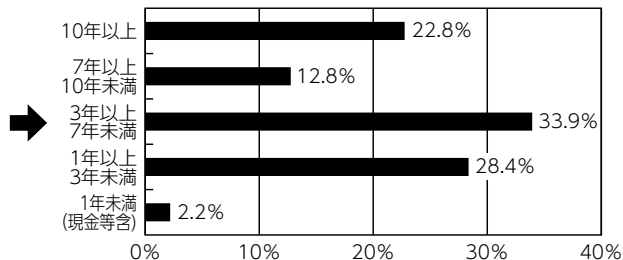
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○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	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%	-

#### 期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	46.7%	47.2%	△0.5%
カナダ	2.0%	2.0%	△0.0%
計	48.7%	49.2%	△0.5%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.9%	△0.0%
計	0.8%	0.9%	△0.0%
欧州			
オーストリア	1.2%	1.2%	△0.0%
ベルギー	1.7%	1.8%	△0.0%
フィンランド	0.5%	0.5%	△0.0%
フランス	8.0%	8.1%	△0.1%
ドイツ	6.3%	6.3%	△0.0%
アイルランド	0.6%	0.6%	△0.0%
イタリア	7.3%	7.3%	△0.1%
オランダ	1.5%	1.5%	△0.0%
スペイン	4.8%	4.9%	△0.1%
ユーロ計	31.8%	32.1%	△0.3%
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	5.2%	5.2%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.5%	△0.0%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.0%
計	38.1%	38.5%	△0.4%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.3%	1.4%	△0.0%
ニュージーランド	0.2%	0.2%	△0.0%
中国	8.3%	8.5%	△0.2%
シンガポール	0.4%	0.4%	△0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	△0.0%
計	10.7%	11.0%	△0.3%
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	1.3%	-	-
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15.1%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークと同程度となり、概ねベンチマークに連動した結果となりました。

## 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 (保 管 費 用)	3円	0.015%	(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
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	3	0.015	
期中の平均基準価額は21,728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 (2023年2月22日から2024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 459,048	千アメリカ・ドル 331,987	
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 25,463	千カナダ・ドル 17,904	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 16,897	千オーストラリア・ドル 13,157	
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 3,224	千シンガポール・ドル 2,464	
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 2,597	千ニュージーランド・ドル 989	
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 40,138	千イギリス・ポンド 22,621	
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 7,410	千イスラエル・シケル 3,549	
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 11,286	千デンマーク・クローネ 12,347	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 13,227	千ノルウェー・クローネ 10,083	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 9,524	千スウェーデン・クローナ 2,541	
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 113,030	千メキシコ・ペソ 81,670	
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 730,187	千オフショア・人民元 137,577	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 11,910	千マレーシア・リンギット 7,301	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 16,614	千ポーランド・ズロチ 10,609	
国	ユーロ	アイルランド	国債証券	千ユーロ 3,525	千ユーロ 2,887
		オランダ	国債証券	11,284	8,015
		ベルギー	国債証券	12,412	9,503
		フランス	国債証券	70,879	54,149
		ドイツ	国債証券	54,900	40,085
		スペイン	国債証券	40,842	30,090
		イタリア	国債証券	62,054	47,199
		フィンランド	国債証券	3,929	2,451
	オーストラリア	国債証券	10,493	7,197	

(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 (2023年2月22日から2024年2月21日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■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 916,450	千アメリカ・ドル 810,479	千円 121,701,636	% 46.7	% -	% 19.6	% 19.4	% 7.8	
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 50,260	千カナダ・ドル 46,076	千円 5,115,401	2.0	-	1.1	0.5	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 40,065	千オーストラリア・ドル 35,489	千円 3,492,489	1.3	-	0.9	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,855	千シンガポール・ドル 9,323	千円 1,041,728	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,570	千ニュージーランド・ドル 6,419	千円 594,617	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 86,324	千イギリス・ポンド 70,878	千円 13,437,202	5.2	-	3.5	1.1	0.6	
イスラエル	千イスラエル・シケル 22,320	千イスラエル・シケル 19,889	千円 810,730	0.3	-	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 32,720	千デンマーク・クローネ 30,676	千円 668,129	0.3	-	0.2	0.0	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 32,620	千ノルウェー・クローネ 29,940	千円 429,040	0.2	-	0.1	0.0	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 37,140	千スウェーデン・クローナ 35,693	千円 517,914	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 273,005	千メキシコ・ペソ 250,053	千円 2,201,447	0.8	-	0.5	0.3	0.0	
中 国	千オフショア・人民元 1,000,520	千オフショア・人民元 1,032,940	千円 21,528,239	8.3	-	3.7	3.7	0.8	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,060	千マレーシア・リンギット 38,987	千円 1,219,734	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,150	千ポーランド・ズロチ 35,744	千円 1,344,336	0.5	-	0.2	0.3	0.1	
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円						
アイルランド	10,200	9,105	1,478,204	0.6	-	0.4	0.1	0.0	
オランダ	25,700	23,264	3,776,775	1.5	-	0.8	0.5	0.1	
ベルギー	30,390	27,580	4,477,411	1.7	-	1.2	0.5	0.1	
フランス	141,120	128,977	20,938,250	8.0	-	4.8	2.6	0.6	
ドイツ	108,580	100,614	16,333,748	6.3	-	3.3	2.1	0.8	
スペイン	82,390	77,154	12,525,285	4.8	-	2.7	1.6	0.6	
イタリア	122,640	116,425	18,900,577	7.3	-	4.1	2.5	0.7	
フィンランド	9,630	8,170	1,326,408	0.5	-	0.3	0.1	0.1	
オーストリア	21,230	18,965	3,078,798	1.2	-	0.6	0.5	0.1	
合 計	-	-	千円 256,938,107	98.7	-	48.9	36.6	13.1	

(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	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	
(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	2,371	356,089	2026/01/31
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	5,740	5,288	794,126	2027/01/31
US T N/B 1.75 01/31/29	国債証券	1.7500	4,500	4,000	600,691	2029/01/31
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	750	725	108,912	2025/01/31
US T N/B 0.75 01/31/28	国債証券	0.7500	4,380	3,819	573,587	2028/01/31
US T N/B 4.125 01/31/25	国債証券	4.1250	1,800	1,785	268,146	2025/01/31
US T N/B 3.5 01/31/30	国債証券	3.5000	3,400	3,261	489,813	2030/01/31
US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	0.3750	5,700	5,256	789,361	2026/01/31
US T N/B 3.5 01/31/28	国債証券	3.5000	2,380	2,310	346,875	2028/01/31
US T N/B 4.0 01/15/27	国債証券	4.0000	3,000	2,968	445,728	2027/01/15
US T N/B 3.875 01/15/26	国債証券	3.8750	4,300	4,243	637,175	2026/01/15
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	2,400	2,464	370,083	2026/02/15
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	1,360	1,120	168,216	2042/02/15
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,540	1,255	188,501	2043/02/15
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,370	973	146,217	2046/02/15
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	1,000	903	135,633	2039/02/15
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	1,860	1,992	299,197	2031/02/15
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	500	515	77,347	2036/02/15
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,230	1,267	190,255	2041/02/15
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	1,424	213,888	2044/02/15
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	4,610	3,530	530,129	2049/02/15
US T N/B 2.25 02/15/52	国債証券	2.2500	5,000	3,219	483,415	2052/02/15
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	600	603	90,611	2038/02/15
US T N/B 3.625 02/15/53	国債証券	3.6250	3,800	3,277	492,149	2053/02/15
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	1,690	1,723	258,845	2040/02/15
US T N/B 2.375 02/15/42	国債証券	2.3750	3,610	2,636	395,854	2042/02/15
US T N/B 1.875 02/15/51	国債証券	1.8750	5,780	3,405	511,431	2051/02/15
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	6,090	5,751	863,678	2026/02/15
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,810	2,020	303,350	2045/02/15
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	2,360	1,825	274,185	2047/02/15
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,650	2,037	306,020	2048/02/15
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	2,040	1,981	297,545	2025/02/15
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,830	4,477	672,407	2029/02/15
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,540	4,283	643,206	2028/02/15
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,780	3,556	534,113	2027/02/15
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,280	2,189	328,837	2026/02/28
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,960	1,917	287,912	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	1.1250	9,690	7,896	1,185,695	2031/02/15
US T N/B 3.875 02/15/43	国債証券	3.8750	3,500	3,186	478,547	2043/02/15
US T N/B 1.875 02/15/41	国債証券	1.8750	5,100	3,485	523,327	2041/02/15
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	4,420	2,712	407,376	2050/02/15
US T N/B 1.875 02/15/32	国債証券	1.8750	8,280	6,939	1,041,964	2032/02/15
US T N/B 3.5 02/15/33	国債証券	3.5000	7,900	7,436	1,116,617	2033/02/15
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,000	150,171	2027/02/28
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	4,830	4,128	619,966	2030/02/15
US T N/B 1.875 02/28/27	国債証券	1.8750	5,210	4,844	727,417	2027/02/28
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	2,980	2,867	430,577	2025/02/28
US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	1.1250	4,690	4,143	622,257	2028/02/29

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 1.875 02/28/29	国債証券	1.8750	4,700	4,196	630,186	2029/02/28	
US T N/B 0.5 02/28/26	国債証券	0.5000	5,170	4,766	715,767	2026/02/28	
US T N/B 1.5 02/15/25	国債証券	1.5000	4,550	4,397	660,307	2025/02/15	
US T N/B 4.0 02/28/30	国債証券	4.0000	3,000	2,955	443,775	2030/02/28	
US T N/B 4.0 02/29/28	国債証券	4.0000	3,200	3,163	474,993	2028/02/29	
US T N/B 4.0 02/15/26	国債証券	4.0000	4,000	3,956	594,070	2026/02/15	
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	1,790	1,746	262,297	2025/03/31	
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,300	3,150	473,093	2026/03/31	
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	3,200	2,856	428,894	2027/03/31	
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	2,860	2,726	409,343	2025/03/31	
US T N/B 1.25 03/31/28	国債証券	1.2500	4,610	4,084	613,360	2028/03/31	
US T N/B 0.75 03/31/26	国債証券	0.7500	5,720	5,290	794,463	2026/03/31	
US T N/B 2.375 03/31/29	国債証券	2.3750	4,000	3,655	548,928	2029/03/31	
US T N/B 2.5 03/31/27	国債証券	2.5000	4,000	3,786	568,508	2027/03/31	
US T N/B 3.625 03/31/30	国債証券	3.6250	3,300	3,183	478,087	2030/03/31	
US T N/B 1.75 03/15/25	国債証券	1.7500	4,000	3,868	580,908	2025/03/15	
US T N/B 3.625 03/31/28	国債証券	3.6250	3,800	3,703	556,131	2028/03/31	
US T N/B 4.625 03/15/26	国債証券	4.6250	3,630	3,634	545,751	2026/03/15	
US T N/B 3.875 03/31/25	国債証券	3.8750	1,050	1,038	155,949	2025/03/31	
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	2,000	1,954	293,521	2025/04/30	
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	2,060	1,968	295,603	2026/04/30	
US T N/B 1.25 04/30/28	国債証券	1.2500	5,100	4,508	677,014	2028/04/30	
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,370	2,100	315,397	2027/04/30	
US T N/B 2.875 04/30/29	国債証券	2.8750	3,800	3,555	533,875	2029/04/30	
US T N/B 0.75 04/30/26	国債証券	0.7500	6,000	5,533	830,889	2026/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/28	国債証券	3.5000	3,100	3,005	451,331	2028/04/30	
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,560	2,428	364,723	2025/04/30	
US T N/B 2.75 04/30/27	国債証券	2.7500	6,000	5,713	857,953	2027/04/30	
US T N/B 3.5 04/30/30	国債証券	3.5000	3,000	2,873	431,413	2030/04/30	
US T N/B 3.75 04/15/26	国債証券	3.7500	6,000	5,904	886,600	2026/04/15	
US T N/B 2.625 04/15/25	国債証券	2.6250	3,000	2,925	439,288	2025/04/15	
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	759	839	126,116	2030/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,210	1,197	179,777	2040/05/15	
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,630	1,601	240,549	2041/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	1,080	869	130,615	2042/05/15	
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	950	933	140,155	2039/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,290	1,790	268,860	2043/05/15	
US T N/B 2.375 05/15/51	国債証券	2.3750	5,560	3,696	555,136	2051/05/15	
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	1,430	1,201	180,401	2044/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,290	1,011	151,893	2045/05/15	
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,620	1,251	187,879	2047/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/52	国債証券	2.8750	4,510	3,346	502,453	2052/05/15	
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,730	1,226	184,132	2046/05/15	
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,830	2,224	334,027	2048/05/15	
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	3,300	2,015	302,659	2040/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	4,600	3,435	515,839	2049/05/15	
US T N/B 3.625 05/15/53	国債証券	3.6250	3,510	3,029	454,981	2053/05/15	
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	600	609	91,556	2038/05/15	
US T N/B 2.25 05/15/41	国債証券	2.2500	4,420	3,201	480,734	2041/05/15	
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	3,950	3,823	574,086	2025/05/15	
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,860	4,594	689,924	2028/05/15	



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 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	3,770	3,439	516,436	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	4,430	4,166	625,673	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	755	810	121,723	2037/05/15
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	5,170	4,856	729,232	2026/05/15
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	8,380	4,185	628,531	2050/05/15
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,250	2,135	320,676	2026/05/31
US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	1.6250	8,740	7,316	1,098,697	2031/05/15
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	1,570	1,532	230,147	2025/05/31
US T N/B 3.25 05/15/42	国債証券	3.2500	3,760	3,143	472,092	2042/05/15
US T N/B 3.875 05/15/43	国債証券	3.8750	800	728	109,316	2043/05/15
US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	2.8750	8,050	7,264	1,090,860	2032/05/15
US T N/B 3.375 05/15/33	国債証券	3.3750	7,500	6,979	1,048,025	2033/05/15
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	2,980	2,632	395,230	2027/05/31
US T N/B 1.25 05/31/28	国債証券	1.2500	4,140	3,652	548,447	2028/05/31
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	7,050	5,653	848,990	2030/05/15
US T N/B 2.625 05/31/27	国債証券	2.6250	4,910	4,651	698,405	2027/05/31
US T N/B 2.75 05/31/29	国債証券	2.7500	3,300	3,065	460,240	2029/05/31
US T N/B 0.75 05/31/26	国債証券	0.7500	5,630	5,177	777,521	2026/05/31
US T N/B 3.625 05/31/28	国債証券	3.6250	2,500	2,435	365,721	2028/05/31
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	1,690	1,595	239,555	2025/05/31
US T N/B 3.75 05/31/30	国債証券	3.7500	3,500	3,397	510,121	2030/05/31
US T N/B 3.625 05/15/26	国債証券	3.6250	3,500	3,434	515,746	2026/05/15
US T N/B 2.75 05/15/25	国債証券	2.7500	2,200	2,145	322,144	2025/05/15
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	1,040	1,012	152,073	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	2,880	2,715	407,729	2026/06/30
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	2,780	2,448	367,718	2027/06/30
US T N/B 1.25 06/30/28	国債証券	1.2500	3,710	3,265	490,340	2028/06/30
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,500	3,293	494,529	2025/06/30
US T N/B 3.25 06/30/27	国債証券	3.2500	4,200	4,057	609,214	2027/06/30
US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	0.8750	4,510	4,152	623,586	2026/06/30
US T N/B 3.25 06/30/29	国債証券	3.2500	3,500	3,329	500,000	2029/06/30
US T N/B 2.875 06/15/25	国債証券	2.8750	2,420	2,361	354,536	2025/06/15
US T N/B 4.0 06/30/28	国債証券	4.0000	2,000	1,977	296,906	2028/06/30
US T N/B 4.125 06/15/26	国債証券	4.1250	4,700	4,661	700,031	2026/06/15
US T N/B 3.75 06/30/30	国債証券	3.7500	5,700	5,531	830,535	2030/06/30
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	2,200	2,143	321,828	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,500	2,352	353,183	2026/07/31
US T N/B 1.0 07/31/28	国債証券	1.0000	9,270	8,049	1,208,687	2028/07/31
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	3,780	3,304	496,221	2027/07/31
US T N/B 4.0 07/31/30	国債証券	4.0000	2,500	2,459	369,343	2030/07/31
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	3,800	3,563	535,067	2025/07/31
US T N/B 2.625 07/31/29	国債証券	2.6250	3,070	2,827	424,508	2029/07/31
US T N/B 4.125 07/31/28	国債証券	4.1250	2,500	2,484	373,061	2028/07/31
US T N/B 0.625 07/31/26	国債証券	0.6250	5,100	4,651	698,507	2026/07/31
US T N/B 2.75 07/31/27	国債証券	2.7500	3,820	3,625	544,426	2027/07/31
US T N/B 3.0 07/15/25	国債証券	3.0000	3,200	3,124	469,137	2025/07/15
US T N/B 4.5 07/15/26	国債証券	4.5000	4,100	4,102	615,956	2026/07/15
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	1,220	1,105	165,966	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,290	1,198	179,897	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,240	957	143,852	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	2,090	1,684	252,930	2044/08/15

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 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	1,480	1,492	224,181	2039/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,470	1,287	193,397	2043/08/15
US T N/B 2.0 08/15/51	国債証券	2.0000	5,810	3,522	528,927	2051/08/15
US T N/B 4.125 08/15/53	国債証券	4.1250	1,600	1,512	227,173	2053/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,770	1,355	203,495	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	3,550	3,411	512,338	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	2,230	1,640	246,263	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	4,140	2,705	406,314	2049/08/15
US T N/B 3.0 08/15/52	国債証券	3.0000	5,540	4,220	633,695	2052/08/15
US T N/B 4.375 08/15/43	国債証券	4.3750	2,000	1,948	292,647	2043/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,270	1,526	229,150	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,810	2,922	438,881	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	4,240	3,955	593,938	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	7,030	6,545	982,844	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	5,030	4,742	712,199	2028/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,830	1,777	266,844	2025/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	3,360	2,938	441,214	2029/08/15
US T N/B 3.375 08/15/42	国債証券	3.3750	2,920	2,482	372,739	2042/08/15
US T N/B 1.75 08/15/41	国債証券	1.7500	5,310	3,510	527,153	2041/08/15
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,060	2,456	368,814	2040/08/15
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	6,870	3,546	532,522	2050/08/15
US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	2.7500	7,840	6,984	1,048,768	2032/08/15
US T N/B 3.875 08/15/33	国債証券	3.8750	8,000	7,742	1,162,613	2033/08/15
US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	1.2500	8,960	7,241	1,087,383	2031/08/15
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	7,740	6,153	923,979	2030/08/15
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	2,800	2,596	389,899	2026/08/31
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	3,590	3,354	503,781	2025/08/31
US T N/B 1.125 08/31/28	国債証券	1.1250	3,730	3,249	488,017	2028/08/31
US T N/B 0.5 08/31/27	国債証券	0.5000	3,060	2,680	402,439	2027/08/31
US T N/B 0.75 08/31/26	国債証券	0.7500	4,950	4,517	678,384	2026/08/31
US T N/B 3.125 08/15/25	国債証券	3.1250	3,030	2,960	444,578	2025/08/15
US T N/B 3.125 08/31/29	国債証券	3.1250	3,110	2,935	440,838	2029/08/31
US T N/B 3.125 08/31/27	国債証券	3.1250	3,940	3,783	568,138	2027/08/31
US T N/B 4.375 08/15/26	国債証券	4.3750	4,000	3,991	599,431	2026/08/15
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,750	1,703	255,861	2025/09/30
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	3,810	3,312	497,388	2027/09/30
US T N/B 4.625 09/30/30	国債証券	4.6250	3,000	3,057	459,067	2030/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,550	1,444	216,919	2026/09/30
US T N/B 1.25 09/30/28	国債証券	1.2500	4,980	4,354	653,898	2028/09/30
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,720	3,465	520,399	2025/09/30
US T N/B 4.125 09/30/27	国債証券	4.1250	3,220	3,197	480,106	2027/09/30
US T N/B 0.875 09/30/26	国債証券	0.8750	5,510	5,036	756,246	2026/09/30
US T N/B 3.5 09/15/25	国債証券	3.5000	3,000	2,944	442,183	2025/09/15
US T N/B 3.875 09/30/29	国債証券	3.8750	4,550	4,459	669,563	2029/09/30
US T N/B 4.625 09/15/26	国債証券	4.6250	3,500	3,514	527,756	2026/09/15
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	2,270	2,208	331,602	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,410	2,240	336,454	2026/10/31
US T N/B 1.375 10/31/28	国債証券	1.3750	4,710	4,134	620,794	2028/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,660	3,187	478,590	2027/10/31
US T N/B 1.125 10/31/26	国債証券	1.1250	4,490	4,118	618,411	2026/10/31
US T N/B 4.0 10/31/29	国債証券	4.0000	2,700	2,662	399,730	2029/10/31

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 4.125 10/31/27	国債証券	4.1250	3,340	3,315	497,919	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	4,000	3,714	557,809	2025/10/31
US T N/B 4.625 10/15/26	国債証券	4.6250	3,400	3,415	512,877	2026/10/15
US T N/B 4.25 10/15/25	国債証券	4.2500	4,000	3,972	596,451	2025/10/15
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	1,350	1,406	211,165	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	2,200	2,334	350,598	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,960	1,543	231,777	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	1,300	1,261	189,496	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,556	1,197	179,882	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	1,020	843	126,592	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,460	1,300	195,336	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,250	1,652	248,089	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	5,280	2,917	438,077	2050/11/15
US T N/B 1.875 11/15/51	国債証券	1.8750	5,370	3,146	472,444	2051/11/15
US T N/B 4.0 11/15/52	国債証券	4.0000	4,860	4,492	674,588	2052/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	460	359	53,947	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	1,080	818	122,902	2046/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	1,000	992	149,086	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	3,450	2,834	425,581	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	3,690	2,478	372,127	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,120	4,916	738,276	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	5,480	5,213	782,857	2028/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	7,830	7,347	1,103,278	2026/11/15
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,038	456,239	2027/11/15
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	3,360	3,259	489,371	2025/11/30
US T N/B 4.0 11/15/42	国債証券	4.0000	3,120	2,895	434,789	2042/11/15
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	4,320	2,717	408,105	2040/11/15
US T N/B 4.75 11/15/43	国債証券	4.7500	500	512	76,927	2043/11/15
US T N/B 2.0 11/15/41	国債証券	2.0000	4,250	2,923	438,985	2041/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,810	1,680	252,318	2026/11/30
US T N/B 4.125 11/15/32	国債証券	4.1250	7,600	7,507	1,127,285	2032/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	2,850	2,497	375,063	2029/11/15
US T N/B 4.5 11/15/33	国債証券	4.5000	2,000	2,033	305,294	2033/11/15
US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	1.3750	8,590	6,959	1,044,999	2031/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	9,480	7,624	1,144,902	2030/11/15
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	3,900	3,403	511,082	2027/11/30
US T N/B 1.25 11/30/26	国債証券	1.2500	4,700	4,317	648,244	2026/11/30
US T N/B 1.5 11/30/28	国債証券	1.5000	5,000	4,406	661,701	2028/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	5,190	4,815	723,118	2025/11/30
US T N/B 3.875 11/30/29	国債証券	3.8750	2,800	2,742	411,825	2029/11/30
US T N/B 3.875 11/30/27	国債証券	3.8750	3,300	3,248	487,727	2027/11/30
US T N/B 4.5 11/15/25	国債証券	4.5000	3,570	3,559	534,542	2025/11/15
US T N/B 4.625 11/15/26	国債証券	4.6250	3,900	3,919	588,620	2026/11/15
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	3,000	2,894	434,704	2025/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	2,110	1,962	294,640	2026/12/31
US T N/B 1.25 12/31/26	国債証券	1.2500	3,890	3,566	535,578	2026/12/31
US T N/B 1.375 12/31/28	国債証券	1.3750	4,600	4,022	603,948	2028/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	4,000	3,701	555,861	2025/12/31
US T N/B 3.875 12/31/29	国債証券	3.8750	2,800	2,741	411,628	2029/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	4,020	3,497	525,216	2027/12/31
US T N/B 4.375 12/15/26	国債証券	4.3750	4,800	4,796	720,289	2026/12/15

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	
<b>(アメリカ)</b>			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 4.0 12/15/25		国債証券	4.0000	4,140	4,093	614,692	2025/12/15
US T N/B 3.875 12/31/27		国債証券	3.8750	4,600	4,527	679,794	2027/12/31
小計		—	—	916,450	810,479	121,701,636	—
<b>(カナダ)</b>			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 3.75 02/01/25		国債証券	3.7500	1,160	1,150	127,675	2025/02/01
CANADA 1.25 03/01/25		国債証券	1.2500	700	676	75,148	2025/03/01
CANADA 0.25 03/01/26		国債証券	0.2500	1,410	1,306	145,062	2026/03/01
CANADA 1.25 03/01/27		国債証券	1.2500	910	844	93,769	2027/03/01
CANADA 3.5 03/01/28		国債証券	3.5000	1,630	1,619	179,792	2028/03/01
CANADA 3.0 04/01/26		国債証券	3.0000	1,400	1,370	152,122	2026/04/01
CANADA 1.5 04/01/25		国債証券	1.5000	1,100	1,063	118,083	2025/04/01
CANADA 1.5 06/01/26		国債証券	1.5000	1,700	1,608	178,594	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29		国債証券	5.7500	740	818	90,862	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33		国債証券	5.7500	610	716	79,595	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37		国債証券	5.0000	630	728	80,894	2037/06/01
CANADA 4.0 06/01/41		国債証券	4.0000	740	790	87,730	2041/06/01
CANADA 2.0 06/01/28		国債証券	2.0000	930	871	96,783	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25		国債証券	2.2500	1,320	1,283	142,538	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27		国債証券	1.0000	550	504	56,015	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29		国債証券	2.2500	530	498	55,311	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30		国債証券	1.2500	2,350	2,051	227,786	2030/06/01
CANADA 2.75 06/01/33		国債証券	2.7500	1,180	1,109	123,221	2033/06/01
CANADA 1.5 06/01/31		国債証券	1.5000	2,470	2,151	238,845	2031/06/01
CANADA 2.0 06/01/32		国債証券	2.0000	1,590	1,417	157,375	2032/06/01
CANADA 3.5 08/01/25		国債証券	3.5000	400	394	43,835	2025/08/01
CANADA 0.5 09/01/25		国債証券	0.5000	2,310	2,180	242,092	2025/09/01
CANADA 2.75 09/01/27		国債証券	2.7500	1,050	1,015	112,775	2027/09/01
CANADA 1.0 09/01/26		国債証券	1.0000	2,670	2,484	275,819	2026/09/01
CANADA 3.25 09/01/28		国債証券	3.2500	1,200	1,181	131,149	2028/09/01
CANADA 3.0 10/01/25		国債証券	3.0000	1,660	1,625	180,456	2025/10/01
CANADA 3.5 12/01/45		国債証券	3.5000	800	806	89,588	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48		国債証券	2.7500	850	756	83,977	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51		国債証券	2.0000	3,460	2,590	287,617	2051/12/01
CANADA 1.75 12/01/53		国債証券	1.7500	2,180	1,515	168,246	2053/12/01
CANADA 2.75 12/01/64		国債証券	2.7500	390	339	37,706	2064/12/01
CANADA 2.75 12/01/55		国債証券	2.7500	300	263	29,268	2055/12/01
CANADA 3.25 12/01/33		国債証券	3.2500	2,100	2,056	228,316	2033/12/01
CANADA 0.5 12/01/30		国債証券	0.5000	2,600	2,132	236,789	2030/12/01
CANADA 1.5 12/01/31		国債証券	1.5000	2,420	2,089	231,956	2031/12/01
CANADA 2.5 12/01/32		国債証券	2.5000	1,520	1,403	155,853	2032/12/01
CANADA 2.25 12/01/29		国債証券	2.2500	700	655	72,741	2029/12/01
小計		—	—	50,260	46,076	5,115,401	—
<b>(オーストラリア)</b>			%	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	1,090	849	83,589	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25		国債証券	3.2500	1,100	1,090	107,360	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27		国債証券	4.7500	1,540	1,585	156,040	2027/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26		国債証券	4.2500	1,600	1,615	158,958	2026/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29		国債証券	3.2500	1,400	1,362	134,035	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33		国債証券	4.5000	1,660	1,702	167,580	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37		国債証券	3.7500	830	783	77,150	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28		国債証券	2.2500	1,780	1,674	164,777	2028/05/21

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(オーストラリア)</b>			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	1,660	1,529	150,519	2030/05/21	
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	960	762	75,080	2041/05/21	
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	2,130	1,706	167,951	2032/05/21	
AUSTRALIAN 3.75 05/21/34	国債証券	3.7500	1,800	1,734	170,694	2034/05/21	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	820	716	70,462	2039/06/21	
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	2,010	1,689	166,222	2031/06/21	
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	650	563	55,483	2035/06/21	
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	2,520	1,420	139,792	2051/06/21	
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	2,615	2,408	237,000	2026/09/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	450	429	42,287	2028/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,430	1,380	135,820	2027/11/21	
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,400	1,319	129,819	2029/11/21	
AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	国債証券	3.0000	1,670	1,513	148,951	2033/11/21	
AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	国債証券	1.7500	1,850	1,527	150,297	2032/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	2,470	1,969	193,799	2031/11/21	
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	1,460	1,372	135,065	2025/11/21	
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,670	1,374	135,234	2030/12/21	
AUSTRALIAN 3.5 12/21/34	国債証券	3.5000	1,500	1,407	138,513	2034/12/21	
小計	—	—	40,065	35,489	3,492,489	—	
<b>(シンガポール)</b>			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	800	810	90,501	2027/03/01	
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	460	441	49,339	2046/03/01	
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	840	672	75,082	2050/03/01	
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	660	636	71,104	2042/04/01	
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	340	334	37,399	2028/05/01	
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	780	769	85,999	2025/06/01	
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	590	576	64,404	2026/06/01	
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	640	635	70,970	2029/07/01	
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	190	174	19,487	2039/07/01	
SINGAPORE 1.625 07/01/31	国債証券	1.6250	840	760	84,946	2031/07/01	
SINGAPORE 3.0 08/01/72	国債証券	3.0000	125	127	14,224	2072/08/01	
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	890	816	91,260	2036/08/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	620	613	68,510	2030/09/01	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	580	594	66,424	2033/09/01	
SINGAPORE 2.875 09/01/27	国債証券	2.8750	200	198	22,223	2027/09/01	
SINGAPORE 1.875 10/01/51	国債証券	1.8750	510	409	45,725	2051/10/01	
SINGAPORE 1.25 11/01/26	国債証券	1.2500	510	485	54,281	2026/11/01	
SINGAPORE 0.5 11/01/25	国債証券	0.5000	280	267	29,842	2025/11/01	
小計	—	—	9,855	9,323	1,041,728	—	
<b>(ニュージーランド)</b>			%	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 4.5 04/15/27	国債証券	4.5000	800	793	73,529	2027/04/15	
NEW ZEALAND 3.5 04/14/33	国債証券	3.5000	450	406	37,662	2033/04/14	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	国債証券	2.7500	810	635	58,902	2037/04/15	
NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	国債証券	2.7500	670	650	60,235	2025/04/15	
NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	国債証券	3.0000	750	693	64,206	2029/04/20	
NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	国債証券	2.7500	540	355	32,892	2051/05/15	
NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	国債証券	1.7500	400	247	22,932	2041/05/15	
NEW ZEALAND 1.5 05/15/31	国債証券	1.5000	880	706	65,439	2031/05/15	
NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	国債証券	4.2500	130	123	11,456	2034/05/15	
NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	国債証券	2.0000	910	739	68,519	2032/05/15	
NEW ZEALAND 0.25 05/15/28	国債証券	0.2500	650	540	50,074	2028/05/15	

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	
(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 0.5 05/15/26		国 債 証 券	0.5000	580	526	48,766	2026/05/15
小 計		-	-	7,570	6,419	594,617	-
(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	1,640	1,356	257,233	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45		国 債 証 券	3.5000	1,550	1,324	251,087	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60		国 債 証 券	4.0000	900	816	154,822	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49		国 債 証 券	1.7500	1,130	658	124,799	2049/01/22
UK TREASURY 3.75 01/29/38		国 債 証 券	3.7500	1,650	1,543	292,668	2038/01/29
UK TREASURY 0.875 01/31/46		国 債 証 券	0.8750	1,350	664	125,901	2046/01/31
UK TREASURY 1.125 01/31/39		国 債 証 券	1.1250	2,110	1,354	256,764	2039/01/31
UK TREASURY 4.625 01/31/34		国 債 証 券	4.6250	400	416	78,930	2034/01/31
UK TREASURY 1.0 01/31/32		国 債 証 券	1.0000	2,470	1,970	373,512	2032/01/31
UK TREASURY 3.25 01/31/33		国 債 証 券	3.2500	2,500	2,351	445,707	2033/01/31
UK TREASURY 0.5 01/31/29		国 債 証 券	0.5000	1,880	1,590	301,513	2029/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28		国 債 証 券	0.1250	1,340	1,152	218,484	2028/01/31
UK TREASURY 0.25 01/31/25		国 債 証 券	0.2500	1,700	1,630	309,123	2025/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26		国 債 証 券	0.1250	1,750	1,617	306,579	2026/01/30
UK TREASURY 4.125 01/29/27		国 債 証 券	4.1250	2,340	2,334	442,643	2027/01/29
UK TREASURY 5.0 03/07/25		国 債 証 券	5.0000	1,485	1,488	282,244	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36		国 債 証 券	4.2500	1,300	1,302	246,995	2036/03/07
UK TREASURY 4.25 06/07/32		国 債 証 券	4.2500	1,770	1,804	342,006	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25		国 債 証 券	0.6250	1,060	1,008	191,181	2025/06/07
UK TREASURY 4.5 06/07/28		国 債 証 券	4.5000	1,750	1,779	337,300	2028/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47		国 債 証 券	1.5000	1,200	671	127,395	2047/07/22
UK TREASURY 1.25 07/31/51		国 債 証 券	1.2500	1,730	839	159,095	2051/07/31
UK TREASURY 3.75 07/22/52		国 債 証 券	3.7500	970	841	159,613	2052/07/22
UK TREASURY 1.5 07/31/53		国 債 証 券	1.5000	1,210	612	116,163	2053/07/31
UK TREASURY 1.75 07/22/57		国 債 証 券	1.7500	1,260	664	125,977	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65		国 債 証 券	2.5000	1,250	790	149,810	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68		国 債 証 券	3.5000	1,480	1,209	229,224	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26		国 債 証 券	1.5000	1,900	1,785	338,431	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27		国 債 証 券	1.2500	1,100	1,002	190,046	2027/07/22
UK TREASURY 0.875 07/31/33		国 債 証 券	0.8750	2,100	1,577	299,050	2033/07/31
UK TREASURY 0.25 07/31/31		国 債 証 券	0.2500	2,240	1,707	323,797	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35		国 債 証 券	0.6250	1,650	1,119	212,208	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39		国 債 証 券	4.2500	1,060	1,037	196,777	2039/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25		国 債 証 券	2.0000	1,110	1,069	202,679	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34		国 債 証 券	4.5000	1,200	1,235	234,298	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37		国 債 証 券	1.7500	1,890	1,394	264,361	2037/09/07
UK TREASURY 3.75 10/22/53		国 債 証 券	3.7500	1,800	1,553	294,531	2053/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/54		国 債 証 券	1.6250	1,270	659	124,953	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61		国 債 証 券	0.5000	1,880	553	105,010	2061/10/22
UK TREASURY 4.0 10/22/63		国 債 証 券	4.0000	820	741	140,616	2063/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71		国 債 証 券	1.6250	830	380	72,117	2071/10/22
UK TREASURY 1.125 10/22/73		国 債 証 券	1.1250	740	267	50,729	2073/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41		国 債 証 券	1.2500	1,750	1,062	201,452	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50		国 債 証 券	0.6250	1,640	653	123,948	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28		国 債 証 券	1.6250	1,030	929	176,235	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29		国 債 証 券	0.8750	1,430	1,211	229,594	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30		国 債 証 券	0.3750	1,390	1,103	209,195	2030/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/26		国 債 証 券	0.3750	2,430	2,199	417,048	2026/10/22

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	
<b>(イギリス)</b>			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.5 10/22/25	国債証券	3.5000	1,500	1,475	279,692	2025/10/22	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	980	1,066	202,208	2028/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	1,380	1,433	271,745	2038/12/07	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,745	1,738	329,574	2042/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,280	1,217	230,757	2046/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,112	1,051	199,340	2055/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	1,310	1,318	249,993	2027/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	1,770	1,722	326,463	2040/12/07	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,495	1,566	297,060	2030/12/07	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	1,317	1,247	236,498	2049/12/07	
小計	—	—	86,324	70,878	13,437,202	—	
<b>(イスラエル)</b>			%	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	1,410	1,557	63,474	2042/01/31	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	国債証券	0.5000	1,430	1,340	54,621	2026/02/27	
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,810	1,561	63,652	2047/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	1,660	1,573	64,133	2027/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	2,860	2,401	97,869	2030/03/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	国債証券	1.3000	2,300	1,845	75,210	2032/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	国債証券	0.5000	1,890	1,819	74,162	2025/04/30	
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	2,420	1,697	69,175	2037/05/31	
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,000	1,941	79,122	2025/08/31	
ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	国債証券	2.2500	2,360	2,199	89,634	2028/09/28	
ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	国債証券	6.2500	1,220	1,294	52,768	2026/10/30	
ISRAEL FIXED BOND 11/29/52	国債証券	2.8000	960	660	26,904	2052/11/29	
小計	—	—	22,320	19,889	810,730	—	
<b>(デンマーク)</b>			%	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	4,560	2,443	53,218	2052/11/15	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	7,650	9,509	207,116	2039/11/15	
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	3,740	3,675	80,049	2025/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	4,850	4,516	98,367	2027/11/15	
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	5,140	4,627	100,786	2029/11/15	
DENMARK 0.0 11/15/31	国債証券	0.0000	5,080	4,236	92,261	2031/11/15	
DENMARK 2.25 11/15/33	国債証券	2.2500	1,700	1,667	36,328	2033/11/15	
小計	—	—	32,720	30,676	668,129	—	
<b>(ノルウェー)</b>			%	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	6,710	6,386	91,511	2026/02/19	
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	5,100	4,792	68,683	2027/02/17	
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	1,130	1,099	15,759	2025/03/13	
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	1,924	27,576	2028/04/26	
NORWAY 2.125 05/18/32	国債証券	2.1250	2,030	1,788	25,630	2032/05/18	
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	4,610	3,978	57,006	2030/08/19	
NORWAY 3.0 08/15/33	国債証券	3.0000	2,900	2,715	38,916	2033/08/15	
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	2,920	2,627	37,652	2029/09/06	
NORWAY 1.25 09/17/31	国債証券	1.2500	2,950	2,460	35,254	2031/09/17	
NORWAY 3.5 10/06/42	国債証券	3.5000	2,200	2,166	31,049	2042/10/06	
小計	—	—	32,620	29,940	429,040	—	
<b>(スウェーデン)</b>			%	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	3,990	4,443	64,482	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	3,390	3,159	45,848	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	5,920	5,870	85,174	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	4,920	4,191	60,812	2031/05/12	

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(スウェーデン)</b>			%	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 2.25 06/01/32	国債証券	2.2500	4,050	4,004	58,106	2032/06/01	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	8,210	7,852	113,945	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	3,960	3,622	52,565	2029/11/12	
SWEDEN 1.75 11/11/33	国債証券	1.7500	2,700	2,548	36,979	2033/11/11	
小計	—	—	37,140	35,693	517,914	—	
<b>(メキシコ)</b>			%	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	36,282	33,436	294,374	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/04/27	国債証券	5.5000	25,080	22,431	197,487	2027/03/04	
MEXICAN BONDS 03/06/25	国債証券	5.0000	3,680	3,495	30,777	2025/03/06	
MEXICAN BONDS 03/01/29	国債証券	8.5000	9,500	9,173	80,763	2029/03/01	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	24,159	23,435	206,327	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	30,148	27,780	244,579	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 05/26/33	国債証券	7.5000	19,290	17,202	151,446	2033/05/26	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	28,146	26,588	234,081	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 07/31/53	国債証券	8.0000	13,290	11,397	100,340	2053/07/31	
MEXICAN BONDS 09/03/26	国債証券	7.0000	8,000	7,502	66,049	2026/09/03	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	24,707	21,151	186,219	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	19,561	17,001	149,680	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	15,642	14,631	128,813	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	5,485	5,803	51,092	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	10,035	9,020	79,413	2034/11/23	
小計	—	—	273,005	250,053	2,201,447	—	
<b>(中国)</b>			%	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	15,500	15,832	329,979	2032/02/17	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 02/25/33	国債証券	2.8800	11,200	11,589	241,546	2033/02/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	2.2600	40,500	40,634	846,893	2025/02/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	国債証券	3.3900	19,100	21,625	450,709	2050/03/16	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	国債証券	2.8000	11,000	11,253	234,531	2029/03/24	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26	国債証券	3.0300	54,000	55,050	1,147,353	2026/03/11	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/25/30	国債証券	2.8000	10,000	10,231	213,231	2030/03/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	国債証券	3.3200	15,820	17,880	372,661	2052/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	国債証券	3.7200	7,600	9,140	190,494	2051/04/12	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.19 04/15/53	国債証券	3.1900	8,500	9,524	198,515	2053/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	国債証券	2.4800	25,100	25,320	527,716	2027/04/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	国債証券	3.0200	18,500	19,263	401,475	2031/05/27	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	国債証券	2.7600	9,000	9,195	191,659	2032/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.67 05/25/33	国債証券	2.6700	14,500	14,741	307,229	2033/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	国債証券	3.0100	54,000	55,641	1,159,653	2028/05/13	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 05/23/29	国債証券	3.2900	4,000	4,205	87,647	2029/05/23	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	国債証券	2.6800	64,600	65,640	1,368,063	2030/05/21	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	国債証券	2.3000	39,500	39,609	825,527	2026/05/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	国債証券	2.2400	8,490	8,500	177,163	2025/05/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	国債証券	2.8500	23,500	23,977	499,730	2027/06/04	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	国債証券	2.7500	22,000	22,447	467,837	2029/06/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	国債証券	3.2500	18,450	18,952	395,004	2026/06/06	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 06/25/30	国債証券	2.6200	10,000	10,119	210,916	2030/06/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.86 07/22/49	国債証券	3.8600	5,800	7,059	147,125	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.4 07/15/28	国債証券	2.4000	25,000	25,102	523,181	2028/07/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	20,410	20,567	428,669	2027/07/25	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	国債証券	2.6900	21,000	21,379	445,593	2032/08/15	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	国債証券	2.1800	20,000	20,016	417,187	2025/08/25	



銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(中国)</b>			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26		国債証券	2.6900	60,600	61,382	1,279,310	2026/08/12
CHINA GOVERNMENT BOND 3.59 08/03/27		国債証券	3.5900	5,000	5,262	109,681	2027/08/03
CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26		国債証券	2.1800	42,000	41,999	875,345	2026/08/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.81 09/14/50		国債証券	3.8100	17,500	21,268	443,269	2050/09/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32		国債証券	2.6000	18,300	18,441	384,348	2032/09/01
CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/15/30		国債証券	2.6000	3,000	3,034	63,243	2030/09/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29		国債証券	2.6200	18,000	18,257	380,521	2029/09/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.12 10/25/52		国債証券	3.1200	9,500	10,348	215,677	2052/10/25
CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51		国債証券	3.5300	12,450	14,536	302,960	2051/10/18
CHINA GOVERNMENT BOND 4.08 10/22/48		国債証券	4.0800	10,300	12,842	267,651	2048/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28		国債証券	2.9100	29,100	29,934	623,887	2028/10/14
CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27		国債証券	2.4400	21,000	21,134	440,477	2027/10/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32		国債証券	2.8000	31,300	32,050	667,976	2032/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31		国債証券	2.8900	15,100	15,568	324,466	2031/11/18
CHINA GOVERNMENT BOND 3.27 11/19/30		国債証券	3.2700	3,000	3,166	65,990	2030/11/19
CHINA GOVERNMENT BOND 3.13 11/21/29		国債証券	3.1300	8,000	8,341	173,843	2029/11/21
CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25		国債証券	2.2800	31,800	31,878	664,392	2025/11/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.39 11/15/26		国債証券	2.3900	22,000	22,131	461,263	2026/11/15
CHINA GOVERNMENT BOND 2.54 12/25/30		国債証券	2.5400	3,000	3,021	62,981	2030/12/25
CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29		国債証券	2.7900	24,000	24,550	511,670	2029/12/15
CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27		国債証券	3.2800	18,500	19,287	401,976	2027/12/03
小計		—	—	1,000,520	1,032,940	21,528,239	—
<b>(マレーシア)</b>			%	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	1,000	1,011	31,652	2027/03/15
MALAYSIA 4.457 03/31/53		国債証券	4.4570	2,000	2,077	64,985	2053/03/31
MALAYSIA 4.736 03/15/46		国債証券	4.7360	300	324	10,155	2046/03/15
MALAYSIA 4.392 04/15/26		国債証券	4.3920	1,050	1,070	33,485	2026/04/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30		国債証券	4.4980	1,200	1,250	39,132	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33		国債証券	3.8440	1,660	1,655	51,799	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37		国債証券	4.7620	1,700	1,835	57,423	2037/04/07
MALAYSIA 2.632 04/15/31		国債証券	2.6320	1,100	1,020	31,914	2031/04/15
MALAYSIA 4.504 04/30/29		国債証券	4.5040	2,950	3,068	96,012	2029/04/30
MALAYSIA 3.502 05/31/27		国債証券	3.5020	650	650	20,346	2027/05/31
MALAYSIA 3.757 05/22/40		国債証券	3.7570	1,500	1,447	45,274	2040/05/22
MALAYSIA 4.254 05/31/35		国債証券	4.2540	1,400	1,437	44,977	2035/05/31
MALAYSIA 3.733 06/15/28		国債証券	3.7330	2,000	2,008	62,822	2028/06/15
MALAYSIA 4.232 06/30/31		国債証券	4.2320	670	687	21,501	2031/06/30
MALAYSIA 4.065 06/15/50		国債証券	4.0650	1,700	1,664	52,076	2050/06/15
MALAYSIA 4.921 07/06/48		国債証券	4.9210	1,990	2,203	68,947	2048/07/06
MALAYSIA 3.906 07/15/26		国債証券	3.9060	1,920	1,942	60,766	2026/07/15
MALAYSIA 3.828 07/05/34		国債証券	3.8280	1,820	1,811	56,668	2034/07/05
MALAYSIA 3.582 07/15/32		国債証券	3.5820	1,400	1,372	42,924	2032/07/15
MALAYSIA 3.885 08/15/29		国債証券	3.8850	700	707	22,148	2029/08/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25		国債証券	3.9550	1,950	1,964	61,467	2025/09/15
MALAYSIA 4.935 09/30/43		国債証券	4.9350	1,600	1,767	55,286	2043/09/30
MALAYSIA 4.696 10/15/42		国債証券	4.6960	960	1,035	32,410	2042/10/15
MALAYSIA 3.9 11/30/26		国債証券	3.9000	1,660	1,679	52,550	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27		国債証券	3.8990	1,730	1,752	54,811	2027/11/16
MALAYSIA 4.642 11/07/33		国債証券	4.6420	1,450	1,540	48,191	2033/11/07
小計		—	—	38,060	38,987	1,219,734	—

銘柄	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	
<b>(ポーランド)</b>		%	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	3,190	3,265	122,805	2029/04/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,460	3,162	118,954	2028/04/25
POLAND 1.75 04/25/32	国債証券	1.7500	5,440	4,178	157,143	2032/04/25
POLAND 0.75 04/25/25	国債証券	0.7500	4,170	3,973	149,430	2025/04/25
POLAND 3.75 05/25/27	国債証券	3.7500	3,650	3,511	132,070	2027/05/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	3,290	3,104	116,759	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	1,590	1,551	58,339	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,360	2,175	81,802	2027/07/25
POLAND 7.5 07/25/28	国債証券	7.5000	3,400	3,709	139,526	2028/07/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	2,000	1,767	66,476	2029/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	4,720	3,684	138,558	2030/10/25
POLAND 0.25 10/25/26	国債証券	0.2500	1,880	1,661	62,470	2026/10/25
小計	—	—	39,150	35,744	1,344,336	—
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	840	708	115,032	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	660	608	98,854	2031/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	590	602	97,848	2025/03/13
IRISH 0.55 04/22/41	国債証券	0.5500	250	169	27,533	2041/04/22
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	650	472	76,713	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	290	257	41,861	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	960	951	154,412	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	710	664	107,847	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	730	678	110,182	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	1,120	1,079	175,166	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	780	678	110,181	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	370	286	46,572	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	420	389	63,203	2027/05/15
IRISH 3.0 10/18/43	国債証券	3.0000	210	211	34,264	2043/10/18
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	670	550	89,393	2031/10/18
IRISH 0.35 10/18/32	国債証券	0.3500	600	495	80,386	2032/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	350	300	48,749	2030/10/18
小計	—	—	10,200	9,105	1,478,204	—
<b>(ユーロ…オランダ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,320	1,495	242,756	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	1,710	1,708	277,407	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	1,430	688	111,827	2052/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	1,090	1,202	195,264	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	1,320	1,489	241,846	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	1,310	1,301	211,215	2033/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	国債証券	0.0000	990	675	109,626	2038/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	1,310	929	150,963	2040/01/15
NETHERLANDS 2.0 01/15/54	国債証券	2.0000	660	563	91,466	2054/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	国債証券	0.0000	1,030	911	147,947	2029/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	1,280	1,187	192,795	2027/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	国債証券	0.0000	2,180	2,065	335,374	2026/01/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	1,820	1,727	280,449	2026/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	1,480	1,371	222,591	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	1,460	1,374	223,123	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	1,360	1,206	195,842	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	700	596	96,847	2030/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	国債証券	0.0000	1,900	1,577	256,126	2031/07/15

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…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 2.5 07/15/33	国債証券	2.5000	350	346	56,179	2033/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	国債証券	0.5000	1,000	844	137,122	2032/07/15
小 計	—	—	25,700	23,264	3,776,775	—
(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	1,600	1,776	288,389	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,280	1,450	235,491	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	1,070	1,105	179,418	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	930	1,013	164,453	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,570	1,867	303,248	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	1,110	973	158,033	2033/04/22
BELGIUM 2.75 04/22/39	国債証券	2.7500	320	304	49,401	2039/04/22
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	640	683	110,954	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	920	664	107,920	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	960	686	111,405	2050/06/22
BELGIUM 1.4 06/22/53	国債証券	1.4000	1,390	889	144,352	2053/06/22
BELGIUM 3.3 06/22/54	国債証券	3.3000	270	264	43,005	2054/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	390	304	49,363	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	450	336	54,614	2066/06/22
BELGIUM 0.65 06/22/71	国債証券	0.6500	870	366	59,536	2071/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,460	1,401	227,450	2026/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	1,570	1,393	226,228	2031/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	940	867	140,834	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	930	600	97,519	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,350	1,235	200,622	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	580	584	94,898	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	610	523	84,915	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,380	1,337	217,178	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	1,210	1,138	184,787	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	780	641	104,095	2037/06/22
BELGIUM 3.45 06/22/43	国債証券	3.4500	240	245	39,829	2043/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	1,200	1,022	166,015	2030/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/33	国債証券	3.0000	1,200	1,213	197,039	2033/06/22
BELGIUM 0.35 06/22/32	国債証券	0.3500	1,050	861	139,842	2032/06/22
BELGIUM 0.0 10/22/31	国債証券	0.0000	1,040	845	137,314	2031/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	1,080	980	159,248	2027/10/22
小 計	—	—	30,390	27,580	4,477,411	—
(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	3,700	3,413	554,081	2027/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	3,530	3,335	541,536	2026/02/25
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	国債証券	0.7500	3,780	3,509	569,691	2028/02/25
FRANCE OAT 2.75 02/25/29	国債証券	2.7500	3,100	3,112	505,345	2029/02/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	1,570	1,515	245,982	2025/03/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	3,850	3,903	633,708	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,690	3,164	513,653	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,530	1,728	280,656	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,460	1,673	271,725	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	3,100	3,518	571,247	2029/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	2,330	2,729	443,077	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	2,540	2,541	412,649	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,950	1,539	249,906	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	3,720	2,568	416,982	2050/05/25

銘柄	当	期				末												
		種	類	利	率		額	面	金	額		償	還	年	月	日		
										外	貨						建	金
<b>(ユーロ…フランス)</b>				%		千	ユー	ロ		千	ユー	ロ		千	円			
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国	債	証	券	0.7500	3,470			1,878				305,020					2052/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	国	債	証	券	0.7500	3,660			1,938				314,732					2053/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国	債	証	券	1.7500	940			636				103,318					2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国	債	証	券	0.5000	790			306				49,798					2072/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国	債	証	券	2.5000	4,650			4,611				748,628					2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国	債	証	券	0.7500	5,090			4,707				764,175					2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国	債	証	券	1.5000	5,780			5,338				866,601					2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国	債	証	券	0.5000	3,430			3,317				538,591					2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国	債	証	券	0.5000	3,590			3,218				522,455					2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国	債	証	券	1.2500	3,560			3,051				495,395					2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国	債	証	券	0.5000	4,960			4,712				765,097					2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国	債	証	券	1.0000	3,560			3,374				547,800					2027/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国	債	証	券	0.5000	1,950			1,298				210,748					2040/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国	債	証	券	1.2500	4,080			3,353				544,449					2036/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	国	債	証	券	1.2500	900			708				115,058					2038/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/43	国	債	証	券	2.5000	1,200			1,073				174,267					2043/05/25
FRANCE OAT 3.0 05/25/33	国	債	証	券	3.0000	3,000			3,046				494,567					2033/05/25
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	国	債	証	券	0.0000	2,790			2,232				362,342					2032/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国	債	証	券	1.7500	2,450			2,055				333,667					2039/06/25
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	国	債	証	券	0.5000	1,490			893				145,019					2044/06/25
FRANCE OAT 2.5 09/24/26	国	債	証	券	2.5000	4,120			4,090				664,120					2026/09/24
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国	債	証	券	6.0000	2,170			2,274				369,268					2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国	債	証	券	2.7500	3,240			3,247				527,129					2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国	債	証	券	4.0000	2,040			2,258				366,661					2038/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国	債	証	券	5.7500	2,610			3,196				518,890					2032/10/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国	債	証	券	1.0000	2,740			2,649				430,136					2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国	債	証	券	0.2500	4,020			3,757				609,921					2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国	債	証	券	0.7500	4,600			4,216				684,425					2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	国	債	証	券	0.0000	3,670			2,983				484,326					2031/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国	債	証	券	0.0000	4,280			3,582				581,580					2030/11/25
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	国	債	証	券	2.0000	3,850			3,622				588,020					2032/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国	債	証	券	0.0000	3,590			3,090				501,787					2029/11/25
小計	-	-	-	-	-	141,120			128,977				20,938,250					-
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>				%		千	ユー	ロ		千	ユー	ロ		千	円			
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国	債	証	券	5.6250	1,310			1,460				237,126					2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国	債	証	券	6.2500	840			1,017				165,110					2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国	債	証	券	5.5000	2,620			3,139				509,635					2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国	債	証	券	4.0000	2,030			2,365				383,970					2037/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国	債	証	券	0.5000	1,650			1,606				260,751					2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国	債	証	券	0.5000	3,860			3,693				599,524					2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国	債	証	券	0.2500	1,430			1,292				209,847					2029/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国	債	証	券	0.5000	2,120			1,970				319,897					2028/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国	債	証	券	0.2500	2,420			2,264				367,601					2027/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国	債	証	券	0.0000	2,340			1,999				324,656					2031/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国	債	証	券	2.3000	3,050			3,045				494,359					2033/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	国	債	証	券	0.0000	2,500			2,086				338,727					2032/02/15
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国	債	証	券	0.0000	1,720			1,502				243,849					2030/02/15
DEUTSCHLAND 2.3 02/15/33	国	債	証	券	2.3000	700			698				113,433					2033/02/15
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国	債	証	券	0.0000	1,590			1,534				249,117					2025/04/11
BUNDESUBL 2.2 04/13/28	国	債	証	券	2.2000	2,100			2,083				338,203					2028/04/13
BUNDESUBL 0.0 04/10/26	国	債	証	券	0.0000	3,510			3,315				538,291					2026/04/10

銘柄	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESUBL 0.0 04/16/27	国債証券	0.0000	2,060	1,906	309,455	2027/04/16	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,760	1,344	218,291	2035/05/15	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	国債証券	1.0000	1,660	1,358	220,475	2038/05/15	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	国債証券	0.0000	1,880	1,394	226,448	2036/05/15	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	650	731	118,831	2027/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	1,180	1,292	209,857	2028/07/04	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,730	2,097	340,472	2039/07/04	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,330	1,456	236,518	2042/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	2,320	2,289	371,653	2044/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,610	2,075	336,902	2040/07/04	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	2,020	2,450	397,834	2034/07/04	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	2,240	2,215	359,662	2046/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	国債証券	0.0000	2,540	1,258	204,270	2052/08/15	
DEUTSCHLAND 1.8 08/15/53	国債証券	1.8000	1,850	1,571	255,105	2053/08/15	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	2,820	2,164	351,439	2048/08/15	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	2,420	2,350	381,540	2025/08/15	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,610	2,443	396,671	2027/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	3,590	3,367	546,672	2026/08/15	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	2,570	2,344	380,561	2028/08/15	
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	2,290	2,021	328,216	2029/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	3,140	1,632	264,969	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	国債証券	1.7000	2,330	2,222	360,879	2032/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	2,890	2,443	396,601	2031/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,010	527	85,639	2050/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	3,730	3,223	523,261	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	890	768	124,796	2030/08/15	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	国債証券	0.0000	1,100	929	150,960	2031/08/15	
BUNDESUBL 0.0 10/09/26	国債証券	0.0000	2,760	2,580	418,939	2026/10/09	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	2,650	2,529	410,601	2025/10/10	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	2,280	2,191	355,829	2027/10/15	
BUNDESUBL 1.3 10/15/27	国債証券	1.3000	1,050	1,009	163,950	2027/10/15	
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,350	1,290	209,524	2025/10/10	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,620	1,481	240,547	2027/11/15	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	国債証券	0.0000	2,560	2,295	372,664	2028/11/15	
DEUTSCHLAND 2.4 11/15/30	国債証券	2.4000	300	301	48,942	2030/11/15	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	国債証券	2.1000	2,000	1,975	320,653	2029/11/15	
小計	-	-	108,580	100,614	16,333,748	-	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,960	2,238	363,423	2029/01/31	
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,660	1,792	290,935	2037/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,330	1,288	209,149	2025/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/27	国債証券	0.0000	1,910	1,755	284,907	2027/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/28	国債証券	0.0000	1,880	1,678	272,436	2028/01/31	
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	1,640	1,548	251,458	2026/01/31	
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,630	1,598	259,500	2025/04/30	
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,510	1,446	234,837	2027/04/30	
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,730	1,693	274,938	2026/04/30	
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,044	331,931	2028/04/30	
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,500	1,396	226,756	2029/04/30	
SPAIN 0.7 04/30/32	国債証券	0.7000	1,850	1,533	248,942	2032/04/30	
SPAIN 3.15 04/30/33	国債証券	3.1500	1,570	1,565	254,101	2033/04/30	

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	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,800	1,553	252,120	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	1,880	1,527	247,974	2031/04/30
SPAIN 3.5 05/31/29	国債証券	3.5000	500	513	83,408	2029/05/31
SPAIN 2.8 05/31/26	国債証券	2.8000	1,800	1,792	290,984	2026/05/31
SPAIN 0.0 05/31/25	国債証券	0.0000	870	835	135,584	2025/05/31
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	2,330	2,488	403,962	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,910	2,202	357,479	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,880	2,135	346,662	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	1,120	1,012	164,419	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,895	1,933	313,918	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,770	1,665	270,353	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,965	2,350	381,630	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,870	1,740	282,629	2033/07/30
SPAIN 3.45 07/30/43	国債証券	3.4500	740	710	115,353	2043/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	2,170	2,038	330,964	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,940	1,667	270,762	2035/07/30
SPAIN 0.85 07/30/37	国債証券	0.8500	1,600	1,149	186,678	2037/07/30
SPAIN 1.0 07/30/42	国債証券	1.0000	540	348	56,648	2042/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,550	1,443	234,289	2027/07/30
SPAIN 0.8 07/30/29	国債証券	0.8000	1,700	1,513	245,744	2029/07/30
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	2,060	2,256	366,374	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	1,210	1,457	236,662	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,300	1,134	184,116	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	1,560	1,292	209,805	2048/10/31
SPAIN 1.9 10/31/52	国債証券	1.9000	1,270	846	137,401	2052/10/31
SPAIN 1.45 10/31/71	国債証券	1.4500	660	321	52,136	2071/10/31
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	1,790	963	156,389	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,810	1,784	289,724	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,860	1,768	287,018	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	2,630	2,521	409,413	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	2,130	1,872	303,968	2029/10/31
SPAIN 0.5 10/31/31	国債証券	0.5000	2,140	1,769	287,305	2031/10/31
SPAIN 2.55 10/31/32	国債証券	2.5500	1,720	1,644	266,943	2032/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	1,810	1,261	204,801	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	2,450	2,187	355,135	2030/10/31
SPAIN 3.55 10/31/33	国債証券	3.5500	1,820	1,867	303,199	2033/10/31
小計	-	-	82,390	77,154	12,525,285	-
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,710	1,603	260,306	2027/01/15
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	国債証券	3.5000	1,310	1,316	213,707	2026/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	2,660	3,071	498,627	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,470	1,472	239,117	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	2,540	2,430	394,583	2028/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	1,610	1,528	248,192	2026/02/01
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	国債証券	0.4500	1,800	1,566	254,297	2029/02/15
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,270	989	160,649	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,690	1,491	242,136	2048/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	400	289	47,000	2067/03/01
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	国債証券	2.1500	360	216	35,094	2072/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	2,110	2,163	351,237	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,290	1,983	322,022	2032/03/01



銘柄	当	期				末		
		種	利	額	価		償還年月日	
					面			額
<b>(ユーロ…イタリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ITALY BTPS 4.5 10/01/53	国債証券	4.5000		670	684	111,073	2053/10/01	
ITALY BTPS 4.0 10/30/31	国債証券	4.0000		1,400	1,441	234,048	2031/10/30	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500		1,250	1,381	224,293	2026/11/01	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000		2,010	2,242	363,991	2027/11/01	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500		2,640	2,902	471,221	2029/11/01	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000		1,550	1,531	248,654	2025/11/15	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000		1,660	1,625	263,935	2025/12/01	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500		2,180	2,072	336,527	2026/12/01	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000		1,940	1,902	308,884	2028/12/01	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	国債証券	0.9500		1,700	1,400	227,412	2031/12/01	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500		2,140	1,904	309,105	2030/12/01	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	国債証券	2.5000		1,340	1,224	198,827	2032/12/01	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	国債証券	3.8500		1,700	1,740	282,518	2029/12/15	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	国債証券	2.6500		1,720	1,688	274,059	2027/12/01	
小計	-	-		122,640	116,425	18,900,577	-	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FINLAND 0.125 04/15/52	国債証券	0.1250		640	298	48,521	2052/04/15	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500		600	524	85,162	2031/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750		380	276	44,937	2047/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000		460	438	71,143	2026/04/15	
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250		480	407	66,172	2034/04/15	
FINLAND 2.75 04/15/38	国債証券	2.7500		370	356	57,931	2038/04/15	
FINLAND 0.5 04/15/43	国債証券	0.5000		380	239	38,880	2043/04/15	
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250		280	199	32,347	2036/04/15	
FINLAND 1.375 04/15/27	国債証券	1.3750		210	201	32,734	2027/04/15	
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000		220	222	36,135	2025/07/04	
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500		320	321	52,181	2028/07/04	
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250		330	309	50,246	2042/07/04	
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000		800	711	115,483	2029/09/15	
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750		810	784	127,336	2025/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000		650	590	95,917	2028/09/15	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000		400	370	60,186	2027/09/15	
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500		290	185	30,036	2040/09/15	
FINLAND 1.5 09/15/32	国債証券	1.5000		700	632	102,699	2032/09/15	
FINLAND 0.125 09/15/31	国債証券	0.1250		700	576	93,646	2031/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/30	国債証券	0.0000		510	428	69,583	2030/09/15	
FINLAND 0.0 09/15/26	国債証券	0.0000		100	93	15,124	2026/09/15	
小計	-	-		9,630	8,170	1,326,408	-	
<b>(ユーロ…オーストリア)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
AUSTRIA 3.8 01/26/62	国債証券	3.8000		310	357	58,062	2062/01/26	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000		740	549	89,179	2047/02/20	
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000		1,520	1,366	221,903	2029/02/20	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500		935	867	140,901	2028/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/34	国債証券	2.9000		150	150	24,387	2034/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/31	国債証券	0.0000		1,410	1,165	189,278	2031/02/20	
AUSTRIA 2.9 02/20/33	国債証券	2.9000		1,300	1,306	212,033	2033/02/20	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	国債証券	0.9000		600	519	84,364	2032/02/20	
AUSTRIA 0.0 02/20/30	国債証券	0.0000		1,180	1,006	163,383	2030/02/20	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	国債証券	4.8500		1,210	1,257	204,062	2026/03/15	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500		1,010	1,131	183,652	2037/03/15	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	国債証券	0.7500		590	344	55,892	2051/03/20	



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…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	国債証券	0.7000	410	185	30,075	2071/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27	国債証券	0.5000	1,340	1,251	203,166	2027/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	870	832	135,183	2034/05/23
AUSTRIA 1.85 05/23/49	国債証券	1.8500	590	464	75,354	2049/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20	国債証券	0.8500	310	140	22,859	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	550	552	89,772	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	615	684	111,049	2027/07/15
AUSTRIA 2.0 07/15/26	国債証券	2.0000	460	451	73,309	2026/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	390	295	47,998	2117/09/20
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	1,330	1,263	205,073	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	890	864	140,395	2025/10/20
AUSTRIA 3.15 10/20/53	国債証券	3.1500	420	423	68,799	2053/10/20
AUSTRIA 0.25 10/20/36	国債証券	0.2500	840	598	97,092	2036/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40	国債証券	0.0000	450	271	44,131	2040/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/28	国債証券	0.0000	620	547	88,955	2028/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	190	113	18,478	2086/11/02
小 計	—	—	21,230	18,965	3,078,798	—
合 計	—	—	—	—	256,938,107	—

## ■投資信託財産の構成

2024年2月21日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比	評 価 額	率
公 社 債	千円	%		
	256,938,107	98.3		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,534,468	1.7		
投 資 信 託 財 産 総 額	261,472,575	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、259,685,707千円、99.3%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、2024年2月21日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=150.16円、1カナダ・ドル=111.02円、1オーストラリア・ドル=98.41円、1シンガポール・ドル=111.73円、1ニュージーランド・ドル=92.63円、1イギリス・ポンド=189.58円、1イスラエル・シケル=40.76円、1デンマーク・クローネ=21.78円、1ノルウェー・クローネ=14.33円、1スウェーデン・クローナ=14.51円、1メキシコ・ペソ=8.803円、1オフショア・人民元=20.841円、1マレーシア・リンギット=31.284円、1ポーランド・ズロチ=37.609円、1ユーロ=162.34円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年2月21日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産 等	262,047,572,911円
コ ー ル ・ 公 社 債 (評価額)	2,571,862,881
未 収 入 金 息	256,938,107,694
前 払 収 入 金 息	575,027,153
未 払 収 入 金 息	1,747,978,124
(B) 負 債 等	1,654,049,105
未 払 収 入 金 息	1,628,558,105
未 払 収 入 金 息	25,491,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	260,393,523,806
元 次 本 金	112,140,675,109
(D) 受 益 権 益 総 額	148,252,848,697
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	112,140,675.109円
	23,220円

(注1) 期首元本額	92,568,430,085円	Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	95,009,306円
追加設定元本額	57,122,203,209円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	989,890,513円
一部解約元本額	37,549,958,225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)	237,386,300円
(注2) 期末における元本の内訳		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)	238,317,641円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	6,936,625,396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)	95,585,889円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,145,444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)	143,381,639円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,898,297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)	544,565円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	33,055,375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)	621,159,184円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	29,463,237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)	543,853,224円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	42,934,640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)	211,165,647円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,209,559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)	866,888,247円
たわらノーロード 先進国債券	20,317,116,345円	予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	634,044,700円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	129,335円	D I AM海替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	4,747,484,094円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,175,860,175円	D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	1,364,728,567円
たわらノーロード バランス (堅実型)	70,372,889円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,512,206,226円
たわらノーロード バランス (標準型)	393,159,511円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,272,436,982円
たわらノーロード バランス (積極型)	90,074,981円	AMO 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)	222,937,463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)	17,547,319円	D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	43,680,338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)	1,061,778,662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)	393,718,174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)	1,874,531,468円	D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	322,665,524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)	939,477,666円	D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	208,816,275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)	721,685,160円	D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	11,704,671円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,181,174円	D I AM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	20,619,600円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	12,367,147円	D I AM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	6,524,169円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	192,544,517円	D I AM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,265円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	20,620,422円	D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	1,512,264円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	38,634,144円	D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	33,413,721円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,881,458,772円	D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,252,683,690円
One DC 先進国債券インデックスファンド	1,443,766,551円	D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,244,567,605円
Oneグローバルバランス	60,758,637円	D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,359,122,210円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	734,747,927円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	50,385,127円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,430,100,443円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	100,205,864円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,916,905,681円	D I AM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)	1,142,198,851円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	415,782,480円	D I AM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	202,876,714円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	155,039円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	822,838,550円	D I AM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	199,846,920円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	23,358,394円	D I AM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	259,826,276円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	887,363,869円	D I AM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	336,700,092円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	15,215,627円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	33,520,121円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	159,329,380円	動的パッケージファンド<DC年金>	48,713,270円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	160,868,965円	コア資産形成ファンド	24,325,247円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	260,318,009円	たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	4,593,798,610円
クルーズコントロール	1,073,014,665円	たわらノーロード 外国債券 (為替ヘッジあり) <ラップ専用>	12,277,305,584円
D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,522,998円	MH AM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	5,666,776,191円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	854,009,676円	MH AM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	4,945,479,083円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	699,203,724円	期末元本合計	112,140,675,109円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	179,400,751円		
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	488,705,414円		
Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	5,190,355円		

## ■損益の状況

当期 自2023年2月22日 至2024年2月21日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,766,181,304	円
	受取利息	5,766,646,977	
	その他の収益	5,079	
	支払利息	△470,752	
(B)	有価証券売買損益	26,829,583,002	
	売却益	30,605,561,933	
	売却損	△3,775,978,931	
(C)	その他の費用	△34,657,163	
(D)	当期損益金(A+B+C)	32,561,107,143	
(E)	前期繰越損益金	94,253,940,578	
(F)	解約差損益金	△43,521,353,795	
(G)	追加信託差損益金	64,959,154,771	
(H)	計(D+E+F+G)	148,252,848,697	
	次期繰越損益金(H)	148,252,848,697	

(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18期 (決算日 2024年2月20日)

(計算期間 2023年2月21日～2024年2月20日)

インデックス225 マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

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			
	円	%	円	%	%	%	百万円
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
18期(2024年2月20日)	32,557	42.3	38,363.61	39.3	98.4	1.5	184,913

(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）。

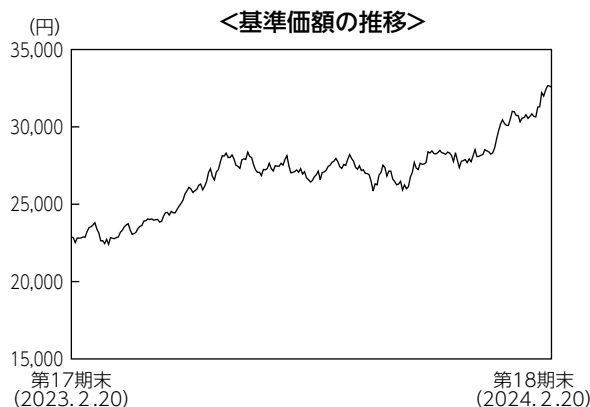
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 2 月 20 日	円 22,882	% -	円 27,531.94	% -	% 97.4	% 2.6
2 月 末	22,823	△0.3	27,445.56	△0.3	98.2	1.7
3 月 末	23,534	2.8	28,041.48	1.9	98.0	1.9
4 月 末	24,220	5.8	28,856.44	4.8	97.1	2.2
5 月 末	25,933	13.3	30,887.88	12.2	97.6	2.4
6 月 末	27,893	21.9	33,189.04	20.5	98.0	2.0
7 月 末	27,883	21.9	33,172.22	20.5	97.8	2.1
8 月 末	27,435	19.9	32,619.34	18.5	97.6	2.4
9 月 末	26,984	17.9	31,857.62	15.7	97.2	2.8
10 月 末	26,136	14.2	30,858.85	12.1	98.0	1.9
11 月 末	28,363	24.0	33,486.89	21.6	98.1	1.8
12 月 末	28,389	24.1	33,464.17	21.5	98.0	1.9
2024年 1 月 末	30,786	34.5	36,286.71	31.8	97.5	2.4
(期 末) 2024年 2 月 20 日	32,557	42.3	38,363.61	39.3	98.4	1.5

(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（2023年2月21日から2024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32,557円（1万口あたり）となり、前期末比で42.3%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、当期の前半、円安の進行や欧米投資家による積極的な日本株買いなどが好感され、上昇しました。2023年7月には、日銀が長短金利操作の運用を柔軟化したことを受け、国内長期金利上昇懸念が台頭したことから上値の重い状況に転じました。年末にかけては、米国追加金融引き締め懸念の後退などが好感されて上昇基調で推移、年明け以降も、新NISA開始に伴う個人投資家の資金流入期待などを背景に、大幅高となりました。

### 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39.3%上昇しました。当ファンドはベンチマークを3.0%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)	1円 (0) (0)	0.002% (0.001) (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
合 計	1	0.002	
期中の平均基準価額は26,896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 (2023年2月21日から2024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
		13,979 (7,760.6)	60,816,985 (-)	13,223.4	55,754,035

(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 103,832	百万円 105,685	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	116,571,020千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	143,707,401千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.81

(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2月21日から2024年2月20日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			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 60,816	百万円 5,637	% 9.3	百万円 55,754	百万円 3,604	% 6.5
株 式 先 物 取 引	103,832	103,832	100.0	105,685	105,685	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 14	百万円 13	百万円 43

### (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	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 26

### (4) 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)	3,331千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	2,730千円
(B)/(A)	81.9%

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	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
ニッスイ	158	158	146,829	
<b>鉱業 (0.1%)</b>				
INPEX	63.2	63.2	127,600	
<b>建設業 (1.5%)</b>				
コムシスホールディングス	158	158	524,718	
大成建設	31.6	31.6	151,553	
大林組	158	158	224,123	
清水建設	158	158	141,157	
長谷工コーポレーション	31.6	31.6	59,344	
鹿島建設	79	79	220,291	
大和ハウス工業	158	158	686,036	
積水ハウス	158	158	519,820	
日揮ホールディングス	158	158	220,963	
<b>食料品 (3.2%)</b>				
日清製粉グループ本社	158	158	335,592	
明治ホールディングス	31.6	63.2	216,017	
日本ハム	79	79	415,382	
サッポロホールディングス	31.6	31.6	212,636	
アサヒグループホールディングス	158	158	841,350	
キリンホールディングス	158	158	339,779	
宝ホールディングス	158	158	188,494	
キッコーマン	158	158	1,463,238	
味の素	158	158	914,504	
ニチレイ	79	79	300,358	
日本たばこ産業	158	158	616,990	
<b>繊維製品 (0.1%)</b>				
東洋紡	15.8	-	-	
帝人	31.6	31.6	39,579	
東レ	158	158	109,051	
<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>				
王子ホールディングス	158	158	87,611	
日本製紙	15.8	15.8	18,027	
<b>化学 (6.7%)</b>				
クラレ	158	158	237,711	
旭化成	158	158	166,216	
レゾナック・ホールディングス	15.8	15.8	51,413	
住友化学	158	158	49,296	
日産化学	158	158	992,556	
東ソー	79	79	159,264	
トクヤマ	31.6	31.6	74,228	
デンカ	31.6	31.6	79,726	
信越化学工業	158	790	4,839,540	
三井化学	31.6	31.6	128,011	

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	
三菱ケミカルグループ	79	79	68,295	
UBE	15.8	15.8	40,653	
花王	158	158	891,278	
DIC	15.8	15.8	46,610	
富士フィルムホールディングス	158	158	1,479,986	
資生堂	158	158	655,384	
日東電工	158	158	2,188,300	
<b>医薬品 (5.9%)</b>				
協和キリン	158	158	457,331	
武田薬品工業	158	158	706,576	
アステラス製薬	790	790	1,331,150	
住友ファーマ	158	158	57,986	
塩野義製薬	158	158	1,128,752	
中外製薬	474	474	2,769,108	
エーザイ	158	158	990,344	
第一三共	474	474	2,333,976	
大塚ホールディングス	158	158	878,322	
<b>石油・石炭製品 (0.2%)</b>				
出光興産	63.2	316	292,868	
ENEOSホールディングス	158	158	102,131	
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>				
横浜ゴム	79	79	316,158	
ブリヂストン	158	158	995,400	
<b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b>				
AGC	31.6	31.6	171,398	
日本板硝子	15.8	-	-	
日本電気硝子	47.4	47.4	169,312	
住友大阪セメント	15.8	15.8	56,864	
太平洋セメント	15.8	15.8	50,481	
東海カーボン	158	158	161,318	
TOYO	79	79	294,512	
日本碍子	158	158	301,069	
<b>鉄鋼 (0.1%)</b>				
日本製鉄	15.8	15.8	57,038	
神戸製鋼所	15.8	15.8	32,366	
JFEホールディングス	15.8	15.8	37,145	
大太平洋金属	15.8	15.8	22,230	
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>				
日本軽金属ホールディングス	15.8	-	-	
三井金属鉱業	15.8	15.8	69,883	
東邦亜鉛	15.8	-	-	
三菱マテリアル	15.8	15.8	41,380	
住友金属鉱山	79	79	328,087	
DOWAホールディングス	31.6	31.6	176,770	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
古河電気工業	15.8	15.8	44,587
住友電気工業	158	158	339,463
フジクラ	158	158	275,710
<b>金属製品 (0.0%)</b>			
SUMCO	15.8	15.8	35,494
<b>機械 (4.5%)</b>			
日本製鋼所	31.6	31.6	80,137
オークマ	31.6	31.6	227,267
アマダ	158	158	257,619
SMC	15.8	15.8	1,372,388
小松製作所	158	158	682,718
住友重機械工業	31.6	31.6	143,874
日立建機	158	158	668,182
クボタ	158	158	350,918
荏原製作所	31.6	31.6	356,132
ダイキン工業	158	158	3,389,100
日本精工	158	158	127,442
NTN	158	158	46,578
ジェイテクト	158	158	216,618
三井E&S	15.8	-	-
日立造船	31.6	31.6	34,191
三菱重工業	15.8	15.8	181,384
IHI	15.8	15.8	49,706
<b>電気機器 (28.3%)</b>			
コニカミノルタ	158	158	74,386
ミネベアミツミ	158	158	479,372
日立製作所	31.6	31.6	387,574
三菱電機	158	158	365,296
富士電機	31.6	31.6	281,082
安川電機	158	158	887,328
ニデック	126.4	126.4	732,108
オムロン	158	158	903,918
ジーエス・ユアサ コーポレーション	31.6	31.6	85,715
日本電気	15.8	15.8	154,113
富士通	15.8	15.8	364,901
ルネサスエレクトロニクス	-	158	387,495
セイコーエプソン	316	316	770,408
パナソニック ホールディングス	158	158	225,071
シャープ	158	158	130,381
ソニーグループ	158	158	2,103,770
TDK	474	474	3,695,304
アルプスアルパイン	158	158	166,137
横河電機	158	158	479,846
アドバンテスト	316	1,264	8,502,928
キーエンス	15.8	15.8	1,090,832
レーザーテック	-	63.2	2,513,464
カシオ計算機	158	158	188,415

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ファナック	158	790	3,332,220
京セラ	316	1,264	2,800,392
太陽誘電	158	158	535,462
村田製作所	126.4	379.2	1,121,484
SCREENホールディングス	31.6	63.2	1,166,040
キヤノン	237	237	996,822
リコー	158	158	201,134
東京エレクトロン	158	474	16,424,100
<b>輸送用機器 (4.8%)</b>			
デンソー	158	632	1,709,244
川崎重工業	15.8	15.8	61,430
日産自動車	158	158	89,459
いすゞ自動車	79	79	170,126
トヨタ自動車	790	790	2,697,060
日野自動車	158	158	74,749
三菱自動車工業	15.8	15.8	7,136
マツダ	31.6	31.6	54,731
本田技研工業	316	948	1,657,104
スズキ	158	158	1,039,482
SUBARU	158	158	530,722
ヤマハ発動機	158	474	655,305
<b>精密機器 (3.7%)</b>			
テルモ	632	632	3,544,256
ニコン	158	158	241,740
オリンパス	632	632	1,371,440
HOYA	79	79	1,461,105
シチズン時計	158	158	168,744
<b>その他製品 (2.1%)</b>			
パンダイナムコホールディングス	158	474	1,383,606
TOPPANホールディングス	79	79	277,448
大日本印刷	79	79	355,263
ヤマハ	158	158	508,760
任天堂	158	158	1,305,554
<b>電気・ガス業 (0.2%)</b>			
東京電力ホールディングス	15.8	15.8	12,561
中部電力	15.8	15.8	30,272
関西電力	15.8	15.8	30,794
東京瓦斯	31.6	31.6	102,668
大阪瓦斯	31.6	31.6	97,612
<b>陸運業 (1.2%)</b>			
東武鉄道	31.6	31.6	122,292
東急	79	79	140,067
小田急電鉄	79	79	166,453
京王電鉄	31.6	31.6	132,972
京成電鉄	79	79	588,708
東日本旅客鉄道	15.8	15.8	141,394
西日本旅客鉄道	15.8	15.8	98,197

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東海旅客鉄道	15.8	79	296,566
ヤマトホールディングス	158	158	379,753
NIPPON EXPRESSホールディングス	15.8	15.8	127,363
<b>海運業 (0.5%)</b>			
日本郵船	47.4	47.4	228,657
商船三井	47.4	47.4	252,357
川崎汽船	47.4	47.4	338,720
<b>空運業 (0.3%)</b>			
日本航空	-	158	440,820
ANAホールディングス	15.8	15.8	51,018
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
三菱倉庫	79	79	363,716
<b>情報・通信業 (10.3%)</b>			
ネクソン	316	316	802,166
メルカリ	-	158	338,831
LINEヤフー	63.2	63.2	26,714
トレンドマイクロ	158	158	1,148,502
日本電信電話	63.2	1,580	286,928
KDDI	948	948	4,381,656
ソフトバンク	158	158	311,102
東宝	15.8	15.8	78,210
NTTデータグループ	790	790	1,845,440
コナミグループ	158	158	1,516,484
ソフトバンクグループ	948	948	8,094,972
<b>卸売業 (3.3%)</b>			
双日	15.8	15.8	59,613
伊藤忠商事	158	158	1,042,010
丸紅	158	158	389,075
豊田通商	158	158	1,449,492
三井物産	158	158	1,006,460
住友商事	158	158	563,902
三菱商事	158	474	1,483,146
<b>小売業 (12.9%)</b>			
J. フロント リテイリング	79	79	123,398
三越伊勢丹ホールディングス	158	158	338,041
セブン&アイ・ホールディングス	158	158	1,008,356
高島屋	79	79	180,436
丸井グループ	158	158	391,050
イオン	158	158	566,904
ニトリホールディングス	-	47.4	1,026,447
ファーストリテイリング	158	474	19,765,800
<b>銀行業 (0.7%)</b>			
しずおかフィナンシャルグループ	158	158	228,152
コンコルディア・フィナンシャルグループ	158	158	115,182
あおぞら銀行	15.8	15.8	34,997
三菱UFJフィナンシャル・グループ	158	158	235,025
りそなホールディングス	15.8	15.8	12,919

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	15.8	31.6	93,836
三井住友フィナンシャルグループ	15.8	15.8	127,474
千葉銀行	158	158	185,808
ふくおかフィナンシャルグループ	31.6	31.6	116,035
みずほフィナンシャルグループ	15.8	15.8	43,228
<b>証券・商品先物取引業 (0.2%)</b>			
大和証券グループ本社	158	158	171,035
野村ホールディングス	158	158	131,329
松井証券	158	-	-
<b>保険業 (1.0%)</b>			
SOMPOホールディングス	31.6	31.6	279,122
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	47.4	47.4	348,911
第一生命ホールディングス	15.8	15.8	53,751
東京海上ホールディングス	237	237	1,040,667
T & Dホールディングス	31.6	31.6	79,821
<b>その他金融業 (0.8%)</b>			
クレディセゾン	158	158	445,560
オリックス	158	158	486,956
日本取引所グループ	158	158	600,400
<b>不動産業 (1.1%)</b>			
東急不動産ホールディングス	158	158	154,476
三井不動産	158	158	643,376
三菱地所	158	158	337,014
東京建物	79	79	170,482
住友不動産	158	158	726,168
<b>サービス業 (4.1%)</b>			
エムスリー	379.2	379.2	796,320
ディー・エヌ・エー	47.4	47.4	59,605
電通グループ	158	158	681,454
オリエンタルランド	-	158	851,778
サイバーエージェント	126.4	126.4	132,972
楽天グループ	158	158	118,452
リクルートホールディングス	474	474	2,791,860
日本郵政	158	158	222,148
セコム	158	158	1,745,900
合 計	株 数 ・ 金 額	株 数	金 額
	銘柄数 < 比率 >	225銘柄	< 98.4% >

(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 2,849		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2024年2月20日現在

項 目		当 期		末
		評 価 額	比	率
株 式		千円 182,021,280		% 97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		5,365,260		2.9
投 資 信 託 財 産 総 額		187,386,540		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

(2024年2月20日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	187,386,540,875円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,835,680,257
株 式(評価額)	182,021,280,360
未 収 入 金	154,349,280
未 収 配 当 金	301,342,000
差 入 委 託 証 拠 金	73,888,978
(B) 負 債	2,473,291,495
未 払 金	2,304,041,495
未 払 解 約 金	169,250,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	184,913,249,380
元 本	56,797,495,629
次 期 繰 越 損 益 金	128,115,753,751
(D) 受 益 権 総 口 数	56,797,495,629口
1万口当たり基準価額(C/D)	32,557円

## ■損益の状況

当期 自2023年2月21日 至2024年2月20日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,945,685,808円
受 取 配 当 金	2,946,536,068
受 取 利 息	26,386
そ の 他 収 益 金	341,960
支 払 利 息	△1,218,606
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	49,923,732,590
売 買 益	53,858,773,086
売 買 損	△3,935,040,496
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,290,055,540
取 引 益	1,995,003,070
取 引 損	△704,947,530
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	54,159,473,938
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	73,452,663,974
(F) 解 約 差 損 益 金	△36,061,260,358
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	36,564,876,197
(H) 合 計(D+E+F+G)	128,115,753,751
次 期 繰 越 損 益 金(H)	128,115,753,751

(注1) 期首元本額 57,021,132,315円  
追加設定元本額 21,701,377,803円  
一部解約元本額 21,925,014,489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)	456,524,626円
〔適格機関投資家私募〕 インデックス225	540,351,002円
マルチアセット・アロケーション戦略ファンド	95,784,581円
(為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家私募)	
マルチアセット・アロケーション戦略ファンドII	35,755,670円
(為替パリアルヘッジ型) (適格機関投資家限定)	
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)	61,836,344円
たわらノーロード 日経225	42,146,409,024円
D I AMパッシブ資産分散ファンド	214,602,120円
固定比率マルチアセット戦略ファンド (米ドル建)	148,192,365円
日本政府保証信託活用型) (適格機関投資家限定)	
低リスク・損失抑制型マルチアセット	6,700,953円
戦略ファンド (適格機関投資家限定)	
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド	6,558,336円
2021-09 (適格機関投資家限定)	
D I AM日経225インデックスファンドVA	670,025,160円
国内株式パッシブ・ファンドー日経	4,261,793,468円
225型ー (適格機関投資家向け)	
D I AM日経225型パッシブ・ファンド	3,140,183,347円
(適格機関投資家向け)	
日米資産配分戦略ファンド (TIPS活用型)	7,237,400円
(為替ヘッジ比率調整型) (適格機関投資家限定)	
MHAM日経225インデックスファンド	4,859,374,284円
〔適格機関投資家限定〕	
MHAMインデックス225 (適格機関投資家限定)	146,166,949円
期末元本合計	56,797,495,629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) (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。

# 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17期（決算日 2024年6月24日）

（対象期間 2023年6月23日～2024年6月24日）

外国リート・パッシブ・ファンド・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	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	不動産 投信指数 先物比率	純資産額
	円	期 騰 落 率	ポイント	期 中 騰 落 率			
13期(2020年6月22日)	10,922	△16.4	111,241.50	△15.7	99.7	—	百万円 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
17期(2024年6月24日)	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0	87,881

(注1) 不動産投信指数先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 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3) S & P 先進国 REIT インデックスはS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが委託会社に付与されています。S & P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、委託会社により一定の目的でサブライセンスされています。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S & P、それらの各関連会社によって後援、推奨、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）。

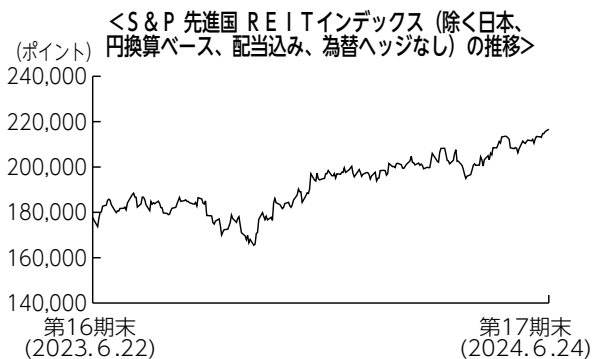
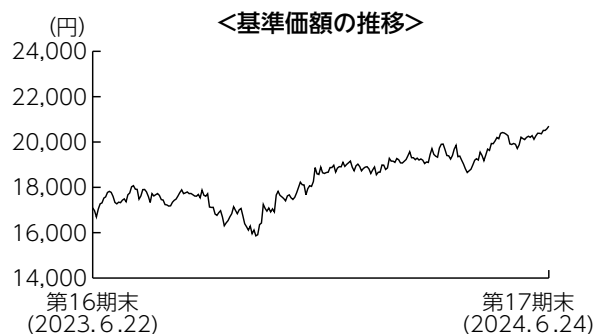
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		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)		投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率		
(期 首) 2023年 6 月22日	円 17,096	% -	ポイント 177,832.19	% -	% 99.4	% -
6 月 末	17,529	2.5	182,685.34	2.7	99.1	-
7 月 末	17,623	3.1	183,725.47	3.3	99.7	-
8 月 末	17,891	4.7	186,587.56	4.9	99.6	-
9 月 末	16,888	△1.2	176,100.67	△1.0	99.1	-
10 月 末	15,911	△6.9	165,961.31	△6.7	99.7	-
11 月 末	17,563	2.7	183,266.40	3.1	99.6	-
12 月 末	18,976	11.0	198,444.21	11.6	99.1	-
2024年 1 月 末	18,816	10.1	196,616.69	10.6	99.6	-
2 月 末	19,149	12.0	200,192.11	12.6	99.5	-
3 月 末	19,901	16.4	208,220.30	17.1	99.2	-
4 月 末	19,554	14.4	204,506.61	15.0	99.4	-
5 月 末	19,877	16.3	207,988.97	17.0	99.3	-
(期 末) 2024年 6 月24日	20,700	21.1	216,675.29	21.8	99.0	1.0

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 不動産投信指数先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2023年6月23日から2024年6月24日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は20,700円となり、前期末比で21.1%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

カナダやシンガポール、香港などのリート市場は下落しマイナスの影響となりました。一方、米国や豪州で浮上した早期利下げ観測や、株高に伴うリスク選好の改善などから、両国のリート市場が上昇したことや、為替市場で全ての指数構成通貨に対し円安となったことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

外国リート市場はまちまちの結果となりました。前半はF R B（米連邦準備理事会）やE C B（欧州中央銀行）の利上げ長期化観測から上値の重い展開となり、2023年10月にはイスラエル情勢の緊迫化や米欧長期金利上昇への警戒感から下落しました。その後は米国や豪州で早期利下げ観測が浮上し長期金利が低下したことから両国のリート市場は上昇しましたが、カナダやシンガポール、香港などのリート市場は下落しました。

為替市場では、米ドルは期前半、F R Bの利上げ長期化観測や日銀の金融政策修正観測の後退などから円安米ドル高となりました。2023年11月に米国で早期利下げ観測が浮上し円の下落幅は縮小しましたが、2024年以降は米国の利下げ観測は後退したほか、3月の日銀のマイナス金利解除決定後も日米金利差は残るとの見方などから改めて円安米ドル高が進行しました。ユーロなど他の指数構成通貨に対しても円安となりました。

### 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21.8%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマークを0.8%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 (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	2円 (0) (0) (2)	0.013% (0.000) (0.002) (0.011)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 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)	4 (0) (4)	0.024 (0.002) (0.022)	(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)	8 (7) (1)	0.046 (0.038) (0.008)	(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	15	0.083	
期中の平均基準価額は18,397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 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

### (1) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44.521	4,791	51.491	5,440
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER'S INC.	0.7	130	0.861	161
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	42.103	2,474	47.241	2,780
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	73.871	2,399	78.516	2,541
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	28.657	200	41.562	287
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGREE REALTY CORP	29.363	1,710	30.57	1,712
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRT APARTMENTS CORP	3.203	59	3.719	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
SL GREEN	17.22	655	19.099	746
	(-)	(-)	(-)	(-)
EPR PROPERTIES	20.917	908	24.191	1,014
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	262.201	29,328	303.138	34,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	40.914	7,276	47.416	8,292
	(-)	(-)	(-)	(-)
LXP INDUSTRIAL TRUST	60.11	529	72.905	634
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
CAMDEN PROPERTY TRUST	30.337	2,942	35.142	3,339
	(-)	(-)	(-)	(-)
VERIS RESIDENTIAL INC	25.854	413	27.396	438
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	26.952	20,491	30.643	22,767
	(-)	(-)	(-)	(-)
NNN REIT INC	49.099	1,892	57.324	2,138
	(-)	(-)	(-)	(-)
CTO REALTY GROUTH INC	-	-	1.936	33
	(-)	(-)	(-)	(-)
COUSINS PROPERTIES INC	35.373	732	42.016	852
	(-)	(-)	(-)	(-)
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	-	-	-	-
	(△14.046)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	37.223	464	46.279	564
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAFEHOLD INC	12.207	221	12.873	215
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18.669	4,210	21.491	4,749
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	101.285	6,084	114.785	6,785
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19.889	1,875	23.003	2,129
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST INDUSTRIAL RT	36.575	1,700	42.101	1,970
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	163.634	2,990	192.551	3,410
	(68.793)	(-)	(-)	(-)
EQUITY COMMONWEALTH	30.158	571	35.968	667
	(-)	(-)	(-)	(-)
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.711	485	29.203	582
	(-)	(-)	(-)	(-)
SERVICE PROPERTIES TRUST	34.114	248	41.344	307
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	191.286	16,821	173.196	14,779
	(-)	(-)	(-)	(-)
EAST GROUP	13.221	2,224	13.918	2,300
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	181.693	3,331	211.022	3,816
	(22.741)	(-)	(-)	(-)
KILROY REALTY CORP	33.041	1,051	37.091	1,184
	(-)	(-)	(-)	(-)
LTC PROPERTIES INC	12.892	419	14.463	456
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	42.905	89	54.866	131
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRANDYWINE REALTY TRUST	29.058	114	45.368	192
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
IRON MOUNTAIN INC	84.737	5,378	97.576	6,262
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	52.643	613	61.448	740
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	58.647	3,863	61.535	4,011
	(-)	(-)	(-)	(-)
ACADIA REALTY TRUST	32.368	491	34.118	511
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	205.808	3,509	239.71	4,083
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	34.115	4,503	39.173	5,045
	(-)	(-)	(-)	(-)
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9.369	92	22.894	228
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL HEALTH INVS INC	8.55	440	10.426	532
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTERSPACE	3.326	192	3.69	213
	(-)	(-)	(-)	(-)
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.963	39	4.265	87
	(-)	(-)	(-)	(-)
GETTY REALTY CORP	14.309	406	14.653	402
	(-)	(-)	(-)	(-)
RPT REALTY	12.409	131	15.407	158
	(△37.596)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	241.687	12,818	238.92	12,253
	(46.343)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	45.789	2,777	52.728	3,167
	(4.873)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	88.351	3,213	104.621	3,730
	(-)	(-)	(-)	(-)
COPT DEFENCE PROPERTIES	25.01	611	29.107	693
	(-)	(-)	(-)	(-)
SAUL CENTERS INC	5.322	193	5.894	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	93.859	11,200	109.206	13,072
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIFE STORAGE INC	0.859	113	-	-
	(△38.877)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	45.539	12,126	52.779	13,992
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	36.367	4,250	42.011	4,935
	(-)	(-)	(-)	(-)
TANGER INC	30.312	736	32.271	791
	(-)	(-)	(-)	(-)
UMH PROPERTIES INC	15.546	224	14.922	214
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	7.301	93	8.897	108
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.496	58	2.833	107
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	119.656	5,316	135.393	5,812
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	46.64	1,053	53.971	1,220
	(-)	(-)	(-)	(-)
ELME COMMUNITIES	23.129	334	27.066	381
	(-)	(-)	(-)	(-)
KITE REALTY GROUP TRUST	56.332	1,197	67.413	1,415
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	59.182	7,298	69.034	8,586
	(34.794)	(-)	(-)	(-)
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15.813	38	22.988	40
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	43.304	416	54.462	522
	(-)	(-)	(-)	(-)
CUBESMART	64.136	2,501	73.264	2,856
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	99.952	12,895	99.877	12,501
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	55.669	460	61.361	506
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	120.97	728	144.998	696
	(-)	(-)	(-)	(-)
DOUGLAS EMMETT INC	49.277	627	57.755	720
	(-)	(-)	(-)	(-)
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	34.935	436	37.953	464
	(-)	(-)	(-)	(-)
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	27.099	152	33.126	187
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	-	-	9.459	56
	(-)	(-)	(-)	(-)
TERRENO REALTY CORP	30.512	1,761	24.342	1,362
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12.003	240	15.468	306
	(-)	(-)	(-)	(-)
RLJ LODGING TRUST	31.451	312	39.557	398
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICOLD REALTY TRUST	75.049	2,057	88.383	2,457
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23.04	311	29.698	397
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHATHAM LODGING TRUST	5.225	51	8.382	82
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	55.891	782	65.968	921
	(-)	(-)	(-)	(-)
WHITESTONE REIT	4.626	47	5.285	58
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	19.816	105	28.132	158
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAG INDUSTRIAL INC	49.348	1,722	55.784	1,926
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	63.87	3,683	71.761	4,009
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALEXANDER & BALDWIN INC	19.265	320	22.63	374
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLADSTONE LAND CORP	3.576	51	5.844	79
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	101.71	1,585	118.698	1,748
	(-)	(-)	(-)	(-)
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18.44	1,707	19.352	1,793
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	16.204	175	20.226	208
	(-)	(-)	(-)	(-)
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	29.193	1,053	31.906	1,094
	(△60.818)	(-)	(-)	(-)
PHYSICIANS REALTY TRUST	43.806	532	48.563	566
	(△102.067)	(-)	(-)	(-)
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	66.598	3,215	68.832	3,276
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN HOMES 4 RENT	92.827	3,264	103.625	3,574
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	53.26	789	63.653	913
	(-)	(-)	(-)	(-)
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	5.684	452	6.967	560
	(-)	(-)	(-)	(-)
JBG SMITH PROPERTIES	19.549	284	28.115	407
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	-	-	-	-
	(△63.796)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	163.111	5,371	191.011	6,172
	(-)	(-)	(-)	(-)
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	-	-	100.1	33
	(-)	(△3)	(-)	(-)
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	23.574	194	34.234	284
	(-)	(-)	(-)	(-)
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8.418	177	10.3	210
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	51.48	1,217	47.358	1,062
	(-)	(-)	(-)	(-)
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	77.068	3,550	85.668	3,876
	(-)	(-)	(-)	(-)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82.72	1,759	97.129	2,051
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIME US REIT	-	-	-	-
	(31.76)	(△1)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
POSTAL REALTY TRUST INC	5.632	80	5.703	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	-	-	2.368	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21.094	522	22.303	544
	(-)	(-)	(-)	(-)
FARMLAND PARTNERS INC	15.013	165	22.077	237
	(-)	(-)	(-)	(-)
ORION OFFICE REIT INC	-	-	7.744	37
	(-)	(-)	(-)	(-)
NETSTREIT CORP	17.614	278	17.012	268
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARETRUST REIT INC	44.817	1,016	31.887	698
	(-)	(-)	(-)	(-)
PEAKSTONE REALTY TRUST	25.787	461	12.15	175
	(-)	(-)	(-)	(-)
INDUS REALTY TRUST INC	-	-	2.103	140
	(-)	(-)	(-)	(-)
PHILLIPS EDISON & CO INC	30.863	1,050	34.113	1,157
	(-)	(-)	(-)	(-)
BLUEROCK HOMES TRUST INC	-	-	1.188	15
	(-)	(-)	(-)	(-)
APARTMENT INCOME REIT CORP	38.971	1,266	48.023	1,509
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROADSTONE NET LEASE INC	34.595	514	42.683	618
	(-)	(-)	(-)	(-)
STAR HOLDINGS	-	-	5.322	75
	(-)	(-)	(-)	(-)
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	5.848	121	6.978	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	394.3	218	239.1	125
	(-)	(△6)	(-)	(-)
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	26.412	394	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	-	-	-
	(5.763)	(1)	(-)	(-)
PARAMOUNT GROUP INC	28.405	128	43.11	192
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17.038	154	16.798	146
	(-)	(-)	(-)	(-)
URBAN EDGE PROPERTIES	28.38	451	33.49	522
	(-)	(-)	(-)	(-)
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20.737	249	23.172	269
	(-)	(-)	(-)	(-)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19.339	230	27.887	345
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	163.733	829	64.263	312
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3.317	122	3.621	118
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	15.828	492	24.069	822
	(-)	(-)	(-)	(-)
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6.372	186	6.899	194
	(-)	(-)	(-)	(-)
APPLE HOSPITALITY REIT INC	61.027	955	65.631	1,024
	(-)	(-)	(-)	(-)
GLOBAL NET LEASE INC	28.67	240	42.191	355
	(42.743)	(-)	(-)	(-)
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	-	-	-	-
	(0.629)	(4)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	49.336	652	60.888	808
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	301.198	8,852	331.053	9,514
	(-)	(-)	(-)	(-)
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	28.644	652	30.699	687
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>カナダ</b>	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	20.529	484	23.651	547
	(-)	(-)	(-)	(-)
CANADIAN APT PPTYS REIT	25.791	1,179	29.746	1,323
	(-)	(-)	(-)	(-)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	49.618	460	54.877	496
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28.659	404	34.075	475
	(-)	(-)	(-)	(-)
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	40.883	738	47.516	833
	(-)	(-)	(-)	(-)
ALLIED PROPERTIES REIT	15.152	269	17.905	303
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	-	-	3.363	36
	(△2.585)	(-)	(-)	(-)
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.644	663	9.605	658
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4.232	26	6.905	41
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROMBIE REAL ESTATE INV	16.028	209	18.95	242
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19.459	245	24.11	299
	(-)	(-)	(-)	(-)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31.25	138	35.58	159
	(-)	(-)	(-)	(-)
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	-	-	2.22	34
	(-)	(-)	(-)	(-)
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	-	-	4.643	14
	(-)	(-)	(-)	(-)
DREAM INDUSTRIAL REIT	23.695	304	27.414	342
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>カナダ</b>	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.558 (-)	602 (-)	10.2 (-)	703 (-)
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	- (△17.707)	- (-)	- (-)	- (-)
CHOICE PROPERTIES REIT	35.392 (-)	462 (-)	42.996 (-)	544 (-)
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	1.955 (-)	33 (-)
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11.913 (-)	165 (-)	14.896 (-)	203 (-)
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	17.876 (-)	43 (-)
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	5.878 (-)	31 (-)
SLATE GROCERY REIT	10.756 (-)	124 (-)	10.653 (-)	115 (-)
PRIMARIS REIT	13.25 (-)	178 (-)	14.806 (-)	198 (-)
SLATE OFFICE REIT	- (-)	- (-)	17.818 (-)	27 (-)
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (-)	8.337 (-)	85 (-)
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17.472 (-)	297 (-)	18.761 (-)	315 (-)
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
BWP TRUST	171.757 (-)	609 (-)	158.601 (-)	548 (-)
MIRVAC GROUP	1,167.272 (-)	2,476 (-)	1,323.343 (-)	2,806 (-)
CROMWELL PROPERTY GROUP	206.513 (-)	84 (-)	318.514 (-)	125 (-)
CHARTER HALL RETAIL REIT	158.557 (-)	534 (-)	184.015 (-)	606 (-)
GPT GROUP	569.358 (-)	2,289 (-)	647.888 (-)	2,601 (-)
CENTURIA CAPITAL GROUP	308.93 (-)	449 (-)	270.119 (-)	395 (-)
ABACUS GROUP	174.871 (-)	184 (-)	201.768 (-)	218 (-)
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	71.254 (-)	188 (-)	94.114 (-)	245 (-)
STOCKLAND	722.285 (-)	2,908 (-)	829.224 (-)	3,360 (-)
INGENIA COMMUNITIES GROUP	114.527 (-)	494 (-)	119.742 (-)	515 (-)
DEXUS	314.91 (-)	2,289 (-)	352.435 (-)	2,546 (-)
GOODMAN GROUP	502.781 (-)	11,860 (-)	567.649 (-)	13,506 (-)



	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
VICINITY CENTRES	1,003.623	1,841	1,173.558	2,109
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL GROUP	136.538	1,411	154.812	1,569
	(-)	(-)	(-)	(-)
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	84.538	196	108.784	242
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGION RE LTD	238.016	520	286.625	605
	(-)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	122.699	370	149.701	458
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARENA REIT	67.105	228	85.07	285
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHARTER HALL LONG WALE REIT	151.636	516	185.161	626
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS INDUSTRIA REIT	19.686	54	17.711	48
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL STORAGE REIT	296.673	659	326.065	709
	(-)	(-)	(-)	(-)
RURAL FUNDS GROUP	94.174	184	119.787	225
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	1,544.091	4,175	1,777.304	4,775
	(-)	(-)	(-)	(-)
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	-	-	140.343	97
	(-)	(-)	(-)	(-)
HMC CAPITAL LTD	64.179	330	76.071	404
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	538.614	643	503.146	594
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHCO REIT	75.434	104	56.03	81
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABACUS STORAGE KING	72.902	78	44.226	44
	(195.539)	(-)	(-)	(-)
CENTURIA OFFICE REIT	44.311	48	69.257	80
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAYPOINT REIT LTD	116.495	277	150.326	350
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>香港</b>	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	630.5	24,255	728.7	26,800
	(-)	(-)	(-)	(-)
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	419	578	496	612
	(-)	(-)	(-)	(-)
CHAMPION REIT	366	965	527	1,230
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	71	127	77	146
	(-)	(-)	(-)	(-)
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	277	1,382	364	1,680
	(-)	(-)	(-)	(-)

	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
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,515.1 (-)	2,845 (△10)	1,699.9 (-)	3,109 (-)
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,078.6 (-)	2,935 (△21)	1,142.7 (-)	3,029 (-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	490.3 (-)	578 (△5)	597.5 (-)	686 (-)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,060.7 (-)	1,656 (△46)	1,154.3 (-)	1,782 (-)
STARHILL GLOBAL REIT	330.7 (-)	164 (-)	415.3 (-)	195 (-)
CAPITALAND ASCOTT TRUST	640.9 (-)	609 (△17)	639.4 (-)	582 (-)
KEPPEL REIT	713.6 (-)	599 (-)	694.3 (-)	592 (-)
FRASERS CENTREPOINT TRUST	379.1 (-)	818 (-)	387.4 (-)	828 (-)
ESR LOGOS REIT	1,470.2 (-)	427 (△9)	1,976.2 (-)	561 (-)
CDL HOSPITALITY TRUSTS	158 (-)	155 (△3)	275.3 (-)	274 (-)
CAPITALAND CHINA TRUST	179.7 (-)	148 (△23)	278.4 (-)	225 (-)
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (△1)	538.1 (-)	115 (-)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	267.8 (-)	340 (△5)	223.3 (-)	283 (-)
PARKWAY LIFE REIT	121.8 (-)	440 (△5)	131.9 (-)	465 (-)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	563.2 (-)	1,259 (△1)	623.2 (-)	1,379 (-)
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	592.1 (-)	833 (△11)	673.9 (-)	907 (-)
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	184.8 (-)	115 (-)	201.7 (-)	121 (-)
PARAGON REIT	361.8 (-)	313 (-)	368.5 (-)	309 (-)
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	53.6 (-)	37 (△0.47114)	71.2 (-)	43 (-)
QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	135.2 (-)	44 (△0.70461)	1,174.355 (-)	240 (-)
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	448.9 (-)	257 (-)	579.5 (-)	312 (-)
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	80.3 (-)	47 (△5)	307 (-)	164 (-)
KEPPEL DC REIT	319.8 (-)	618 (△10)	376.9 (-)	696 (-)
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	657.9 (-)	736 (△15)	783.9 (-)	827 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>ニュージーランド</b>	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	348.222	420	328.964	382
	(-)	(-)	(-)	(-)
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	13.547	32	223.11	450
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN PROPERTY TRUST	202.439	431	246.973	520
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIWI PROPERTY GROUP LTD	315.744	267	384.422	321
	(-)	(-)	(-)	(-)
ARGOSY PROPERTY LTD	189.174	211	200.554	220
	(-)	(-)	(-)	(-)
STRIDE STAPLED GROUP	30.039	41	263.389	331
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	270.474	895	307.817	1,018
	(-)	(-)	(-)	(-)
DERWENT LONDON PLC	35.117	700	39.543	764
	(-)	(-)	(-)	(-)
BIG YELLOW GROUP PLC	56.282	598	55.829	551
	(-)	(-)	(-)	(-)
HAMMERSON PLC	1,244.694	312	1,539.073	383
	(-)	(-)	(-)	(-)
LAND SECURITIES GROUP PLC	220.397	1,342	255.575	1,536
	(-)	(-)	(-)	(-)
WORKSPACE GROUP PLC	31.106	155	35.891	177
	(-)	(-)	(-)	(-)
UNITE GROUP PLC	144.545	1,345	162.453	1,483
	(-)	(-)	(-)	(-)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	233.58	215	298.954	274
	(-)	(-)	(-)	(-)
SEGRO PLC	421.322	3,294	431.267	3,288
	(-)	(-)	(-)	(-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	135.122	556	85.135	334
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASSURA PLC	691.22	294	800.762	337
	(-)	(-)	(-)	(-)
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	-	-	50.234	27
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	-	-	52.789	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
HELICAL PLC	-	-	5.963	13
	(-)	(-)	(-)	(-)
PICTON PROPERTY INCOME LTD	170.84	113	185.846	120
	(-)	(-)	(-)	(-)
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	160.763	88	201.78	109
	(△354.973)	(-)	(-)	(-)
SAFESTORE HOLDINGS LTD	43.415	325	51.935	373
	(-)	(-)	(-)	(-)
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	376.435	696	396.622	709
	(401.903)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	182.131 (-)	122 (-)	243.237 (-)	165 (-)
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	549.049 (-)	655 (-)	635.277 (-)	748 (-)
WAREHOUSE REIT PLC	58.167 (-)	48 (-)	60.241 (-)	48 (-)
NEWRIVER REIT PLC	30.491 (-)	26 (-)	64.763 (-)	49 (-)
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	- (-)	- (-)	293.773 (-)	233 (-)
PRS REIT PLC/THE	141.145 (-)	109 (-)	180.137 (-)	135 (-)
CLS HOLDINGS PLC	- (-)	- (-)	38.026 (-)	45 (-)
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	178.71 (-)	107 (-)	214.964 (-)	121 (-)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	325.039 (-)	246 (-)	381.621 (-)	291 (-)
TRITAX BIG BOX REIT PLC	582.838 (157.608)	831 (-)	662.654 (-)	941 (-)
CUSTODIAN REIT PLC	101.126 (-)	83 (-)	104.931 (-)	86 (-)
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	436.589 (-)	342 (-)	183.813 (-)	141 (-)
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	131.486 (-)	114 (-)	175.194 (-)	155 (-)
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	- (-)	- (-)	103.977 (-)	71 (-)
LIFE SCIENCE REIT PLC	201.363 (-)	143 (-)	53.766 (-)	34 (-)
GREAT PORTLAND ESTATES PLC-RTS	- (96.861)	- (-)	96.861 (-)	102 (-)
AEW UK REIT PLC	33.925 (-)	29 (-)	62.221 (-)	52 (-)
LXI REIT PLC	366.301 (△730.734)	331 (-)	403.027 (-)	356 (-)
REGIONAL REIT LTD	56.067 (-)	24 (-)	- (-)	- (-)
URBAN LOGISTICS REIT PLC	98.957 (-)	111 (-)	130.393 (-)	141 (-)
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	100.219 (-)	84 (-)	115.933 (-)	93 (-)
<b>イスラエル</b>	千□	千イスラエル・シュケル	千□	千イスラエル・シュケル
REIT 1 LTD	37.888 (-)	555 (-)	44.537 (-)	652 (-)
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	57.219 (-)	422 (-)	65.119 (-)	479 (-)
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	39.089 (-)	68 (-)	59.731 (-)	103 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>韓国</b>	千□	千韓国・ウォン	千□	千韓国・ウォン
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	10.475 (-)	42,625 (-)	49.828 (-)	194,286 (-)
E KOCREF CR-REIT CO LTD	- (-)	- (-)	11.135 (-)	54,863 (-)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21.366 (-)	131,851 (-)	24 (-)	151,899 (-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.697 (-)	26,264 (55)	24.051 (-)	100,182 (-)
LOTTE REIT CO LTD	43.393 (-)	133,723 (-)	51.072 (-)	159,436 (-)
KORAMCO LIFE INFRA REIT	10.885 (-)	58,631 (-)	8.873 (-)	45,653 (-)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	- (-)	- (-)	9.851 (-)	31,664 (-)
JR REIT XXVII	44.308 (-)	179,948 (-)	45.023 (-)	182,075 (-)
SK REITS CO LTD	16.994 (-)	74,021 (△3,172)	- (-)	- (-)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	29.522 (-)	109,361 (△159)	39.496 (-)	147,731 (-)
D&D PLATFORM REIT CO LTD	17.128 (-)	55,171 (△24)	19.888 (-)	64,614 (-)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	9.562 (-)	34,844 (△544)	8.876 (-)	30,237 (-)
SK REITS CO LTD-RTS	- (11.9)	- (△16)	11.9 (-)	77 (-)
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD-RTS	- (7.341)	- (△55)	7.341 (-)	796 (-)
<b>ユーロ (ガーンジー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
SHURGARD SELF STORAGE LTD	14.26 (-)	568 (-)	1.676 (-)	71 (-)
<b>ユーロ (シンガポール)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
CROMWELL REIT EUR	95.4 (-)	127 (△16)	128.2 (-)	163 (-)
<b>ユーロ (アイルランド)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	60.918 (-)	58 (-)	83.346 (-)	78 (-)
<b>ユーロ (オランダ)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
VASTNED RETAIL	3.282 (-)	65 (-)	3.903 (-)	75 (-)
WERELDHAVE NV	8.41 (-)	124 (-)	12.56 (-)	175 (-)
NSI NV	2.777 (-)	48 (-)	3.792 (-)	65 (-)
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10.687 (-)	225 (-)	12.016 (-)	244 (-)
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
COFINIMMO SA	10.952 (-)	703 (-)	9.881 (-)	603 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
RETAIL ESTATES	4.347	252	4.62	266
	(-)	(-)	(-)	(-)
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3.366	60	15.979	330
	(-)	(-)	(-)	(-)
WAREHOUSES DE PAUW	54.907	1,367	53.483	1,278
	(-)	(-)	(-)	(-)
MONTEA SCA	5.641	396	4.493	312
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA	17.307	963	15.759	838
	(-)	(7)	(-)	(-)
CARE PROPERTY INVEST NV	4.423	53	5.343	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
AEDIFICA SA-RTS	-	-	17.659	7
	(17.659)	(△7)	(-)	(-)
XIOR STUDENT HOUSING NV	13.195	360	9.442	256
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (フランス)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	16.193	1,555	19.88	1,884
	(-)	(-)	(-)	(-)
ICADE	5.38	172	7.293	220
	(-)	(△24)	(-)	(-)
ALTAREA	1.572	123	1.761	137
	(-)	(△0.33328)	(-)	(-)
KLEPIERRE	54.725	1,290	62.745	1,440
	(-)	(△74)	(-)	(-)
COVIVIO	13.935	594	14.422	596
	(-)	(-)	(-)	(-)
MERCIALYS	27.097	222	25.38	209
	(-)	(-)	(-)	(-)
CARMILA SA	11.681	165	15.53	218
	(-)	(△20)	(-)	(-)
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	27.41	1,428	34.451	1,773
	(-)	(△100)	(-)	(-)
<b>ユーロ (ドイツ)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
HAMBORNER REIT AG	11.372	72	15.044	94
	(-)	(△12)	(-)	(-)
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	-	-	3.939	15
	(-)	(-)	(-)	(-)
<b>ユーロ (スペイン)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	66.154	362	84.623	456
	(-)	(△7)	(-)	(-)
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	11.497	66	18.351	104
	(-)	(△1)	(-)	(-)
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	81.925	694	96.047	794
	(-)	(△30)	(-)	(-)

(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。

(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	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 1,922		百万円 1,032		百万円 -		百万円 -	

(注) 金額は受渡代金です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年6月23日から2024年6月24日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		末	比率
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額		
<b>不動産ファンド (アメリカ)</b>		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		391.9	291.8	39	6,344		0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST		72.7	72.7	0	0		0.0
PRIME US REIT		317.6	349.36	40	6,423		0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE		144.6	299.8	178	28,519		0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTME		839	839	55	8,853		0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		70.549	63.579	7,410	1,184,833		1.3
ALEXANDER'S INC.		1.021	0.86	188	30,159		0.0
BOSTON PROPERTIES INC		63.691	58.553	3,601	575,729		0.7
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		104.551	99.906	3,298	527,427		0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO-A		65.982	53.077	423	67,633		0.1
AGREE REALTY CORP		41.761	40.554	2,494	398,752		0.5
BRT APARTMENTS CORP		6.159	5.643	101	16,158		0.0
SL GREEN		28.057	26.178	1,444	230,988		0.3
EPR PROPERTIES		33.842	30.568	1,247	199,447		0.2
PROLOGIS INC		414.926	373.989	40,914	6,541,393		7.4
AVALONBAY COMMUNITIES INC		63.859	57.357	11,694	1,869,719		2.1
LXP INDUSTRIAL TRUST		131.103	118.308	1,050	167,965		0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST		47.839	43.034	4,720	754,766		0.9
VERIS RESIDENTIAL INC		35.212	33.67	487	77,948		0.1
EQUINIX INC		42.028	38.337	29,327	4,688,929		5.3
NNN REIT INC		82.288	74.063	3,126	499,935		0.6
CTO REALTY GROUTH INC		9.356	7.42	126	20,285		0.0
COUSINS PROPERTIES INC		68.071	61.428	1,420	227,162		0.3
URSTADT BIDDLE PROPERTIES		14.046	-	-	-		-
SITE CENTERS CORP		81.813	72.757	1,043	166,808		0.2
SAFEHOLD INC		17.782	17.116	324	51,856		0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		11.922	11.922	9	1,562		0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC		28.759	25.937	7,216	1,153,724		1.3
EQUITY RESIDENTIAL		152.806	139.306	9,515	1,521,416		1.7
FEDERAL REALTY INVS TRUST		33.218	30.104	3,017	482,506		0.5
FIRST INDUSTRIAL RT		58.984	53.458	2,526	404,010		0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		244.412	284.288	5,469	874,495		1.0
EQUITY COMMONWEALTH		49.039	43.229	837	133,943		0.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC		48.223	42.731	1,109	177,354		0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST		76.925	69.695	353	56,494		0.1
WELLTOWER INC		223.439	241.529	24,713	3,951,153		4.5
EAST GROUP		20.032	19.335	3,231	516,614		0.6
KIMCO REALTY		277.027	270.439	5,132	820,653		0.9
KILROY REALTY CORP		47.193	43.143	1,362	217,829		0.2
LTC PROPERTIES INC		18.9	17.329	587	93,922		0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		101.192	89.231	233	37,377		0.0



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	%
BRANDYWINE REALTY TRUST	81.948	65.638	297	47,643	0.1
IRON MOUNTAIN INC	131.248	118.409	10,521	1,682,229	1.9
THE MACERICH COMPANY	95.956	87.151	1,278	204,407	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	78.222	75.334	4,846	774,936	0.9
ACADIA REALTY TRUST	44.351	42.601	739	118,171	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	318.701	284.799	5,220	834,632	0.9
MID AMERICA	52.249	47.191	6,652	1,063,528	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13.525	—	—	—	—
NATIONAL HEALTH INVS INC	19.429	17.553	1,171	187,325	0.2
CENTERSPACE	6.622	6.258	419	67,125	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8.132	5.83	138	22,183	0.0
GETTY REALTY CORP	20.182	19.838	524	83,796	0.1
RPT REALTY	40.594	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	302.637	351.747	18,695	2,989,013	3.4
REGENCY CENTERS CORP	68.717	66.651	4,141	662,173	0.8
UDR INC	138.65	122.38	4,983	796,732	0.9
COPT DEFENCE PROPERTIES	50.428	46.331	1,141	182,444	0.2
SAUL CENTERS INC	5.447	4.875	176	28,261	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	147.007	131.66	19,243	3,076,638	3.5
LIFE STORAGE INC	38.018	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	71.125	63.885	18,593	2,972,765	3.4
SUN COMMUNITIES INC	55.989	50.345	5,916	945,937	1.1
TANGER INC	46.487	44.528	1,182	189,013	0.2
UMH PROPERTIES INC	26.109	26.733	414	66,290	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16.72	15.124	209	33,562	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6.151	4.814	185	29,678	0.0
VENTAS INC	179.26	163.523	8,244	1,318,183	1.5
VORNADO REALTY TRUST	71.874	64.543	1,665	266,336	0.3
ELME COMMUNITIES	40.732	36.795	555	88,771	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	99.789	88.708	1,944	310,883	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	60.583	85.525	13,592	2,173,167	2.5
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	53.55	46.375	74	11,863	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	94.114	82.956	840	134,354	0.2
CUBESMART	100.353	91.225	4,130	660,411	0.8
DIGITAL REALTY TRUST INC	131.006	131.081	19,445	3,109,005	3.5
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	91.448	85.756	715	114,346	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	266.517	242.489	1,163	186,091	0.2
DOUGLAS EMMETT INC	76.09	67.612	905	144,743	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS C	55.617	52.599	643	102,932	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	58.595	52.568	378	60,512	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	50.883	41.424	241	38,677	0.0
TERRENO REALTY CORP	32.893	39.063	2,264	361,982	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	23.022	19.557	421	67,319	0.1
RLJ LODGING TRUST	70.804	62.698	601	96,231	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	121.186	107.852	2,734	437,119	0.5

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		%
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		55.166	48.508	672	107,568		0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST		23.664	23.664	53	8,550		0.0
CHATHAM LODGING TRUST		22.868	19.711	162	26,030		0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC		103.588	93.511	1,369	218,875		0.2
WHITESTONE REIT		19.598	18.939	251	40,150		0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC		61.059	52.743	257	41,235		0.0
STAG INDUSTRIAL INC		79.986	73.55	2,608	416,980		0.5
WP CAREY INC		96.284	88.393	4,872	778,970		0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC		33.832	30.467	499	79,788		0.1
GLADSTONE LAND CORP		15.596	13.328	175	28,085		0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		169.898	152.91	2,454	392,378		0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		25.104	24.192	2,410	385,311		0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC		29.672	25.65	281	45,028		0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		63.531	—	—	—		—
PHYSICIANS REALTY TRUST		106.824	—	—	—		—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC		90.045	87.811	3,909	625,026		0.7
AMERICAN HOMES 4 RENT		140.789	129.991	4,725	755,460		0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC		101.147	90.754	1,642	262,626		0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES		12.848	11.565	1,245	199,194		0.2
JBG SMITH PROPERTIES		43.096	34.53	506	80,988		0.1
THE NECESSITY RETAIL REIT INC		63.796	—	—	—		—
INVITATION HOMES INC		260.485	232.585	8,238	1,317,117		1.5
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC		62.501	51.841	471	75,341		0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		17.079	15.197	320	51,315		0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUS		66.693	70.815	1,901	303,993		0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES		26.881	26.881	92	14,741		0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES IN		118.272	109.672	4,866	777,999		0.9
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		136.117	121.708	2,744	438,793		0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC		22.683	22.683	62	9,936		0.0
POSTAL REALTY TRUST INC		7.309	7.238	95	15,228		0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC		6.752	4.384	67	10,759		0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP		29.365	28.156	690	110,468		0.1
FARMLAND PARTNERS INC		23.717	16.653	192	30,831		0.0
CITY OFFICE REIT INC		17.231	17.231	86	13,774		0.0
ORION OFFICE REIT INC		28.112	20.368	69	11,104		0.0
NETSTREIT CORP		28.118	28.72	485	77,600		0.1
CARETRUST REIT INC		44.457	57.387	1,428	228,458		0.3
PEAKSTONE REALTY TRUST		—	13.637	148	23,699		0.0
INDUS REALTY TRUST INC		2.103	—	—	—		—
PHILLIPS EDISON & CO INC		52.693	49.443	1,603	256,436		0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC		1.188	—	—	—		—
APARTMENT INCOME REIT CORP		67.666	58.614	2,285	365,383		0.4
BROADSTONE NET LEASE INC		83.884	75.796	1,192	190,620		0.2
STAR HOLDINGS		5.322	—	—	—		—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC		11.835	10.705	239	38,269		0.0

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
<b>(アメリカ)</b>	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	-	26.412	394	63,045		0.1
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	-	5.763	138	22,177		0.0
PARAMOUNT GROUP INC	78.702	63.997	287	45,940		0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	26.422	26.662	234	37,554		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	52.509	47.399	856	136,937		0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES I	42.482	40.047	487	77,921		0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	49.736	41.188	586	93,838		0.1
COMMUNICATIONS SALES & LEASING I	-	99.47	284	45,483		0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10.016	9.712	361	57,840		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUS	36.394	28.153	1,189	190,171		0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10.321	9.794	226	36,249		0.0
APPLE HOSPITALITY REIT INC	95.647	91.043	1,328	212,371		0.2
GLOBAL NET LEASE INC	48.468	77.69	553	88,438		0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE	14.638	15.267	74	11,862		0.0
CLIPPER REALTY INC	5.086	5.086	18	2,894		0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC	96.622	85.07	1,260	201,566		0.2
VICI PROPERTIES INC	451.537	421.682	11,849	1,894,460		2.2
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	39.634	37.579	921	147,379		0.2
小 計	□ 数 ・ 金 額	11,681.835	10,964.702	423,772	67,752,784	-
	銘 柄 数<比 率>	145銘柄<77.0%>	139銘柄<77.1%>	-	-	77.1
<b>(カナダ)</b>	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	31.367	28.245	608	71,084		0.1
CANADIAN APT PPTYS REIT	37.034	33.079	1,424	166,306		0.2
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58.204	52.945	457	53,459		0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	46.831	41.415	599	69,953		0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66.005	59.372	972	113,521		0.1
ALLIED PROPERTIES REIT	28.626	25.873	396	46,329		0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRU	8.533	2.585	47	5,552		0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9.738	9.777	670	78,211		0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRU	24.568	21.895	140	16,382		0.0
CROMBIE REAL ESTATE INV	24.648	21.726	267	31,193		0.0
INTERENT REAL ESTATE INVEST	32.303	27.652	326	38,088		0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	55.673	51.343	238	27,868		0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENT	8.705	6.485	95	11,203		0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT	4.643	-	-	-		-
DREAM INDUSTRIAL REIT	56.937	53.218	654	76,409		0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.423	15.423	48	5,635		0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT T	13.984	12.342	816	95,272		0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	21.434	3.727	30	3,606		0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	72.055	64.451	804	93,891		0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVE	9.341	7.386	107	12,553		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25.088	22.105	284	33,234		0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE	17.876	-	-	-		-
PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15.769	9.891	45	5,345		0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8.104	8.104	125	14,624		0.0

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
<b>(カナダ)</b>	千□	千円	千□	千カナダ・ドル	千円	%
SLATE GROCERY REIT	12.066		12.169	133	15,540	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT	14.455		14.455	95	11,136	0.0
PRIMARIS REIT	21.998		20.442	268	31,306	0.0
SLATE OFFICE REIT	17.818		—	—	—	—
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTAT	8.337		—	—	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INV	24.983		23.694	396	46,271	0.1
小計	□数・金額	792,546	649,799	10,057	1,173,982	—
	銘柄数<比率>	30銘柄<1.7%>	26銘柄<1.3%>	—	—	1.3
<b>(オーストラリア)</b>	千□	千円	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%
BWP TRUST	209.056		222.212	806	85,631	0.1
MIRVAC GROUP	1,776.143		1,620.072	3,175	337,094	0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP	632.521		520.52	216	22,932	0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT	230.204		204.746	685	72,815	0.1
GPT GROUP	853.243		774.713	3,191	338,843	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP	302.227		341.038	601	63,901	0.1
ABACUS GROUP	195.539		168.642	198	21,125	0.0
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTU	160.446		137.586	335	35,638	0.0
STOCKLAND	1,071.893		964.954	4,284	454,831	0.5
INGENIA COMMUNITIES GROUP	162.299		157.084	761	80,878	0.1
DEXUS	479.312		441.787	2,893	307,195	0.3
GOODMAN GROUP	769.687		704.819	25,288	2,684,670	3.1
VICINITY CENTRES	1,758.932		1,588.997	2,995	317,976	0.4
CHARTER HALL GROUP	212.89		194.616	2,382	252,883	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	126.146		101.9	241	25,637	0.0
REGION RE LTD	515.147		466.538	1,045	110,941	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	240.142		213.14	667	70,822	0.1
ARENA REIT	165.205		147.24	584	62,055	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	299.469		265.944	922	97,967	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT	91.184		93.159	281	29,867	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	538.807		509.415	1,186	126,005	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	85.857		85.857	297	31,627	0.0
GDI PROPERTY GROUP	222.442		222.442	133	14,168	0.0
RURAL FUNDS GROUP	173.97		148.357	307	32,601	0.0
SCENTRE GROUP	2,339.436		2,106.223	6,718	713,273	0.8
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY	140.343		—	—	—	—
HMC CAPITAL LTD	109.034		97.142	720	76,519	0.1
HOMECO DAILY NEEDS REIT	709.912		745.38	913	96,933	0.1
HEALTHCO REIT	182.619		202.023	232	24,663	0.0
ABACUS STORAGE KING	—		224.215	266	28,325	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	210.931		185.985	223	23,693	0.0
WAYPOINT REIT LTD	300.308		266.477	620	65,913	0.1
小計	□数・金額	15,265,344	14,123,223	63,182	6,707,435	—
	銘柄数<比率>	31銘柄<6.8%>	31銘柄<7.6%>	—	—	7.6
<b>(香港)</b>	千□	千円	千□	千香港・ドル	千円	%
LINK REIT	1,145.32		1,047.12	33,350	683,357	0.8

銘柄	期首(前期末)	当 期			末	
		□ 数	□ 数	外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(香港)</b>	千□	千□	千香港・ドル	千円	%	
PROSPERITY REIT	538	538	747	15,322	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TR	985	908	889	18,232	0.0	
CHAMPION REIT	896.07	735.07	1,117	22,893	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	445	439	768	15,741	0.0	
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT T	678	591	2,316	47,469	0.1	
小 計	□ 数 ・ 金 額	4,687.39	4,258.19	39,190	803,017	-
	銘柄 数<比 率>	6銘柄<1.4%>	6銘柄<0.9%>	-	-	0.9
<b>(シンガポール)</b>	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円	%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	2,246.609	2,061.809	3,999	471,869	0.5	
CAPLAND ASCENDAS REIT	1,505.56	1,441.46	3,646	430,224	0.5	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,005.29	898.09	951	112,304	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,469.02	1,375.42	1,788	210,935	0.2	
STARHILL GLOBAL REIT	614.9	530.3	254	30,028	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	995.816	997.316	882	104,123	0.1	
KEPPEL REIT	890.7	910	755	89,102	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	480.7	472.4	1,006	118,702	0.1	
ESR LOGOS REIT	2,901.84	2,395.84	658	77,725	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	394.5	277.2	266	31,393	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	548.48	449.78	301	35,550	0.0	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRU	538.1	-	-	-	-	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	228.595	273.095	344	40,593	0.0	
PARKWAY LIFE REIT	173.2	163.1	570	67,343	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	912.62	852.62	1,824	215,248	0.2	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	1,038.8	957	1,167	137,734	0.2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	481.4	464.5	285	33,700	0.0	
PARAGON REIT	493.8	487.1	421	49,705	0.1	
EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT	112.4	112.4	15	1,856	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT T	259.9	242.3	159	18,865	0.0	
OUÉ REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,039.155	-	-	-	-	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	847.2	716.6	408	48,186	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	226.7	-	-	-	-	
KEPPEL DC REIT	594.4	537.3	951	112,191	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL T	1,304.864	1,178.864	1,131	133,507	0.2	
小 計	□ 数 ・ 金 額	21,304.549	17,794.494	21,792	2,570,894	-
	銘柄 数<比 率>	25銘柄<3.6%>	22銘柄<2.9%>	-	-	2.9
<b>(ニュージーランド)</b>	千□	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%	
PRECINCT PROPERTIES	610.508	629.766	714	69,905	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	209.563	-	-	-	-	
GOODMAN PROPERTY TRUST	476.422	431.888	898	87,856	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	710.515	641.837	532	52,100	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	376.442	365.062	376	36,774	0.0	
STRIDE STAPLED GROUP	233.35	-	-	-	-	
小 計	□ 数 ・ 金 額	2,616.8	2,068.553	2,521	246,636	-
	銘柄 数<比 率>	6銘柄<0.4%>	4銘柄<0.3%>	-	-	0.3

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
(イギリス)		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円	%
BRITISH LAND CO PLC		416.926	379.583	1,567	316,937	0.4
DERWENT LONDON PLC		49.785	45.359	1,031	208,531	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		78.821	79.274	930	188,154	0.2
HAMMERSON PLC		1,850.26	1,555.881	440	89,018	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC		339.433	304.255	1,903	384,752	0.4
WORKSPACE GROUP PLC		60.495	55.71	328	66,338	0.1
INTU PROPERTIES PLC		231.04	231.04	0	0	0.0
UNITE GROUP PLC		178.13	160.222	1,438	290,880	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC		600.827	535.453	488	98,726	0.1
SEGRO PLC		550.499	540.554	4,827	975,904	1.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		114.09	164.077	554	112,119	0.1
ASSURA PLC		1,318.883	1,209.341	472	95,596	0.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI		184.841	134.607	68	13,797	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT		256.281	203.492	91	18,595	0.0
HELICAL PLC		48.089	42.126	100	20,269	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		248.473	233.467	158	31,954	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD		395.99	—	—	—	—
SAFESTORE HOLDINGS LTD		96.433	87.913	701	141,831	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		441.765	823.481	1,604	324,475	0.4
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRU		351.056	289.95	223	45,136	0.1
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		875.198	788.97	1,090	220,437	0.3
WAREHOUSE REIT PLC		184.359	182.285	143	29,039	0.0
NEWRIVER REIT PLC		148.157	113.885	84	17,060	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		293.773	—	—	—	—
PRS REIT PLC/THE		249.964	210.972	162	32,842	0.0
CLS HOLDINGS PLC		83.611	45.585	42	8,607	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT		153.569	117.315	66	13,519	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		552.98	496.398	358	72,557	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC		844.097	921.889	1,415	286,090	0.3
CUSTODIAN REIT PLC		190.248	186.443	136	27,591	0.0
TARGET HEALTHCARE REIT PLC		—	252.776	203	41,087	0.0
HOME REIT PLC		286.621	286.621	0	0	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		288.036	244.328	229	46,481	0.1
EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO P		103.977	—	—	—	—
LIFE SCIENCE REIT PLC		—	147.597	49	9,936	0.0
AEW UK REIT PLC		78.98	50.684	45	9,160	0.0
LXI REIT PLC		767.46	—	—	—	—
REGIONAL REIT LTD		180.491	236.558	49	9,995	0.0
URBAN LOGISTICS REIT PLC		221.68	190.244	235	47,692	0.1
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		185.316	169.602	145	29,453	0.0
小計	□ 数・金額 銘柄 数<比率>	13,500.634 38銘柄<4.7%>	11,717.937 36銘柄<4.9%>	21,390 —	4,324,575 —	— 4.9
(イスラエル)		千□	千□	千イスラエル・シユケル	千円	%
REIT 1 LTD		87.414	80.765	1,102	46,935	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD		92.361	84.461	554	23,588	0.0

銘柄	期首(前期末)	当期			期末	
		□数	□数	外貨建金額		邦貨換算金額
<b>(イスラエル)</b>	千口	千口	千イスラエル・シケル	千円	%	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	314.331	293.689	441	18,780	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	494.106 3銘柄<0.1%>	458.915 3銘柄<0.1%>	2,097 -	89,303 -	- 0.1
<b>(韓国)</b>	千口	千口	千韓国・ウォン	千円	%	
MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC RE	39.353	-	-	-	-	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	11.135	-	-	-	-	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	29.807	27.173	168,200	19,359	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	18.354	-	-	-	-	
LOTTE REIT CO LTD	55.954	48.275	162,686	18,725	0.0	
KORAMCO LIFE INFRA REIT	20.53	22.542	104,031	11,974	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9.851	-	-	-	-	
JR REIT XXVII	66.386	65.671	273,191	31,444	0.0	
SK REITS CO LTD	31.791	48.785	231,728	26,671	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	73.968	63.994	292,132	33,624	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	26.101	23.341	78,659	9,053	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	20.887	21.573	78,849	9,075	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	404.117 12銘柄<0.2%>	321.354 8銘柄<0.2%>	1,389,480 -	159,929 -	- 0.2
<b>(ユーロ…ガーデンジ)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
SHURGARD SELF STORAGE LTD	-	12.584	482	82,504	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄<-%>	12.584 1銘柄<0.1%>	482 -	82,504 -	- 0.1
<b>(ユーロ…シンガポール)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
CROMWELL REIT EUR	162.64	129.84	184	31,520	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	162.64 1銘柄<0.0%>	129.84 1銘柄<0.0%>	184 -	31,520 -	- 0.0
<b>(ユーロ…アイルランド)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REI	198.163	175.735	159	27,309	0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	198.163 1銘柄<0.0%>	175.735 1銘柄<0.0%>	159 -	27,309 -	- 0.0
<b>(ユーロ…オランダ)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
VASTNED RETAIL	7.975	7.354	173	29,670	0.0	
WERELDHAVE NV	18.149	13.999	187	32,021	0.0	
NSI NV	8.534	7.519	145	24,834	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19.196	17.867	393	67,199	0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	53.854 4銘柄<0.2%>	46,739 4銘柄<0.2%>	899 -	153,727 -	- 0.2
<b>(ユーロ…ベルギー)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
COFINIMMO SA	13.78	14.851	849	145,226	0.2	
RETAIL ESTATES	5.13	4.857	307	52,561	0.1	
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	12.613	-	-	-	-	
WAREHOUSES DE PAUW	69.994	71.418	1,804	308,415	0.4	
MONTEA SCA	6.01	7.158	563	96,307	0.1	
AEDIFICA	17.659	19.207	1,098	187,823	0.2	
CARE PROPERTY INVEST NV	16.012	15.092	197	33,748	0.0	

銘柄	期首(前期末)	当期			期末	
		□数	外貨建金額	邦貨換算金額		比率
(ユーロ…ベルギー) XIOR STUDENT HOUSING NV	千□ 10.247	千□ 14	千ユーロ 403	千円 68,931	% 0.1	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	151.445 8銘柄<1.0%>	146.583 7銘柄<1.0%>	5,223 -	893,013 -	- 1.0
(ユーロ…フランス) GECINA SA ICADE ALTAREA KLEPIERRE COVIVIO MERCIALYS CARMILA SA UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	千□ 24.437 14.462 2.083 86.815 20.812 35.663 26.256 48.183	千□ 20.75 12,549 1,894 78,795 20,325 37.38 22,407 41,142	千ユーロ 1,886 305 168 2,029 929 397 364 3,023	千円 322,460 52,304 28,818 347,007 158,935 67,930 62,363 516,831	% 0.4 0.1 0.0 0.4 0.2 0.1 0.1 0.6	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	258.711 8銘柄<1.7%>	235.242 8銘柄<1.8%>	9,105 -	1,556,652 -	- 1.8
(ユーロ…ドイツ) HAMBORNER REIT AG ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千□ 32.393 3.939	千□ 28.721 -	千ユーロ 188 -	千円 32,161 -	% 0.0 -	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	36.332 2銘柄<0.0%>	28.721 1銘柄<0.0%>	188 -	32,161 -	- 0.0
(ユーロ…スペイン) INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千□ 133.768 26.318 148.852	千□ 115,299 19,464 134.73	千ユーロ 637 134 1,420	千円 109,004 22,960 242,772	% 0.1 0.0 0.3	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	308.938 3銘柄<0.4%>	269.493 3銘柄<0.4%>	2,191 -	374,737 -	- 0.4
(ユーロ…イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	千□ 20.555	千□ 20.555	千ユーロ 35	千円 6,149	% 0.0	
小計	□数・金額 銘柄数<比率>	20.555 1銘柄<0.0%>	20.555 1銘柄<0.0%>	35 -	6,149 -	- 0.0
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	71,937.959 324銘柄<99.4%>	63,422.659 302銘柄<99.0%>	- -	86,986,336 -	- 99.0

(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。

## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期		期末
		買	建 額	
外国	D J U S R E A L E S T A T E		百万円 895	百万円 -

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。



## ■投資信託財産の構成

2024年6月24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	86,986,336 千円	98.4 %
コール・ローン等、その他	1,451,023	1.6
投資信託財産総額	88,437,359	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、87,853,241千円、99.3%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、2024年6月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=159.88円、1カナダ・ドル=116.73円、1オーストラリア・ドル=106.16円、1香港・ドル=20.49円、1シンガポール・ドル=117.97円、1ニュージーランド・ドル=97.80円、1イギリス・ポンド=202.17円、1イスラエル・シケル=42.573円、100韓国・ウォン=11.51円、1ユーロ=170.96円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年6月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	88,649,701,899円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	300,886,231
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	9,407,460,726
投 資 信 託 受 益 証 券(評価額)	77,578,875,696
未 収 入 金	636,567,111
未 収 配 当 金	289,741,082
差 入 委 託 証 拠	436,171,053
(B) 負 債	767,857,343
未 払 金	754,822,343
未 払 解 約 金	13,035,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	87,881,844,556
元 本	42,455,688,196
次 期 繰 越 損 益 金	45,426,156,360
(D) 受 益 権 総 口 数	42,455,688,196口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	20,700円

(注1) 期首元本額 47,496,039,171円  
追加設定元本額 32,421,167,258円  
一部解約元本額 37,461,518,233円

(注2) 期末における元本の内訳

たわらノーロード 先進国リート (為替ヘッジなし) <ラップ専用>	3,553,671,263円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,401,394円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,121,852円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	39,716,333円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	45,898,769円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,586,104円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	27,197,441円
たわらノーロード 先進国リート	15,330,920,587円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	128,586,248円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	250,596,932円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	4,258,594,024円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,106,523円
たわらノーロード バランス (標準型)	618,010,808円
たわらノーロード バランス (積極型)	1,446,430,148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)	1,255,966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)	633,358,212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)	672,887,840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)	1,200,068,581円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	536,766円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	40,159,308円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	13,385,607円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	33,328,539円
One DC先進国リートインデックスファンド	2,255,560,675円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	15,876,493円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	596,420,560円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	79,425,412円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	189,471,408円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	313,572,673円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	612,101,769円
投資のソムリエ	3,856,050,647円
投資のソムリエ<DC年金>	413,259,951円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	270,614,486円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,013,891円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,452,619,453円
ワールドアセットバランス (基本コース)	246,980,107円
ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	680,485,328円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	63,029,259円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	32,850,694円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,386,291円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	86,191,058円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,215,386,591円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,783,516円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	38,983,095円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	35,002,071円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	22,084,482円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	5,403,231円
Oneグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	68,809,621円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	270,424,593円
D I A M外国リートインデックスファンド<DC年金>	383,275,072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)	867,926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)	501,108円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	5,202円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	62,054,960円
AMOne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)	895,492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 (FOF s用) (適格機関投資家専用)	2,122,603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)	40,047,574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)	101,133,689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)	16,902,701円
期末元本合計	42,455,688,196円

## ■損益の状況

当期 自2023年6月23日 至2024年6月24日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,544,474,640円	
	受取配当金	3,509,420,266	
	受取利息	22,157,843	
	その他の収益	12,979,415	
	支払利息	△82,884	
(B)	有価証券売買損益	11,467,586,659	
	売買益	18,334,949,393	
	売買損	△6,867,362,734	
(C)	先物取引等取引損益	4,548,586	
	取引益	5,384,758	
	取引損	△836,172	
(D)	その他費用	△38,379,043	
(E)	当期損益金(A+B+C+D)	14,978,230,842	
(F)	前期繰越損益金	33,703,055,639	
(G)	解約差損益金	△27,955,379,863	
(H)	追加信託差損益金	24,700,249,742	
(I)	計(E+F+G+H)	45,426,156,360	
	次期繰越損益金(I)	45,426,156,360	

(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

■先物取引等の指図範囲の規定を追加しました。

(2024年4月12日)